

富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金

二 0 二五年中期报告

2025 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： 2025 年 08 月 30 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 2025 年 8 月 28 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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	6
2.1	基金基本情况	6
2.2	基金产品说明	6
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	9
§ 4	管理人报告	12
4.1	基金管理人及基金经理情况	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§ 5	托管人报告	18
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§ 6	中期财务报告（未经审计）	19
6.1	资产负债表	19
6.2	利润表	20
6.3	净资产变动表	21
6.4	报表附注	22
§ 7	投资组合报告	49

7.1	期末基金资产组合情况.....	49
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	50
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
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.....	67
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..	67
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..	68
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.....	68
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	68
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	68
7.12	投资组合报告附注.....	68
§ 8	基金份额持有人信息	71
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	71
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.....	71
§ 9	开放式基金份额变动	72
§ 10	重大事件揭示.....	73
10.1	基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
10.4	基金投资策略的改变.....	73
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	73
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	73
10.8	其他重大事件.....	77
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	79
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	79
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	79
§ 12	备查文件目录.....	80

§ 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	
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	111,182,018.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C
下属分级基金的交易代码	006034	014170
报告期末下属分级基金的份额总额	72,902,240.58 份	38,279,777.54 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对 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	021-6063 7103
	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	张金良

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	A 类：中国证券登记结算有限责任公司；C 类：富国基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号； 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	3,914,017.18
本期利润	5,245,364.78
加权平均基金份额本期利润	0.0722
本期加权平均净值利润率	3.59%
本期基金份额净值增长率	3.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	75,512,350.39
期末可供分配基金份额利润	1.0358
期末基金资产净值	152,821,639.58
期末基金份额净值	2.0963
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	109.63%

(2) 富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	2,152,339.72
本期利润	2,407,420.47
加权平均基金份额本期利润	0.0641
本期加权平均净值利润率	3.20%
本期基金份额净值增长率	3.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	39,391,226.79
期末可供分配基金份额利润	1.0290
期末基金资产净值	79,976,939.64
期末基金份额净值	2.0893
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	11.97%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式

基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.15%	0.52%	2.16%	0.55%	0.99%	-0.03%
过去三个月	3.97%	1.06%	0.85%	1.05%	3.12%	0.01%
过去六个月	3.66%	0.94%	-0.27%	0.97%	3.93%	-0.03%
过去一年	16.05%	1.24%	11.30%	1.31%	4.75%	-0.07%
过去三年	0.33%	0.99%	-14.34%	1.04%	14.67%	-0.05%
自基金合同生效起至今	109.63%	1.13%	34.40%	1.15%	75.23%	-0.02%

(2) 富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C

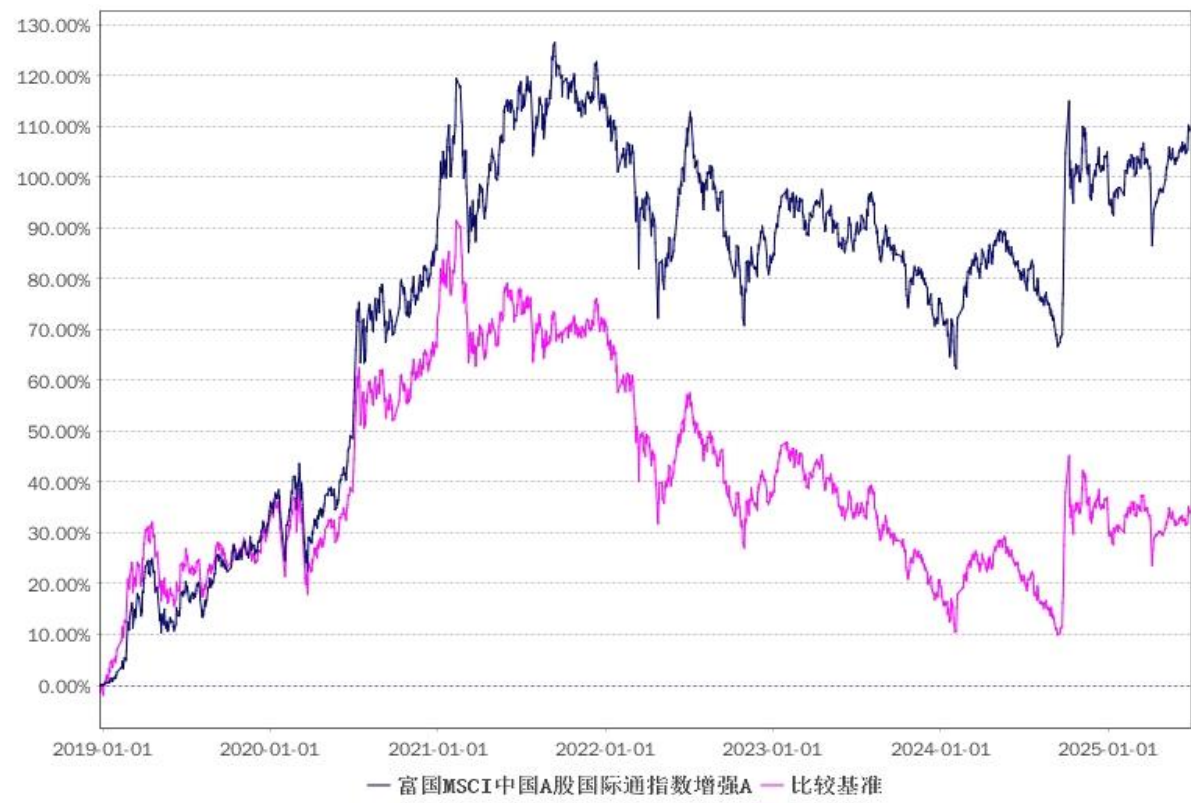
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.14%	0.52%	2.16%	0.55%	0.98%	-0.03%
过去三个月	3.92%	1.06%	0.85%	1.05%	3.07%	0.01%
过去六个月	3.55%	0.94%	-0.27%	0.97%	3.82%	-0.03%
过去一年	15.81%	1.24%	11.30%	1.31%	4.51%	-0.07%
自基金分级生效日起至今	11.97%	1.08%	3.53%	1.14%	8.44%	-0.06%

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

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

(1) 自基金合同生效以来富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A 基金累计净值增

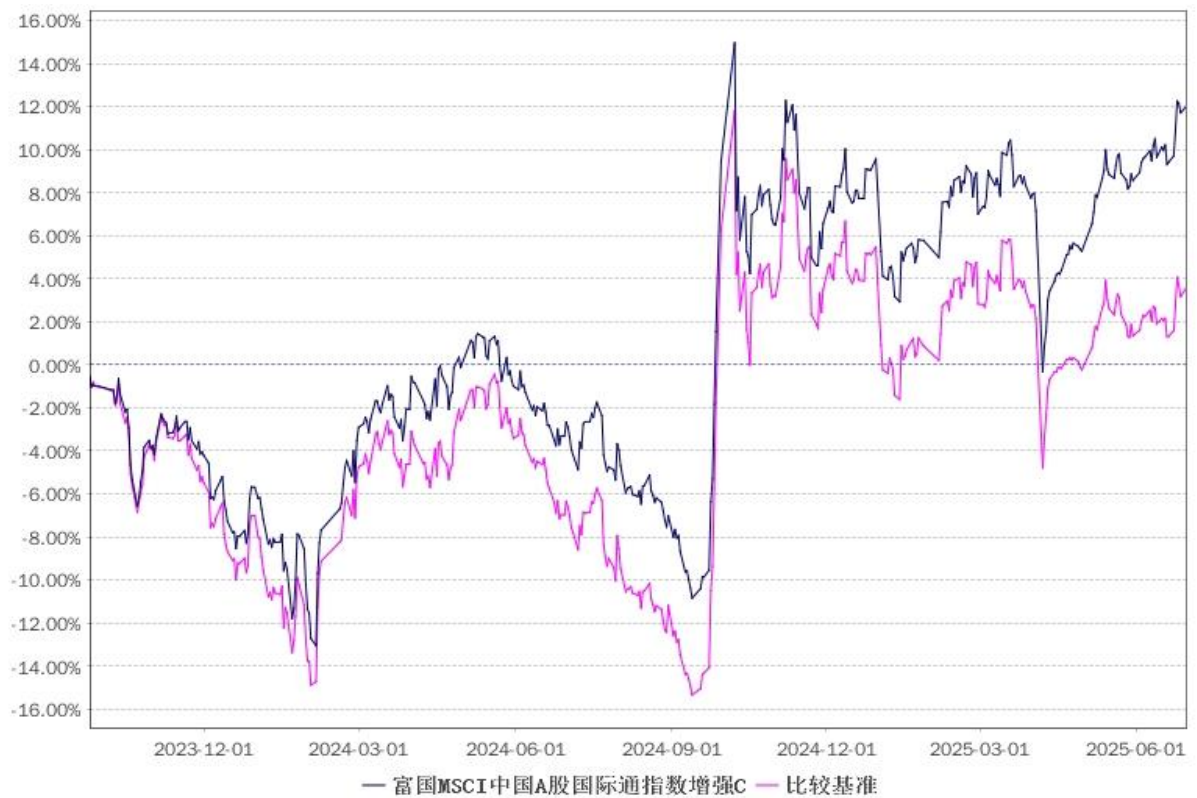
长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 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。

（2）自基金合同生效以来富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2023 年 9 月 22 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：国泰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。

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安（以下简称“存续公司”）承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持本公司股权亦归属于存续公司，即存续公司成为本公司的主要股东。根据 2025 年 4 月 4 日《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，存续公司正式更名为“国泰海通证券股份有限公司”。

截至 2025 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 391 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	—	20	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 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2018 年 07 月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理；自 2018 年 12 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自 2024 年 04 月起任富国 MSCI 中国 A50 互联互通增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 01 月起任富国中证 A500 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	—	15	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; 自 2025 年 04 月起任富国致盛量化选股股票型证券投资基金基金经理; 自 2025 年 05 月起任富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金经理; 自 2025 年 06 月起任富国致享量化选股股票型证券投资基金基金经理; 具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期, 富国基金管理有限公司作为富国 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, 以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标, 基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和相关法规要求，制定了《证券投资公平交易管理办法》，保证公司旗下不同投资组合在系统控制、日常操作层面享有公平的交易机会，并保持各投资组合的独立投资决策权。

本报告期内公司旗下基金严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，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。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间，出现 33 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，为投资组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平对待投资组合或利益输送等情况。

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

2025 年初，外部关税担忧给全球风险资产带来扰动，市场迎来快速调整。春节后，国内大模型的出现，缩小了市场对于中美 AI 发展前景的认知差异，市场以 AI 为核心开启了新一轮上行，内外资共振流入重估中国资产。随着两会积极的政策定调、以及一系列更加聚焦需求侧、民生侧的政策密集落地，市场由前期 AI 板块的“一枝独秀”，逐步扩散至消费、金融、周期等低位顺周期板块。4 月初，由于美国对全球加征不合理关税，中国随后进行反制，中美关税摩擦逐步升级，中美进入“不可贸易”状态。美国滥施关税给全球资本市场带来大规模冲击。4 月 8 日，中央汇金发布公告，通过增持 ETF 进入市场，同时中央部门、地方政府与上市公司合力维护市场稳定，指数稳步上行。国内方面，5 月 7 日国内推出一揽子金融支持政策，包含全面降准降息、维护股市楼市。海外方面，中美在关税问题上达成共识，缓解贸易摩擦，该阶段市场普涨。5 月中旬起，由于海外关税存在反复，美债及日债拍卖利率跳升，对全球市场流动性存在扰动，同时伊朗与

以色列冲突加剧全球避险情绪，市场整体振幅加大。6月下旬，随着伊朗与以色列阶段性停火，鲍威尔表态偏鸽、美联储7月降息的可能性提升，市场开始反弹。

总体来看，2025年上半年上证综指上涨2.76%，沪深300上涨0.03%，创业板指上涨0.53%，中证500指数上涨3.31%。

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，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2025年6月30日，本基金份额净值富国MSCI中国A股国际通指数增强A为2.0963元，富国MSCI中国A股国际通指数增强C为2.0893元；份额累计净值富国MSCI中国A股国际通指数增强A为2.0963元，富国MSCI中国A股国际通指数增强C为2.0893元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国MSCI中国A股国际通指数增强A为3.66%，富国MSCI中国A股国际通指数增强C为3.55%；同期业绩比较基准收益率情况：富国MSCI中国A股国际通指数增强A为-0.27%，富国MSCI中国A股国际通指数增强C为-0.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，市场逐步向好的条件在持续累积。随着稳定资本市场政策逐步深入人心，市场对于阶段性宏观数据扰动有所免疫，风险偏好有望提升。伴随着反内卷政策的出台，市场对于短期可能存在的需求回落担忧也将缓解，着眼未来，在减少资本开支的大背景下，上游周期和中游制造产能过剩情况均有望持续好转，企业盈利有望逐步改善。与此同时，在中美谈判持续推进和国内外AI模型持续发展的背景下，科技也有望进一步打开估值空间。

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

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：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	23,266,780.16	16,293,178.97
结算备付金	458,501.30	940,628.11
存出保证金	39,913.33	34,769.05
交易性金融资产	210,084,202.40	213,135,020.30
其中：股票投资	209,674,031.56	213,135,020.30
基金投资	—	—
债券投资	410,170.84	—
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	—	109,592.34
应收股利	—	—
应收申购款	24,698.00	21,604.86
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	233,874,095.19	230,534,793.63
负债和净资产	本期末	上年度末
	2025 年 06 月 30 日	2024 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	—	44,304.21
应付赎回款	706,569.11	3,543,206.37
应付管理人报酬	163,837.20	194,923.99
应付托管费	24,575.60	29,238.57
应付销售服务费	9,202.03	11,434.31
应付投资顾问费	—	—
应交税费	—	—
应付利润	—	—

递延所得税负债	—	—
其他负债	171,332.03	162,566.72
负债合计	1,075,515.97	3,985,674.17
净资产：		
实收基金	111,182,018.12	112,105,498.98
其他综合收益	—	—
未分配利润	121,616,561.10	114,443,620.48
净资产合计	232,798,579.22	226,549,119.46
负债和净资产总计	233,874,095.19	230,534,793.63

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.0939 元，基金份额总额 111,182,018.12 份。其中：富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A 份额净值 2.0963 元，份额总额 72,902,240.58 份；富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C 份额净值 2.0893 元，份额总额 38,279,777.54 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：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	9,086,574.92	9,256,823.44
1. 利息收入	30,233.79	42,472.48
其中：存款利息收入	30,233.79	42,472.48
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	7,459,673.86	2,404,671.75
其中：股票投资收益	4,506,842.00	-1,008,633.68
基金投资收益	—	—
债券投资收益	5,604.03	12,203.01
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	2,947,227.83	3,401,102.42
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）	1,586,428.35	6,786,956.16
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	10,238.92	22,723.05
减：二、营业总支出	1,433,789.67	1,729,064.77
1. 管理人报酬	1,101,362.26	1,304,164.24
2. 托管费	165,204.30	195,624.66
3. 销售服务费	75,423.51	81,342.07
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	—	0.02
8. 其他费用	91,799.60	147,933.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	7,652,785.25	7,527,758.67
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	7,652,785.25	7,527,758.67
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	7,652,785.25	7,527,758.67

6.3 净资产变动表

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：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2025 年 01 月 01 日至 2025 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	112,105,498.98	114,443,620.48	226,549,119.46
二、本期期初净资产	112,105,498.98	114,443,620.48	226,549,119.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-923,480.86	7,172,940.62	6,249,459.76
（一）、综合收益总额	—	7,652,785.25	7,652,785.25
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-923,480.86	-479,844.63	-1,403,325.49
其中：1. 基金申购款	47,551,525.52	48,138,861.15	95,690,386.67
2. 基金赎回款	—	—	—
	48,475,006.38	48,618,705.78	97,093,712.16
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—

(四)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	111,182,018.12	121,616,561.10	232,798,579.22
项目	上年度可比期间 (2024年01月01日至2024年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	106,245,420.37	80,782,380.23	187,027,800.60
二、本期期初净资产	106,245,420.37	80,782,380.23	187,027,800.60
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	43,172,489.53	39,581,096.22	82,753,585.75
(一)、综合收益总额	—	7,527,758.67	7,527,758.67
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	43,172,489.53	32,053,337.55	75,225,827.08
其中: 1. 基金申购款	78,596,280.39	60,519,328.31	139,115,608.70
2. 基金赎回款	—	—	—
	35,423,790.86	28,465,990.76	63,889,781.62
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	—	—	—
(四)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	149,417,909.90	120,363,476.45	269,781,386.35

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
_____	_____	_____
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国 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。根据基金管理人于 2023 年 9 月 20 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自 2023 年 9 月 22 日起，本基金增加 C 类份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，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、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2025年6月30日的财务状况以及2025年1月1日至2025年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

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

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

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

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

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征增值税试点的通知》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作为增值税纳税人；

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[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[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2025 年 06 月 30 日)
活期存款	23,266,780.16
等于：本金	23,264,696.41
加：应计利息	2,083.75
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	23,266,780.16

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（2025 年 06 月 30 日）			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	201,940,071.12	—	209,674,031.56	7,733,960.44
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	1,640.06	410,170.84	5,128.78
	银行间市场	—	—	—
	合计	1,640.06	410,170.84	5,128.78
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	202,343,473.12	1,640.06	210,084,202.40	7,739,089.22

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（2025 年 06 月 30 日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	421.65
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	59,066.47
其中：交易所市场	59,066.47
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	51,843.91
合计	171,332.03

6.4.7.7 实收基金

富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A：

金额单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	76,567,433.09	76,567,433.09
本期申购	7,395,610.71	7,395,610.71
本期赎回（以“-”号填列）	-11,060,803.22	-11,060,803.22
本期末	72,902,240.58	72,902,240.58

富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C：

金额单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,538,065.89	35,538,065.89
本期申购	40,155,914.81	40,155,914.81
本期赎回（以“-”号填列）	-37,414,203.16	-37,414,203.16
本期末	38,279,777.54	38,279,777.54

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	75,201,050.	3,077,181.	78,278,231.79

	39	40	
本期期初	75,201,050.39	3,077,181.40	78,278,231.79
本期利润	3,914,017.18	1,331,347.60	5,245,364.78
本期基金份额交易产生的变动数	-3,602,717.18	-1,480.39	-3,604,197.57
其中：基金申购款	7,524,105.40	125,440.86	7,649,546.26
基金赎回款	-11,126,822.58	-126,921.25	-11,253,743.83
本期已分配利润	—	—	—
本期末	75,512,350.39	4,407,048.61	79,919,399.00

富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,741,067.63	1,424,321.06	36,165,388.69
本期期初	34,741,067.63	1,424,321.06	36,165,388.69
本期利润	2,152,339.72	255,080.75	2,407,420.47
本期基金份额交易产生的变动数	2,497,819.44	626,533.50	3,124,352.94
其中：基金申购款	39,858,438.29	630,876.60	40,489,314.89
基金赎回款	-37,360,618.85	-4,343.10	-37,364,961.95
本期已分配利润	—	—	—
本期末	39,391,226.79	2,305,935.31	41,697,162.10

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
活期存款利息收入	28,135.39
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	1,258.59
其他	839.81
合计	30,233.79

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
卖出股票成交总额	572,792,441.32
减：卖出股票成本总额	567,772,357.88
减：交易费用	513,241.44
买卖股票差价收入	4,506,842.00

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（2025年01月01日至2025年06月30日）
债券投资收益——利息收入	727.66
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,876.37
合计	5,604.03

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（2025年01月01日至2025年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	535,872.65
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	528,185.00
减：应计利息总额	2,809.93
减：交易费用	1.35
买卖债券差价收入	4,876.37

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（2025年01月01日至2025年06月30日）
股票投资产生的股利收益	2,947,227.83
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	2,947,227.83

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
1. 交易性金融资产	1,586,428.35
股票投资	1,581,299.57
债券投资	5,128.78
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	1,586,428.35

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
基金赎回费收入	9,075.10
基金转换费收入	1,163.82

合计	10,238.92
----	-----------

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
审计费用	18,843.91
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	2,378.91
指数使用费	10,574.30
其他	2.48
合计	91,799.60

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

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰海通证券股份有限公司（由国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 4 月变更名称而来，以下简称“国泰海通”）承继及承接海通证券股份有限公司的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持本公司股权亦归属于国泰海通，即国泰海通成为本公司的主要股东。变更后，本公司的股东为国泰海通证券股份有限公司，出资比例为 27.775%；申万宏源证券有限公司，出资比例为 27.775%；加拿大蒙特利尔银行，出资比例为 27.775%；山东省金融资产管理股份有限公司，出资比例为 16.675%。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构（2025 年 3 月 14 日前）
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	基金管理人的股东、基金代销机构（自 2025 年 3 月 14 日起）
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（“建设银行”）	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。关联方国泰海通证券有限公司（简称“国泰海通”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原关联方海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 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（%）
国泰海通	43,005,863.41	3.79	—	—
海通证券	—	—	40,691,312.27	4.95
申万宏源	101,158,210.18	8.92	31,123,946.99	3.78

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

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债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国泰海通	5,843.86	3.79	5,843.86	9.89
申万宏源	13,747.85	8.92	6,908.37	11.70
关联方名称	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	29,943.40	4.95	29,943.40	9.73
申万宏源	22,903.09	3.78	22,789.70	7.40

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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（2025年01月01日至2025年06月30日）	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	1,101,362.26	1,304,164.24
其中：应支付销售机构的客户维护费	207,888.83	222,997.81
应支付基金管理人的净管理费	893,473.43	1,081,166.43

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： $H=E\times 1.00\%/当年天数$

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	165,204.30	195,624.66

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C	合计
富国基金管理有限公司	—	28,190.34	28,190.34
国泰海通证券股份有限公司	—	2.12	2.12
合计	—	28,192.46	28,192.46

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C	合计
富国基金管理有限公司	—	36,062.73	36,062.73
合计	—	36,062.73	36,062.73

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

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

$$H=E\times\text{年销售服务费率}\div\text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.10.4报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)	
	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C

基金合同生效日（2018 年 12 月 25 日）持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	—	—	—	535.91
期间申购/买入总份额	—	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	—	—	—	535.91
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	—	—	0.00%

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 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	23,266,780.16	28,135.39	19,218,506.19	34,128.46

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 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：	总金额

				股/张)	
国泰海通证券股份 有限公司	301658	首航新 能	IPO 网下 申购	4,369	51,554.20
申万宏源证券承销 保荐有限责任公司	301479	弘景光 电	IPO 网下 申购	1,296	54,302.40
申万宏源证券承销 保荐有限责任公司	301601	惠通科 技	IPO 网下 申购	3,417	40,320.60
申万宏源证券承销 保荐有限责任公司	301636	泽润新 能	IPO 网下 申购	1,273	42,085.38
申万宏源证券承销 保荐有限责任公司	688411	海博思 创	IPO 网下 申购	4,515	87,500.70

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）					
关联方名称	证券代 码	证券名 称	发行方 式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
海通证券股份有限 公司	301565	中仑新材	IPO 网下 申购	5,991	71,173.08

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：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 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
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月	新股限售	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	—
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月	新股限售	5.30	14.44	626	3,317.80	9,039.44	—
001382	新亚电缆	2025-03-13	6 个月	新股限售	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	—
001390	古麒绒材	2025-05-21	6 个月	新股限售	12.08	18.12	176	2,126.08	3,189.12	—
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月	新股限售	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	—
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	新股限售	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	—

301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新股限售	27.50	56.19	226	6,215.00	12,698.94	—
301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月	新股限售	10.40	34.11	690	7,176.00	23,535.90	—
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月	新股限售	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	—
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新股限售	39.92	45.22	235	6,467.04	10,626.70	—
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	新股限售	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	—
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	新股限售	89.60	139.48	44	3,942.40	6,137.12	—
301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	新股限售	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	—
301601	惠通科技	2025-01-08	6 个月	新股限售	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	—
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	新股限售	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	—
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	新股限售	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	—
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月	新股限售	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	—
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月	新股限售	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	—
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新股限售	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	—
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新股限售	12.80	44.54	290	3,712.00	12,916.60	—
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股限售	26.50	32.68	111	2,941.50	3,627.48	—
603049	中策橡胶	2025-05-27	6 个月	新股限售	46.50	42.85	90	4,185.00	3,856.50	—
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股限售	12.30	54.45	191	2,349.30	10,399.95	—
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月	新股限售	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	—
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新股限售	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	—
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新股限售	93.50	90.66	32	2,992.00	2,901.12	—
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	新股限售	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	—
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	新股限售	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	—
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	新股限售	20.60	35.08	117	2,410.20	4,104.36	—
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	新股限售	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	—
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	新股限售	24.18	33.32	96	2,321.28	3,198.72	—
688411	海博思创	2025-01-20	6 个月	新股限售	19.38	83.49	452	8,759.76	37,737.48	—
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	新股限售	11.68	26.95	680	7,942.40	18,326.00	—
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	新股限售	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	—
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新股限售	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	—
688757	胜科纳米	2025-03-18	6 个月	新股限售	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	—
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月	新股限售	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	—
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	新股限售	47.27	124.16	155	7,326.85	19,244.80	—

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123257	安克转债	2025-06-16	1 个月内 (含)	认购新发 证券	100.00	100.01	2	200.00	200.01	—

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 2025 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 2025 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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银

行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2025 年 06 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
AAA	—	—
AAA 以下	8,671.33	—
未评级	—	—
合计	8,671.33	—

注：本基金上年度末未持有按长期信用评级列示的信用债。本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

本基金本报告期末及上年度末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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

单位：人民币元

本期末（2025 年 06 月 30 日）	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	23,266,780.16	—	—	—	—	—	23,266,780.16
结算备付金	458,501.30	—	—	—	—	—	458,501.30
存出保证金	39,913.33	—	—	—	—	—	39,913.33
交易性金融资产	—	—	410,170.84	—	—	209,674,031.56	210,084,202.40
应收申购款	—	—	—	—	—	24,698.00	24,698.00
资产总计	23,765,194.79	—	410,170.84	—	—	209,698,729.56	233,874,095.19
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	706,569.11	706,569.11
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	163,837.20	163,837.20
应付托管费	—	—	—	—	—	24,575.60	24,575.60
应付销售服务费	—	—	—	—	—	9,202.03	9,202.03
其他负债	—	—	—	—	—	171,332.03	171,332.03
负债总计	—	—	—	—	—	1,075,515.97	1,075,515.97
利率敏感度缺口	23,765,194.79	—	410,170.84	—	—	208,623,213.59	232,798,579.22
上年度末（2024 年 12 月 31 日）	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	16,293,178.97	—	—	—	—	—	16,293,178.97
结算备付金	940,628.11	—	—	—	—	—	940,628.11
存出保证金	34,769.05	—	—	—	—	—	34,769.05

交易性金融资产	—	—	—	—	—	213,135,020.30	213,135,020.30
应收清算款	—	—	—	—	—	109,592.34	109,592.34
应收申购款	710.00	—	—	—	—	20,894.86	21,604.86
资产总计	17,269,286.13	—	—	—	—	213,265,507.50	230,534,793.63
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	44,304.21	44,304.21
应付赎回款	—	—	—	—	—	3,543,206.37	3,543,206.37
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	194,923.99	194,923.99
应付托管费	—	—	—	—	—	29,238.57	29,238.57
应付销售服务费	—	—	—	—	—	11,434.31	11,434.31
其他负债	—	—	—	—	—	162,566.72	162,566.72
负债总计	—	—	—	—	—	3,985,674.17	3,985,674.17
利率敏感度缺口	17,269,286.13	—	—	—	—	209,279,833.33	226,549,119.46

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。本基金上年度末未持有债券资产（不含可转债），因此上年度末市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。		
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 (2025 年 06 月 30 日)	上年度末 (2024 年 12 月 31 日)
	1. 基准点利率增加 0.1%	-265.92	—
	2. 基准点利率减少 0.1%	265.92	—

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，所面临的最大的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 (2025 年 06 月 30 日)		上年度末 (2024 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	209,674,031.56	90.07	213,135,020.30	94.08
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	410,170.84	0.18	—	—
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	210,084,202.40	90.24	213,135,020.30	94.08

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

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

		本期末 (2025年06月30日)	上年度末 (2024年12月31日)
	1. 业绩比较基准增加 1%	2, 229, 545. 49	2, 100, 368. 62
	2. 业绩比较基准减少 1%	-2, 229, 545. 49	-2, 100, 368. 62

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果 所属的层次	本期末 (2025年06月30日)	上年度末 (2024年12月31日)
第一层次	209, 320, 912. 62	211, 886, 072. 90
第二层次	401, 699. 52	864, 895. 50
第三层次	361, 590. 26	384, 051. 90
合计	210, 084, 202. 40	213, 135, 020. 30

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	209,674,031.56	89.65
	其中：股票	209,674,031.56	89.65
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	410,170.84	0.18
	其中：债券	410,170.84	0.18
	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	23,725,281.46	10.14
8	其他各项资产	64,611.33	0.03
9	合计	233,874,095.19	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 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	772,984.00	0.33
B	采矿业	11,710,371.00	5.03
C	制造业	70,597,195.19	30.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,101,568.00	3.48
E	建筑业	4,398,572.00	1.89
F	批发和零售业	292,588.00	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	8,850,522.49	3.80
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,769,010.20	2.05
J	金融业	63,069,963.80	27.09
K	房地产业	95,580.00	0.04

L	租赁和商务服务业	1,090,431.00	0.47
M	科学研究和技术服务业	1,286,675.00	0.55
N	水利、环境和公共设施管理业	36,252.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	229,632.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	1,321,192.00	0.57
S	综合	—	—
	合计	176,622,536.68	75.87

7.2.1.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	1,104,148.00	0.47
C	制造业	19,095,857.99	8.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	644,209.00	0.28
E	建筑业	179,368.00	0.08
F	批发和零售业	504,052.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	2,355,084.00	1.01
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,655,400.36	1.57
J	金融业	2,757,540.60	1.18
K	房地产业	23,760.00	0.01
L	租赁和商务服务业	1,038,116.00	0.45
M	科学研究和技术服务业	643,989.44	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	470,257.49	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	154,224.00	0.07
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	425,488.00	0.18
S	综合	—	—
	合计	33,051,494.88	14.20

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

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	2,300	3,241,896.00	1.39
2	300750	宁德时代	11,560	2,915,663.20	1.25
3	601288	农业银行	460,800	2,709,504.00	1.16

4	600900	长江电力	88,100	2,655,334.00	1.14
5	002736	国信证券	216,700	2,496,384.00	1.07
6	600919	江苏银行	205,600	2,454,864.00	1.05
7	601318	中国平安	42,400	2,352,352.00	1.01
8	600926	杭州银行	138,300	2,326,206.00	1.00
9	601857	中国石油	264,800	2,264,040.00	0.97
10	600036	招商银行	46,100	2,118,295.00	0.91
11	600276	恒瑞医药	40,200	2,086,380.00	0.90
12	601818	光大银行	501,200	2,079,980.00	0.89
13	601688	华泰证券	112,300	2,000,063.00	0.86
14	601169	北京银行	292,800	1,999,824.00	0.86
15	002352	顺丰控股	39,900	1,945,524.00	0.84
16	601991	大唐发电	601,900	1,908,023.00	0.82
17	600016	民生银行	397,600	1,888,600.00	0.81
18	600000	浦发银行	133,000	1,846,040.00	0.79
19	000776	广发证券	109,700	1,844,057.00	0.79
20	601398	工商银行	232,800	1,766,952.00	0.76
21	601009	南京银行	149,100	1,732,542.00	0.74
22	002001	新 和 成	81,345	1,730,208.15	0.74
23	601006	大秦铁路	256,800	1,694,880.00	0.73
24	601899	紫金矿业	86,300	1,682,850.00	0.72
25	601838	成都银行	82,000	1,648,200.00	0.71
26	600660	福耀玻璃	28,300	1,613,383.00	0.69
27	601166	兴业银行	69,000	1,610,460.00	0.69
28	000725	京东方A	394,500	1,574,055.00	0.68
29	601919	中远海控	101,490	1,526,409.60	0.66
30	002230	科大讯飞	31,800	1,522,584.00	0.65
31	605499	东鹏饮料	4,790	1,504,299.50	0.65
32	603993	洛阳钼业	178,100	1,499,602.00	0.64
33	601916	浙商银行	440,400	1,492,956.00	0.64
34	000063	中兴通讯	45,000	1,462,050.00	0.63
35	000988	华工科技	31,100	1,462,011.00	0.63
36	601328	交通银行	181,800	1,454,400.00	0.62
37	601668	中国建筑	251,600	1,451,732.00	0.62
38	600741	华域汽车	81,960	1,446,594.00	0.62
39	002966	苏州银行	164,600	1,445,188.00	0.62
40	601577	长沙银行	138,700	1,378,678.00	0.59
41	600039	四川路桥	135,500	1,341,450.00	0.58
42	000333	美的集团	18,500	1,335,700.00	0.57
43	600030	中信证券	48,100	1,328,522.00	0.57
44	601319	中国人保	151,600	1,320,436.00	0.57

45	603259	药明康德	18,500	1,286,675.00	0.55
46	601658	邮储银行	233,600	1,277,792.00	0.55
47	688008	澜起科技	15,249	1,250,418.00	0.54
48	601988	中国银行	217,700	1,223,474.00	0.53
49	601336	新华保险	20,900	1,222,650.00	0.53
50	601958	金钼股份	111,500	1,219,810.00	0.52
51	600875	东方电气	72,200	1,208,628.00	0.52
52	601088	中国神华	29,500	1,195,930.00	0.51
53	601928	凤凰传媒	103,400	1,154,978.00	0.50
54	000001	平安银行	93,800	1,132,166.00	0.49
55	601077	渝农商行	156,300	1,115,982.00	0.48
56	000100	TCL 科技	257,670	1,115,711.10	0.48
57	002223	鱼跃医疗	30,600	1,089,360.00	0.47
58	000977	浪潮信息	21,300	1,083,744.00	0.47
59	300033	同花顺	3,900	1,064,739.00	0.46
60	600015	华夏银行	133,500	1,055,985.00	0.45
61	002142	宁波银行	38,200	1,045,152.00	0.45
62	000538	云南白药	18,380	1,025,420.20	0.44
63	002414	高德红外	98,700	1,011,675.00	0.43
64	600011	华能国际	139,800	998,172.00	0.43
65	000630	铜陵有色	294,800	984,632.00	0.42
66	000338	潍柴动力	62,600	962,788.00	0.41
67	601138	工业富联	44,700	955,686.00	0.41
68	600958	东方证券	97,900	947,672.00	0.41
69	600482	中国动力	40,000	922,800.00	0.40
70	603288	海天味业	23,639	919,793.49	0.40
71	002371	北方华创	2,000	884,420.00	0.38
72	600999	招商证券	49,900	877,741.00	0.38
73	600873	梅花生物	81,300	869,097.00	0.37
74	300383	光环新网	59,200	846,560.00	0.36
75	600115	中国东航	208,000	838,240.00	0.36
76	002595	豪迈科技	13,800	817,236.00	0.35
77	601555	东吴证券	90,200	789,250.00	0.34
78	600703	三安光电	63,000	782,460.00	0.34
79	002648	卫星化学	45,000	779,850.00	0.33
80	601901	方正证券	98,000	775,180.00	0.33
81	600535	天士力	49,500	774,675.00	0.33
82	002714	牧原股份	18,400	772,984.00	0.33
83	600031	三一重工	41,600	746,720.00	0.32
84	600109	国金证券	84,900	744,573.00	0.32
85	002128	电投能源	37,600	743,728.00	0.32

86	601717	中创智领	44,400	737,928.00	0.32
87	601998	中信银行	86,600	736,100.00	0.32
88	601111	中国国航	93,101	734,566.89	0.32
89	601825	沪农商行	74,700	724,590.00	0.31
90	601601	中国太保	19,300	723,943.00	0.31
91	600219	南山铝业	188,800	723,104.00	0.31
92	601766	中国中车	102,100	718,784.00	0.31
93	600352	浙江龙盛	70,300	714,248.00	0.31
94	601600	中国铝业	101,400	713,856.00	0.31
95	600050	中国联通	132,800	709,152.00	0.30
96	601877	正泰电器	31,200	707,304.00	0.30
97	600057	厦门象屿	98,500	692,455.00	0.30
98	601995	中金公司	19,400	685,984.00	0.29
99	600029	南方航空	115,500	681,450.00	0.29
100	300502	新易盛	5,340	678,286.80	0.29
101	000807	云铝股份	42,400	677,552.00	0.29
102	300442	润泽科技	13,600	673,608.00	0.29
103	600061	国投资本	88,900	668,528.00	0.29
104	688041	海光信息	4,695	663,356.55	0.28
105	002027	分众传媒	90,800	662,840.00	0.28
106	600585	海螺水泥	30,800	661,276.00	0.28
107	002384	东山精密	17,200	649,644.00	0.28
108	601168	西部矿业	38,700	643,581.00	0.28
109	002916	深南电路	5,935	639,852.35	0.27
110	601225	陕西煤业	33,100	636,844.00	0.27
111	600111	北方稀土	25,400	632,460.00	0.27
112	601816	京沪高铁	109,300	628,475.00	0.27
113	688256	寒武纪	1,011	608,116.50	0.26
114	002340	格林美	95,400	605,790.00	0.26
115	603187	海容冷链	51,409	604,569.84	0.26
116	002600	领益智造	70,100	602,159.00	0.26
117	000792	盐湖股份	35,200	601,216.00	0.26
118	600160	巨化股份	20,700	593,676.00	0.26
119	000301	东方盛虹	68,500	570,605.00	0.25
120	002939	长城证券	67,800	568,164.00	0.24
121	300657	弘信电子	20,100	560,589.00	0.24
122	600350	山东高速	52,100	555,386.00	0.24
123	600298	安琪酵母	15,700	552,169.00	0.24
124	000729	燕京啤酒	41,900	541,767.00	0.23
125	600941	中国移动	4,800	540,240.00	0.23
126	600795	国电电力	111,400	539,176.00	0.23

127	300059	东方财富	23,300	538,929.00	0.23
128	000728	国元证券	68,200	538,098.00	0.23
129	002594	比亚迪	1,600	531,056.00	0.23
130	688009	中国通号	103,175	530,319.50	0.23
131	600066	宇通客车	21,200	527,032.00	0.23
132	688599	天合光能	36,128	524,939.84	0.23
133	000408	藏格矿业	12,200	520,574.00	0.22
134	000783	长江证券	70,800	490,644.00	0.21
135	002155	湖南黄金	27,380	488,733.00	0.21
136	600497	驰宏锌锗	91,900	486,151.00	0.21
137	601117	中国化学	62,400	478,608.00	0.21
138	600901	江苏金租	77,500	469,650.00	0.20
139	600905	三峡能源	110,100	469,026.00	0.20
140	600019	宝钢股份	70,200	462,618.00	0.20
141	603601	再升科技	112,280	455,856.80	0.20
142	300115	长盈精密	21,200	453,680.00	0.19
143	600096	云天化	20,400	448,188.00	0.19
144	002673	西部证券	55,960	440,964.80	0.19
145	600428	中远海特	70,300	439,375.00	0.19
146	601881	中国银河	25,600	439,040.00	0.19
147	600028	中国石化	77,700	438,228.00	0.19
148	600256	广汇能源	69,300	417,186.00	0.18
149	002475	立讯精密	12,000	416,280.00	0.18
150	600887	伊利股份	14,800	412,624.00	0.18
151	003816	中国广核	113,200	412,048.00	0.18
152	601618	中国中冶	138,200	411,836.00	0.18
153	601108	财通证券	51,700	408,947.00	0.18
154	002241	歌尔股份	17,500	408,100.00	0.18
155	601456	国联民生	38,900	402,615.00	0.17
156	002459	晶澳科技	40,300	402,194.00	0.17
157	601633	长城汽车	18,700	401,676.00	0.17
158	600690	海尔智家	16,200	401,436.00	0.17
159	601985	中国核电	42,100	392,372.00	0.17
160	000858	五 粮 液	3,300	392,370.00	0.17
161	300580	贝斯特	15,900	390,663.00	0.17
162	601728	中国电信	50,100	388,275.00	0.17
163	601390	中国中铁	69,100	387,651.00	0.17
164	300274	阳光电源	5,700	386,289.00	0.17
165	601865	福莱特	25,200	383,292.00	0.16
166	600377	宁沪高速	24,900	381,966.00	0.16
167	000089	深圳机场	54,100	373,290.00	0.16

168	688111	金山办公	1,330	372,466.50	0.16
169	603885	吉祥航空	27,200	366,384.00	0.16
170	603881	数据港	14,180	362,299.00	0.16
171	688766	普冉股份	5,602	354,046.40	0.15
172	600085	同仁堂	9,800	353,388.00	0.15
173	000625	长安汽车	27,200	347,072.00	0.15
174	000651	格力电器	7,700	345,884.00	0.15
175	002252	上海莱士	49,900	342,813.00	0.15
176	600968	海油发展	83,900	342,312.00	0.15
177	600989	宝丰能源	21,200	342,168.00	0.15
178	601990	南京证券	41,800	337,744.00	0.15
179	688235	百济神州	1,434	335,039.76	0.14
180	600549	厦门钨业	16,000	334,720.00	0.14
181	002461	珠江啤酒	29,600	334,184.00	0.14
182	600104	上汽集团	20,800	333,840.00	0.14
183	688188	柏楚电子	2,520	331,783.20	0.14
184	603909	建发合诚	33,900	330,186.00	0.14
185	603323	苏农银行	57,690	323,640.90	0.14
186	600369	西南证券	73,500	319,725.00	0.14
187	601669	中国电建	65,100	317,037.00	0.14
188	002032	苏泊尔	6,000	314,340.00	0.14
189	600918	中泰证券	48,700	313,141.00	0.13
190	603893	瑞芯微	2,000	303,720.00	0.13
191	600547	山东黄金	9,200	293,756.00	0.13
192	600176	中国巨石	25,500	290,700.00	0.12
193	600908	无锡银行	45,900	289,629.00	0.12
194	000423	东阿阿胶	5,500	287,650.00	0.12
195	002206	海利得	56,200	287,182.00	0.12
196	000963	华东医药	7,100	286,556.00	0.12
197	002014	永新股份	23,400	283,608.00	0.12
198	603309	维力医疗	22,200	282,384.00	0.12
199	301338	凯格精机	5,900	281,489.00	0.12
200	603808	歌力思	33,800	280,540.00	0.12
201	300993	玉马科技	18,300	277,428.00	0.12
202	300857	协创数据	3,200	275,392.00	0.12
203	000726	鲁泰A	43,200	273,888.00	0.12
204	601311	骆驼股份	30,100	271,803.00	0.12
205	688728	格科微	17,644	271,717.60	0.12
206	002807	江阴银行	56,900	270,275.00	0.12
207	000708	中信特钢	22,700	266,952.00	0.11
208	601799	星宇股份	2,100	262,500.00	0.11

209	688169	石头科技	1,663	260,342.65	0.11
210	300308	中际旭创	1,780	259,630.80	0.11
211	301328	维峰电子	6,100	257,115.00	0.11
212	300058	蓝色光标	39,000	255,840.00	0.11
213	300476	胜宏科技	1,900	255,322.00	0.11
214	688220	翱捷科技	3,246	254,161.80	0.11
215	603071	物产环能	19,800	252,054.00	0.11
216	603799	华友钴业	6,800	251,736.00	0.11
217	300014	亿纬锂能	5,400	247,374.00	0.11
218	000719	中原传媒	19,900	246,959.00	0.11
219	605117	德业股份	4,680	246,448.80	0.11
220	600426	华鲁恒升	11,100	240,537.00	0.10
221	600415	小商品城	11,500	237,820.00	0.10
222	601229	上海银行	22,400	237,664.00	0.10
223	600418	江淮汽车	5,900	236,531.00	0.10
224	600642	申能股份	27,000	232,200.00	0.10
225	001203	大中矿业	24,500	231,525.00	0.10
226	300015	爱尔眼科	18,400	229,632.00	0.10
227	001872	招商港口	11,500	228,390.00	0.10
228	600362	江西铜业	9,600	224,928.00	0.10
229	002865	钧达股份	5,600	218,400.00	0.09
230	600027	华电国际	39,900	218,253.00	0.09
231	600299	安迪苏	22,400	216,160.00	0.09
232	600079	人福医药	10,100	211,898.00	0.09
233	603444	吉比特	700	211,365.00	0.09
234	002839	张家港行	46,600	209,700.00	0.09
235	002050	三花智控	7,900	208,402.00	0.09
236	002851	麦格米特	4,100	205,574.00	0.09
237	300433	蓝思科技	9,071	202,283.30	0.09
238	000598	兴蓉环境	27,800	200,438.00	0.09
239	601021	春秋航空	3,600	200,340.00	0.09
240	002444	巨星科技	7,800	198,978.00	0.09
241	002463	沪电股份	4,600	195,868.00	0.08
242	002896	中大力德	3,380	195,735.80	0.08
243	003021	兆威机电	1,800	194,670.00	0.08
244	601128	常熟银行	26,210	193,167.70	0.08
245	600380	健康元	17,400	191,922.00	0.08
246	002539	云图控股	20,400	191,352.00	0.08
247	600153	建发股份	18,300	189,771.00	0.08
248	002202	金风科技	18,300	187,575.00	0.08
249	688023	安恒信息	3,260	184,972.40	0.08

250	603899	晨光股份	6,300	182,637.00	0.08
251	000983	山西焦煤	28,500	182,400.00	0.08
252	688082	盛美上海	1,588	180,936.72	0.08
253	601066	中信建投	7,500	180,375.00	0.08
254	300017	网宿科技	16,800	180,096.00	0.08
255	300760	迈瑞医疗	800	179,800.00	0.08
256	600177	雅戈尔	24,500	178,850.00	0.08
257	600004	白云机场	19,400	176,540.00	0.08
258	600282	南钢股份	41,800	175,560.00	0.08
259	002007	华兰生物	11,200	175,504.00	0.08
260	600522	中天科技	12,100	174,966.00	0.08
261	001339	智微智能	3,600	173,988.00	0.07
262	603529	爱玛科技	5,000	172,000.00	0.07
263	300418	昆仑万维	5,100	171,513.00	0.07
264	000895	双汇发展	7,000	170,870.00	0.07
265	300251	光线传媒	8,200	166,214.00	0.07
266	603986	兆易创新	1,300	164,489.00	0.07
267	688472	阿特斯	17,798	162,851.70	0.07
268	002281	光迅科技	3,300	162,756.00	0.07
269	603156	养元饮品	7,500	158,700.00	0.07
270	600839	四川长虹	16,300	158,436.00	0.07
271	603728	鸣志电器	2,700	155,169.00	0.07
272	002659	凯文教育	30,600	154,224.00	0.07
273	002236	大华股份	9,700	154,036.00	0.07
274	000426	兴业银锡	9,700	153,260.00	0.07
275	600089	特变电工	12,800	152,704.00	0.07
276	605090	九丰能源	5,900	152,279.00	0.07
277	600332	白云山	5,700	150,252.00	0.06
278	601898	中煤能源	13,700	149,878.00	0.06
279	688551	科威尔	5,060	148,713.40	0.06
280	603848	好太太	9,600	147,840.00	0.06
281	000932	华菱钢铁	33,000	145,200.00	0.06
282	600025	华能水电	15,200	145,160.00	0.06
283	600584	长电科技	4,300	144,867.00	0.06
284	600196	复星医药	5,700	143,013.00	0.06
285	301368	丰立智能	2,300	142,209.00	0.06
286	600150	中国船舶	4,300	139,922.00	0.06
287	002415	海康威视	5,000	138,650.00	0.06
288	603916	苏博特	15,200	137,712.00	0.06
289	002493	荣盛石化	16,600	137,448.00	0.06
290	601377	兴业证券	21,500	133,085.00	0.06

291	600132	重庆啤酒	2,400	132,240.00	0.06
292	301261	恒工精密	1,800	131,202.00	0.06
293	000885	城发环境	9,800	130,536.00	0.06
294	601231	环旭电子	8,800	128,744.00	0.06
295	002185	华天科技	12,400	125,240.00	0.05
296	601369	陕鼓动力	14,100	123,657.00	0.05
297	002821	凯莱英	1,400	123,550.00	0.05
298	000425	徐工机械	15,900	123,543.00	0.05
299	600023	浙能电力	23,200	122,960.00	0.05
300	300369	绿盟科技	15,700	121,989.00	0.05
301	688327	云从科技	8,770	120,938.30	0.05
302	002790	瑞尔特	16,600	120,682.00	0.05
303	603393	新天然气	4,100	118,695.00	0.05
304	002837	英维克	3,960	117,651.60	0.05
305	688236	春立医疗	6,278	116,708.02	0.05
306	601216	君正集团	21,000	115,920.00	0.05
307	601878	浙商证券	10,600	115,646.00	0.05
308	002637	赞宇科技	11,400	113,772.00	0.05
309	688029	南微医学	1,684	113,754.20	0.05
310	688046	药康生物	7,524	113,160.96	0.05
311	601696	中银证券	10,500	112,245.00	0.05
312	688521	芯原股份	1,156	111,554.00	0.05
313	300953	震裕科技	1,100	111,485.00	0.05
314	301236	软通动力	2,000	109,280.00	0.05
315	688396	华润微	2,285	107,760.60	0.05
316	300590	移为通信	8,200	106,682.00	0.05
317	600398	海澜之家	15,000	104,400.00	0.04
318	600893	航发动力	2,700	104,058.00	0.04
319	688308	欧科亿	5,634	103,947.30	0.04
320	688126	沪硅产业	5,488	102,735.36	0.04
321	002156	通富微电	4,000	102,480.00	0.04
322	601827	三峰环境	12,100	101,640.00	0.04
323	603195	公牛集团	2,100	101,325.00	0.04
324	600733	北汽蓝谷	13,600	100,232.00	0.04
325	688677	海泰新光	2,562	99,943.62	0.04
326	301358	湖南裕能	3,200	99,808.00	0.04
327	002948	青岛银行	20,000	99,600.00	0.04
328	300738	奥飞数据	4,700	98,371.00	0.04
329	301332	德尔玛	9,500	97,280.00	0.04
330	688469	芯联集成	20,280	96,735.60	0.04
331	002466	天齐锂业	3,000	96,120.00	0.04

332	603662	柯力传感	1,500	95,895.00	0.04
333	600515	海南机场	27,000	95,580.00	0.04
334	002028	思源电气	1,300	94,783.00	0.04
335	002080	中材科技	4,800	93,600.00	0.04
336	688208	道通科技	3,046	93,207.60	0.04
337	601162	天风证券	18,900	93,177.00	0.04
338	600009	上海机场	2,900	92,133.00	0.04
339	300718	长盛轴承	1,300	90,337.00	0.04
340	300638	广和通	3,100	88,753.00	0.04
341	601179	中国西电	14,200	87,188.00	0.04
342	601360	三六零	8,500	86,700.00	0.04
343	002416	爱施德	7,100	85,342.00	0.04
344	600236	桂冠电力	13,600	85,272.00	0.04
345	688162	巨一科技	3,080	83,899.20	0.04
346	300751	迈为股份	1,200	83,472.00	0.04
347	000876	新希望	8,800	82,544.00	0.04
348	688408	中信博	1,761	82,203.48	0.04
349	300679	电连技术	1,800	81,684.00	0.04
350	688568	中科星图	2,262	81,454.62	0.03
351	603515	欧普照明	4,500	80,955.00	0.03
352	301220	亚香股份	1,800	80,820.00	0.03
353	600489	中金黄金	5,500	80,465.00	0.03
354	301160	翔楼新材	1,000	80,080.00	0.03
355	002078	太阳纸业	5,900	79,414.00	0.03
356	688223	晶科能源	15,230	79,043.70	0.03
357	002965	祥鑫科技	2,000	78,440.00	0.03
358	600323	瀚蓝环境	3,200	77,920.00	0.03
359	300432	富临精工	5,900	77,113.00	0.03
360	002913	奥士康	2,600	76,466.00	0.03
361	300620	光库科技	1,600	75,376.00	0.03
362	002831	裕同科技	3,200	74,944.00	0.03
363	603699	纽威股份	2,400	74,808.00	0.03
364	600961	株冶集团	6,600	73,788.00	0.03
365	300788	中信出版	2,300	73,784.00	0.03
366	300755	华致酒行	3,800	73,340.00	0.03
367	688480	赛恩斯	2,275	73,141.25	0.03
368	300699	光威复材	2,300	72,841.00	0.03
369	600755	厦门国贸	11,900	71,995.00	0.03
370	301195	北路智控	2,000	71,600.00	0.03
371	001965	招商公路	5,865	70,380.00	0.03
372	600760	中航沈飞	1,200	70,344.00	0.03

373	600167	联美控股	12,500	70,250.00	0.03
374	603303	得邦照明	5,800	70,006.00	0.03
375	002353	杰瑞股份	2,000	70,000.00	0.03
376	002739	万达电影	6,100	69,723.00	0.03
377	688608	恒玄科技	200	69,596.00	0.03
378	002705	新宝股份	4,700	69,090.00	0.03
379	301413	安培龙	900	68,805.00	0.03
380	688281	华秦科技	1,120	67,771.20	0.03
381	603871	嘉友国际	6,300	67,725.00	0.03
382	002690	美亚光电	4,000	67,480.00	0.03
383	600438	通威股份	4,000	67,000.00	0.03
384	601012	隆基绿能	4,460	66,989.20	0.03
385	600480	凌云股份	5,500	66,935.00	0.03
386	600475	华光环能	6,300	65,646.00	0.03
387	002212	天融信	8,500	65,450.00	0.03
388	002073	软控股份	7,300	64,897.00	0.03
389	688114	华大智造	992	64,311.36	0.03
390	600866	星湖科技	9,200	63,572.00	0.03
391	300547	川环科技	2,100	63,462.00	0.03
392	600346	恒力石化	4,400	62,744.00	0.03
393	601686	友发集团	11,000	62,480.00	0.03
394	300223	北京君正	900	62,280.00	0.03
395	600517	国网英大	12,000	61,200.00	0.03
396	300938	信测标准	2,900	60,929.00	0.03
397	688578	艾力斯	649	60,382.96	0.03
398	603966	法兰泰克	6,500	60,320.00	0.03
399	603087	甘李药业	1,100	60,258.00	0.03
400	002543	万和电气	5,400	59,994.00	0.03
401	688025	杰普特	828	59,202.00	0.03
402	000498	山东路桥	10,000	58,800.00	0.03
403	603889	新澳股份	10,100	58,580.00	0.03
404	002588	史丹利	6,600	58,146.00	0.02
405	300458	全志科技	1,460	57,947.40	0.02
406	688225	亚信安全	2,841	57,927.99	0.02
407	688486	龙迅股份	862	57,650.56	0.02
408	601100	恒立液压	800	57,600.00	0.02
409	600188	兖矿能源	4,700	57,199.00	0.02
410	300832	新产业	1,000	56,720.00	0.02
411	600233	圆通速递	4,400	56,716.00	0.02
412	600372	中航机载	4,700	56,682.00	0.02
413	603277	银都股份	3,540	56,640.00	0.02

414	688819	天能股份	2,018	56,019.68	0.02
415	002242	九阳股份	5,800	55,100.00	0.02
416	603565	中谷物流	5,700	54,435.00	0.02
417	002532	天山铝业	6,300	52,353.00	0.02
418	002460	赣锋锂业	1,500	50,655.00	0.02
419	600998	九州通	9,700	49,858.00	0.02
420	000661	长春高新	500	49,590.00	0.02
421	301029	怡合达	2,100	48,006.00	0.02
422	002649	博彦科技	3,300	47,949.00	0.02
423	001288	运机集团	2,300	47,909.00	0.02
424	601689	拓普集团	1,000	47,250.00	0.02
425	605589	圣泉集团	1,700	47,175.00	0.02
426	601528	瑞丰银行	8,000	46,320.00	0.02
427	003022	联泓新科	2,900	45,907.00	0.02
428	002233	塔牌集团	6,200	45,880.00	0.02
429	000568	泸州老窖	400	45,360.00	0.02
430	300628	亿联网络	1,300	45,188.00	0.02
431	688315	诺禾致源	3,194	45,099.28	0.02
432	600406	国电南瑞	2,000	44,820.00	0.02
433	688692	达梦数据	200	44,578.00	0.02
434	605305	中际联合	1,600	44,448.00	0.02
435	600348	华阳股份	6,600	43,956.00	0.02
436	601133	柏诚股份	3,400	43,214.00	0.02
437	002675	东诚药业	3,000	43,170.00	0.02
438	688037	芯源微	400	42,880.00	0.02
439	688525	佰维存储	628	42,327.20	0.02
440	688196	卓越新能	879	42,253.53	0.02
441	600095	湘财股份	4,200	42,126.00	0.02
442	603755	日辰股份	1,600	41,792.00	0.02
443	300856	科思股份	2,700	40,905.00	0.02
444	600166	福田汽车	14,600	39,566.00	0.02
445	603057	紫燕食品	1,800	39,348.00	0.02
446	600141	兴发集团	1,900	39,007.00	0.02
447	002468	申通快递	3,600	38,484.00	0.02
448	605598	上海港湾	1,800	38,466.00	0.02
449	688786	悦安新材	1,642	38,258.60	0.02
450	301091	深城交	1,300	38,012.00	0.02
451	002478	常宝股份	7,200	37,800.00	0.02
452	688411	海博思创	452	37,737.48	0.02
453	605507	国邦医药	1,900	37,563.00	0.02
454	603203	快克智能	1,500	37,305.00	0.02

455	603612	索通发展	2,000	36,760.00	0.02
456	603568	伟明环保	1,900	36,252.00	0.02
457	000893	亚钾国际	1,200	36,168.00	0.02
458	603868	飞科电器	1,000	35,870.00	0.02
459	603160	汇顶科技	500	35,515.00	0.02
460	688389	普门科技	2,743	35,439.56	0.02
461	300207	欣旺达	1,700	34,102.00	0.01
462	300866	安克创新	300	34,080.00	0.01
463	002701	奥瑞金	5,600	33,320.00	0.01
464	300470	中密控股	900	33,093.00	0.01
465	603583	捷昌驱动	900	32,868.00	0.01
466	002484	江海股份	1,600	32,784.00	0.01
467	000157	中联重科	4,500	32,535.00	0.01
468	600602	云赛智联	1,600	32,272.00	0.01
469	301363	美好医疗	1,800	31,752.00	0.01
470	000938	紫光股份	1,300	31,187.00	0.01
471	301061	匠心家居	400	31,016.00	0.01
472	688332	中科蓝讯	300	30,924.00	0.01
473	600460	士兰微	1,200	29,784.00	0.01
474	688018	乐鑫科技	200	29,220.00	0.01
475	603379	三美股份	600	28,872.00	0.01
476	300496	中科创达	500	28,610.00	0.01
477	603369	今世缘	700	27,251.00	0.01
478	001283	豪鹏科技	500	27,225.00	0.01
479	600012	皖通高速	1,600	27,168.00	0.01
480	001308	康冠科技	1,200	27,144.00	0.01
481	002643	万润股份	2,300	26,473.00	0.01
482	603919	金徽酒	1,400	25,340.00	0.01
483	002407	多氟多	2,000	24,380.00	0.01
484	688378	奥来德	1,440	24,264.00	0.01
485	002780	三夫户外	1,800	24,102.00	0.01
486	603035	常熟汽饰	1,800	23,940.00	0.01
487	000560	我爱我家	8,000	23,760.00	0.01
488	301458	钧崴电子	690	23,535.90	0.01
489	002925	盈趣科技	1,300	23,374.00	0.01
490	601233	桐昆股份	2,200	23,320.00	0.01
491	600038	中直股份	600	23,286.00	0.01
492	603979	金诚信	500	23,220.00	0.01
493	600486	扬农化工	400	23,200.00	0.01
494	603298	杭叉集团	1,100	23,045.00	0.01
495	002876	三利谱	900	22,671.00	0.01

496	600502	安徽建工	4,800	22,560.00	0.01
497	300809	华辰装备	600	22,548.00	0.01
498	301080	百普赛斯	300	21,459.00	0.01
499	688156	路德环境	1,264	21,374.24	0.01
500	002405	四维图新	2,500	21,350.00	0.01
501	601137	博威合金	1,200	21,348.00	0.01
502	688286	敏芯股份	300	21,207.00	0.01
503	002555	三七互娱	1,200	20,748.00	0.01
504	000960	锡业股份	1,300	19,890.00	0.01
505	601019	山东出版	2,100	19,887.00	0.01
506	688031	星环科技	423	19,724.49	0.01
507	688161	威高骨科	728	19,503.12	0.01
508	605555	德昌股份	1,170	19,386.90	0.01
509	688775	影石创新	155	19,244.80	0.01
510	002706	良信股份	2,100	18,711.00	0.01
511	002603	以岭药业	1,300	18,330.00	0.01
512	688545	兴福电子	680	18,326.00	0.01
513	605128	上海沿浦	600	18,156.00	0.01
514	688583	思看科技	227	18,087.36	0.01
515	300662	科锐国际	600	17,826.00	0.01
516	000600	建投能源	2,500	17,275.00	0.01
517	002803	吉宏股份	1,200	17,112.00	0.01
518	688563	航材股份	300	16,989.00	0.01
519	603039	泛微网络	300	16,710.00	0.01
520	600499	科达制造	1,700	16,660.00	0.01
521	000902	新洋丰	1,200	16,596.00	0.01
522	601628	中国人寿	400	16,476.00	0.01
523	000928	中钢国际	2,600	16,328.00	0.01
524	301602	超研股份	658	16,318.40	0.01
525	300803	指南针	200	16,132.00	0.01
526	688538	和辉光电	6,862	16,057.08	0.01
527	603180	金牌家居	800	15,576.00	0.01
528	300373	扬杰科技	300	15,570.00	0.01
529	603466	风语筑	1,500	15,135.00	0.01
530	688376	美埃科技	406	15,131.62	0.01
531	300041	回天新材	1,600	15,072.00	0.01
532	601872	招商轮船	2,400	15,024.00	0.01
533	002918	蒙娜丽莎	1,800	14,940.00	0.01
534	600867	通化东宝	1,800	14,760.00	0.01
535	603737	三棵树	400	14,740.00	0.01
536	001328	登康口腔	300	14,652.00	0.01

537	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.01
538	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.01
539	600582	天地科技	2,300	13,777.00	0.01
540	688095	福昕软件	200	13,582.00	0.01
541	002683	广东宏大	400	13,576.00	0.01
542	002899	英派斯	600	13,470.00	0.01
543	601198	东兴证券	1,200	13,380.00	0.01
544	000596	古井贡酒	100	13,315.00	0.01
545	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.01
546	605077	华康股份	800	12,944.00	0.01
547	301678	新恒汇	290	12,916.60	0.01
548	301275	汉朔科技	226	12,698.94	0.01
549	688668	鼎通科技	200	12,492.00	0.01
550	600988	赤峰黄金	500	12,440.00	0.01
551	601598	中国外运	2,500	12,325.00	0.01
552	688702	盛科通信	200	12,216.00	0.01
553	688157	松井股份	300	11,964.00	0.01
554	000778	新兴铸管	3,200	11,904.00	0.01
555	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.01
556	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
557	300443	金雷股份	500	11,300.00	0.00
558	600429	三元股份	2,500	11,275.00	0.00
559	300681	英搏尔	400	11,064.00	0.00
560	600563	法拉电子	100	10,909.00	0.00
561	603730	岱美股份	1,900	10,811.00	0.00
562	301501	恒鑫生活	235	10,626.70	0.00
563	603072	天和磁材	191	10,399.95	0.00
564	601868	中国能建	4,600	10,258.00	0.00
565	600595	中孚实业	2,300	10,074.00	0.00
566	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
567	002938	鹏鼎控股	300	9,609.00	0.00
568	688403	汇成股份	920	9,558.80	0.00
569	603558	健盛集团	1,000	9,110.00	0.00
570	603239	浙江仙通	600	9,066.00	0.00
571	001356	富岭股份	626	9,039.44	0.00
572	300894	火星人	700	8,981.00	0.00
573	600886	国投电力	600	8,844.00	0.00
574	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
575	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
576	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
577	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00

578	002949	华阳国际	500	6,740.00	0.00
579	600588	用友网络	500	6,685.00	0.00
580	301590	优优绿能	44	6,137.12	0.00
581	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
582	000564	供销大集	2,600	6,032.00	0.00
583	002311	海大集团	100	5,859.00	0.00
584	300737	科顺股份	1,200	5,784.00	0.00
585	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
586	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
587	601208	东材科技	500	4,740.00	0.00
588	688150	莱特光电	189	4,672.08	0.00
589	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
590	603271	永杰新材	117	4,104.36	0.00
591	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
592	603049	中策橡胶	90	3,856.50	0.00
593	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
594	603014	威高血净	111	3,627.48	0.00
595	603409	汇通控股	96	3,198.72	0.00
596	001390	古麒绒材	176	3,189.12	0.00
597	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
598	603202	天有为	32	2,901.12	0.00
599	002056	横店东磁	200	2,830.00	0.00
600	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
601	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
602	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
603	603877	太平鸟	100	1,450.00	0.00
604	688006	杭可科技	73	1,423.50	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	000776	广发证券	4,671,438.00	2.06
2	601919	中远海控	4,631,015.80	2.04
3	000651	格力电器	4,474,017.00	1.97
4	601688	华泰证券	4,195,446.00	1.85
5	300750	宁德时代	4,076,670.00	1.80
6	601991	大唐发电	4,042,683.00	1.78
7	002001	新 和 成	3,970,372.00	1.75
8	300308	中际旭创	3,949,398.00	1.74

9	600926	杭州银行	3,904,383.00	1.72
10	000333	美的集团	3,725,808.00	1.64
11	601009	南京银行	3,715,886.00	1.64
12	000977	浪潮信息	3,650,412.00	1.61
13	601899	紫金矿业	3,574,573.00	1.58
14	002230	科大讯飞	3,552,889.00	1.57
15	002371	北方华创	3,288,389.00	1.45
16	605499	东鹏饮料	3,283,971.00	1.45
17	600900	长江电力	3,245,741.00	1.43
18	601318	中国平安	3,114,295.00	1.37
19	000063	中兴通讯	3,107,731.00	1.37
20	603259	药明康德	3,044,314.00	1.34

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	300750	宁德时代	7,473,562.00	3.30
2	600519	贵州茅台	5,490,566.00	2.42
3	600036	招商银行	5,119,035.00	2.26
4	000776	广发证券	5,097,191.00	2.25
5	002594	比亚迪	5,046,585.00	2.23
6	000651	格力电器	4,718,793.00	2.08
7	000333	美的集团	4,164,199.00	1.84
8	601688	华泰证券	4,065,983.00	1.79
9	000858	五 粮 液	4,004,082.00	1.77
10	605499	东鹏饮料	3,997,899.00	1.76
11	600887	伊利股份	3,991,961.00	1.76
12	601919	中远海控	3,946,940.50	1.74
13	600900	长江电力	3,891,702.00	1.72
14	300308	中际旭创	3,805,108.00	1.68
15	601816	京沪高铁	3,631,167.00	1.60
16	600031	三一重工	3,478,669.00	1.54
17	600183	生益科技	3,338,505.00	1.47
18	601012	隆基绿能	3,251,038.00	1.44
19	600096	云天化	3,224,087.00	1.42
20	603501	豪威集团	3,180,323.50	1.40

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	562,730,069.57
卖出股票收入（成交）总额	572,792,441.32

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	401,499.51	0.17
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	8,671.33	0.00
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	410,170.84	0.18

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019766	25 国债 01	2,000	200,881.48	0.09
2	019773	25 国债 08	2,000	200,618.03	0.09
3	123256	恒帅转债	37	8,471.32	0.00
4	123257	安克转债	2	200.01	0.00

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会深圳监管局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局浙江监管局、国家外汇管理局浙江省分局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告

编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余证券的发行主体本期未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。

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	39,913.33
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	24,698.00
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	64,611.33

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
富国 MSCI 中国 A 股 国际通指数增强 A	6,789	10,738.29	35,933,896 .46	49.29	36,968,34 4.12	50.71
富国 MSCI 中国 A 股 国际通指数增强 C	2,221	17,235.38	34,888,994 .25	91.14	3,390,783 .29	8.86
合计	9,010	12,339.85	70,822,890 .71	63.70	40,359,12 7.41	36.30

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有 从业人员持有本 基金	富国 MSCI 中国 A 股国际 通指数增强 A	240,903.90	0.3304
	富国 MSCI 中国 A 股国际 通指数增强 C	76,357.79	0.1995
	合计	317,261.69	0.2854

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理 人员、基金投资 和研究部门负责人 持有本开放式 基金	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A	0
	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理 持有本开放式基 金	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A	10~50
	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C
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	76,567,433.09	35,538,065.89
本报告期基金总申购份额	7,395,610.71	40,155,914.81
减：本报告期基金总赎回份额	11,060,803.22	37,414,203.16
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	72,902,240.58	38,279,777.54

§ 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。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
渤海证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	3	15,551,161.80	1.37	2,113.34	1.37	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
东财证券	2	—	—	—	—	—
方正证券	2	84,801,948.58	7.48	11,524.42	7.48	—
高盛中国	1	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—
广发证券	2	6,205,026.24	0.55	843.24	0.55	—
国海证券	2	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通	4	43,005,863.41	3.79	5,843.86	3.79	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—
国投证券	2	—	—	—	—	—
国信证券	2	65,136,223.18	5.74	8,852.82	5.74	—
海通证券	2	—	—	—	—	—
华泰证券	2	13,979,371.60	1.23	1,900.06	1.23	—
华源证券	2	—	—	—	—	—
平安证券	2	353,582,458.22	31.18	48,057.20	31.18	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	101,158,210.18	8.92	13,747.85	8.92	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	—	—	—
西南证券	2	—	—	—	—	—
湘财证券	2	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—

招商证券	1	105,208,772.65	9.28	14,298.49	9.28	—
中航证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	295,873,984.94	26.09	40,212.02	26.09	—
中泰证券	2	—	—	—	—	—
中信建投	2	21,298,841.84	1.88	2,894.43	1.88	—
中信证券	3	28,270,252.63	2.49	3,843.77	2.49	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

注：1、我公司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。本报告期本基金新增券商交易单元：华源证券（019189、63156）。
2、国泰海通证券有限公司（简称“国泰海通”）是由国泰君安证券股份有限公司与海通证券股份有限公司于2025年3月14日合并组建而成。上表显示的国泰海通数据为自2025年3月15日至2025年6月30日通过国泰海通证券席位交易的情况，本期海通证券、国泰君安数据为自2025年1月1日至2025年3月14日通过海通证券、国泰君安席位交易的情况。

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（%）
渤海证券	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东财证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	998,710.00	69.75	—	—	—	—
高盛中国	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰海通	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—

国投证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	399,502.00	27.90	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
华源证券	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—
招商证券	33,641.90	2.35	—	—	—	—
中航证券	—	—	—	—	—	—
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	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于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	2025年01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	2025年01月09日
3	富国基金管理有限公司关于变更主要股东事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告	规定披露媒介	2025年01月21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	2025年01月21日
5	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	2025年03月07日
6	富国基金管理有限公司关于公司主要股东变更的公告	规定披露媒介	2025年03月18日
7	关于富国基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	规定披露媒介	2025年03月20日
8	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	2025年03月27日
9	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	2025年04月08日

10	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	2025年05月06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

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，根据中国证券监督管理委员会于 2025 年 1 月 17 日出具的《关于同意国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司并募集配套资金注册、核准国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司、海富通基金管理有限公司变更主要股东及实际控制人、富国基金管理有限公司变更主要股东、海通期货股份有限公司变更主要股东及实际控制人的批复》，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司，并依法承接富国基金管理有限公司 14,443 万元出资（占注册资本比例 27.775%）。自吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安成为基金管理人的主要股东。具体可参见基金管理人于 2025 年 1 月 21 日发布的《富国基金管理有限公司关于变更主要股东事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告》、2025 年 3 月 18 日发布的《富国基金管理有限公司关于公司主要股东变更的公告》。根据国泰海通证券股份有限公司于 2025 年 4 月 4 日发布的相关公告，国泰君安的公司名称变更为国泰海通证券股份有限公司。

二、本报告期内，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规的规定和基金合同的约定，为降低投资者的理财成本，经与本基金托管人协商一致，自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费调整为由基金管理人承担，并相应修订基金合同有关内容。具体可参见基金管理人于 2025 年 3 月 20 日发布的《关于富国基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》及修订后的基金合同、托管协议等法律文件。

§ 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	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		