

# 上证综指交易型开放式指数证券投资基金

## 二〇二四年中期报告

2024年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024年08月31日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	6
2.1	基金基本情况	6
2.2	基金产品说明	6
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	8
§4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	14
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6	中期财务报告（未经审计）	17
6.1	资产负债表	17
6.2	利润表	18
6.3	净资产变动表	19
6.4	报表附注	20
§7	投资组合报告	43
7.1	期末基金资产组合情况	43

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	54
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12	投资组合报告附注.....	54
§8	基金份额持有人信息.....	57
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	57
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	58
§9	开放式基金份额变动.....	59
§10	重大事件揭示.....	60
10.1	基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4	基金投资策略的改变.....	60
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8	其他重大事件.....	62
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	63
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.....	63
§12	备查文件目录.....	64



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上证综指交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	上证综指 ETF
场内简称	上证指数 ETF
基金主代码	510210
交易代码	510210
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2011 年 01 月 30 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,379,192,565.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 3 月 25 日

注：根据 2020 年 7 月 10 日发布的《富国基金管理有限公司关于上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金变更基金扩位简称的公告》，本基金场内简称进行了调整。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的标的指数为上证综合指数。
投资策略	本基金采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的最优化目标组合的构建、存托凭证的投资策略、其他金融工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	上证综合指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金，跟踪上证综合指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	郭明
	联系电话	021-20361818	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95588

传真	021-20361616	010—66105798
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	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	裴长江	廖林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年01月01日至2024年06月30日)
本期已实现收益	-43,991,417.14
本期利润	120,084,992.17
加权平均基金份额本期利润	0.0128
本期加权平均净值利润率	1.75%
本期基金份额净值增长率	-0.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)
期末可供分配利润	1,491,267,202.09
期末可供分配基金份额利润	0.1437
期末基金资产净值	7,556,861,138.70
期末基金份额净值	0.728
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	53.51%

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

### 3.2 基金净值表现

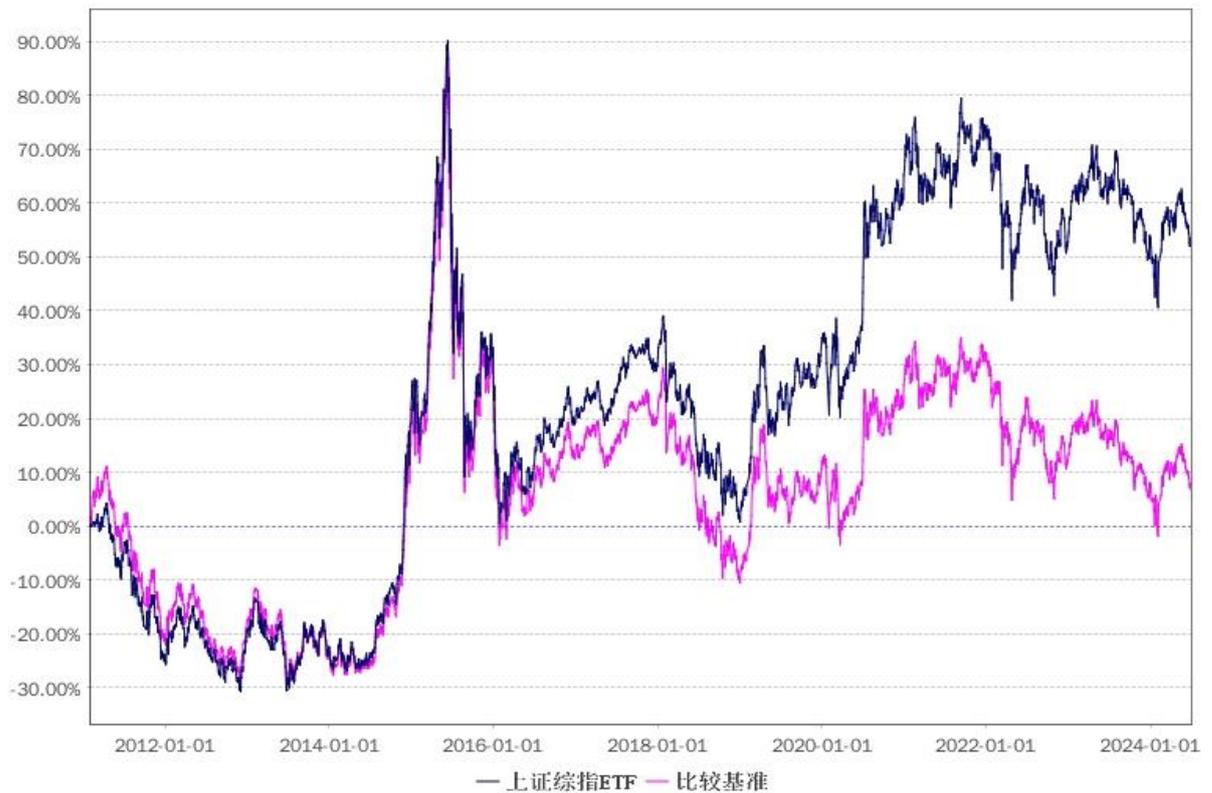
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-2.93%	0.54%	-3.87%	0.55%	0.94%	-0.01%
过去三个月	-2.02%	0.70%	-2.43%	0.72%	0.41%	-0.02%
过去六个月	-0.27%	0.93%	-0.25%	0.95%	-0.02%	-0.02%
过去一年	-5.68%	0.83%	-7.33%	0.84%	1.65%	-0.01%
过去三年	-8.55%	0.93%	-17.37%	0.93%	8.82%	0.00%

自基金合同生效起至今	53.51%	1.22%	7.80%	1.24%	45.71%	-0.02%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	--------

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2024年6月30日。 2、本基金于2011年1月30日成立，建仓期3个月，从2011年1月30日起至2011年4月29日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王保合	本基金现任基金经理	2011-03-03	—	18	博士，自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监、量化与海外投资部量化

					<p>投资总监；现任富国基金量化投资部总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。自 2011 年 03 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2011 年 03 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2015 年 04 月起任富国中证国有企业改革指数型证券投资基金(原富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金)基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证全指证券公司指数型证券投资基金(原富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金)基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证银行指数型证券投资基金(原富国中证银行指数分级证券投资基金)基金经理；自 2019 年 11 月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2019 年 12 月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2020 年 09 月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2022 年 10 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国创业板增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 09 月起任富国致弘量化选股股票型证券投资基金基金经理；自 2023 年 12 月起任富国致航量化选股股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。</p>
方旻	本基金现任基金经理	2014-11-19	—	14	<p>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</p>

					<p>化投资总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼资深定量基金经理。自 2014 年 11 月起任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2018 年 05 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2019 年 01 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自 2020 年 02 月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	--	--

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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上证综指交易型开放式指数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》、《上证综指交易型开放式指数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**

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现8次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年开年以来，国内悲观预期加速释放，海外修正抢跑的降息预期，资金和情绪的负反馈导致市场调整加速。尽管月末超预期降准、地产政策优化以及资本市场政策密集出台使得权重股带领市场短暂反弹，但雪球敲入、私募强制平仓等消息面和资金面负反馈仍在持续。2 月，随着国内经济与政策预期得到重新修正，风险偏好改善驱动市场快速反弹。在海外 AI 技术迎来突破等信息刺激下，A 股迎来大幅反弹，月末沪指成功站上 3000 点。3 月，市场重新进入以景气和政策为驱动的修复期，指数围绕关键点位震荡。经过前期大幅上涨后，投资者关注点重回现实，市场在三月下旬做多动能减弱，沪指一度下挫至 3000 点以下，但月末在政策预期催化下回到 3000 点上。4 月末，美国一季度经济呈现“滞涨”态势，降息预期推后下非美货币普遍贬值，而国内基本面较为稳健，人民币汇率抗跌走出独立行情，中国资产在全球的配置性价比和逻辑开始凸显，引发外资回流。业绩期进入尾声后，内资风险偏好抬升，合力推动沪指突破 3100 点。6 月进入验证期，国内经济复苏再度放缓，PMI 回落枯荣线以下、信用扩张疲软、经济“供强需弱”特征延续。接连落空的预期验证放大悲观情绪，沪指连续调整至 3000 点以下。

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

在投资管理上，本基金采用量化和人工管理相结合的方法，处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件，合理安排股票仓位及头寸，将跟踪误差控制在合理水平，努力为投资者提供合格的投资工具。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.728 元；份额累计净值为 1.545 元；本报告期，本基金份额净值增长率为-0.27%，同期业绩比较基准收益率为-0.25%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 下半年，风险偏好有望迎来修复窗口。从国内来看，为完成两会政府工作报告中提出的经济增长目标，下半年相关财政政策及货币政策有望进一

步发力。从海外看，随着美国通胀数据和就业数据持续走弱，美联储开启降息的概率进一步提升，新兴市场资金有望迎来回流，有助于风险偏好的提升。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

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

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 中期财务报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2024年06月 30日	上年度末 2023年12月31 日
<b>资 产：</b>		
货币资金	104,457,109.24	16,690,199.99
结算备付金	5,960,866.81	290,498.47
存出保证金	193,207.63	147,674.22
交易性金融资产	7,538,488,909.56	7,089,509,824.11
其中：股票投资	7,538,488,909.56	7,089,509,824.11
基金投资	—	—
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	857,829.47	—
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	7,649,957,922.71	7,106,638,196.79
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末 2024年06月 30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	85,917,900.45	394,501.92
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	2,778,119.29	2,907,946.48
应付托管费	555,623.85	581,589.32

应付销售服务费	—	—
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	3,845,140.42	3,039,143.53
负债合计	93,096,784.01	6,923,181.25
<b>净资产：</b>		
实收基金	6,065,593,936.6 1	5,685,149,924.27
其他综合收益	—	—
未分配利润	1,491,267,202.0 9	1,414,565,091.27
净资产合计	7,556,861,138.7 0	7,099,715,015.54
负债和净资产总计	7,649,957,922.7 1	7,106,638,196.79

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.728 元，基金份额总额 10,379,192,565.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日)
<b>一、营业总收入</b>	141,795,089.09	50,425,825.09
1.利息收入	131,607.21	24,350.38
其中：存款利息收入	131,607.21	24,350.38
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）	-21,668,367.24	75,181,557.67
其中：股票投资收益	-103,481,366.28	34,767,914.86
基金投资收益	—	—
债券投资收益	400,413.46	334,686.36
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	81,412,585.58	40,078,956.45
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）	164,076,409.31	-25,268,793.48
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-744,560.19	488,710.52
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>21,710,096.92</b>	<b>5,668,516.76</b>
1. 管理人报酬	17,155,245.02	4,434,142.80
2. 托管费	3,431,049.01	886,828.56
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	1.22	1.26
8. 其他费用	1,123,801.67	347,544.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>120,084,992.17</b>	<b>44,757,308.33</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>120,084,992.17</b>	<b>44,757,308.33</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>	<b>—</b>	<b>—</b>
<b>六、综合收益总额</b>	<b>120,084,992.17</b>	<b>44,757,308.33</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2024年01月01日至2024年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,685,149,924.27	1,414,565,091.27	7,099,715,015.54
二、本期期初净资产	5,685,149,924.27	1,414,565,091.27	7,099,715,015.54
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	380,444,012.34	76,702,110.82	457,146,123.16
(一)、综合收益总额	—	120,084,992.17	120,084,992.17
(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)	380,444,012.34	-43,382,881.35	337,061,130.99
其中：1. 基金申购款	6,879,549,769.65	1,566,660,188.77	8,446,209,958.42
2. 基金赎回款	—	—	—
	6,499,105,757.31	1,610,043,070.12	8,109,148,827.43

(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	6,065,593,936.61	1,491,267,202.09	7,556,861,138.70
项目	上年度可比期间 (2023年01月01日至2023年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	703,145,016.17	370,600,641.95	1,073,745,658.12
二、本期期初净资产	703,145,016.17	370,600,641.95	1,073,745,658.12
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,248,476,701.39	1,102,037,109.84	3,350,513,811.23
(一)、综合收益总额	—	44,757,308.33	44,757,308.33
(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)	2,248,476,701.39	1,413,012,436.47	3,661,489,137.86
其中：1.基金申购款	3,033,032,899.49	1,886,986,779.60	4,920,019,679.09
2.基金赎回款	-784,556,198.10	-473,974,343.13	—
(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)	—	-355,732,634.96	-355,732,634.96
(四)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	2,951,621,717.56	1,472,637,751.79	4,424,259,469.35

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

基金管理人  
基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

上证综指交易型开放式指数证券投资基金（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[2010]1379号《关于核准上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核

准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2011 年 1 月 30 日正式生效，首次设立募集规模为 320,363,407.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于存托凭证、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准为上证综合指数。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和中期报告》》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

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

#### **6.4.5 会计差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **6.4.6 税项**

##### **1 印花税**

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### **2 增值税**

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

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

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

入；

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

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

### 3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育费附加的单位外）及地方教育费附加。

### 4 企业所得税

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

## 5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2024年06月30日)
活期存款	104,457,109.24
等于：本金	104,448,677.38
加：应计利息	8,431.86
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	104,457,109.24

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

#### 6.4.7.2交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	7,608,958,64 8.94	—	7,538,488,90 9.56	— 70,469,739.3 8
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	7,608,958,64 8.94	—	7,538,488,90 9.56	— 70,469,739.3 8

#### 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（2024年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—

应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	2,559,011.96
其中：交易所市场	2,559,011.96
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	180,000.00
预提审计费	76,813.78
应付指数使用费	1,029,314.68
合计	3,845,140.42

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,728,192,565.00	5,685,149,924.27
本期申购	11,772,000,000.00	6,879,549,769.65
本期赎回（以“-”号填列）	-11,121,000,000.00	-6,499,105,757.31
本期末	10,379,192,565.00	6,065,593,936.61

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,768,703,681.46	—	1,414,565,091.27
本期期初	2,768,703,681.46	1,354,138,590.19	1,414,565,091.27
本期利润	-43,991,417.14	164,076,409.31	120,084,992.17
本期基金份额交易产生的变动数	206,567,003.36	-249,949,884.71	-43,382,881.35
其中：基金申购款	3,274,114,284.27	—	1,566,660,188.77
基金赎回款	—	1,457,504,210.79	—
基金赎回款	3,067,547,280.91	—	1,610,043,070.12
本期已分配利润	—	—	—
本期末	2,931,279,267.68	1,440,012,065.59	1,491,267,202.09

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
活期存款利息收入	104,890.88
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	25,406.57
其他	1,309.76
合计	131,607.21

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	-80,508,384.48
股票投资收益——赎回差价收入	-22,972,981.80
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	-103,481,366.28

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出股票成交总额	2,531,581,733.80
减：卖出股票成本总额	2,606,474,189.80
减：交易费用	5,615,928.48
买卖股票差价收入	-80,508,384.48

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
赎回基金份额对价总额	8,109,148,827.43
减：现金支付赎回款总额	2,410,895.43
减：赎回股票成本总额	8,129,710,913.80
减：交易费用	—
赎回差价收入	-22,972,981.80

##### 6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
债券投资收益——利息收入	342.99

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	400,070.47
合计	400,413.46

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,252,513.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,852,000.00
减：应计利息总额	353.15
减：交易费用	90.12
买卖债券差价收入	400,070.47

#### 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（2024年01月01日至2024年06月30日）
股票投资产生的股利收益	81,412,585.58
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	81,412,585.58

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
------	-----------------------------

1. 交易性金融资产	164,076,409.31
股票投资	164,076,409.31
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	164,076,409.31

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
基金赎回费收入	—
替代损益	-744,560.19
合计	-744,560.19

#### 6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
审计费用	33,813.78
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	325.03
指数使用费	1,029,314.68
其他	348.18
合计	1,123,801.67

### 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

根据本基金管理人于2024年08月27日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加E类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，基

金管理人经与基金托管人协商一致，决定于2024年8月29日起对旗下富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金增加E类份额，并对本基金的基金合同及托管协议做相应修改，相应内容也将在定期更新的招募说明书中一并修改。截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
富国鑫汇养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
申万宏源	5,437,522,921.32	100.00	922,495,074.48	70.89

##### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
申万宏源	2,252,513.74	100.00	1,690,764.53	100.00

### 6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	4,001,576.97	100.00	2,559,011.96	100.00
关联方名称	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	665,392.85	70.89	650,571.08	70.42

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

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

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至 2024年06月30日）	上年度可比期间（2023年01月 01日至2023年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	17,155,245.02	4,434,142.80
其中：支付销售机构的客户维护费	263,963.62	11,516.48
应支付基金管理人的净 管理费	16,891,281.40	4,422,626.32

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01 日至2024年06月30 日）	上年度可比期间（2023年01 月01日至2023年06月30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	3,431,049.01	886,828.56

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末（2024年06月30日）		上年度末（2023年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,071,875,034.00	10.33	1,293,827,252.00	13.30
富国鑫汇养老目标日期2045五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	2,544,200.00	0.02	—	—
海通证券股份有限公司	936,800.00	0.01	936,200.00	0.01

公司				
申万宏源证券有限公司	5,106,656.00	0.05	4,213,818.00	0.04

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	104,457,109.24	104,890.88	48,334,749.41	21,706.89

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

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

##### 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月	新股限售	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	—
603082	北自科技	2024-01-23	6个月	新股限售	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	—
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内 (含)	新股认购	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	—
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	新股限售	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	—
603312	西典新能	2024-01-04	6个月	新股限售	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	—
603341	龙旗科技	2024-02-23	6个月	新股限售	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	—
603375	盛景微	2024-01-17	6个月	新股限售	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	—
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月	新股限售	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	—
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月	新股限售	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	—
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月	新股限售	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	—

688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	新股限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	—
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	新股限售	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	—

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

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

#### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的信用债。

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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

### **6.4.13.3 流动性风险**

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

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

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

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

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

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

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### **6.4.13.4 市场风险**

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

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

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

###### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

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

单位：人民币元

本期末（2024年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	104,457,109.24	—	—	—	—	—	104,457,109.24
结算备付金	5,960,866.81	—	—	—	—	—	5,960,866.81
存出保证金	193,207.63	—	—	—	—	—	193,207.63
交易性金融资产	—	—	—	—	—	7,538,488,909.56	7,538,488,909.56
应收清算款	—	—	—	—	—	857,829.47	857,829.47
资产总计	110,611,183.68	—	—	—	—	7,539,346,739.03	7,649,957,922.71
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	85,917,900.45	85,917,900.45
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,778,119.29	2,778,119.29
应付托管费	—	—	—	—	—	555,623.85	555,623.85
其他负债	—	—	—	—	—	3,845,140.42	3,845,140.42
负债总计	—	—	—	—	—	93,096,784.01	93,096,784.01
利率敏感度缺口	110,611,183.68	—	—	—	—	7,446,249,955.02	7,556,861,138.70
上年度末（2023年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	16,690,199.99	—	—	—	—	—	16,690,199.99
结算备付金	290,498.47	—	—	—	—	—	290,498.47
存出保证金	147,674.22	—	—	—	—	—	147,674.22
交易性金融资产	—	—	—	—	—	7,089,509,824.11	7,089,509,824.11

资产总计	17,128,372.68	—	—	—	—	7,089,509,824.11	7,106,638,196.79
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	394,501.92	394,501.92
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,907,946.48	2,907,946.48
应付托管费	—	—	—	—	—	581,589.32	581,589.32
其他负债	—	—	—	—	—	3,039,143.53	3,039,143.53
负债总计	—	—	—	—	—	6,923,181.25	6,923,181.25
利率敏感度缺口	17,128,372.68	—	—	—	—	7,082,586,642.86	7,099,715,015.54

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在10个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于存托凭证、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）		上年度末（2023年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	7,538,488,909.56	99.76	7,089,509,824.11	99.86
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投	—	—	—	—

资				
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	7,538,488,909.56	99.76	7,089,509,824.11	99.86

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加1%	72,838,083.85	70,112,200.41
2. 业绩比较基准减少1%	-72,838,083.85	-70,112,200.41	

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 (2024年06月30日)	上年度末 (2023年12月31日)
第一层次	7,538,350,053.80	7,089,087,961.06
第二层次	24,002.55	—
第三层次	114,853.21	421,863.05
合计	7,538,488,909.56	7,089,509,824.11

#### 6.4.14.2 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	7,538,488,909.56	98.54
	其中：股票	7,538,488,909.56	98.54
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	110,417,976.05	1.44
8	其他各项资产	1,051,037.10	0.01
9	合计	7,649,957,922.71	100.00

注：上表中的股票投资项的金额包含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项及 7.3 不含可退替代款估值增值

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

##### 7.2.1.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	82,297.03	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,481.05	0.00
J	金融业	—	—

K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	138,855.76	0.00

### 7.2.1.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	7,103,371.00	0.09
B	采矿业	946,797,526.64	12.53
C	制造业	3,108,819,471.26	41.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	467,632,455.30	6.19
E	建筑业	176,111,867.33	2.33
F	批发和零售业	84,857,320.97	1.12
G	交通运输、仓储和邮政业	332,473,154.77	4.40
H	住宿和餐饮业	18,387,371.60	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	363,955,715.87	4.82
J	金融业	1,794,418,879.35	23.75
K	房地产业	92,904,700.00	1.23
L	租赁和商务服务业	33,125,949.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	20,764,076.89	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	4,121,780.04	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	8,551,255.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	78,223,265.41	1.04
S	综合	—	—
	合计	7,538,248,160.43	99.75

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	600519	贵州茅台	234,294	343,800,672.66	4.55
2	601857	中国石油	28,514,968	294,274,469.76	3.89
3	601288	农业银行	63,763,139	278,007,286.04	3.68
4	601988	中国银行	41,601,811	192,200,366.82	2.54
5	601088	中国神华	3,351,413	148,702,194.81	1.97
6	601658	邮储银行	26,035,200	131,998,464.00	1.75
7	600036	招商银行	3,643,636	124,575,914.84	1.65
8	600900	长江电力	4,288,995	124,037,735.40	1.64
9	601628	中国人寿	3,524,117	109,423,832.85	1.45
10	600028	中国石化	16,630,188	105,102,788.16	1.39
11	601138	工业富联	3,541,100	97,026,140.00	1.28
12	601166	兴业银行	5,242,133	92,366,383.46	1.22
13	601728	中国电信	14,863,057	91,407,800.55	1.21
14	601328	交通银行	10,234,540	76,452,013.80	1.01
15	601899	紫金矿业	4,350,300	76,434,771.00	1.01
16	601318	中国平安	1,828,140	75,611,870.40	1.00
17	601225	陕西煤业	2,610,615	67,275,548.55	0.89
18	601009	南京银行	5,361,475	55,705,725.25	0.74
19	600406	国电南瑞	2,220,780	55,430,668.80	0.73
20	601668	中国建筑	10,089,120	53,573,227.20	0.71
21	600795	国电电力	8,889,100	53,245,709.00	0.70
22	601939	建设银行	6,960,071	51,504,525.40	0.68
23	600309	万华化学	624,502	50,497,231.72	0.67
24	600000	浦发银行	5,926,181	48,772,469.63	0.65
25	601601	中国太保	1,689,900	47,080,614.00	0.62
26	600809	山西汾酒	221,040	46,612,915.20	0.62
27	603993	洛阳钼业	5,354,200	45,510,700.00	0.60
28	600760	中航沈飞	1,131,842	45,386,864.20	0.60
29	601998	中信银行	6,677,408	44,738,633.60	0.59
30	600276	恒瑞医药	1,122,276	43,162,734.96	0.57
31	600150	中国船舶	1,011,921	41,195,303.91	0.55
32	600483	福能股份	3,417,220	39,844,785.20	0.53
33	600642	申能股份	4,392,900	38,789,307.00	0.51
34	600109	国金证券	5,081,600	38,366,080.00	0.51
35	601021	春秋航空	670,500	37,769,265.00	0.50
36	600893	航发动力	1,029,100	37,613,605.00	0.50
37	600019	宝钢股份	5,623,033	37,393,169.45	0.49
38	600489	中金黄金	2,500,534	37,007,903.20	0.49
39	601128	常熟银行	4,841,056	36,646,793.92	0.48
40	600050	中国联通	7,746,800	36,409,960.00	0.48
41	601816	京沪高铁	6,768,300	36,345,771.00	0.48

42	688041	海光信息	515,846	36,274,290.72	0.48
43	600863	内蒙华电	7,726,750	35,852,120.00	0.47
44	601898	中煤能源	2,752,700	34,353,696.00	0.45
45	601000	唐山港	7,211,715	33,895,060.50	0.45
46	600030	中信证券	1,851,389	33,750,821.47	0.45
47	601888	中国中免	530,100	33,125,949.00	0.44
48	601633	长城汽车	1,304,237	32,997,196.10	0.44
49	600233	圆通速递	2,093,217	32,758,846.05	0.43
50	601168	西部矿业	1,794,500	32,211,275.00	0.43
51	600332	白云山	1,092,268	32,036,220.44	0.42
52	603288	海天味业	928,723	32,013,081.81	0.42
53	600690	海尔智家	1,115,400	31,655,052.00	0.42
54	600919	江苏银行	4,252,920	31,599,195.60	0.42
55	600585	海螺水泥	1,323,375	31,218,416.25	0.41
56	600031	三一重工	1,885,157	31,105,090.50	0.41
57	601390	中国中铁	4,632,101	30,201,298.52	0.40
58	600125	铁龙物流	4,997,900	29,837,463.00	0.39
59	605499	东鹏饮料	135,700	29,277,275.00	0.39
60	688126	沪硅产业	2,097,466	28,966,005.46	0.38
61	600350	山东高速	3,255,200	28,808,520.00	0.38
62	600061	国投资本	5,081,821	28,712,288.65	0.38
63	601377	兴业证券	5,666,280	28,671,376.80	0.38
64	603501	韦尔股份	284,064	28,227,439.68	0.37
65	601066	中信建投	1,460,100	28,092,324.00	0.37
66	600188	兖矿能源	1,230,402	27,967,037.46	0.37
67	600346	恒力石化	1,987,120	27,720,324.00	0.37
68	603816	顾家家居	855,915	27,637,495.35	0.37
69	600885	宏发股份	998,006	27,624,806.08	0.37
70	600516	方大炭素	6,226,894	26,837,913.14	0.36
71	600909	华安证券	6,325,397	26,629,921.37	0.35
72	601555	东吴证券	4,416,869	26,059,527.10	0.34
73	603939	益丰药房	1,054,628	25,891,117.40	0.34
74	600373	中文传媒	1,730,019	25,673,481.96	0.34
75	600547	山东黄金	931,765	25,511,725.70	0.34
76	603596	伯特利	654,720	25,468,608.00	0.34
77	600850	电科数字	1,405,353	25,436,889.30	0.34
78	603977	国泰集团	2,469,000	25,109,730.00	0.33
79	688363	华熙生物	442,231	25,017,007.67	0.33
80	600368	五洲交通	6,935,735	24,760,573.95	0.33
81	600104	上汽集团	1,779,800	24,668,028.00	0.33
82	605358	立昂微	1,055,544	24,425,288.16	0.32

83	601319	中国人保	4,734,400	24,382,160.00	0.32
84	600887	伊利股份	937,743	24,231,279.12	0.32
85	600745	闻泰科技	852,501	24,083,153.25	0.32
86	600674	川投能源	1,269,566	23,804,362.50	0.32
87	601818	光大银行	7,430,100	23,553,417.00	0.31
88	600352	浙江龙盛	2,733,500	23,480,765.00	0.31
89	601618	中国中冶	7,341,584	22,758,910.40	0.30
90	600703	三安光电	1,932,660	22,650,775.20	0.30
91	600926	杭州银行	1,731,200	22,592,160.00	0.30
92	600183	生益科技	1,071,900	22,574,214.00	0.30
93	600011	华能国际	2,332,005	22,433,888.10	0.30
94	600428	中远海特	3,643,625	22,298,985.00	0.30
95	601100	恒立液压	477,000	22,218,660.00	0.29
96	600143	金发科技	3,344,206	22,105,201.66	0.29
97	600487	亨通光电	1,395,020	21,999,465.40	0.29
98	600048	保利发展	2,458,839	21,539,429.64	0.29
99	688506	百利天恒	117,473	21,309,602.20	0.28
100	688385	复旦微电	678,314	21,285,493.32	0.28
101	603859	能科科技	1,004,775	21,120,370.50	0.28
102	600273	嘉化能源	2,952,600	21,081,564.00	0.28
103	603899	晨光股份	670,319	20,967,578.32	0.28
104	603259	药明康德	529,831	20,764,076.89	0.27
105	600803	新奥股份	998,038	20,759,190.40	0.27
106	601016	节能风电	6,915,290	20,676,717.10	0.27
107	603392	万泰生物	313,600	20,659,968.00	0.27
108	601985	中国核电	1,922,900	20,498,114.00	0.27
109	601717	郑煤机	1,372,800	20,317,440.00	0.27
110	601881	中国银河	1,869,100	20,298,426.00	0.27
111	688728	格科微	1,666,344	20,179,425.84	0.27
112	603328	依顿电子	2,564,100	20,153,826.00	0.27
113	601800	中国交建	2,239,669	20,022,640.86	0.26
114	600664	哈药股份	7,580,653	20,012,923.92	0.26
115	688111	金山办公	87,250	19,849,375.00	0.26
116	603369	今世缘	427,600	19,755,120.00	0.26
117	600111	北方稀土	1,136,750	19,552,100.00	0.26
118	688036	传音控股	252,215	19,304,536.10	0.26
119	600158	中体产业	2,475,800	19,038,902.00	0.25
120	601919	中远海控	1,223,200	18,947,368.00	0.25
121	601688	华泰证券	1,528,470	18,937,743.30	0.25
122	689009	九号公司	511,938	18,844,437.78	0.25
123	600089	特变电工	1,348,840	18,708,410.80	0.25

124	600268	国电南自	3,249,912	18,556,997.52	0.25
125	603393	新天然气	533,354	18,528,717.96	0.25
126	603633	徕木股份	2,339,970	18,509,162.70	0.24
127	600258	首旅酒店	1,488,856	18,387,371.60	0.24
128	601669	中国电建	3,282,600	18,349,734.00	0.24
129	601231	环旭电子	1,138,382	18,271,031.10	0.24
130	600570	恒生电子	1,022,837	18,063,301.42	0.24
131	688127	蓝特光学	980,459	18,030,641.01	0.24
132	601698	中国卫通	1,277,323	17,997,481.07	0.24
133	600166	福田汽车	7,868,700	17,704,575.00	0.23
134	600206	有研新材	1,976,832	17,593,804.80	0.23
135	601689	拓普集团	327,700	17,567,997.00	0.23
136	600015	华夏银行	2,740,487	17,539,116.80	0.23
137	600161	天坛生物	710,820	17,344,008.00	0.23
138	601111	中国国航	2,347,800	17,326,764.00	0.23
139	600773	西藏城投	1,678,476	17,321,872.32	0.23
140	600882	妙可蓝多	1,385,961	17,282,933.67	0.23
141	603260	合盛硅业	366,700	17,128,557.00	0.23
142	601678	滨化股份	4,908,606	17,081,948.88	0.23
143	601117	中国化学	2,057,100	16,950,504.00	0.22
144	600033	福建高速	5,046,000	16,904,100.00	0.22
145	601777	力帆科技	4,317,078	16,577,579.52	0.22
146	600025	华能水电	1,533,100	16,526,818.00	0.22
147	603599	广信股份	1,351,872	16,398,207.36	0.22
148	600085	同仁堂	428,400	16,369,164.00	0.22
149	601825	沪农商行	2,419,600	16,259,712.00	0.22
150	600521	华海药业	942,700	16,073,035.00	0.21
151	688981	中芯国际	348,040	16,044,644.00	0.21
152	601155	新城控股	1,806,480	16,023,477.60	0.21
153	600383	金地集团	4,665,172	15,861,584.80	0.21
154	600663	陆家嘴	1,785,652	15,749,450.64	0.21
155	600559	老白干酒	852,600	15,500,268.00	0.21
156	600694	大商股份	918,530	15,440,489.30	0.20
157	688033	天宜上佳	2,566,693	15,400,158.00	0.20
158	603019	中科曙光	370,896	15,392,184.00	0.20
159	688303	大全能源	747,899	15,249,660.61	0.20
160	688088	虹软科技	525,620	15,169,393.20	0.20
161	688166	博瑞医药	431,375	15,098,125.00	0.20
162	688475	萤石网络	440,315	15,019,144.65	0.20
163	600825	新华传媒	3,932,255	14,903,246.45	0.20
164	603078	江化微	1,111,561	14,883,801.79	0.20

165	688249	晶合集成	1,006,706	14,768,377.02	0.20
166	600438	通威股份	772,100	14,754,831.00	0.20
167	603456	九洲药业	1,073,900	14,733,908.00	0.19
168	600237	铜峰电子	2,815,600	14,697,432.00	0.19
169	688321	微芯生物	834,842	14,693,219.20	0.19
170	600116	三峡水利	2,116,500	14,603,850.00	0.19
171	603806	福斯特	979,996	14,405,941.20	0.19
172	600073	光明肉业	2,598,995	14,320,462.45	0.19
173	600110	诺德股份	4,682,700	14,282,235.00	0.19
174	600256	广汇能源	2,131,200	14,279,040.00	0.19
175	605056	咸亨国际	1,320,300	14,232,834.00	0.19
176	601700	风范股份	3,166,500	13,900,935.00	0.18
177	601012	隆基绿能	987,380	13,843,067.60	0.18
178	600612	老凤祥	237,666	13,829,784.54	0.18
179	603027	千禾味业	1,039,504	13,825,403.20	0.18
180	600395	盘江股份	2,284,900	13,732,249.00	0.18
181	601059	信达证券	965,625	13,721,531.25	0.18
182	605488	福莱新材	1,053,872	13,700,336.00	0.18
183	603015	弘讯科技	1,807,100	13,661,676.00	0.18
184	600353	旭光电子	2,179,320	13,446,404.40	0.18
185	603486	科沃斯	282,996	13,351,751.28	0.18
186	688366	昊海生科	214,828	13,250,591.04	0.18
187	603158	腾龙股份	1,857,600	13,077,504.00	0.17
188	605388	均瑶健康	2,373,740	13,008,095.20	0.17
189	603786	科博达	200,200	12,842,830.00	0.17
190	603606	东方电缆	261,100	12,744,291.00	0.17
191	688690	纳微科技	733,185	12,735,423.45	0.17
192	688375	国博电子	179,789	12,700,294.96	0.17
193	688349	三一重能	508,467	12,630,320.28	0.17
194	600886	国投电力	690,136	12,588,080.64	0.17
195	688289	圣湘生物	713,618	12,545,404.44	0.17
196	688167	炬光科技	226,620	12,464,100.00	0.16
197	600558	大西洋	3,458,500	12,450,600.00	0.16
198	688083	中望软件	167,890	12,192,171.80	0.16
199	603610	麒盛科技	1,225,374	12,106,695.12	0.16
200	688799	华纳药厂	280,576	11,904,839.68	0.16
201	688336	三生国健	581,947	11,842,621.45	0.16
202	600436	片仔癀	57,100	11,829,407.00	0.16
203	688590	新致软件	906,302	11,691,295.80	0.15
204	688223	晶科能源	1,641,973	11,658,008.30	0.15
205	603033	三维股份	980,206	11,468,410.20	0.15

206	688007	光峰科技	698,988	11,253,706.80	0.15
207	603348	文灿股份	404,100	11,189,529.00	0.15
208	603520	司太立	1,172,151	11,182,320.54	0.15
209	688589	力合微	443,419	11,178,592.99	0.15
210	603169	兰石重装	2,474,100	11,133,450.00	0.15
211	600557	康缘药业	706,896	11,098,267.20	0.15
212	600522	中天科技	698,400	11,069,640.00	0.15
213	688210	统联精密	499,506	11,064,057.90	0.15
214	603358	华达科技	382,474	11,034,374.90	0.15
215	688586	江航装备	1,179,323	10,967,703.90	0.15
216	600496	精工钢构	4,263,400	10,914,304.00	0.14
217	603915	国茂股份	1,059,300	10,900,197.00	0.14
218	603687	大胜达	1,513,206	10,834,554.96	0.14
219	603918	金桥信息	1,034,700	10,812,615.00	0.14
220	600160	巨化股份	442,700	10,682,351.00	0.14
221	688172	燕东微	659,613	10,672,538.34	0.14
222	601229	上海银行	1,449,000	10,519,740.00	0.14
223	601008	连云港	3,005,400	10,338,576.00	0.14
224	600758	辽宁能源	3,595,200	10,282,272.00	0.14
225	605319	无锡振华	572,000	10,124,400.00	0.13
226	603878	武进不锈	1,542,300	10,086,642.00	0.13
227	603277	银都股份	333,100	10,006,324.00	0.13
228	600897	厦门空港	775,807	9,782,926.27	0.13
229	688677	海泰新光	245,536	9,632,377.28	0.13
230	601600	中国铝业	1,248,700	9,527,581.00	0.13
231	600184	光电股份	1,104,100	9,395,891.00	0.12
232	688733	壹石通	626,268	9,362,706.60	0.12
233	603799	华友钴业	422,640	9,353,023.20	0.12
234	600198	大唐电信	1,812,100	9,332,315.00	0.12
235	688301	奕瑞科技	80,620	9,289,842.60	0.12
236	603698	航天工程	755,547	9,043,897.59	0.12
237	688599	天合光能	531,086	8,985,975.12	0.12
238	688232	新点软件	453,158	8,936,275.76	0.12
239	603507	振江股份	261,200	8,572,584.00	0.11
240	603882	金域医学	314,500	8,551,255.00	0.11
241	600590	泰豪科技	2,223,050	8,469,820.50	0.11
242	688798	艾为电子	149,280	8,452,233.60	0.11
243	600651	飞乐音响	3,014,000	8,318,640.00	0.11
244	605136	丽人丽妆	1,506,677	8,301,790.27	0.11
245	605016	百龙创园	407,230	8,295,275.10	0.11
246	600845	宝信软件	258,676	8,259,524.68	0.11

247	603203	快克智能	343,600	8,102,088.00	0.11
248	688161	威高骨科	407,537	8,077,383.34	0.11
249	688028	沃尔德	487,074	8,002,625.82	0.11
250	605155	西大门	873,072	7,988,608.80	0.11
251	603048	浙江黎明	549,300	7,975,836.00	0.11
252	601968	宝钢包装	1,697,300	7,943,364.00	0.11
253	605208	永茂泰	1,273,300	7,932,659.00	0.10
254	600299	安迪苏	804,600	7,804,620.00	0.10
255	603730	岱美股份	776,120	7,714,632.80	0.10
256	688050	爱博医疗	105,005	7,698,966.60	0.10
257	600219	南山铝业	1,984,984	7,562,789.04	0.10
258	603195	公牛集团	97,899	7,549,970.88	0.10
259	601133	柏诚股份	693,115	7,409,399.35	0.10
260	601019	山东出版	624,400	7,380,408.00	0.10
261	603093	南华期货	840,000	7,274,400.00	0.10
262	688008	澜起科技	126,940	7,255,890.40	0.10
263	600348	华阳股份	714,600	7,117,416.00	0.09
264	600287	ST舜天	2,003,500	7,112,425.00	0.09
265	688139	海尔生物	190,960	7,103,712.00	0.09
266	600540	新赛股份	2,083,100	7,103,371.00	0.09
267	600128	苏豪弘业	1,114,800	7,101,276.00	0.09
268	603999	读者传媒	1,498,800	7,089,324.00	0.09
269	601838	成都银行	466,100	7,080,059.00	0.09
270	601699	潞安环能	388,000	7,034,440.00	0.09
271	688063	派能科技	172,819	6,862,642.49	0.09
272	600039	四川路桥	867,700	6,846,153.00	0.09
273	688271	联影医疗	62,340	6,838,698.00	0.09
274	600738	丽尚国潮	1,846,700	6,777,389.00	0.09
275	600235	民丰特纸	1,469,900	6,761,540.00	0.09
276	603380	易德龙	334,600	6,718,768.00	0.09
277	603618	杭电股份	1,490,300	6,527,514.00	0.09
278	600026	中远海能	415,800	6,490,638.00	0.09
279	600848	上海临港	703,500	6,408,885.00	0.08
280	603699	纽威股份	372,200	6,372,064.00	0.08
281	600018	上港集团	1,074,100	6,208,298.00	0.08
282	600329	达仁堂	185,100	5,995,389.00	0.08
283	603009	北特科技	325,300	5,832,629.00	0.08
284	603629	利通电子	307,500	5,676,450.00	0.08
285	605058	澳弘电子	284,200	5,593,056.00	0.07
286	603817	海峡环保	1,143,500	5,443,060.00	0.07
287	601211	国泰君安	390,700	5,293,985.00	0.07

288	688390	固德威	91,360	5,127,123.20	0.07
289	601279	英利汽车	1,369,800	5,109,354.00	0.07
290	600232	金鹰股份	1,085,800	4,679,798.00	0.06
291	688219	会通股份	599,761	4,660,142.97	0.06
292	603192	汇得科技	345,600	4,641,408.00	0.06
293	688273	麦澜德	234,009	4,633,378.20	0.06
294	688768	容知日新	191,940	4,493,315.40	0.06
295	688231	隆达股份	298,400	4,255,184.00	0.06
296	601801	皖新传媒	597,100	4,137,903.00	0.05
297	688156	路德环境	311,548	4,121,780.04	0.05
298	605122	四方新材	409,580	3,981,117.60	0.05
299	605255	天普股份	328,730	3,951,334.60	0.05
300	603833	欧派家居	73,700	3,947,372.00	0.05
301	603669	灵康药业	43,400	204,848.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
2	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
3	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
4	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
5	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
6	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
7	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
8	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
9	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
10	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
11	603375	盛景微	72	2,800.80	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	600809	山西汾酒	54,122,843.01	0.76
2	600642	申能股份	36,213,508.00	0.51
3	600558	大西洋	33,320,464.00	0.47
4	603977	国泰集团	30,071,509.00	0.42
5	603288	海天味业	29,676,663.88	0.42
6	603369	今世缘	28,418,520.00	0.40

7	601127	赛力斯	28,397,534.00	0.40
8	603486	科沃斯	28,133,973.15	0.40
9	603279	景津装备	27,764,553.42	0.39
10	600519	贵州茅台	27,667,194.00	0.39
11	601288	农业银行	27,269,042.00	0.38
12	605499	东鹏饮料	26,115,712.50	0.37
13	600125	铁龙物流	25,950,544.00	0.37
14	688506	百利天恒	25,746,083.28	0.36
15	688036	传音控股	25,671,171.15	0.36
16	603687	大胜达	25,495,784.00	0.36
17	600158	中体产业	25,379,661.00	0.36
18	688111	金山办公	25,101,186.13	0.35
19	688363	华熙生物	24,418,118.21	0.34
20	600410	华胜天成	23,948,607.00	0.34

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	600519	贵州茅台	256,949,979.36	3.62
2	688609	九联科技	55,145,641.02	0.78
3	603667	五洲新春	42,244,287.54	0.60
4	603960	克来机电	39,809,253.22	0.56
5	601857	中国石油	38,720,545.83	0.55
6	601988	中国银行	35,599,515.00	0.50
7	601179	中国西电	33,713,748.00	0.47
8	600862	中航高科	32,352,171.74	0.46
9	603663	三祥新材	30,118,742.58	0.42
10	603279	景津装备	29,257,807.06	0.41
11	688303	大全能源	28,982,771.00	0.41
12	603189	网达软件	28,878,005.00	0.41
13	600838	上海九百	28,066,379.33	0.40
14	600708	光明地产	26,089,120.60	0.37
15	688779	五矿新能	25,782,998.61	0.36
16	601628	中国人寿	25,651,956.00	0.36
17	600172	黄河旋风	25,098,710.04	0.35
18	601238	广汽集团	23,590,594.69	0.33
19	600741	华域汽车	23,475,165.32	0.33
20	601127	赛力斯	23,290,640.00	0.33

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	2,906,929,039.15
卖出股票收入（成交）总额	2,531,581,733.80

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

### 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，招商银行股份有限公司在报告编制

日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局、国家金融监督管理总局深圳监管局、国家金融监督管理总局的处罚。

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国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国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、中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国邮政储蓄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	193,207.63
2	应收清算款	857,829.47
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—

8	其他	—
9	合计	1,051,037.10

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688692	达梦数据	30,612.75	0.00	新股限售
2	603285	键邦股份	24,002.55	0.00	新股认购
3	601033	永兴股份	20,077.68	0.00	新股限售
4	688709	成都华微	19,635.55	0.00	新股限售
5	688584	上海合晶	13,760.74	0.00	新股限售

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
86,019	120,661.63	6,309,497,198.00	60.79	4,069,695,367.00	39.21	1,071,875,034.00	10.33

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	707,882,100.00	6.82
2	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	676,792,000.00	6.52
3	大家人寿保险股份有限公司—传统产品	408,754,700.00	3.94
4	友邦人寿保险有限公司—分红	343,862,700.00	3.31
5	友邦人寿保险有限公司—传统	339,360,100.00	3.27
6	信泰人寿保险股份有限公司—传统产品	312,058,500.00	3.01
7	招商局仁和人寿保险股份有限公司—传统产品3号	310,454,938.00	2.99
8	富国基金—中国人寿保险股份有限公司—分红险—富国基金国寿股份均衡股票型组合单一	243,321,300.00	2.34
9	招商局仁和人寿保险股份有限公司—分红产品1号	173,809,003.00	1.67
10	富国基金—中国人寿保险股份有限公司—传统险—富国基金国寿股份均衡股票传统可供出	162,866,100.00	1.57
11	富国上证综指交易型开放式指数证	1,071,875,034.00	10.33

	券投资基金联接基金		
--	-----------	--	--

### 8.3 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	—	—

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

---

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年01月30日)基金份额总额	320,363,407.00
报告期期初基金份额总额	9,728,192,565.00
本报告期基金总申购份额	11,772,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	11,121,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	10,379,192,565.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：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。

### 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 (%)	
长江证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	1	5,437,522,921.32	100.00	4,001,576.97	100.00	—
银河证券	2	—	—	—	—	—

注：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：长江证券（720710）。

#### 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 (%)
长江证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	2,252,513.74	100.00	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—

## **10.8 其他重大事件**

注：本基金本报告期无需要说明的重大事件。

---

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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。

## § 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上证综指交易型开放式指数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: <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。
2、上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同		
3、上证综指交易型开放式指数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、上证综指交易型开放式指数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		