

富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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： 国投证券股份有限公司

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。

基金托管人国投证券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.....	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.....	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6	管理人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.....	16
§ 5	托管人报告	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§ 6	中期财务报告（未经审计）	18
6.1	资产负债表.....	18
6.2	利润表.....	19
6.3	净资产变动表.....	20
6.4	报表附注.....	21
§ 7	投资组合报告	48

7.1	期末基金资产组合情况.....	48
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	48
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	49
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64
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..	64
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..	64
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.....	64
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	65
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
7.12	投资组合报告附注.....	65
§ 8	基金份额持有人信息	68
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	68
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
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.....	69
§ 9	开放式基金份额变动	70
§ 10	重大事件揭示.....	71
10.1	基金份额持有人大会决议.....	71
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.....	71
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71
10.4	基金投资策略的改变.....	71
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
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.....	71
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
10.8	其他重大事件.....	73
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	74
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	74
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	74
§ 12	备查文件目录.....	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	富国中证 A500ETF
场内简称	中证 A500ETF 富国
基金主代码	563220
交易代码	563220
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 09 月 25 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	国投证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,895,013,687.00 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	2024 年 10 月 15 日

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最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的资产配置策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券（含可分离交易可转债）及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数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	国投证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	郭刚
	联系电话	021-20361818	0755-81682162
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgfw@sdicsc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	0755-81682208
传真		021-20361616	—
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大

	办公楼二座 27-30 层	厦
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	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦 15 层资产托管部
邮政编码	200120	518038
法定代表人	裴长江	王苏望

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 国投证券股份有限公司 深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦 15 层资产托管部

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(2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	-53,188,996.43
本期利润	326,536,153.13
加权平均基金份额本期利润	0.0183
本期加权平均净值利润率	1.87%
本期基金份额净值增长率	1.61%
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	-18,005,917.58
期末可供分配基金份额利润	-0.0013
期末基金资产净值	13,989,754,725.54
期末基金份额净值	1.0068
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	0.68%

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	3.54%	0.60%	2.82%	0.60%	0.72%	0.00%
过去三个月	1.86%	1.20%	0.84%	1.20%	1.02%	0.00%
过去六个月	1.61%	1.10%	0.47%	1.10%	1.14%	0.00%
自基金合同	0.68%	1.27%	19.18%	1.58%	-18.50%	-0.31%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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2025年6月30日。

2、本基金于2024年9月25日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

本基金建仓期6个月，从2024年9月25日起至2025年3月24日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：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		
苏华清	本基金现任基金经理	2024-09-25	—	7	硕士，曾任中证指数有限公司研究员；自 2022 年 6 月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员；现任富国基金量化投资部定量基金经理。自 2023 年 10 月起任富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 11 月起任富国深证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 01 月起任富国深证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2024 年 03 月起任富国中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 04 月起任富国中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2024 年 06 月起任富国中证通信设备主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 08 月起任富国中证通信设备主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2024 年 09 月起任富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 11 月起任富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2025 年 01 月起任富国恒生 A 股专精特新企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 02 月起任富国上证科创板新能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 04 月起任富国上证科创板新能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2025 年 05 月起任富国恒生

					A 股专精特新企业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2025 年 05 月起任富国中证诚通国企数字经济交易型开放式指数证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
王乐乐	本基金现任基金经理	2024-09-25	—	15	博士，曾任上海证券有限责任公司研究员，华泰联合证券有限责任公司研究员，华泰证券股份有限公司研究员、创新规划团队负责人；自 2015 年 5 月加入富国基金管理有限公司，历任定量基金经理、量化投资部量化投资总监助理、高级定量基金经理；现任富国基金量化投资部 ETF 投资总监兼高级定量基金经理。自 2019 年 07 月起任富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2019 年 09 月起任富国中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2019 年 10 月起任富国中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2019 年 11 月起任富国中证科技 50 策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2019 年 11 月起任富国中证央企创新驱动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 02 月起任富国中证科技 50 策略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 03 月起任富国中证消费 50 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 03 月起任富国中证医药 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2020 年 07 月起任富国上海金交易型开放式证券投资基金基金经理；自 2020 年 07 月起任富国上海金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理；自 2022 年 07 月起任富国中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 A100 交易型开放

					式指数证券投资基金(原富国中证100 交易型开放式指数证券投资基金)基金经理；自 2022 年 12 月起任富国北证 50 成份指数型证券投资基金基金经理；自 2023 年 06 月起任富国中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2023 年 11 月起任富国中证医药 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2024 年 06 月起任富国中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(原富国中证 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金)基金经理；自 2024 年 09 月起任富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 11 月起任富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证 A500 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》、《富国中证 A500 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《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 21 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，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，努力为投资者提供更合格的投资工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0068 元；份额累计净值为 1.0068 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 1.61%；同期业绩比较基准收益率为 0.47%。

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有望缓解，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，国投证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在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信息的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、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：富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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	26,432,703.34	79,937,915.96
结算备付金	3,875,813.16	—
存出保证金	1,407,081.60	—
交易性金融资产	13,976,965,321.99	16,427,319,984.66
其中：股票投资	13,976,965,321.99	16,427,319,984.66
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	144,916.88	—
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	14,008,825,836.97	16,507,257,900.62
负债和净资产	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 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	16,306,493.90	28,665,591.97
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	1,892,959.21	2,030,508.11
应付托管费	630,986.40	676,836.04
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	240,671.92	49,262.30
负债合计	19,071,111.43	31,422,198.42
净资产：		
实收基金	13,895,013,687.00	16,628,013,687.00
其他综合收益	—	—
未分配利润	94,741,038.54	-152,177,984.80
净资产合计	13,989,754,725.54	16,475,835,702.20
负债和净资产总计	14,008,825,836.97	16,507,257,900.62

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0068 元，基金份额总额 13,895,013,687.00 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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)
一、营业总收入	344,122,491.93
1. 利息收入	255,472.84
其中：存款利息收入	255,472.84
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）	-47,393,376.12
其中：股票投资收益	-242,419,301.45
基金投资收益	—
债券投资收益	195,993.10
资产支持证券投资收益	—
贵金属投资收益	—
衍生工具收益	399,723.24
股利收益	194,430,208.99
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）	379,725,149.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	11,535,245.65
减：二、营业总支出	17,586,338.80
1. 管理人报酬	13,044,374.80

2. 托管费	4,348,124.98
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	2,429.40
8. 其他费用	191,409.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	326,536,153.13
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	326,536,153.13
五、其他综合收益的税后净额	—
六、综合收益总额	326,536,153.13

注：本基金合同生效日为 2024 年 9 月 25 日,无上年度同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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	16,628,013,687.00	— 152,177,984.80	16,475,835,702.20
二、本期期初净资产	16,628,013,687.00	— 152,177,984.80	16,475,835,702.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	— 2,733,000,000.00	246,919,023.34	— 2,486,080,976.66
（一）、综合收益总额	—	326,536,153.13	326,536,153.13
（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）	— 2,733,000,000.00	— 79,617,129.79	— 2,812,617,129.79
其中：1. 基金申购款	10,431,000,000.00	— 317,161,460.18	10,113,838,539.82
2. 基金赎回款	—	237,544,330.3	—

	13,164,000.00	9	12,926,455.66 9.61
(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	13,895,013.68 7.00	94,741,038.54	13,989,754.72 5.54

注：本基金合同生效日为 2024 年 9 月 25 日，无上年度同期对比数据。

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

富国中证 A500 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”）[2024]1268 号文《关于准予富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予公开募集注册。由基金管理人富国基金管理有限公司自 2024 年 9 月 10 日至 2024 年 9 月 20 日止向社会公开发行业募集。募集期结束经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具德师报(验)字(24)第 00179 号后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2024 年 09 月 25 日正式生效。本基金为契约型，交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的净有效认购金额为人民币 1,999,997,396.00 元，折算成基金份额计 1,999,997,396.00 份（其中，网上现金认购确认净有效认购资金为人民币 1,943,819,258.00 元，折算成基金份额计 1,943,819,258.00 份；网下现金认购确认净有效认购资金为人民币 56,178,138.00 元，折算成基金份额计 56,178,138.00 份）；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 704,739.79 元。（其中，根据注册登记机构的记录，网上现金认购有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 688,447.81 元，其中，利息折份额部分为人民币 0.00 元，折算成基金份额计 0.00 份；网下现金认购有效认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 16,291.98 元，折算成基金份额计

16,291.00 份，剩余部分为人民币 0.98 元，计入基金财产，不折算成投资者基金份额。）。至此，富国中证 A500ETF 募集的实收基金为人民币 2,000,013,687.00 元，折算成基金份额合计 2,000,013,687.00 份。本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，基金托管人为国投证券股份有限公司。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、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、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具以及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相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。

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，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为中证 A500 指数收益率。

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	352,697.44
等于：本金	352,558.54
加：应计利息	138.90
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	26,080,005.90
等于：本金	26,071,574.40
加：应计利息	8,431.50
减：坏账准备	—
合计	26,432,703.34

注：本基金本报告期末未持有定期存款。其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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	13,885,816,897.77	—	13,976,965,321.99	91,148,424.22
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	13,885,816,897.77	—	13,976,965,321.99	91,148,424.22

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

单位：人民币元

项目	本期末（2025 年 06 月 30 日）			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	11,382,520.00	—	—	—
股指期货	11,382,520.00	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—

合计	11,382,520.00	—	—	—
----	---------------	---	---	---

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

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2507	IF2507	8.00	9,378,720.00	236,160.00
IC2507	IC2507	2.00	2,346,960.00	107,000.00
合计				343,160.00
减：可抵销期货暂收款				343,160.00
净额				—

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2025 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	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	92,108.87

IOPV 计算发布费	14,179.29
预提_注册登记费	74,383.76
合计	240,671.92

6.4.7.7 实收基金

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	16,628,013,687.00	16,628,013,687.00
本期申购	10,431,000,000.00	10,431,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-13,164,000,000.00	-13,164,000,000.00
本期末	13,895,013,687.00	13,895,013,687.00

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	14,112,659.18	-166,290,643.98	-152,177,984.80
本期期初	14,112,659.18	-166,290,643.98	-152,177,984.80
本期利润	-53,188,996.43	379,725,149.56	326,536,153.13
本期基金份额交易产生的变动数	21,070,419.67	-100,687,549.46	-79,617,129.79
其中：基金申购款	-24,474,265.51	-292,687,194.67	-317,161,460.18
基金赎回款	45,544,685.18	191,999,645.21	237,544,330.39
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-18,005,917.58	112,746,956.12	94,741,038.54

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	14,082.18
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	221,622.44
结算备付金利息收入	19,768.22
其他	—
合计	255,472.84

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	-188,698,061.47
股票投资收益——赎回差价收入	-53,721,239.98
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	-242,419,301.45

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
卖出股票成交总额	6,682,962,414.20
减：卖出股票成本总额	6,865,797,595.56
减：交易费用	5,862,880.11
买卖股票差价收入	-188,698,061.47

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
赎回基金份额对价总额	12,926,455,669.61
减：现金支付赎回款总额	5,497,159,212.61
减：赎回股票成本总额	7,483,017,696.98
减：交易费用	—
赎回差价收入	-53,721,239.98

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
债券投资收益——利息收入	57.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	195,935.83
合计	195,993.10

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	781,126.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	585,100.00
减：应计利息总额	58.99
减：交易费用	31.23
买卖债券差价收入	195,935.83

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
股指期货投资收益	399,723.24

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	194,430,208.99
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	194,430,208.99

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	379,381,989.56
股票投资	379,381,989.56
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	343,160.00
权证投资	—
股指期货	343,160.00
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	379,725,149.56

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	—
替代损益	11,535,245.65
合计	11,535,245.65

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	47,108.87

信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
其他	84,300.75
合计	191,409.62

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、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
国投证券股份有限公司（“国投证券”）	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
富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

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。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

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金合同生效日为 2024 年 09 月 25 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为 2024 年 09 月 25 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金合同生效日为 2024 年 09 月 25 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。本基金合同生效日为 2024 年 09 月 25 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。本基金合同生效日为 2024 年 09 月 25 日，无上年度同期对比数据。

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）
当期发生的基金应支付的管理费	13,044,374.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,027,853.41
应支付基金管理人的净管理费	11,016,521.39

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。

本基金合同生效日为 2024 年 9 月 25 日，无上年度同期对比数据。

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）
当期发生的基金应支付的托管费	4,348,124.98

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。

本基金合同生效日为 2024 年 9 月 25 日，无上年度同期对比数据。

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：本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

本基金合同生效日 2024 年 09 月 25 日, 无上年度同期对比数据。

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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金合同生效日为 2024 年 9 月 25 日，无上年度同期对比数据。

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（2025 年 06 月 30 日）		上年度末（2024 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 (%)
富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	3,027,387,209.00	21.79	3,255,006,146.00	19.58
国泰海通证券股份有限公司	995,045,316.00	7.16	—	—
国投证券股份有限公司	79,041,100.00	0.57	9,870,000.00	0.06
海通证券股份有限公司	—	—	89,570,000.00	0.54
申万宏源证券有限公司	51,455,800.00	0.37	672,045,109.00	4.04

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

注：本基金本报告期未发生关联方银行存款业务。本基金合同生效日为 2024 年 09 月 25 日，无上年度同期对比数据。

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：股/张）	总金额
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	5,591	108,353.58

注：本基金合同生效日为 2024 年 09 月 25 日，无上年度同期对比数据。

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

为更紧密地跟踪标的指数，降低跟踪误差，经与基金托管人协商一致，本基金在报告期内根据基金合同约定的投资策略投资于基金托管人关联方发行的股票国投电力（600886.SH）、瀚蓝环境（600323.SH）。

本报告期末，本基金持有国投电力 1,466,400 股，占基金资产净值比例 0.15%。
上年度末，本基金持有国投电力 2,128,900 股，占基金资产净值比例 0.21%。

本报告期末，本基金持有瀚蓝环境 295,600 股，占基金资产净值比例 0.05%。
上年度末，本基金持有瀚蓝环境 349,000 股，占基金资产净值比例 0.05%。

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（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
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月	新股限售	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	—
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	—
001388	信通电子	2025-06-24	1 个月内 (含)	新股认购	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	—
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	新股限售	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	—
001390	古麒绒材	2025-05-21	6 个月	新股限售	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	—
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	—
002044	美年健康	2025-06-11	6 个月	大宗交易 限售	4.92	4.75	300,000	1,476,000.00	1,425,000.00	—
002044	美年健康	2025-06-26	6 个月	大宗交易 限售	4.70	4.74	300,000	1,410,000.00	1,422,000.00	—
002044	美年健康	2025-06-27	6 个月	大宗交易 限售	4.75	4.74	300,000	1,425,000.00	1,422,000.00	—

300383	光环新网	2025-05-20	6 个月	大宗交易 限售	12.56	12.96	300,000	3,768,000.00	3,888,000.00	—
300457	赢合科技	2025-06-23	6 个月	大宗交易 限售	19.78	20.96	130,000	2,571,400.00	2,724,800.00	—
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	—
301458	钧崑电子	2025-01-02	6 个月	新股限售	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	—
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	349	9,620.72	15,781.78	—
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	73	6,540.80	10,182.04	—
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	382	4,889.60	17,014.28	—
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股限售	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	—
603049	中策橡胶	2025-05-27	6 个月	新股限售	46.50	42.85	724	33,666.00	31,023.40	—
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股限售	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	—
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	166	15,521.00	15,049.56	—
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	126	2,595.60	4,420.08	—
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	100	2,418.00	3,332.00	—
688411	海博思创	2025-01-20	6 个月	新股限售	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	—
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	新股限售	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	—
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	—

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个工作日内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	26,432,703.34	—	—	—	—	—	26,432,703.34
结算备付金	3,875,813.16	—	—	—	—	—	3,875,813.16
存出保证金	—	—	—	—	—	1,407,081.60	1,407,081.60
交易性金融资产	—	—	—	—	—	13,976,965,321.99	13,976,965,321.99
应收清算款	—	—	—	—	—	144,916.88	144,916.88
资产总计	30,308,516.50	—	—	—	—	13,978,517,320.47	14,008,825,836.97
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	16,306,493.90	16,306,493.90
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,892,959.21	1,892,959.21
应付托管费	—	—	—	—	—	630,986.40	630,986.40
其他负债	—	—	—	—	—	240,671.92	240,671.92
负债总计	—	—	—	—	—	19,071,111.43	19,071,111.43
利率敏感度缺口	30,308,516.50	—	—	—	—	13,959,446,209.04	13,989,754,725.54
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	79,937,915.96	—	—	—	—	—	79,937,915.96
交易性金融资产	—	—	—	—	—	16,427,319,984.	16,427,319,984.66

						66	
资产总计	79,937,915.96	—	—	—	—	16,427,319,984.66	16,507,257,900.62
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	28,665,591.97	28,665,591.97
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,030,508.11	2,030,508.11
应付托管费	—	—	—	—	—	676,836.04	676,836.04
其他负债	—	—	—	—	—	49,262.30	49,262.30
负债总计	—	—	—	—	—	31,422,198.42	31,422,198.42
利率敏感度缺口	79,937,915.96	—	—	—	—	16,395,897,786.24	16,475,835,702.20

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

本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、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、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具以及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相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。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，本基金的投资比例会做相应调整。

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	13,976,965,321.99	99.91	16,427,319,984.66	99.71
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	13,976,965,321.99	99.91	16,427,319,984.66	99.71

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%	139,862,721.68	96,492,621.15
	2. 业绩比较基准减少 1%	-139,862,721.68	-96,492,621.15

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	13,965,663,605.05	16,403,577,708.82
第二层次	15,385.54	23,591,650.50
第三层次	11,286,331.40	150,625.34
合计	13,976,965,321.99	16,427,319,984.66

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	13,976,965,321.99	99.77
	其中：股票	13,976,965,321.99	99.77
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	30,308,516.50	0.22
8	其他各项资产	1,551,998.48	0.01
9	合计	14,008,825,836.97	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	75,290,936.00	0.54
B	采矿业	707,390,120.09	5.06
C	制造业	8,117,987,663.57	58.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	429,642,806.00	3.07
E	建筑业	265,116,014.16	1.90
F	批发和零售业	99,070,104.71	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	486,358,119.63	3.48
H	住宿和餐饮业	11,939,862.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	930,873,112.87	6.65
J	金融业	2,258,391,657.25	16.14
K	房地产业	145,819,761.60	1.04

L	租赁和商务服务业	155,773,429.60	1.11
M	科学研究和技术服务业	156,464,200.61	1.12
N	水利、环境和公共设施管理业	30,443,302.52	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	9,115,434.00	0.07
Q	卫生和社会工作	52,981,907.44	0.38
R	文化、体育和娱乐业	43,886,973.00	0.31
S	综合	—	—
	合计	13,976,545,405.05	99.91

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	—	—
C	制造业	391,513.74	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	—	—
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	28,403.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	419,916.94	0.00

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	381,201	537,310,433.52	3.84
2	300750	宁德时代	1,604,626	404,718,769.72	2.89
3	601318	中国平安	6,541,539	362,924,583.72	2.59

4	600036	招商银行	7, 522, 274	345, 648, 490. 30	2. 47
5	601166	兴业银行	10, 077, 800	235, 215, 852. 00	1. 68
6	600900	长江电力	7, 431, 000	223, 970, 340. 00	1. 60
7	000333	美的集团	2, 959, 154	213, 650, 918. 80	1. 53
8	601899	紫金矿业	10, 026, 567	195, 518, 056. 50	1. 40
9	002594	比亚迪	552, 200	183, 280, 702. 00	1. 31
10	300059	东方财富	7, 679, 300	177, 622, 209. 00	1. 27
11	600030	中信证券	5, 949, 888	164, 335, 906. 56	1. 17
12	601398	工商银行	21, 279, 900	161, 514, 441. 00	1. 15
13	600276	恒瑞医药	2, 717, 820	141, 054, 858. 00	1. 01
14	000858	五 粮 液	1, 178, 400	140, 111, 760. 00	1. 00
15	601328	交通银行	16, 201, 164	129, 609, 312. 00	0. 93
16	000651	格力电器	2, 725, 500	122, 429, 460. 00	0. 88
17	601288	农业银行	19, 476, 300	114, 520, 644. 00	0. 82
18	600887	伊利股份	3, 856, 890	107, 530, 093. 20	0. 77
19	600919	江苏银行	8, 926, 078	106, 577, 371. 32	0. 76
20	688981	中芯国际	1, 207, 690	106, 482, 027. 30	0. 76
21	002475	立讯精密	3, 067, 100	106, 397, 699. 00	0. 76
22	603259	药明康德	1, 522, 800	105, 910, 740. 00	0. 76
23	601816	京沪高铁	17, 798, 400	102, 340, 800. 00	0. 73
24	600000	浦发银行	7, 119, 530	98, 819, 076. 40	0. 71
25	000725	京东方 A	22, 302, 800	88, 988, 172. 00	0. 64
26	002371	北方华创	197, 400	87, 292, 254. 00	0. 62
27	300760	迈瑞医疗	367, 700	82, 640, 575. 00	0. 59
28	601088	中国神华	2, 029, 100	82, 259, 714. 00	0. 59
29	300308	中际旭创	547, 900	79, 916, 694. 00	0. 57
30	688041	海光信息	561, 299	79, 305, 935. 71	0. 57
31	688256	寒武纪	128, 573	77, 336, 659. 50	0. 55
32	601601	中国太保	2, 056, 367	77, 134, 326. 17	0. 55
33	300502	新易盛	605, 520	76, 913, 150. 40	0. 55
34	300124	汇川技术	1, 145, 100	73, 939, 107. 00	0. 53
35	601728	中国电信	9, 443, 200	73, 184, 800. 00	0. 52
36	601668	中国建筑	12, 548, 497	72, 404, 827. 69	0. 52
37	002352	顺丰控股	1, 471, 600	71, 755, 216. 00	0. 51
38	000001	平安银行	5, 903, 300	71, 252, 831. 00	0. 51
39	002714	牧原股份	1, 641, 100	68, 942, 611. 00	0. 49
40	002230	科大讯飞	1, 405, 100	67, 276, 188. 00	0. 48
41	601127	赛力斯	499, 892	67, 145, 493. 44	0. 48
42	603501	豪威集团	522, 970	66, 757, 120. 50	0. 48
43	600031	三一重工	3, 604, 475	64, 700, 326. 25	0. 46
44	000063	中兴通讯	1, 969, 200	63, 979, 308. 00	0. 46

45	603019	中科曙光	884,400	62,261,760.00	0.45
46	002415	海康威视	2,241,300	62,151,249.00	0.44
47	600309	万华化学	1,143,332	62,037,194.32	0.44
48	600941	中国移动	550,200	61,925,010.00	0.44
49	300274	阳光电源	877,500	59,468,175.00	0.43
50	601857	中国石油	6,907,203	59,056,585.65	0.42
51	601919	中远海控	3,842,968	57,798,238.72	0.41
52	688008	澜起科技	693,768	56,888,976.00	0.41
53	600690	海尔智家	2,276,500	56,411,670.00	0.40
54	600660	福耀玻璃	977,900	55,750,079.00	0.40
55	601012	隆基绿能	3,690,804	55,435,876.08	0.40
56	600406	国电南瑞	2,453,336	54,979,259.76	0.39
57	601766	中国中车	7,419,970	52,236,588.80	0.37
58	603986	兆易创新	403,356	51,036,634.68	0.36
59	600050	中国联通	9,500,499	50,732,664.66	0.36
60	000338	潍柴动力	3,294,800	50,674,024.00	0.36
61	000568	泸州老窖	445,000	50,463,000.00	0.36
62	600028	中国石化	8,901,988	50,207,212.32	0.36
63	000100	TCL 科技	11,451,600	49,585,428.00	0.35
64	300476	胜宏科技	366,300	49,223,394.00	0.35
65	688012	中微公司	269,490	49,128,027.00	0.35
66	601988	中国银行	8,683,270	48,799,977.40	0.35
67	601006	大秦铁路	7,330,000	48,378,000.00	0.35
68	601985	中国核电	4,985,200	46,462,064.00	0.33
69	600104	上汽集团	2,831,000	45,437,550.00	0.32
70	601225	陕西煤业	2,358,800	45,383,312.00	0.32
71	002027	分众传媒	6,186,800	45,163,640.00	0.32
72	600150	中国船舶	1,355,900	44,120,986.00	0.32
73	600418	江淮汽车	1,075,200	43,104,768.00	0.31
74	601628	中国人寿	1,021,902	42,092,143.38	0.30
75	605499	东鹏饮料	128,109	40,232,631.45	0.29
76	688111	金山办公	142,655	39,950,532.75	0.29
77	603288	海天味业	1,023,495	39,824,190.45	0.28
78	600760	中航沈飞	667,608	39,135,180.96	0.28
79	688271	联影医疗	304,599	38,909,476.26	0.28
80	000425	徐工机械	4,985,000	38,733,450.00	0.28
81	600111	北方稀土	1,554,500	38,707,050.00	0.28
82	000792	盐湖股份	2,254,100	38,500,028.00	0.28
83	000625	长安汽车	2,993,800	38,200,888.00	0.27
84	600938	中国海油	1,460,000	38,120,600.00	0.27
85	600436	片仔癀	185,800	37,161,858.00	0.27

86	601888	中国中免	608,200	37,081,954.00	0.27
87	600905	三峡能源	8,682,800	36,988,728.00	0.26
88	601658	邮储银行	6,719,200	36,754,024.00	0.26
89	002625	光启技术	916,000	36,621,680.00	0.26
90	600089	特变电工	3,060,450	36,511,168.50	0.26
91	300033	同花顺	132,500	36,173,825.00	0.26
92	603993	洛阳钼业	4,277,800	36,019,076.00	0.26
93	002050	三花智控	1,358,000	35,824,040.00	0.26
94	600547	山东黄金	1,115,540	35,619,192.20	0.25
95	300015	爱尔眼科	2,836,600	35,400,768.00	0.25
96	600048	保利发展	4,343,296	35,180,697.60	0.25
97	600019	宝钢股份	5,308,300	34,981,697.00	0.25
98	601390	中国中铁	6,214,500	34,863,345.00	0.25
99	002241	歌尔股份	1,494,000	34,840,080.00	0.25
100	002463	沪电股份	817,970	34,829,162.60	0.25
101	300014	亿纬锂能	744,700	34,114,707.00	0.24
102	600415	小商品城	1,647,600	34,072,368.00	0.24
103	601600	中国铝业	4,800,700	33,796,928.00	0.24
104	000977	浪潮信息	645,800	32,858,304.00	0.23
105	601989	中国重工	6,942,400	32,212,736.00	0.23
106	600585	海螺水泥	1,465,300	31,459,991.00	0.22
107	600893	航发动力	809,600	31,201,984.00	0.22
108	002179	中航光电	771,500	31,137,740.00	0.22
109	600570	恒生电子	922,368	30,936,222.72	0.22
110	000538	云南白药	550,000	30,684,500.00	0.22
111	603799	华友钴业	817,390	30,259,777.80	0.22
112	000988	华工科技	626,211	29,438,179.11	0.21
113	002384	东山精密	778,400	29,400,168.00	0.21
114	000938	紫光股份	1,216,100	29,174,239.00	0.21
115	600584	长电科技	864,300	29,118,267.00	0.21
116	601727	上海电气	3,858,500	28,514,315.00	0.20
117	002028	思源电气	377,800	27,545,398.00	0.20
118	300408	三环集团	815,000	27,221,000.00	0.19
119	600438	通威股份	1,620,516	27,143,643.00	0.19
120	300433	蓝思科技	1,210,600	26,996,380.00	0.19
121	002049	紫光国微	407,800	26,857,708.00	0.19
122	000002	万 科A	4,138,000	26,565,960.00	0.19
123	600795	国电电力	5,405,400	26,162,136.00	0.19
124	600489	中金黄金	1,758,900	25,732,707.00	0.18
125	601669	中国电建	5,259,800	25,615,226.00	0.18
126	600988	赤峰黄金	1,020,600	25,392,528.00	0.18

127	601689	拓普集团	535,502	25,302,469.50	0.18
128	300339	润和软件	485,700	24,688,131.00	0.18
129	600010	宝钢股份	13,733,600	24,583,144.00	0.18
130	002422	科伦药业	677,700	24,342,984.00	0.17
131	002456	欧菲光	2,042,500	24,203,625.00	0.17
132	600009	上海机场	755,072	23,988,637.44	0.17
133	601100	恒立液压	324,700	23,378,400.00	0.17
134	600160	巨化股份	809,800	23,225,064.00	0.17
135	002460	赣锋锂业	684,400	23,112,188.00	0.17
136	000768	中航西飞	836,000	22,856,240.00	0.16
137	300394	天孚通信	281,600	22,482,944.00	0.16
138	601186	中国铁建	2,801,000	22,436,010.00	0.16
139	688036	传音控股	280,973	22,393,548.10	0.16
140	600183	生益科技	736,800	22,214,520.00	0.16
141	002252	上海莱士	3,221,800	22,133,766.00	0.16
142	000963	华东医药	539,860	21,788,749.60	0.16
143	600839	四川长虹	2,237,000	21,743,640.00	0.16
144	000157	中联重科	2,996,900	21,667,587.00	0.15
145	600886	国投电力	1,466,400	21,614,736.00	0.15
146	600989	宝丰能源	1,331,700	21,493,638.00	0.15
147	601360	三六零	2,106,400	21,485,280.00	0.15
148	002074	国轩高科	655,300	21,271,038.00	0.15
149	600115	中国东航	5,206,500	20,982,195.00	0.15
150	601058	赛轮轮胎	1,597,500	20,959,200.00	0.15
151	002466	天齐锂业	645,300	20,675,412.00	0.15
152	300442	润泽科技	414,000	20,505,420.00	0.15
153	000408	藏格矿业	478,300	20,409,061.00	0.15
154	002517	恺英网络	1,048,800	20,252,328.00	0.14
155	600066	宇通客车	806,800	20,057,048.00	0.14
156	000807	云铝股份	1,252,700	20,018,146.00	0.14
157	688169	石头科技	127,513	19,962,160.15	0.14
158	002001	新 和 成	933,800	19,861,926.00	0.14
159	002340	格林美	3,102,500	19,700,875.00	0.14
160	600426	华鲁恒升	900,000	19,503,000.00	0.14
161	000661	长春高新	195,300	19,369,854.00	0.14
162	000975	山金国际	1,021,628	19,349,634.32	0.14
163	600029	南方航空	3,279,400	19,348,460.00	0.14
164	002195	岩山科技	3,424,900	19,282,187.00	0.14
165	001979	招商蛇口	2,191,200	19,216,824.00	0.14
166	601800	中国交建	2,153,800	19,147,282.00	0.14
167	002558	巨人网络	811,900	19,120,245.00	0.14

168	600196	复星医药	761,547	19,107,214.23	0.14
169	002236	大华股份	1,202,200	19,090,936.00	0.14
170	600011	华能国际	2,662,700	19,011,678.00	0.14
171	600674	川投能源	1,184,000	18,991,360.00	0.14
172	300661	圣邦股份	260,767	18,976,014.59	0.14
173	688126	沪硅产业	1,013,197	18,967,047.84	0.14
174	301236	软通动力	346,500	18,932,760.00	0.14
175	002156	通富微电	736,400	18,866,568.00	0.13
176	600487	亨通光电	1,198,500	18,337,050.00	0.13
177	300418	昆仑万维	543,600	18,281,268.00	0.13
178	600346	恒力石化	1,271,800	18,135,868.00	0.13
179	688608	恒玄科技	51,762	18,012,140.76	0.13
180	600745	闻泰科技	537,100	18,008,963.00	0.13
181	300251	光线传媒	887,200	17,983,544.00	0.13
182	300207	欣旺达	894,400	17,941,664.00	0.13
183	601111	中国国航	2,273,700	17,939,493.00	0.13
184	002648	卫星化学	1,034,500	17,927,885.00	0.13
185	600372	中航机载	1,478,761	17,833,857.66	0.13
186	688213	思特威	173,269	17,711,557.18	0.13
187	002916	深南电路	164,247	17,707,469.07	0.13
188	601868	中国能建	7,911,900	17,643,537.00	0.13
189	600460	士兰微	706,100	17,525,402.00	0.13
190	688777	中控技术	389,591	17,496,531.81	0.13
191	002920	德赛西威	170,933	17,457,387.29	0.12
192	003816	中国广核	4,795,400	17,455,256.00	0.12
193	000066	中国长城	1,175,100	17,391,480.00	0.12
194	688120	华海清科	102,073	17,219,715.10	0.12
195	601168	西部矿业	1,027,800	17,092,314.00	0.12
196	600096	云天化	774,600	17,017,962.00	0.12
197	601117	中国化学	2,218,500	17,015,895.00	0.12
198	601319	中国人保	1,949,100	16,976,661.00	0.12
199	600741	华域汽车	960,800	16,958,120.00	0.12
200	002465	海格通信	1,205,900	16,810,246.00	0.12
201	600879	航天电子	1,603,000	16,783,410.00	0.12
202	000786	北新建材	631,700	16,727,416.00	0.12
203	600176	中国巨石	1,465,675	16,708,695.00	0.12
204	002273	水晶光电	836,600	16,706,902.00	0.12
205	300347	泰格医药	312,500	16,662,500.00	0.12
206	002601	龙佰集团	1,024,600	16,608,766.00	0.12
207	600256	广汇能源	2,758,400	16,605,568.00	0.12
208	688235	百济神州	70,872	16,558,534.08	0.12

209	300450	先导智能	663,900	16,497,915.00	0.12
210	600588	用友网络	1,230,960	16,457,935.20	0.12
211	601021	春秋航空	295,586	16,449,360.90	0.12
212	300896	爱美客	93,220	16,295,788.20	0.12
213	002555	三七互娱	941,900	16,285,451.00	0.12
214	601633	长城汽车	757,380	16,268,522.40	0.12
215	000831	中国稀土	449,600	16,239,552.00	0.12
216	600219	南山铝业	4,237,600	16,230,008.00	0.12
217	600352	浙江龙盛	1,580,400	16,056,864.00	0.11
218	300782	卓胜微	224,900	16,051,113.00	0.11
219	300017	网宿科技	1,496,700	16,044,624.00	0.11
220	002294	信立泰	337,700	15,983,341.00	0.11
221	000933	神火股份	959,600	15,967,744.00	0.11
222	302132	中航成飞	181,400	15,952,316.00	0.11
223	002185	华天科技	1,574,300	15,900,430.00	0.11
224	600885	宏发股份	707,900	15,793,249.00	0.11
225	600482	中国动力	682,400	15,742,968.00	0.11
226	600039	四川路桥	1,586,780	15,709,122.00	0.11
227	688002	睿创微纳	224,696	15,665,805.12	0.11
228	000630	铜陵有色	4,682,900	15,640,886.00	0.11
229	688617	惠泰医疗	52,117	15,478,749.00	0.11
230	688396	华润微	327,093	15,425,705.88	0.11
231	002493	荣盛石化	1,850,600	15,322,968.00	0.11
232	002129	TCL 中环	1,977,500	15,187,200.00	0.11
233	600362	江西铜业	647,800	15,177,954.00	0.11
234	002130	沃尔核材	630,400	15,016,128.00	0.11
235	300866	安克创新	131,000	14,881,600.00	0.11
236	600085	同仁堂	412,001	14,856,756.06	0.11
237	601877	正泰电器	650,500	14,746,835.00	0.11
238	001965	招商公路	1,228,900	14,746,800.00	0.11
239	688099	晶晨股份	207,512	14,735,427.12	0.11
240	300454	深信服	155,900	14,682,662.00	0.10
241	688506	百利天恒	49,402	14,628,920.24	0.10
242	002709	天赐材料	803,200	14,553,984.00	0.10
243	688122	西部超导	280,126	14,532,936.88	0.10
244	002281	光迅科技	292,500	14,426,100.00	0.10
245	002131	利欧股份	4,109,800	14,384,300.00	0.10
246	002085	万丰奥威	899,500	14,293,055.00	0.10
247	002595	豪迈科技	240,699	14,254,194.78	0.10
248	603129	春风动力	65,800	14,245,700.00	0.10
249	000423	东阿阿胶	272,000	14,225,600.00	0.10

250	300122	智飞生物	725,914	14,220,655.26	0.10
251	002180	纳思达	619,900	14,220,506.00	0.10
252	300474	景嘉微	193,200	14,103,600.00	0.10
253	300002	神州泰岳	1,191,800	14,063,240.00	0.10
254	002738	中矿资源	436,000	14,021,760.00	0.10
255	300223	北京君正	202,400	14,006,080.00	0.10
256	002532	天山铝业	1,682,100	13,978,251.00	0.10
257	300058	蓝色光标	2,130,060	13,973,193.60	0.10
258	603392	万泰生物	228,103	13,914,283.00	0.10
259	002138	顺络电子	492,800	13,857,536.00	0.10
260	002078	太阳纸业	1,029,300	13,854,378.00	0.10
261	600161	天坛生物	719,371	13,804,729.49	0.10
262	002436	兴森科技	1,036,500	13,723,260.00	0.10
263	600233	圆通速递	1,059,184	13,652,881.76	0.10
264	002472	双环传动	407,000	13,630,430.00	0.10
265	002410	广联达	1,012,100	13,572,261.00	0.10
266	603596	伯特利	255,803	13,478,260.07	0.10
267	300136	信维通信	600,700	13,455,680.00	0.10
268	002128	电投能源	679,000	13,430,620.00	0.10
269	600188	兖矿能源	1,102,980	13,423,266.60	0.10
270	002938	鹏鼎控股	419,000	13,420,570.00	0.10
271	300759	康龙化成	546,800	13,418,472.00	0.10
272	300832	新产业	236,265	13,400,950.80	0.10
273	000301	东方盛虹	1,606,200	13,379,646.00	0.10
274	600862	中航高科	512,700	13,371,216.00	0.10
275	688072	拓荆科技	86,217	13,252,415.07	0.09
276	688047	龙芯中科	98,901	13,192,404.39	0.09
277	300346	南大光电	415,680	13,152,115.20	0.09
278	600143	金发科技	1,272,900	13,123,599.00	0.09
279	002065	东华软件	1,361,000	13,065,600.00	0.09
280	300054	鼎龙股份	455,400	13,060,872.00	0.09
281	300024	机器人	760,100	13,058,518.00	0.09
282	002353	杰瑞股份	372,700	13,044,500.00	0.09
283	002223	鱼跃医疗	364,800	12,986,880.00	0.09
284	601618	中国中冶	4,357,600	12,985,648.00	0.09
285	000034	神州数码	344,845	12,979,965.80	0.09
286	601615	明阳智能	1,125,600	12,933,144.00	0.09
287	688578	艾力斯	138,596	12,894,971.84	0.09
288	300395	菲利华	251,700	12,861,870.00	0.09
289	603606	东方电缆	248,500	12,849,935.00	0.09
290	002202	金风科技	1,245,400	12,765,350.00	0.09

291	000999	华润三九	405,710	12,690,608.80	0.09
292	688223	晶科能源	2,442,119	12,674,597.61	0.09
293	300496	中科创达	220,935	12,641,900.70	0.09
294	002008	大族激光	516,200	12,579,794.00	0.09
295	600845	宝信软件	531,880	12,563,005.60	0.09
296	300383	光环新网	901,200	12,485,160.00	0.09
297	002271	东方雨虹	1,160,000	12,446,800.00	0.09
298	603659	璞泰来	658,200	12,360,996.00	0.09
299	601872	招商轮船	1,973,800	12,355,988.00	0.09
300	600549	厦门钨业	590,600	12,355,352.00	0.09
301	002624	完美世界	814,400	12,354,448.00	0.09
302	002405	四维图新	1,446,200	12,350,548.00	0.09
303	688266	泽璟制药	114,139	12,271,083.89	0.09
304	600515	海南机场	3,448,200	12,206,628.00	0.09
305	603605	珀莱雅	146,457	12,125,175.03	0.09
306	600895	张江高科	470,900	12,102,130.00	0.09
307	300012	华测检测	1,033,500	12,081,615.00	0.09
308	002459	晶澳科技	1,206,100	12,036,878.00	0.09
309	300604	长川科技	266,100	11,950,551.00	0.09
310	000426	兴业银锡	754,200	11,916,360.00	0.09
311	300459	汤姆猫	2,118,700	11,864,720.00	0.08
312	603087	甘李药业	216,488	11,859,212.64	0.08
313	002155	湖南黄金	662,390	11,823,661.50	0.08
314	000733	振华科技	233,300	11,676,665.00	0.08
315	300627	华测导航	331,300	11,595,500.00	0.08
316	300253	卫宁健康	1,090,500	11,559,300.00	0.08
317	688599	天合光能	794,068	11,537,808.04	0.08
318	605117	德业股份	217,136	11,434,381.76	0.08
319	000617	中油资本	1,550,700	11,320,110.00	0.08
320	601216	君正集团	2,050,600	11,319,312.00	0.08
321	605589	圣泉集团	406,300	11,274,825.00	0.08
322	688180	君实生物	330,459	11,228,996.82	0.08
323	000519	中兵红箭	511,600	11,198,924.00	0.08
324	600332	白云山	424,200	11,181,912.00	0.08
325	300699	光威复材	352,800	11,173,176.00	0.08
326	300037	新宙邦	316,720	11,148,544.00	0.08
327	600392	盛和资源	845,800	11,139,186.00	0.08
328	600153	建发股份	1,070,200	11,097,974.00	0.08
329	002444	巨星科技	432,500	11,033,075.00	0.08
330	300003	乐普医疗	799,500	11,017,110.00	0.08
331	601233	桐昆股份	1,038,402	11,007,061.20	0.08

332	601799	星宇股份	88,000	11,000,000.00	0.08
333	000932	华菱钢铁	2,493,100	10,969,640.00	0.08
334	600803	新奥股份	576,600	10,897,740.00	0.08
335	002821	凯莱英	123,040	10,858,280.00	0.08
336	300316	晶盛机电	397,600	10,794,840.00	0.08
337	000878	云南铜业	848,400	10,791,648.00	0.08
338	002414	高德红外	1,049,000	10,752,250.00	0.08
339	300142	沃森生物	976,500	10,741,500.00	0.08
340	300001	特锐德	447,700	10,731,369.00	0.08
341	002389	航天彩虹	418,900	10,723,840.00	0.08
342	300073	当升科技	243,900	10,699,893.00	0.08
343	600699	均胜电子	613,200	10,694,208.00	0.08
344	300628	亿联网络	305,700	10,626,132.00	0.08
345	002409	雅克科技	191,800	10,489,542.00	0.07
346	603979	金诚信	224,800	10,439,712.00	0.07
347	600521	华海药业	559,049	10,415,082.87	0.07
348	002007	华兰生物	663,990	10,404,723.30	0.07
349	002812	恩捷股份	352,600	10,327,654.00	0.07
350	600177	雅戈尔	1,405,044	10,256,821.20	0.07
351	600118	中国卫星	358,500	10,242,345.00	0.07
352	300568	星源材质	805,100	10,208,668.00	0.07
353	688188	柏楚电子	77,497	10,203,255.02	0.07
354	600398	海澜之家	1,465,400	10,199,184.00	0.07
355	300724	捷佳伟创	186,900	10,148,670.00	0.07
356	300757	罗博特科	67,600	10,137,972.00	0.07
357	002152	广电运通	753,500	10,127,040.00	0.07
358	603260	合盛硅业	212,781	10,085,819.40	0.07
359	000623	吉林敖东	593,400	10,058,130.00	0.07
360	601238	广汽集团	1,341,975	10,051,392.75	0.07
361	600704	物产中大	1,895,855	9,991,155.85	0.07
362	000738	航发控制	481,300	9,986,975.00	0.07
363	300315	掌趣科技	1,639,200	9,949,944.00	0.07
364	000009	中国宝安	1,117,200	9,920,736.00	0.07
365	600765	中航重机	587,641	9,919,380.08	0.07
366	300413	芒果超媒	453,900	9,904,098.00	0.07
367	600563	法拉电子	90,700	9,894,463.00	0.07
368	002044	美年健康	1,986,700	9,854,638.00	0.07
369	300558	贝达药业	169,600	9,828,320.00	0.07
370	600497	驰宏锌锗	1,854,800	9,811,892.00	0.07
371	600316	洪都航空	259,300	9,775,610.00	0.07
372	600141	兴发集团	469,541	9,639,676.73	0.07

373	600018	上港集团	1,684,011	9,615,702.81	0.07
374	002318	久立特材	410,800	9,608,612.00	0.07
375	600038	中直股份	246,800	9,578,308.00	0.07
376	601567	三星医疗	426,100	9,553,162.00	0.07
377	600486	扬农化工	163,900	9,506,200.00	0.07
378	002025	航天电器	184,100	9,464,581.00	0.07
379	000960	锡业股份	614,100	9,395,730.00	0.07
380	601677	明泰铝业	754,700	9,373,374.00	0.07
381	000400	许继电气	430,100	9,363,277.00	0.07
382	300919	中伟股份	282,940	9,303,067.20	0.07
383	300763	锦浪科技	161,000	9,239,790.00	0.07
384	601607	上海医药	513,400	9,179,592.00	0.07
385	300088	长信科技	1,536,700	9,158,732.00	0.07
386	002607	中公教育	2,978,900	9,115,434.00	0.07
387	600498	烽火通信	429,700	9,036,591.00	0.06
388	600637	东方明珠	1,209,555	9,035,375.85	0.06
389	603486	科沃斯	154,600	9,002,358.00	0.06
390	603939	益丰药房	367,700	8,997,619.00	0.06
391	002245	蔚蓝锂芯	698,200	8,957,906.00	0.06
392	600529	山东药玻	403,100	8,924,634.00	0.06
393	300182	捷成股份	1,618,100	8,915,731.00	0.06
394	300068	南都电源	553,900	8,818,088.00	0.06
395	002407	多氟多	721,900	8,799,961.00	0.06
396	002739	万达电影	769,100	8,790,813.00	0.06
397	000039	中集集团	1,117,600	8,784,336.00	0.06
398	002841	视源股份	251,500	8,701,900.00	0.06
399	601018	宁波港	2,367,400	8,664,684.00	0.06
400	600026	中远海能	837,100	8,647,243.00	0.06
401	301358	湖南裕能	274,200	8,552,298.00	0.06
402	000887	中鼎股份	483,700	8,508,283.00	0.06
403	603806	福斯特	651,700	8,446,032.00	0.06
404	300285	国瓷材料	486,600	8,442,510.00	0.06
405	300676	华大基因	168,593	8,390,873.61	0.06
406	688303	大全能源	385,021	8,208,647.72	0.06
407	300144	宋城演艺	958,700	8,196,885.00	0.06
408	600820	隧道股份	1,332,200	8,126,420.00	0.06
409	600008	首创环保	2,678,400	8,088,768.00	0.06
410	688009	中国通号	1,559,094	8,013,743.16	0.06
411	300296	利亚德	1,310,500	7,994,050.00	0.06
412	300567	精测电子	131,600	7,976,276.00	0.06
413	002064	华峰化学	1,205,600	7,969,016.00	0.06

414	002497	雅化集团	698,600	7,964,040.00	0.06
415	600998	九州通	1,548,199	7,957,742.86	0.06
416	002312	川发龙蟒	686,900	7,885,612.00	0.06
417	600516	方大炭素	1,698,586	7,881,439.04	0.06
418	600166	福田汽车	2,901,700	7,863,607.00	0.06
419	603568	伟明环保	409,099	7,805,608.92	0.06
420	600170	上海建工	3,239,673	7,742,818.47	0.06
421	600763	通策医疗	187,173	7,726,501.44	0.06
422	600312	平高电气	498,100	7,665,759.00	0.05
423	601155	新城控股	558,200	7,636,176.00	0.05
424	603816	顾家家居	298,100	7,607,512.00	0.05
425	002176	江特电机	1,047,700	7,606,302.00	0.05
426	600208	衢州发展	2,566,100	7,595,656.00	0.05
427	000683	博源化工	1,584,600	7,590,234.00	0.05
428	605358	立昂微	325,096	7,574,736.80	0.05
429	601179	中国西电	1,230,800	7,557,112.00	0.05
430	688005	容百科技	336,109	7,501,952.88	0.05
431	000708	中信特钢	628,800	7,394,688.00	0.05
432	002244	滨江集团	755,200	7,363,200.00	0.05
433	603885	吉祥航空	541,600	7,295,352.00	0.05
434	601000	唐山港	1,793,300	7,280,798.00	0.05
435	002603	以岭药业	514,700	7,257,270.00	0.05
436	002432	九安医疗	198,801	7,242,320.43	0.05
437	000629	钒钛股份	2,826,402	7,235,589.12	0.05
438	600323	瀚蓝环境	295,600	7,197,860.00	0.05
439	000818	航锦科技	319,500	7,188,750.00	0.05
440	000830	鲁西化工	694,600	7,154,380.00	0.05
441	600535	天士力	452,380	7,079,747.00	0.05
442	002439	启明星辰	439,000	7,019,610.00	0.05
443	603613	国联股份	294,600	6,979,074.00	0.05
444	603833	欧派家居	122,800	6,932,060.00	0.05
445	600499	科达制造	697,400	6,834,520.00	0.05
446	601880	辽港股份	4,544,700	6,817,050.00	0.05
447	603000	人民网	334,800	6,766,308.00	0.05
448	300390	天华新能	352,500	6,722,175.00	0.05
449	002145	中核钛白	1,618,600	6,717,190.00	0.05
450	000563	陕国投A	1,864,500	6,656,265.00	0.05
451	600859	王府井	479,200	6,656,088.00	0.05
452	600511	国药股份	226,700	6,610,572.00	0.05
453	600655	豫园股份	1,183,152	6,566,493.60	0.05
454	603077	和邦生物	3,746,200	6,555,850.00	0.05

455	300751	迈为股份	93,880	6,530,292.80	0.05
456	600004	白云机场	717,500	6,529,250.00	0.05
457	000547	航天发展	776,300	6,520,920.00	0.05
458	601966	玲珑轮胎	442,800	6,495,876.00	0.05
459	600325	华发股份	1,331,200	6,482,944.00	0.05
460	600131	国网信通	364,300	6,448,110.00	0.05
461	603899	晨光股份	221,200	6,412,588.00	0.05
462	000998	隆平高科	644,500	6,348,325.00	0.05
463	300529	健帆生物	289,500	6,244,515.00	0.04
464	600754	锦江酒店	275,800	6,188,952.00	0.04
465	002756	永兴材料	193,500	6,143,625.00	0.04
466	300601	康泰生物	401,700	6,101,823.00	0.04
467	300573	兴齐眼药	115,364	5,974,701.56	0.04
468	300070	碧水源	1,319,300	5,936,850.00	0.04
469	601866	中远海发	2,388,700	5,900,089.00	0.04
470	002120	韵达股份	876,400	5,871,880.00	0.04
471	600667	太极实业	891,900	5,868,702.00	0.04
472	600867	通化东宝	712,500	5,842,500.00	0.04
473	300438	鹏辉能源	211,300	5,833,993.00	0.04
474	002544	普天科技	245,800	5,764,010.00	0.04
475	600258	首旅酒店	407,000	5,750,910.00	0.04
476	000032	深桑达A	274,700	5,557,181.00	0.04
477	000069	华侨城A	2,454,800	5,523,300.00	0.04
478	002508	老板电器	285,300	5,423,553.00	0.04
479	300457	赢合科技	246,600	5,406,600.00	0.04
480	300118	东方日升	563,400	5,397,372.00	0.04
481	000967	盈峰环境	768,900	5,343,855.00	0.04
482	002292	奥飞娱乐	546,700	5,313,924.00	0.04
483	002831	裕同科技	223,516	5,234,744.72	0.04
484	688063	派能科技	115,474	5,205,567.92	0.04
485	603650	彤程新材	161,000	5,176,150.00	0.04
486	600129	太极集团	234,400	4,995,064.00	0.04
487	300769	德方纳米	150,560	4,971,491.20	0.04
488	688390	固德威	114,080	4,956,776.00	0.04
489	601636	旗滨集团	983,600	4,927,836.00	0.04
490	002572	索菲亚	350,200	4,906,302.00	0.04
491	002266	浙富控股	1,584,720	4,880,937.60	0.03
492	000035	中国天楹	1,077,400	4,622,046.00	0.03
493	600864	哈投股份	757,600	4,522,872.00	0.03
494	002091	江苏国泰	606,800	4,411,436.00	0.03
495	600315	上海家化	201,300	4,241,391.00	0.03

496	002372	伟星新材	386,600	4,005,176.00	0.03
497	001914	招商积余	255,600	3,161,772.00	0.02
498	600007	中国国贸	135,300	2,784,474.00	0.02
499	600335	国机汽车	356,400	2,298,780.00	0.02
500	301381	赛维时代	81,800	1,631,910.00	0.01
501	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
502	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
503	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
504	301458	钧崑电子	701	23,911.11	0.00
505	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
506	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
507	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
508	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
509	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
510	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
511	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
512	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
513	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
514	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
515	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
516	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
517	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
518	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
519	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
520	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
521	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
522	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
523	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
524	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
525	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
526	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
527	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
528	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
529	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
530	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
531	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
532	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
533	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
534	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
535	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
536	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	300750	宁德时代	387,131,920.67	2.35
2	000333	美的集团	188,322,207.95	1.14
3	000858	五粮液	149,713,254.29	0.91
4	300059	东方财富	136,194,485.83	0.83
5	002594	比亚迪	119,942,404.47	0.73
6	002475	立讯精密	95,190,164.94	0.58
7	000651	格力电器	94,129,885.00	0.57
8	300760	迈瑞医疗	93,004,556.72	0.56
9	600519	贵州茅台	88,890,980.36	0.54
10	000725	京东方A	72,598,256.00	0.44
11	300124	汇川技术	70,425,838.41	0.43
12	002230	科大讯飞	68,739,108.00	0.42
13	002714	牧原股份	55,500,771.22	0.34
14	000063	中兴通讯	53,366,100.30	0.32
15	000001	平安银行	51,737,289.20	0.31
16	002415	海康威视	51,172,155.83	0.31
17	300274	阳光电源	48,576,317.30	0.29
18	002352	顺丰控股	43,506,355.24	0.26
19	300661	圣邦股份	43,423,432.00	0.26
20	000568	泸州老窖	42,353,572.69	0.26

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	464,425,622.36	2.82
2	000333	美的集团	232,251,231.22	1.41
3	000858	五粮液	179,485,037.20	1.09
4	002594	比亚迪	169,194,829.44	1.03
5	300059	东方财富	166,990,510.54	1.01
6	000651	格力电器	117,729,956.20	0.71
7	002475	立讯精密	112,553,765.60	0.68
8	300760	迈瑞医疗	110,815,503.70	0.67
9	300124	汇川技术	100,724,750.32	0.61

10	000725	京东方 A	89,101,827.00	0.54
11	002714	牧原股份	71,218,683.25	0.43
12	002230	科大讯飞	66,820,577.32	0.41
13	000001	平安银行	65,645,484.00	0.40
14	002415	海康威视	64,748,166.24	0.39
15	000063	中兴通讯	62,272,343.93	0.38
16	002352	顺丰控股	58,329,352.51	0.35
17	300274	阳光电源	57,640,336.58	0.35
18	000568	泸州老窖	54,094,821.07	0.33
19	600519	贵州茅台	51,461,741.69	0.31
20	002371	北方华创	50,605,038.00	0.31

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	5,925,296,124.48
卖出股票收入（成交）总额	6,682,962,414.20

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

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，兴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福建监管局的处罚。

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	1,407,081.60
2	应收清算款	144,916.88
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	1,551,998.48

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688411	海博思创	46,754.40	0.00	新股限售
2	603049	中策橡胶	31,023.40	0.00	新股限售
3	688545	兴福电子	26,788.30	0.00	新股限售

4	301458	钧崑电子	23,911.11	0.00	新股限售
5	688583	思看科技	18,087.36	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		富国中证 A500 交易型 开放式指数证券投资 基金发起式联接基金	
		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 (%)
14,253	974,883.44	13,089,114 ,975.00	94.20	805,898,71 2.00	5.80	3,027,387, 209.00	21.79

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”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	中国人寿保险股份有限公司	1,755,771,775.00	12.64
2	国泰海通证券股份有限公司	995,045,316.00	7.16
3	新华人寿保险股份有限公司	791,696,476.00	5.70
4	北京诚通金控投资有限公司	555,279,087.00	4.00
5	中国人寿保险股份有限公司	486,889,788.00	3.50
6	中国平安人寿保险股份有限公司— 自有资金	438,895,540.00	3.16
7	中国平安人寿保险股份有限公司— 分红一个险分红	412,126,108.00	2.97
8	国华人寿保险股份有限公司—传统 十三号	203,962,100.00	1.47
9	国华人寿保险股份有限公司—传统 三号	187,728,400.00	1.35
10	华泰证券股份有限公司	184,939,266.00	1.33
11	富国中证 A500 交易型开放式指数证 券投资基金发起式联接基金	3,027,387,209.00	21.79

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(2024 年 09 月 25 日)基金份额总额	2,000,013,687.00
报告期期初基金份额总额	16,628,013,687.00
本报告期基金总申购份额	10,431,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	13,164,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	13,895,013,687.00

§ 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。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、公募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 （%）	
中泰证券	7	12,606,356,264.45	100.00	1,713,193.90	100.00	—

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）
中泰证券	781,126.05	100.00	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2025年01月09日
2	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
3	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	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03月07日
5	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
6	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2025年03月27日
7	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2025-06-13 至 2025-06-15; 2025-06-19 至 2025-06-30	3,255,006.14 6.00	4,056,000.00	4,283,618.93 7.00	3,027,387.20 09.00	21.79%
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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。

§ 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国中证 A500 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 : http://www.fullgoal.com.cn 。
2、富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同		
3、富国中证 A500 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、富国中证 A500 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		