

富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金
二〇二三年年度报告

2023年12月31日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024年03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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 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。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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.....	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	20
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§7 年度财务报告	23
7.1 资产负债表.....	23

7.2 利润表.....	24
7.3 净资产变动表.....	26
7.4 报表附注.....	27
§8 投资组合报告.....	60
8.1 期末基金资产组合情况.....	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	61
8.3 期末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.....	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	72
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	73
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	73
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	73
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	73
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	73
8.12 市场中性策略执行情况.....	74
8.13 投资组合报告附注.....	74
§9 基金份额持有人信息.....	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	75
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	76
§10 开放式基金份额变动.....	76
§11 重大事件揭示.....	76
11.1 基金份额持有人大会决议.....	76
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	77
11.4 基金投资策略的改变.....	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	77
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	77
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	77
11.8 其他重大事件.....	81
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	81
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	81

12.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§13 备查文件目录	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金	
基金简称	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式	
基金主代码	001641	
基金运作方式	契约型，本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。	
基金合同生效日	2015年09月17日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	82,400,349.52份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式A	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式C
下属分级基金的交易代码	001641	009149
报告期末下属分级基金的份额总额	61,836,276.02份	20,564,073.50份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的基础上，利用股指期货等金融工具对冲市场波动风险，力争为投资人实现较高的投资收益。
投资策略	本基金根据对市场的判断，采用“多空对冲”等投资策略，在控制基金资产的股票系统性风险暴露的前提下，实现基金资产的保值增值。在股票投资方面，本基金采取自下而上的方法，精选具备基本面健康、核心竞争力强、成长潜力大的投资标的，主动承担“自下而上”的股票选择风险，构建本基金的现货组合；在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。本基金的存托凭证投资策略、对冲策略、套利策略及其他投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中国人民银行公布的一年期银行定期存款基准利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，利用股指期货等金融工具对冲市场波动风险，相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	王小飞
	联系电话	021-20361818	021-60637103
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95105686、4008880688	021-60637228
传真		021-20361616	021-60635778
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		裴长江	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	939,245.14	-5,542,796.03	210,365,306.77
本期利润	-370,287.52	-14,321,304.08	-39,321,830.29
加权平均基金份额本期利润	-0.0052	-0.1005	-0.0229
本期加权平均净值利润率	-0.42%	-7.85%	-1.71%
本期基金份额净值增长率	-0.32%	-5.44%	-1.27%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	8,212,301.93	8,888,916.54	55,584,795.32
期末可供分配基金份额利润	0.1328	0.1202	0.1969
期末基金资产净值	77,090,301.76	92,490,652.41	373,456,974.51
期末基金份额净值	1.247	1.251	1.323
3.1.3 累计期末指标	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	24.70%	25.10%	32.30%

(2) 富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	52,728.02	-1,835,954.59	3,132,790.75
本期利润	-348,494.71	-1,132,224.50	-791,496.69
加权平均基金份额本期利润	-0.0138	-0.0741	-0.0341
本期加权平均净值利润率	-1.13%	-5.97%	-2.57%
本期基金份额净值增长率	-1.14%	-6.21%	-2.03%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	1,951,257.82	2,394,294.57	1,556,684.87
期末可供分配基金份额利润	0.0949	0.0924	0.1776
期末基金资产净值	24,878,500.50	31,695,413.81	11,432,729.50
期末基金份额净值	1.210	1.224	1.305
3.1.3 累计期末指标	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日

基金份额累计净值增长率	-1.31%	-0.16%	6.44%
-------------	--------	--------	-------

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.48%	0.18%	1.13%	0.02%	-0.65%	0.16%
过去六个月	-0.64%	0.16%	2.27%	0.01%	-2.91%	0.15%
过去一年	-0.32%	0.20%	4.50%	0.01%	-4.82%	0.19%
过去三年	-6.94%	0.31%	13.50%	0.01%	-20.44%	0.30%
过去五年	15.36%	0.35%	22.50%	0.01%	-7.14%	0.34%
自基金合同生效起至今	24.70%	0.29%	37.33%	0.01%	-12.63%	0.28%

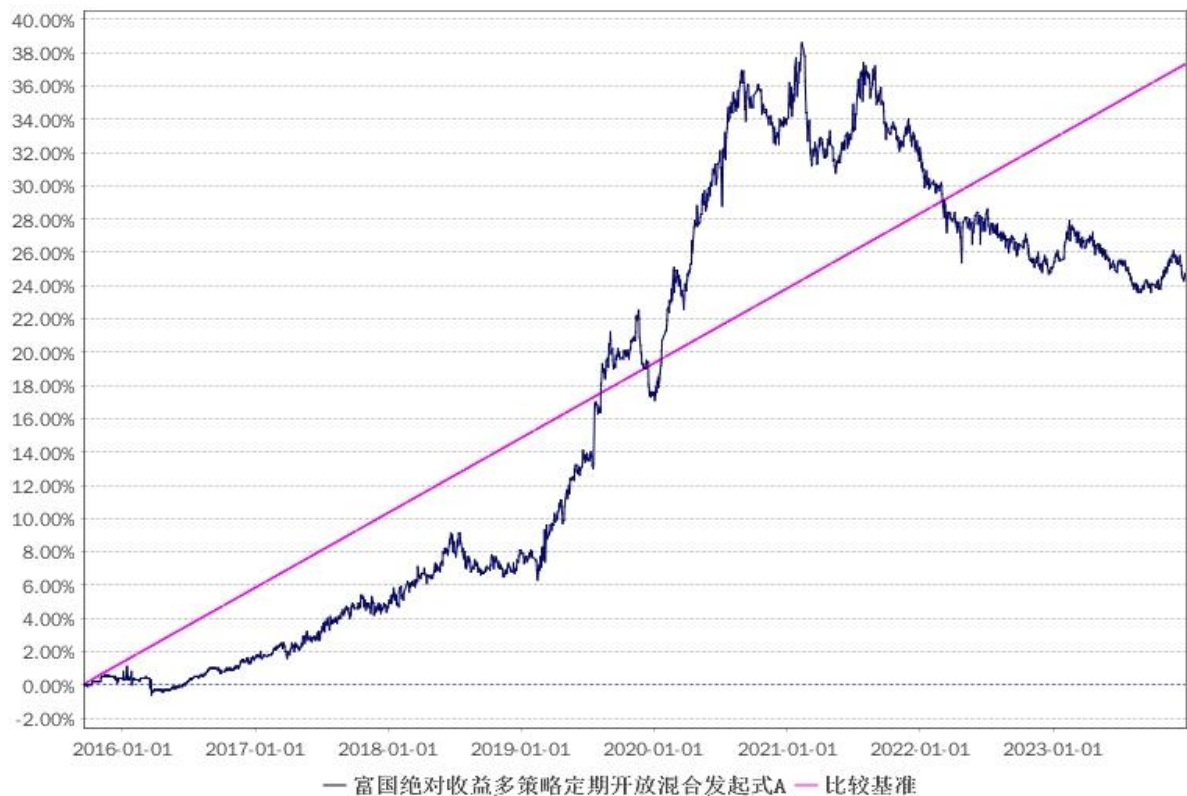
(2) 富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.25%	0.19%	1.13%	0.02%	-0.88%	0.17%
过去六个月	-1.06%	0.17%	2.27%	0.01%	-3.33%	0.16%
过去一年	-1.14%	0.20%	4.50%	0.01%	-5.64%	0.19%
过去三年	-9.16%	0.31%	13.50%	0.01%	-22.66%	0.30%
自基金分级生效日起至今	-1.31%	0.33%	16.98%	0.01%	-18.29%	0.32%

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

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

(1) 自基金合同生效以来富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2023 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2015 年 9 月 17 日成立，建仓期 6 个月，从 2015 年 9 月 17 日起至 2016 年 3 月 16 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2) 自基金合同生效以来富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

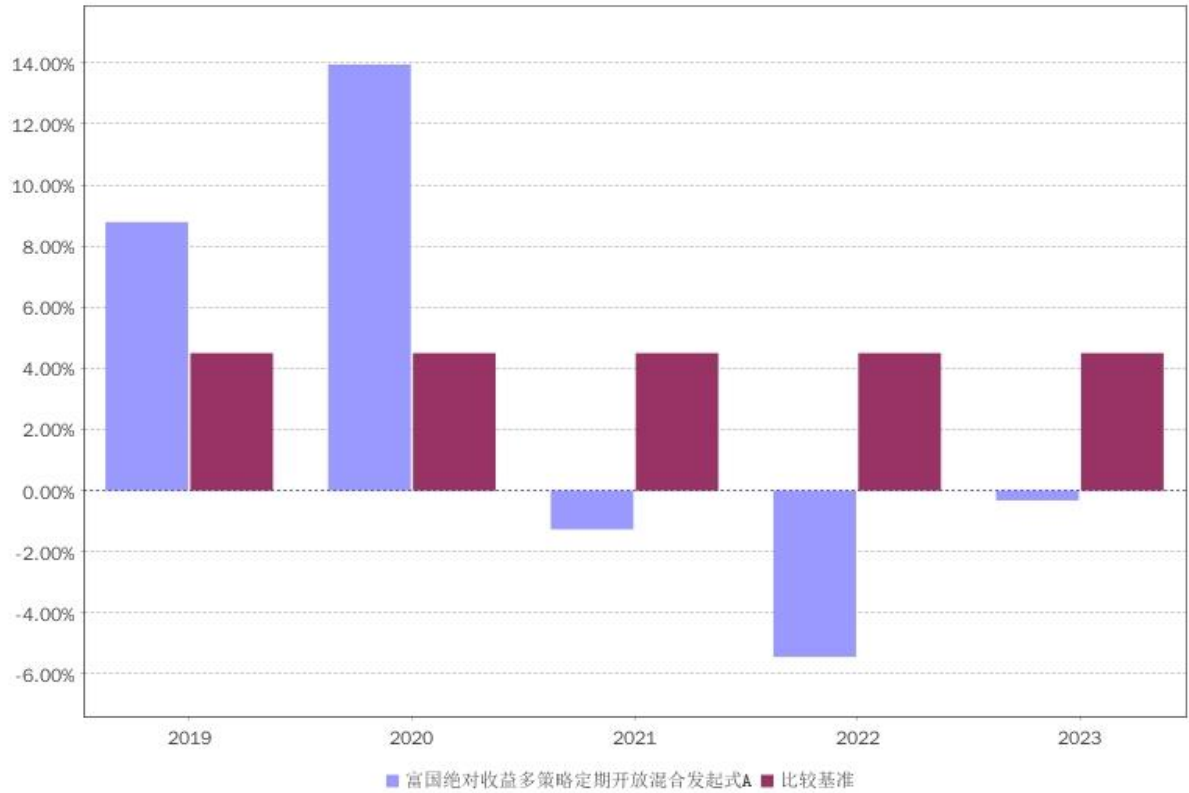


注：1、截止日期为 2023 年 12 月 31 日。

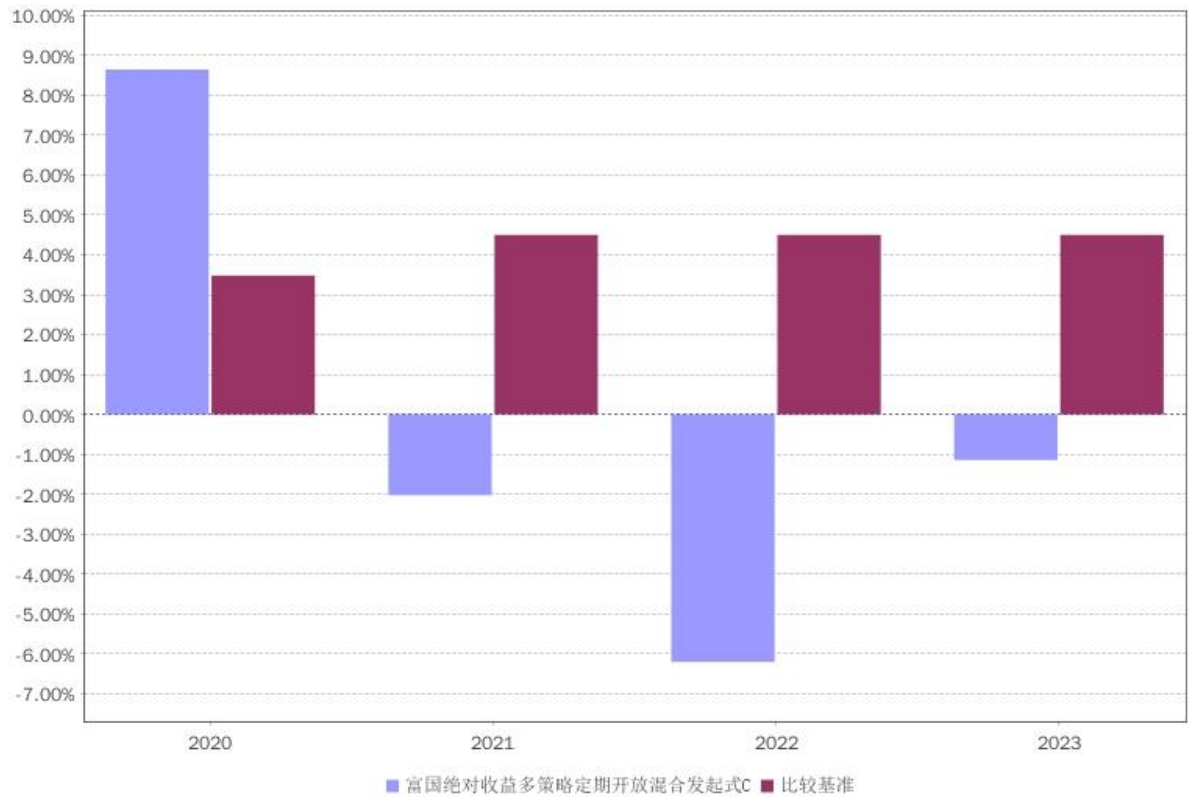
2、本基金自 2020 年 3 月 23 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 过去五年以来富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



(2) 过去五年以来富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：C 类份额自 2020 年 3 月 24 日起有基金份额。2020 年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

(1) 富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A

注：过往三年本基金未进行利润分配。

(2) 富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C

注：过往三年本基金未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 330 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		
于鹏	本基金现任基金经理	2015-11-26	—	16	博士，曾任 HSBC BANK PLC（汇丰银行）固定收益证券策略分析师，中国国际金融（香港）有限公司高级固定收益证券策略分析师，Millennium Capital Partners LLP（英国千禧资本）固定收益策略分析师；自 2013 年 4 月加入富国基金管理有限公司，历任固定收益投资经理、权益基金经理；现任富国基金权益投资部权益投资总监助理兼高级权益基金经理。自 2015 年 11 月起任富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2017 年 11 月起任富国研究量化精选混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 07 月起任富国中证 500 基本面精选股票型发起式证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式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》、《富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分

析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现 4 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

A 股市场风险偏好在报告期延续了前一年收缩状态，沪深 300，中证 500 等指数均有不同程度调整。风格特征角度价值持续跑赢成长，大盘风格领先小盘风格。

在报告期内，本基金一定程度多头暴露对净值有所影响。股指期货在大部分时间呈现升水结构，特别是沪深 300 和上证 50 合约，这意味着基差环境或已经开始有利于市场中性产品运作。

和传统权益产品不同，本基金主要根据不同的对冲标的构建现货组合，力争获取相应的超额收益。通过股指期货工具，本基金将相应相对收益转化为绝对收益。

在报告期内本基金主要选择沪深 300 合约和中证 500 合约进行对冲。根据对冲标的，我们构建不同的现货组合。我们认为个股选择和组合管理是获得相对收益的关键，前者的核心在于对标的基本面的判断，而后的关键是控制组合和跟踪标的之间的差异。

在选股维度我们注重行业内优质个股筛选，更加关注标的的基本面信息。从长

期来看，基本面扎实的成长个股会为组合贡献利润和业绩驱动的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值 A 级为 1.247 元，C 级为 1.21 元；份额累计净值 A 级为 1.247 元，C 级为 1.21 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为-0.32%，C 级为-1.14%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 4.50%，C 级为 4.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经历了连续两年的风险偏好收缩阶段后，我们认为在新的报告期内将出现拐点。

宏观维度上，美联储预计将进入降息周期，这在一定程度上支持风险资产例如新兴市场走势。国内市场无论财政政策还是货币政策都可能对权益市场形成支撑。政府财政预算的适度扩张以及实际利率的进一步下降，都有利于 A 股市场 ROE 修复以及风险偏好提升。

权益市场微观结构上我们认为市场风格特征将更加均衡。在价值风格连续跑赢成长风格三个年度后，我们认为后者无论在胜率和赔率上都位于历史上比较优异的位置。

伴随着市场风格偏好提升，我们期待一定程度多头暴露会在新的报告期有所贡献。股指期货基差环境也会进一步修复，有利于市场中性产品运作。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

本基金管理人始终坚持持有人利益优先原则，报告期内持续完善内控管理机制，全方位推动监察稽核工作深入开展。在基础性工作的基础上，2023 年度基金管理人重点开展的监察稽核工作包括以下方面：

（一）持续推进制度流程建设，保障业务合规开展

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

（二）深入进行新规学习，扎实推动新规落地

2023 年度，公司从新规解读、制度建立、系统建设、流程改造等方面持续推进各项重要法律法规、监管要求的落地工作，并对落地情况开展专项检查，确保各项业务合法合规开展。

（三）培育合规文化，全面提升员工合规意识

为持续提高全员合规意识，公司对新员工、特定业务条线员工、全体员工开展不同侧重点的合规培训与宣导，结合多维度、多层次的合规谈话及合规考试，多管齐下全面提升员工的合规意识。

（四）立足于合规，不断拓展风险管理职能

报告期内，公司持续推进旗下组合的投资合规风控阈值多维度排查梳理和日常投资合规监督工作的规范化管理，进一步根据系统升级迭代情况整合优化历史风控工具。公司持续强化合规风控培训工作，提升各部门主动合规的能力和意识。公司不断加强对新业务、新品种及整体风险控制能力的研究，保持对各类风险的敏感度，加强日常监测和定期风险评估，持续提升对于各类投资标的的风险管理水平。

（五）持续推进合规风控工作的系统化建设

2023 年公司结合自主研发和专业系统外采等多种途径，持续推动合规风控信息化建设。公司通过搭建、完善覆盖事前、事中、事后的风控系统工具体系，助力有效监测、识别投资组合运作过程中的各类风险，加强投资过程中各类风险的管理能力。在合规管理方面，新增或优化系统管理功能模块包括合规考试、合规谈话、采购及合同一体化管理流程等。通过系统建设，提升合规管理工作质效。

（六）全面加强员工行为管理

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

（七）扎实推进反洗钱工作

公司高度重视反洗钱工作，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求。除在客户尽职调查、大额和可疑交易报告、客户资料和交易记录保存等反洗钱核心义务方面积极履职外，还通过重点专项工作等方式有序推动反洗钱工作深入开展。报告期

内，主要重点工作包括开展机构洗钱风险评估、持续推动系统建设和数据治理工作、强化客户身份识别前端管控、多层次立体化文化宣贯等。

（八）深入开展内部审计，发挥第三道防线功能

公司围绕各条线各部门制度框架体系建立情况、法规落实情况及当年工作重点开展审计工作。通过基础风险点例行检查与法规落实情况、监管重点排查相结合的方式，深入开展内部审计检查并督导整改完善。报告期内，公司开展多项专项审计，涵盖投研、交易、销售、信息技术、反洗钱等各业务领域。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70015656_B65 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的

	<p>规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报</p>

	<p>获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间</p>
--	--

	安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王珊珊	费泽旭
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
审计报告日期	2024 年 03 月 28 日	

§ 7 年度财务报告

7.1 资产负债表

会计主体：富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7,875,351.49	14,748,756.83
结算备付金	6,110,214.48	12,100,509.99
存出保证金	8,399,861.48	10,074,636.27
交易性金融资产	80,126,617.58	87,682,970.36
其中：股票投资	80,118,617.05	87,616,026.54
基金投资	—	—
债券投资	8,000.53	66,943.82
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	—	73,280.58
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	102,512,045.03	124,680,154.03
负债和净资产	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：		

短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	—	—
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	92,607.86	122,065.53
应付托管费	18,521.57	30,516.42
应付销售服务费	19,786.01	27,794.94
应付投资顾问费	—	—
应交税费	35,519.43	0.35
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	376,807.90	313,710.57
负债合计	543,242.77	494,087.81
净资产：		
实收基金	82,400,349.52	99,828,359.91
其他综合收益	—	—
未分配利润	19,568,452.74	24,357,706.31
净资产合计	101,968,802.26	124,186,066.22
负债和净资产总计	102,512,045.03	124,680,154.03

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.237 元，基金份额总额 82,400,349.52 份。其中：富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A 份额净值 1.247 元，份额总额 61,836,276.02 份；富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C 份额净值 1.210 元，份额总额 20,564,073.50 份。基金资产净值（暂估附加管理费前）101,968,802.26 元，暂估附加管理费金额 0.00 元，基金资产净值（暂估附加管理费后）101,968,802.26 元。

实际计提时的附加管理费金额可能会与此处暂估附加管理费金额有差异。其中，基金资产净值（暂估附加管理费后）=基金资产净值（暂估附加管理费前）-暂估附加管理费金额；暂估附加管理费为假设本基金于本报告期末按照当日的基金份额净值(计提附加管理费前)清算，根据基金份额持有人持有的基金份额(包括未到期份额)至该日止持有期间的收益情况估算的附加管理费。该金额是各基金份额持有人的暂估附加管理费的合计，各基金份额持有人实际应承担的附加管理费金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认。

7.2 利润表

会计主体：富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2023年01月01日至2023年12月31日)	上年度可比期间 (2022年01月01日至2022年12月31日)
一、营业总收入	1,215,636.96	-12,362,029.20
1.利息收入	204,057.77	337,238.95
其中：存款利息收入	188,036.41	337,238.95
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	16,021.36	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	2,722,116.96	-4,821,093.27
其中：股票投资收益	-5,771,293.01	-53,279,675.57
基金投资收益	—	—
债券投资收益	46,927.07	213,983.62
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	6,841,909.43	46,257,126.01
股利收益	1,604,573.47	1,987,472.67
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	—	—
其他投资收益	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,710,755.39	-8,074,777.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	217.62	196,603.08
减：二、营业总支出	1,934,419.19	3,091,499.38
1. 管理人报酬	1,199,468.78	2,047,458.42
2. 托管费	272,501.94	511,864.62
3. 销售服务费	246,694.07	152,009.98
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	24,819.40	179,116.36
8. 其他费用	190,935.00	201,050.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-718,782.23	-15,453,528.58
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-718,782.23	-15,453,528.58
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	-718,782.23	-15,453,528.58

7.3 净资产变动表

会计主体：富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2023年01月01日至2023年12月31日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、上期期末净资产	99,828,359.91	24,357,706.31	124,186,066.22
二、本期期初净资产	99,828,359.91	24,357,706.31	124,186,066.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	17,428,010.39	4,789,253.57	22,217,263.96
（一）、综合收益总额	—	-718,782.23	-718,782.23
（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）	17,428,010.39	4,070,471.34	21,498,481.73
其中：1. 基金申购款	4,324,712.68	1,148,151.94	5,472,864.62
2. 基金赎回款	21,752,723.07	5,218,623.28	26,971,346.35
（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、本期期末净资产	82,400,349.52	19,568,452.74	101,968,802.26
项目	上年度可比期间 (2022年01月01日至2022年12月31日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	291,073,243.07	93,816,460.94	384,889,704.01
二、本期期初净资产	291,073,243.07	93,816,460.94	384,889,704.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	191,244,883.16	69,458,754.63	260,703,637.79
（一）、综合收益总额	—	—	—

		15,453,528.58	15,453,528.58
(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)	191,244,883.16	54,005,226.05	245,250,109.21
其中: 1.基金申购款	31,049,614.16	7,427,878.37	38,477,492.53
2.基金赎回款	222,294,497.32	61,433,104.42	283,727,601.74
(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、本期期末净资产	99,828,359.91	24,357,706.31	124,186,066.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金(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[2015]425号文《关于准予富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2015年9月17日生效,首次设立募集规模为465,664,314.43份基金份额。根据基金管理人于2020年3月19日发布的《关于富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》,自2020年3月23日起,本基金增加C类份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、股指期货、权证、债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券

（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票及存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类空头工具价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票及存托凭证市值、买入股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类多头工具价值的合计值。

开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、存托凭证、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。

开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的一年期银行定期存款基准利率（税后）+3%（如遇中国人民银行就该等基准利率进行调整则作相应调整）。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券

投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和中期报告》》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的

权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

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

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

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足

证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相

关服务的期间计入当期损益。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式仅现金分红一种；

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

3、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；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事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4 企业所得税

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

5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储

蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2023 年 12 月 31 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
活期存款	7,875,351.49	14,748,756.83
等于：本金	7,874,282.32	14,746,691.75
加：应计利息	1,069.17	2,065.08
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	7,875,351.49	14,748,756.83

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2023年12月31日）				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	81,813,771.17	—	80,118,617.05	— 1,695,154.12	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	8,000.00	0.53	8,000.53	—
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	8,000.00	0.53	8,000.53	—
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	81,821,771.17	0.53	80,126,617.58	— 1,695,154.12	
项目	上年度末（2022年12月31日）				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	88,500,052.55	—	87,616,026.54	-884,026.01	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	54,000.00	13.02	66,943.82	12,930.80
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	54,000.00	13.02	66,943.82	12,930.80
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	88,554,052.55	13.02	87,682,970.36	-871,095.21	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

金额单位：人民币元

项目	本期末（2023年12月31日）			
	名义金额	公允价值		备注(成本)
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	-70,011,696.57	—	—	—
股指期货	-70,011,696.57	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	-70,011,696.57	—	—	—

项目	上年度末（2022年12月31日）			
	名义金额	公允价值		备注(成本)
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	-78,361,993.05	—	—	—
股指期货	-78,361,993.05	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	-78,361,993.05	—	—	—

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。

7.4.7.3.2 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
IC2402	IC2402	-2.00	2,169,360.00	-27,680.00
IF2402	IF2402	-16.00	16,539,840.00	-354,540.00
IF2401	IF2401	-19.00	19,606,860.00	266,336.57
IC2401	IC2401	-29.00	31,533,440.00	278,080.00
合计				162,196.57
减：可抵销期货暂收款				162,196.57
净额				—

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31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	223,807.90	270,710.57
其中：交易所市场	223,807.90	270,710.57
银行间市场	—	—
应付利息	—	—
预提信息披露费	120,000.00	—
预提审计费	33,000.00	43,000.00
合计	376,807.90	313,710.57

7.4.7.7 实收基金

富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A：

金额单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	73,929,872.12	73,929,872.12
本期申购	4,305,988.71	4,305,988.71
本期赎回（以“-”号填列）	-16,399,584.81	-16,399,584.81
本期末	61,836,276.02	61,836,276.02

富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C：

金额单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,898,487.79	25,898,487.79
本期申购	18,723.97	18,723.97
本期赎回（以“-”号填列）	-5,353,138.26	-5,353,138.26
本期末	20,564,073.50	20,564,073.50

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,888,916.54	9,671,863.75	18,560,780.29
本期期初	8,888,916.54	9,671,863.75	18,560,780.29

本期利润	939,245.14	- 1,309,532.66	-370,287.52
本期基金份额交易产生的变动数	- 1,615,859.75	- 1,320,607.28	-2,936,467.03
其中：基金申购款	545,235.76	598,635.15	1,143,870.91
基金赎回款	- 2,161,095.51	- 1,919,242.43	-4,080,337.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,212,301.93	7,041,723.81	15,254,025.74

富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,394,294.57	3,402,631.45	5,796,926.02
本期期初	2,394,294.57	3,402,631.45	5,796,926.02
本期利润	52,728.02	-401,222.73	-348,494.71
本期基金份额交易产生的变动数	-495,764.77	-638,239.54	-1,134,004.31
其中：基金申购款	1,829.13	2,451.90	4,281.03
基金赎回款	-497,593.90	-640,691.44	-1,138,285.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,951,257.82	2,363,169.18	4,314,427.00

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
活期存款利息收入	30,684.86	70,837.40
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	157,050.94	262,734.54
其他	300.61	3,667.01
合计	188,036.41	337,238.95

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
卖出股票成交总额	600,349,712.86	781,677,498.35
减：卖出股票成本总额	604,669,505.58	832,822,932.72
减：交易费用	1,451,500.29	2,134,241.20
买卖股票差价收入	-5,771,293.01	-53,279,675.57

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
债券投资收益——利息收入	26.72	479.55
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	46,900.35	213,504.07
合计	46,927.07	213,983.62

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	239,449.55	1,201,831.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	192,500.00	987,800.00
减：应计利息总额	39.60	522.22
减：交易费用	9.60	5.19
买卖债券差价收入	46,900.35	213,504.07

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

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

7.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖贵金属交易。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
股指期货投资收益	6,841,909.43	46,257,126.01

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
股票投资产生的股利收益	1,604,573.47	1,987,472.67
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	1,604,573.47	1,987,472.67

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
1. 交易性金融资产	-824,058.91	-8,054,713.52
股票投资	-811,128.11	-8,015,784.74
债券投资	-12,930.80	-38,928.78
资产支持证券投资	—	—
基金投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他	—	—
2. 衍生工具	-886,696.48	-20,064.44
权证投资	—	—
股指期货-套保卖出股指期货	-886,696.48	-20,064.44
3. 其他	—	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—	—
合计	-1,710,755.39	-8,074,777.96

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
基金赎回费收入	129.39	193,052.11
基金转换费收入	88.23	3,550.97
合计	217.62	196,603.08

7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
审计费用	33,000.00	43,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
银行费用	735.00	850.00
债券账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	190,935.00	201,050.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构、基金发起人
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
山东省金融资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	165,989,191.12	13.85	211,131,757.40	15.16
申万宏源	127,639,025.88	10.65	281,871,854.61	20.24

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
海通证券	4,988.80	2.08	10,089.60	0.84
申万宏源	17,406.15	7.27	59,611.18	4.96

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
海通证券	10,200,000.00	100.00	—	—

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	121,050.97	13.88	32,862.41	14.68
申万宏源	92,832.97	10.64	23,416.67	10.46
关联方名称	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	173,747.44	14.29	74,847.40	27.65
申万宏源	249,833.10	20.55	30,022.62	11.09

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	1,199,468.78	2,047,458.42
其中：应支付销售机构的客户维护费	438,079.38	519,192.04
应支付基金管理人的净管理费	761,389.40	1,528,266.38

注：本基金管理人的管理费为基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之和。其中，基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费计提方法、计提标准和支付方式如下：

（1）本基金的基本管理费按前一日的基金资产净值的 1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金基本管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

(2) 附加管理费是在每一提取评价日（提取评价日为每次基金封闭期的最后一个工作日）计算并计提。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	272,501.94	511,864.62

注：2023年7月10日前，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提，自2023年7月10日起，基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	合计
富国基金管理有限公司	—	35,713.97	35,713.97
合计	—	35,713.97	35,713.97

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式	合计

	A	C	
富国基金管理有限公司	—	11,905.45	11,905.45
合计	—	11,905.45	11,905.45

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

在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.80% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资

本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	7,875,351.49	30,684.86	14,748,756.83	70,837.40

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	688062	迈威生物	IPO网下申购	8,578	300,006.97
海通证券股份有限公司	688220	翱捷科技	IPO网下申购	1,999	330,560.04

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位： 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113069	博 23 转债	2023-12-22	1 个月内（含）	认购新发 证券	100.00	100.01	80	8,000.00	8,000.53	—

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险

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

7.4.13.2 信用风险

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
AAA	—	—
AAA 以下	8,000.53	66,943.82
未评级	—	—
合计	8,000.53	66,943.82

注：本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金采用定期开放的运作方式，封闭期内不得申请申购、赎回本基金。在开放期内，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，因此除在附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。开放期内，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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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

单位：人民币元

本期末（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	7,875,351.49	—	—	—	—	—	7,875,351.49
结算备付金	6,110,214.48	—	—	—	—	—	6,110,214.48
存出保证金	17,921.48	—	—	—	—	8,381,940.00	8,399,861.48
交易性金融资产	—	—	8,000.53	—	—	80,118,617.05	80,126,617.58
资产总计	14,003,487.45	—	8,000.53	—	—	88,500,557.05	102,512,045.03
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	92,607.86	92,607.86
应付托管费	—	—	—	—	—	18,521.57	18,521.57
应付销售服务费	—	—	—	—	—	19,786.01	19,786.01
应交税费	—	—	—	—	—	35,519.43	35,519.43
其他负债	—	—	—	—	—	376,807.90	376,807.90
负债总计	—	—	—	—	—	543,242.77	543,242.77
利率敏感度缺口	14,003,487.45	—	8,000.53	—	—	87,957,314.28	101,968,802.26
上年度末（2022年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	14,748,756.83	—	—	—	—	—	14,748,756.83
结算备付金	12,100,509.99	—	—	—	—	—	12,100,509.99
存出保证金	21,498.67	—	—	—	—	10,053,137.60	10,074,636.27
交易性金融资产	—	—	66,943.82	—	—	87,616,026.54	87,682,970.36

应收清算款	—	—	—	—	—	73,280.58	73,280.58
资产总计	26,870,765.49	—	66,943.82	—	—	97,742,444.72	124,680,154.03
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	122,065.53	122,065.53
应付托管费	—	—	—	—	—	30,516.42	30,516.42
应付销售服务费	—	—	—	—	—	27,794.94	27,794.94
应交税费	—	—	—	—	—	0.35	0.35
其他负债	—	—	—	—	—	313,710.57	313,710.57
负债总计	—	—	—	—	—	494,087.81	494,087.81
利率敏感度缺口	26,870,765.49	—	66,943.82	—	—	97,248,356.91	124,186,066.22

7.4.13.4.1.2 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。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、权证、债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的比例范围在 80%-120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类空头工具价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类多头工具价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含

到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等。开放期内,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

金额单位:人民币元

项目	本期末(2023年12月31日)		上年度末(2022年12月31日)	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	80,118,617.05	78.57	87,616,026.54	70.55
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	8,000.53	0.01	66,943.82	0.05
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	80,126,617.58	78.58	87,682,970.36	70.61

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型(CAPM)对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析,反映了在其他变量不变的假设下,市场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,除市场基准发生变动,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(2023年12月31日)	上年度末(2022年12月31日)

1. 市场基准增加 1%	88,594.26	143,947.12
2. 市场基准减少 1%	-88,594.26	-143,947.12

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 (2023年12月31日)	上年度末 (2022年12月31日)
第一层次	80,118,617.05	87,497,783.60
第二层次	8,000.53	129,526.80
第三层次	—	55,659.96
合计	80,126,617.58	87,682,970.36

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	—	55,659.96	55,659.96
当期购买	—	—	—
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	214,649.12	214,649.12
当期利得或损失总额	—	158,989.16	158,989.16
其中：计入损益的利得或损失	—	158,989.16	158,989.16
期末余额	—	—	—
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	—	—	—
项目	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	—	616,615.05	616,615.05
当期购买	—	49,524.72	49,524.72
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	554,435.15	554,435.15
当期利得或损失总额	—	-56,044.66	-56,044.66
其中：计入损益的利得或损失	—	-56,044.66	-56,044.66
期末余额	—	55,659.96	55,659.96
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	—	6,135.24	6,135.24

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
—	—	—	—	—	—
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	55,659.96	平均价格 亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.3422	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	80,118,617.05	78.16
	其中：股票	80,118,617.05	78.16
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	8,000.53	0.01
	其中：债券	8,000.53	0.01

	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	13,985,565.97	13.64
8	其他各项资产	8,399,861.48	8.19
9	合计	102,512,045.03	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

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	2,382,513.00	2.34
C	制造业	51,567,850.69	50.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,223,367.00	1.20
E	建筑业	874,892.00	0.86
F	批发和零售业	2,726,989.00	2.67
G	交通运输、仓储和邮政业	1,629,286.00	1.60
H	住宿和餐饮业	167,134.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,605,432.70	4.52
J	金融业	9,088,499.30	8.91
K	房地产业	1,438,743.00	1.41
L	租赁和商务服务业	1,068,688.86	1.05
M	科学研究和技术服务业	482,790.50	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	482,430.00	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	85,408.00	0.08
Q	卫生和社会工作	134,160.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	2,013,683.00	1.97
S	综合	146,750.00	0.14
	合计	80,118,617.05	78.57

8.3 期末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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	906	1,563,756.00	1.53

2	300750	宁德时代	6,815	1,112,616.90	1.09
3	000725	京东方A	279,900	1,091,610.00	1.07
4	000970	中科三环	104,200	1,078,470.00	1.06
5	000933	神火股份	61,400	1,031,520.00	1.01
6	002027	分众传媒	138,200	873,424.00	0.86
7	600104	上汽集团	62,200	841,566.00	0.83
8	300677	英科医疗	35,200	822,272.00	0.81
9	002415	海康威视	22,861	793,733.92	0.78
10	688002	睿创微纳	17,900	791,538.00	0.78
11	300026	红日药业	185,700	787,368.00	0.77
12	601766	中国中车	145,400	764,804.00	0.75
13	000651	格力电器	23,623	759,951.91	0.75
14	002736	国信证券	83,900	716,506.00	0.70
15	002670	国盛金控	75,100	699,932.00	0.69
16	601319	中国人保	144,600	699,864.00	0.69
17	000563	陕国投A	230,100	699,504.00	0.69
18	300390	天华新能	26,900	681,915.00	0.67
19	000997	新大陆	34,700	680,467.00	0.67
20	000623	吉林敖东	44,800	678,272.00	0.67
21	600155	华创云信	78,300	653,022.00	0.64
22	600999	招商证券	47,760	651,446.40	0.64
23	600741	华域汽车	39,600	644,688.00	0.63
24	601728	中国电信	118,600	641,626.00	0.63
25	601857	中国石油	89,100	629,046.00	0.62
26	600219	南山铝业	199,100	585,354.00	0.57
27	600426	华鲁恒升	20,260	558,973.40	0.55
28	601607	上海医药	33,100	553,763.00	0.54
29	002738	中矿资源	14,800	552,188.00	0.54
30	601877	正泰电器	25,600	550,656.00	0.54
31	601989	中国重工	131,100	541,443.00	0.53
32	600845	宝信软件	11,000	536,800.00	0.53
33	000895	双汇发展	19,685	525,786.35	0.52
34	688396	华润微	11,466	512,415.54	0.50
35	000156	华数传媒	67,000	493,790.00	0.48
36	600707	彩虹股份	69,500	469,125.00	0.46
37	600582	天地科技	82,400	448,256.00	0.44
38	600050	中国联通	101,800	445,884.00	0.44
39	601717	郑煤机	35,000	442,750.00	0.43
40	688009	中国通号	100,080	438,350.40	0.43
41	688220	翱捷科技	6,100	429,684.00	0.42
42	600499	科达制造	40,700	429,385.00	0.42

43	688006	杭可科技	18,100	424,988.00	0.42
44	600928	西安银行	125,000	416,250.00	0.41
45	002625	光启技术	28,100	415,318.00	0.41
46	002138	顺络电子	15,300	413,253.00	0.41
47	600481	双良节能	48,700	412,002.00	0.40
48	002600	领益智造	60,900	411,684.00	0.40
49	603688	石英股份	4,700	408,336.00	0.40
50	000069	华侨城A	129,900	403,989.00	0.40
51	688029	南微医学	4,100	396,880.00	0.39
52	600038	中直股份	10,300	396,859.00	0.39
53	300088	长信科技	59,300	396,717.00	0.39
54	000636	风华高科	29,000	396,140.00	0.39
55	002223	鱼跃医疗	11,300	390,754.00	0.38
56	600862	中航高科	17,500	387,625.00	0.38
57	002432	九安医疗	10,200	384,234.00	0.38
58	002916	深南电路	5,400	383,346.00	0.38
59	603883	老百姓	12,600	376,614.00	0.37
60	003031	中瓷电子	4,200	370,566.00	0.36
61	600967	内蒙一机	44,800	370,048.00	0.36
62	000778	新兴铸管	96,700	369,394.00	0.36
63	600062	华润双鹤	19,700	366,420.00	0.36
64	000930	中粮科技	54,100	359,224.00	0.35
65	603379	三美股份	10,500	357,000.00	0.35
66	300487	蓝晓科技	6,700	355,502.00	0.35
67	002030	达安基因	36,500	353,320.00	0.35
68	601238	广汽集团	40,100	350,875.00	0.34
69	600022	山东钢铁	251,600	344,692.00	0.34
70	300017	网宿科技	43,900	344,615.00	0.34
71	000932	华菱钢铁	66,100	340,415.00	0.33
72	300363	博腾股份	13,500	339,525.00	0.33
73	601898	中煤能源	34,700	336,243.00	0.33
74	002025	航天电器	7,000	336,140.00	0.33
75	300037	新宙邦	7,100	335,830.00	0.33
76	603858	步长制药	19,700	335,097.00	0.33
77	000830	鲁西化工	33,200	332,996.00	0.33
78	300118	东方日升	18,800	331,820.00	0.33
79	002518	科士达	11,900	328,440.00	0.32
80	000598	兴蓉环境	57,200	325,468.00	0.32
81	603026	胜华新材	7,000	321,020.00	0.31
82	000937	冀中能源	44,900	320,586.00	0.31
83	300001	特锐德	15,900	319,590.00	0.31

84	000783	长江证券	59,100	317,958.00	0.31
85	002092	中泰化学	52,100	317,810.00	0.31
86	002028	思源电气	6,100	317,444.00	0.31
87	002326	永太科技	27,300	317,226.00	0.31
88	002673	西部证券	49,500	315,315.00	0.31
89	600008	首创环保	116,900	314,461.00	0.31
90	601666	平煤股份	26,900	310,964.00	0.30
91	000967	盈峰环境	65,400	310,650.00	0.30
92	300682	朗新集团	18,800	308,132.00	0.30
93	600131	国网信通	20,300	307,545.00	0.30
94	002506	协鑫集成	111,600	305,784.00	0.30
95	600167	联美控股	53,800	305,046.00	0.30
96	601816	京沪高铁	61,800	304,056.00	0.30
97	688208	道通科技	12,300	292,125.00	0.29
98	603218	日月股份	23,500	290,695.00	0.29
99	600737	中粮糖业	35,100	289,224.00	0.28
100	600339	中油工程	95,200	288,456.00	0.28
101	000581	威孚高科	19,100	287,837.00	0.28
102	002958	青农商行	109,800	287,676.00	0.28
103	000887	中鼎股份	23,100	285,747.00	0.28
104	300394	天孚通信	3,100	283,712.00	0.28
105	002865	钧达股份	3,600	278,928.00	0.27
106	601128	常熟银行	43,400	277,326.00	0.27
107	600016	民生银行	73,200	273,768.00	0.27
108	002408	齐翔腾达	51,700	272,976.00	0.27
109	000338	潍柴动力	19,200	262,080.00	0.26
110	601169	北京银行	57,000	258,210.00	0.25
111	601211	国泰君安	17,100	254,448.00	0.25
112	600812	华北制药	44,600	254,220.00	0.25
113	601811	新华文轩	18,200	248,612.00	0.24
114	002281	光迅科技	8,700	247,950.00	0.24
115	600498	烽火通信	14,700	244,608.00	0.24
116	601360	三六零	27,000	243,270.00	0.24
117	600958	东方证券	27,900	242,730.00	0.24
118	002508	老板电器	11,100	241,758.00	0.24
119	603355	莱克电气	10,700	238,610.00	0.23
120	002236	大华股份	12,800	236,160.00	0.23
121	603993	洛阳钼业	45,400	236,080.00	0.23
122	600018	上港集团	47,900	234,710.00	0.23
123	002821	凯莱英	2,000	232,200.00	0.23
124	601006	大秦铁路	32,000	230,720.00	0.23

125	601988	中国银行	57,700	230,223.00	0.23
126	300223	北京君正	3,400	219,810.00	0.22
127	600015	华夏银行	39,000	219,180.00	0.21
128	601019	山东出版	23,000	215,740.00	0.21
129	002064	华峰化学	32,100	215,391.00	0.21
130	002739	万达电影	16,500	214,830.00	0.21
131	600362	江西铜业	12,000	214,320.00	0.21
132	002180	纳思达	9,400	212,722.00	0.21
133	002078	太阳纸业	17,300	210,541.00	0.21
134	300251	光线传媒	25,600	208,640.00	0.20
135	601878	浙商证券	20,000	208,600.00	0.20
136	000617	中油资本	38,600	208,440.00	0.20
137	002572	索菲亚	12,800	204,160.00	0.20
138	002449	国星光电	21,400	202,658.00	0.20
139	600820	隧道股份	35,000	201,600.00	0.20
140	601318	中国平安	4,993	201,217.90	0.20
141	601668	中国建筑	41,800	201,058.00	0.20
142	600755	厦门国贸	28,800	200,736.00	0.20
143	600977	中国电影	16,400	200,736.00	0.20
144	000800	一汽解放	23,600	200,600.00	0.20
145	002131	利欧股份	86,500	197,220.00	0.19
146	600757	长江传媒	26,300	195,935.00	0.19
147	300122	智飞生物	3,200	195,552.00	0.19
148	600153	建发股份	20,100	193,563.00	0.19
149	600841	动力新科	32,700	193,257.00	0.19
150	603056	德邦股份	13,300	192,451.00	0.19
151	601288	农业银行	52,500	191,100.00	0.19
152	600655	豫园股份	30,700	190,647.00	0.19
153	301122	采纳股份	5,600	189,616.00	0.19
154	300058	蓝色光标	26,100	187,398.00	0.18
155	002568	百润股份	7,600	187,036.00	0.18
156	601998	中信银行	35,000	185,150.00	0.18
157	600276	恒瑞医药	4,093	185,126.39	0.18
158	600827	百联股份	19,400	184,106.00	0.18
159	603156	养元饮品	8,600	182,836.00	0.18
160	000089	深圳机场	28,400	182,612.00	0.18
161	601588	北辰实业	94,400	179,360.00	0.18
162	603885	吉祥航空	14,900	178,800.00	0.18
163	601236	红塔证券	23,300	176,847.00	0.17
164	002557	洽洽食品	5,059	176,154.38	0.17
165	000157	中联重科	26,875	175,493.75	0.17

166	600918	中泰证券	25,500	174,930.00	0.17
167	600170	上海建工	74,200	173,628.00	0.17
168	002462	嘉事堂	12,200	173,362.00	0.17
169	605018	长华集团	15,600	172,848.00	0.17
170	603317	天味食品	12,860	170,909.40	0.17
171	000559	万向钱潮	32,900	170,751.00	0.17
172	600258	首旅酒店	10,700	167,134.00	0.16
173	601608	中信重工	42,000	162,120.00	0.16
174	000729	燕京啤酒	18,500	159,655.00	0.16
175	600758	辽宁能源	43,900	158,918.00	0.16
176	603869	新智认知	16,800	158,592.00	0.16
177	601229	上海银行	26,400	157,608.00	0.15
178	688561	奇安信	3,850	154,346.50	0.15
179	600061	国投资本	22,900	154,346.00	0.15
180	600398	海澜之家	20,800	154,336.00	0.15
181	600829	人民同泰	19,200	150,144.00	0.15
182	002563	森马服饰	26,000	150,020.00	0.15
183	603530	神马电力	7,200	149,328.00	0.15
184	603933	睿能科技	9,600	149,280.00	0.15
185	600594	益佰制药	26,200	149,078.00	0.15
186	002372	伟星新材	10,300	149,041.00	0.15
187	603259	药明康德	2,029	147,630.04	0.14
188	000009	中国宝安	12,500	146,750.00	0.14
189	002644	佛慈制药	15,000	146,250.00	0.14
190	002791	坚朗五金	3,500	141,715.00	0.14
191	605188	国光连锁	16,400	139,564.00	0.14
192	002296	辉煌科技	16,900	139,425.00	0.14
193	002900	哈三联	10,200	139,230.00	0.14
194	601231	环旭电子	9,200	139,012.00	0.14
195	603421	鼎信通讯	14,700	138,180.00	0.14
196	002905	金逸影视	12,500	137,000.00	0.13
197	300843	胜蓝股份	5,900	135,582.00	0.13
198	002524	光正眼科	20,800	134,160.00	0.13
199	601636	旗滨集团	19,300	132,012.00	0.13
200	300323	华灿光电	18,000	131,760.00	0.13
201	300787	海能实业	7,800	131,196.00	0.13
202	600774	汉商集团	13,300	131,138.00	0.13
203	600488	津药药业	26,700	130,830.00	0.13
204	300686	智动力	12,200	129,076.00	0.13
205	300739	明阳电路	8,400	128,604.00	0.13
206	601865	福莱特	4,800	128,160.00	0.13

207	002788	鹭燕医药	14,000	125,860.00	0.12
208	002817	黄山胶囊	13,800	120,888.00	0.12
209	003043	华亚智能	2,400	120,504.00	0.12
210	600325	华发股份	16,600	119,686.00	0.12
211	601518	吉林高速	46,800	119,340.00	0.12
212	002498	汉缆股份	29,800	119,200.00	0.12
213	600308	华泰股份	34,200	118,332.00	0.12
214	300046	台基股份	7,400	117,734.00	0.12
215	301011	华立科技	5,000	117,000.00	0.11
216	002107	沃华医药	19,200	116,544.00	0.11
217	301119	正强股份	4,500	116,460.00	0.11
218	600173	卧龙地产	23,200	116,000.00	0.11
219	000031	大悦城	38,800	115,236.00	0.11
220	603787	新日股份	9,200	115,092.00	0.11
221	002244	滨江集团	15,800	114,866.00	0.11
222	603989	艾华集团	5,300	114,056.00	0.11
223	002551	尚荣医疗	27,900	113,274.00	0.11
224	000402	金融街	31,200	113,256.00	0.11
225	000042	中洲控股	19,700	113,078.00	0.11
226	603817	海峡环保	17,600	112,288.00	0.11
227	002636	金安国纪	12,500	111,375.00	0.11
228	603333	尚纬股份	19,300	110,203.00	0.11
229	603776	永安行	7,800	109,824.00	0.11
230	002399	海普瑞	9,100	106,743.00	0.10
231	688273	麦澜德	3,200	106,592.00	0.10
232	600379	宝光股份	10,600	106,530.00	0.10
233	002956	西麦食品	7,400	106,042.00	0.10
234	002627	三峡旅游	19,800	105,732.00	0.10
235	603659	璞泰来	4,991	104,461.63	0.10
236	600403	大有能源	26,900	102,220.00	0.10
237	000788	北大医药	14,800	99,308.00	0.10
238	603096	新经典	5,000	98,400.00	0.10
239	301197	工大科雅	5,200	97,708.00	0.10
240	003816	中国广核	30,400	94,544.00	0.09
241	600628	新世界	13,400	93,934.00	0.09
242	301010	晶雪节能	5,000	93,450.00	0.09
243	000100	TCL科技	21,600	92,880.00	0.09
244	002287	奇正藏药	4,100	92,209.00	0.09
245	688247	宣泰医药	8,300	91,134.00	0.09
246	002734	利民股份	11,400	90,858.00	0.09
247	603676	卫信康	8,600	89,698.00	0.09

248	600749	西藏旅游	7,600	89,376.00	0.09
249	600299	安迪苏	11,100	88,800.00	0.09
250	300543	朗科智能	8,100	88,452.00	0.09
251	300484	蓝海华腾	7,000	88,410.00	0.09
252	300651	金陵体育	4,400	87,912.00	0.09
253	603369	今世缘	1,800	87,750.00	0.09
254	300381	溢多利	11,900	87,703.00	0.09
255	600080	金花股份	11,700	87,165.00	0.09
256	603387	基蛋生物	7,900	86,900.00	0.09
257	002621	美吉姆	27,200	85,408.00	0.08
258	600939	重庆建工	25,800	84,624.00	0.08
259	002628	成都路桥	25,100	82,830.00	0.08
260	002159	三特索道	5,400	82,404.00	0.08
261	688227	品高股份	4,300	82,001.00	0.08
262	002492	恒基达鑫	13,500	80,865.00	0.08
263	300605	恒锋信息	5,400	80,838.00	0.08
264	300642	透景生命	4,500	79,425.00	0.08
265	601568	北元集团	16,600	78,684.00	0.08
266	688459	哈铁科技	8,400	78,624.00	0.08
267	601688	华泰证券	5,600	78,120.00	0.08
268	300500	启迪设计	5,400	77,382.00	0.08
269	002016	世荣兆业	12,300	77,367.00	0.08
270	600693	东百集团	19,100	76,591.00	0.08
271	000931	中关村	12,700	74,549.00	0.07
272	603655	朗博科技	3,500	72,870.00	0.07
273	600969	郴电国际	11,000	71,500.00	0.07
274	601002	晋亿实业	14,600	70,664.00	0.07
275	300246	宝莱特	6,800	70,040.00	0.07
276	600887	伊利股份	2,600	69,550.00	0.07
277	002111	威海广泰	7,600	68,856.00	0.07
278	603214	爱婴室	4,200	68,712.00	0.07
279	301002	崧盛股份	3,300	68,442.00	0.07
280	600828	茂业商业	18,700	68,255.00	0.07
281	002879	长缆科技	4,200	67,284.00	0.07
282	002871	伟隆股份	6,000	67,080.00	0.07
283	301366	一博科技	2,000	66,740.00	0.07
284	600815	厦工股份	24,600	66,174.00	0.06
285	603843	正平股份	18,800	65,612.00	0.06
286	300117	嘉寓股份	22,600	65,540.00	0.06
287	300454	深信服	900	65,061.00	0.06
288	301333	诺思格	1,000	64,480.00	0.06

289	300871	回盛生物	4,400	63,624.00	0.06
290	000876	新希望	6,700	62,444.00	0.06
291	301279	金道科技	2,500	61,975.00	0.06
292	601212	白银有色	22,800	61,332.00	0.06
293	601137	博威合金	3,700	57,461.00	0.06
294	600332	白云山	2,000	57,200.00	0.06
295	688699	明微电子	1,400	56,490.00	0.06
296	300752	隆利科技	2,900	52,693.00	0.05
297	301256	华融化学	6,400	52,672.00	0.05
298	601799	星宇股份	400	52,444.00	0.05
299	002666	德联集团	9,600	51,840.00	0.05
300	603866	桃李面包	6,600	50,556.00	0.05
301	688179	阿拉丁	2,600	49,816.00	0.05
302	000538	云南白药	1,000	49,150.00	0.05
303	601956	东贝集团	8,000	47,760.00	0.05
304	301399	英特科技	1,200	45,924.00	0.05
305	300412	迦南科技	8,000	45,520.00	0.04
306	003030	祖名股份	2,100	45,360.00	0.04
307	000880	潍柴重机	4,200	44,646.00	0.04
308	301199	迈赫股份	1,700	44,625.00	0.04
309	300667	必创科技	2,600	44,616.00	0.04
310	000952	广济药业	5,500	43,945.00	0.04
311	301137	哈焊华通	2,400	43,896.00	0.04
312	688662	富信科技	1,200	43,740.00	0.04
313	000718	苏宁环球	16,800	43,512.00	0.04
314	002288	超华科技	9,900	43,164.00	0.04
315	603506	南都物业	3,900	42,393.00	0.04
316	603508	思维列控	2,700	42,390.00	0.04
317	301379	天山电子	1,400	41,426.00	0.04
318	301252	同星科技	1,000	41,240.00	0.04
319	300306	远方信息	3,400	41,072.00	0.04
320	603931	格林达	1,600	40,944.00	0.04
321	002423	中粮资本	6,100	40,748.00	0.04
322	300508	维宏股份	1,400	39,620.00	0.04
323	301041	金百泽	1,400	37,828.00	0.04
324	603192	汇得科技	1,900	37,335.00	0.04
325	300943	春晖智控	2,600	37,284.00	0.04
326	002996	顺博合金	3,400	37,128.00	0.04
327	603335	迪生力	5,500	36,905.00	0.04
328	300489	光智科技	1,800	36,432.00	0.04
329	600036	招商银行	1,300	36,166.00	0.04

330	002909	集泰股份	4,600	35,098.00	0.03
331	001268	联合精密	1,400	35,000.00	0.03
332	601398	工商银行	7,200	34,416.00	0.03
333	688189	南新制药	3,618	34,117.74	0.03
334	300176	派生科技	5,000	33,800.00	0.03
335	300472	新元科技	3,500	33,040.00	0.03
336	300828	锐新科技	2,100	32,844.00	0.03
337	605151	西上海	1,700	32,436.00	0.03
338	301158	德石股份	2,000	32,180.00	0.03
339	300710	万隆光电	1,300	31,616.00	0.03
340	300950	德固特	1,900	30,647.00	0.03
341	300515	三德科技	2,600	30,004.00	0.03
342	600584	长电科技	1,000	29,860.00	0.03
343	688165	埃夫特	2,574	29,498.04	0.03
344	301138	华研精机	1,000	29,000.00	0.03
345	688217	睿昂基因	800	28,624.00	0.03
346	603810	丰山集团	2,100	28,077.00	0.03
347	300962	中金辐照	1,800	27,936.00	0.03
348	301130	西点药业	1,000	27,880.00	0.03
349	301086	鸿富瀚	600	27,732.00	0.03
350	688216	气派科技	1,000	27,670.00	0.03
351	002365	永安药业	2,800	27,384.00	0.03
352	002796	世嘉科技	2,400	27,144.00	0.03
353	688199	久日新材	1,000	27,030.00	0.03
354	688045	必易微	600	25,698.00	0.03
355	688329	艾隆科技	1,000	24,860.00	0.02
356	601377	兴业证券	4,000	23,480.00	0.02
357	688169	石头科技	80	22,636.00	0.02
358	688607	康众医疗	1,100	22,418.00	0.02
359	301290	东星医疗	800	22,072.00	0.02
360	301388	欣灵电气	900	21,951.00	0.02
361	688021	奥福环保	1,000	20,850.00	0.02
362	688265	南模生物	500	19,225.00	0.02
363	300408	三环集团	600	17,670.00	0.02
364	301063	海锅股份	700	15,960.00	0.02
365	002461	珠江啤酒	2,000	15,800.00	0.02
366	688420	美腾科技	600	15,504.00	0.02
367	603182	嘉华股份	1,000	14,770.00	0.01
368	688656	浩欧博	400	13,904.00	0.01
369	301365	矩阵股份	800	12,096.00	0.01
370	688389	普门科技	505	11,367.55	0.01

371	601888	中国中免	94	7,866.86	0.01
372	301118	恒光股份	300	7,329.00	0.01
373	600000	浦发银行	600	3,972.00	0.00
374	002050	三花智控	98	2,881.20	0.00
375	688105	诺唯赞	73	2,337.46	0.00
376	603799	华友钴业	70	2,305.10	0.00
377	002985	北摩高科	53	1,838.04	0.00
378	600760	中航沈飞	40	1,687.20	0.00
379	603225	新凤鸣	118	1,675.60	0.00
380	000708	中信特钢	115	1,614.60	0.00
381	002648	卫星化学	109	1,607.75	0.00
382	600406	国电南瑞	60	1,339.20	0.00
383	002459	晶澳科技	64	1,326.08	0.00
384	600031	三一重工	66	908.82	0.00
385	601016	节能风电	20	60.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	5,122,867.00	4.13
2	600519	贵州茅台	4,236,027.00	3.41
3	000725	京东方 A	3,497,780.00	2.82
4	002027	分众传媒	3,425,328.00	2.76
5	002415	海康威视	3,389,330.00	2.73
6	000333	美的集团	3,294,066.00	2.65
7	000063	中兴通讯	2,913,663.00	2.35
8	000651	格力电器	2,878,354.00	2.32
9	600887	伊利股份	2,759,666.00	2.22
10	601728	中国电信	2,658,493.00	2.14
11	601398	工商银行	2,613,792.00	2.10
12	601766	中国中车	2,569,379.00	2.07
13	601006	大秦铁路	2,532,476.00	2.04
14	000623	吉林敖东	2,468,107.00	1.99
15	600155	华创云信	2,446,630.00	1.97
16	002304	洋河股份	2,333,936.00	1.88
17	000338	潍柴动力	2,315,045.00	1.86
18	003816	中国广核	2,272,095.00	1.83
19	000858	五粮液	2,220,892.00	1.79
20	300760	迈瑞医疗	2,072,294.00	1.67

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	4,557,715.60	3.67
2	600519	贵州茅台	4,125,748.00	3.32
3	000333	美的集团	3,844,651.68	3.10
4	600887	伊利股份	3,163,076.35	2.55
5	000063	中兴通讯	3,037,508.00	2.45
6	002027	分众传媒	2,984,330.00	2.40
7	002415	海康威视	2,898,945.00	2.33
8	601318	中国平安	2,872,418.00	2.31
9	000858	五粮液	2,833,386.60	2.28
10	000338	潍柴动力	2,614,099.20	2.10
11	601398	工商银行	2,612,724.72	2.10
12	000415	渤海租赁	2,493,887.00	2.01
13	601006	大秦铁路	2,326,540.00	1.87
14	002304	洋河股份	2,322,970.00	1.87
15	000725	京东方 A	2,288,993.00	1.84
16	300760	迈瑞医疗	2,276,331.00	1.83
17	000651	格力电器	2,274,252.00	1.83
18	300115	长盈精密	2,250,611.00	1.81
19	003816	中国广核	2,165,677.00	1.74
20	000425	徐工机械	2,134,576.00	1.72

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	597,983,224.20
卖出股票收入（成交）总额	600,349,712.86

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
----	------	---------	---------------

1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	8,000.53	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	8,000.53	0.01

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113069	博 23 转债	80	8,000.53	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金不允许投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 80,118,617.05 元，占基金资产净值的比例为 78.57%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 69,849,500.00 元，占基金资产净值的比例为 68.50%，空头合约市值占股票资产的比例为 87.18%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 1,070,616.42 元，公允价值变动损益为-1,697,824.59 元。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.13.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

8.13.3 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	8,399,861.48
2	应收清算款	—
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	8,399,861.48

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	7,761	7,967.57	6,188,122.29	10.01	55,648,153.73	89.99
富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	228	90,193.30	16,116,035.46	78.37	4,448,038.04	21.63
合计	7,989	10,314.23	22,304,157.75	27.07	60,096,191.77	72.93

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	64,600.30	0.1045
	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	8.93	0.0000
	合计	64,609.23	0.0784

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	0
	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	0
	合计	0

本基金基金经理持有本开放式基金	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	0
	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数 (份)	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数 (份)	发起份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	—	—	—	—	—
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	富国绝对收益多策略 定期开放混合发起式 A	富国绝对收益多策略 定期开放混合发起式 C
基金合同生效日(2015年09月17日) 基金份额总额	465,664,314.43	—
报告期期初基金份额总额	73,929,872.12	25,898,487.79
本报告期基金总申购份额	4,305,988.71	18,723.97
减：本报告期基金总赎回份额	16,399,584.81	5,353,138.26
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	61,836,276.02	20,564,073.50

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2023 年 11 月 23 日发布公告，李强先生自 2023 年 11 月 22 日起担任首席信息官，同日起林志松先生不再兼任首席信息官。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 3.3 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 21 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：根据我行审计报告，本行不存在涉嫌犯罪被依法立案调查的情况，本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施、涉嫌严重违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责的情况；本行或者本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或者受到中国证监会行政处罚，或者受到其他有权机关重大行政处罚，或者被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分的情况；本行董事、监事、高级管理人员不存在因涉嫌违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责的情况。况。

11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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 (%)	
国投证券	2	—	—	—	—	—
渤海证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	1	2,903,787.19	0.24	2,675.20	0.31	—
长江证券	3	18,829,403.36	1.57	13,581.91	1.56	—
德邦证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	2	30,977.84	0.00	22.34	0.00	—
东财证券	2	80,673,387.76	6.73	59,308.34	6.80	—
方正证券	2	23,554,711.81	1.97	17,316.30	1.99	—
高盛中国	1	5,413,819.93	0.45	4,987.93	0.57	—
光大证券	2	22,295,239.66	1.86	16,403.75	1.88	—
广发证券	2	38,410,470.59	3.21	27,807.35	3.19	—
国海证券	2	24,188,015.60	2.02	17,566.57	2.01	—
国盛证券	2	220,398,922.97	18.40	159,617.85	18.30	—
国泰君安	2	8,850,195.99	0.74	6,496.22	0.74	—
国信证券	2	20,973,531.97	1.75	15,435.03	1.77	—
海通证券	2	165,989,191.12	13.85	121,050.97	13.88	—
华泰证券	1	28,557,737.00	2.38	21,016.47	2.41	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	127,639,025.88	10.65	92,832.97	10.64	—
太平洋证券	2	43,425,292.73	3.62	31,323.02	3.59	—
天风证券	2	32,182,709.63	2.69	23,214.08	2.66	—
西南证券	2	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—
信达证券	2	8,183,741.00	0.68	6,022.41	0.69	—
兴业证券	1	36,814,695.05	3.07	26,555.87	3.04	—
招商证券	1	19,974,133.86	1.67	14,407.30	1.65	—
中航证券	2	24,163,889.24	2.02	17,428.96	2.00	—
中金公司	2	38,698,079.74	3.23	28,478.51	3.27	—
中泰证券	2	99,323,096.57	8.29	71,640.60	8.21	—
中信建投	1	62,226,339.23	5.19	44,884.42	5.15	—

中信证券	4	44,371,140.80	3.70	32,160.13	3.69	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

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。本报告期本基金退租券商交易单元：德邦证券（50401）。本报告期本基金新增券商交易单元：中信证券（017462、58563）。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国投证券	—	—	—	—	—	—
渤海证券	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东财证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	71,560.24	29.89	—	—	—	—
高盛中国	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	30,802.77	12.86	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	4,988.80	2.08	10,200,000.00	100.00	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—
上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	17,406.15	7.27	—	—	—	—
太平洋证券	24,323.81	10.16	—	—	—	—

天风证券	—	—	—	—	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中航证券	63,458.16	26.50	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	19,937.50	8.33	—	—	—	—
中信证券	6,972.12	2.91	—	—	—	—
中银证券	—	—	—	—	—	—

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金第 30 个开放期开放申购、赎回和转换业务的公告	规定披露媒介	2023 年 03 月 16 日
2	富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金第 31 个开放期开放申购、赎回和转换业务的公告	规定披露媒介	2023 年 06 月 15 日
3	富国基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等事项的公告	规定披露媒介	2023 年 07 月 08 日
4	富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金第 32 个开放期开放申购、赎回和转换业务的公告	规定披露媒介	2023 年 09 月 14 日
5	富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定披露媒介	2023 年 11 月 23 日
6	富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金第 33 个开放期开放申购、赎回和转换业务的公告	规定披露媒介	2023 年 12 月 14 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，为更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者

的理财成本，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人决定自 2023 年 7 月 10 日起，调低本基金的托管费率，并对基金合同及托管协议的相应条款进行修订。具体可参见基金管理人于 2023 年 7 月 8 日发布的《富国基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等事项的公告》及修订后的基金合同、托管协议。二、本报告期内，经基金管理人董事会七届一次会议审议通过并按规定备案，李强先生自 2023 年 11 月 22 日起担任首席信息官，同日起林志松先生不再兼任首席信息官。具体可参见基金管理人于 2023 年 11 月 23 日发布的《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

§ 13 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式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、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同		
3、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式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、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式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		