

富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 .....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告 .....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	21
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 .....	21
§5 托管人报告 .....	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	21
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.....	21
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 .....	21
§6 审计报告 .....	22
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
§7 年度财务报告 .....	24
7.1 资产负债表.....	24

7.2 利润表.....	26
7.3 净资产变动表.....	27
7.4 报表附注.....	28
§8 投资组合报告.....	68
8.1 期末基金资产组合情况.....	68
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	68
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	69
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	93
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	94
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.....	95
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.....	95
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.....	95
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.....	95
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	95
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	95
8.12 投资组合报告附注.....	96
§9 基金份额持有人信息.....	97
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	97
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	97
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	97
9.4 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.....	98
§10 开放式基金份额变动.....	98
§11 重大事件揭示.....	98
11.1 基金份额持有人大会决议.....	98
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.....	98
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	99
11.4 基金投资策略的改变.....	99
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	99
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.....	99
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	99
11.8 其他重大事件.....	102
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	103
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.....	103
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	103

§13 备查文件目录 ..... 103

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	富国中证 1000 指数增强 (LOF)	
基金主代码	161039	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 05 月 31 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,816,900,462.56 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2018 年 6 月 20 日	
下属分级基金的基金简称	富国中证 1000 指数增强 (LOF) A	富国中证 1000 指数增强 (LOF) C
下属分级基金场内简称	1000 增强 LOF	—
下属分级基金的交易代码	161039	013331
报告期末下属分级基金的份额总额	1,016,344,929.26 份	800,555,533.30 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，主要策略为复制目标指数，即投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础，利用富国定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。本基金在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。本基金的股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略及参与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 1000 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	任航
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		裴长江	谷澍

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

### 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	A类: 中国证券登记结算有限责任公司; C类: 富国基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街17号

### § 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) 富国中证 1000 指数增强 (LOF) 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	2,743,100.37	-188,859,048.11	62,851,979.58
本期利润	11,679,282.37	-367,054,510.74	147,647,233.62
加权平均基金份额本期利润	0.0106	-0.3134	0.2977
本期加权平均净值利润率	0.55%	-16.33%	14.61%
本期基金份额净值增长率	-0.15%	-14.40%	27.33%
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	657,307,562.98	728,380,062.65	680,674,772.84
期末可供分配基金份额利润	0.6467	0.6594	0.8347
期末基金资产净值	1,852,928,617.22	2,017,052,721.61	1,739,461,889.47
期末基金份额净值	1.8231	1.8259	2.1331
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	82.31%	82.59%	113.31%

##### (2) 富国中证 1000 指数增强 (LOF) 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	-17,120,430.66	-47,092,910.46	7,212,816.68
本期利润	-46,335,431.11	-136,409,796.91	-5,379,821.17
加权平均基金份额本期利润	-0.0897	-0.4378	-0.0324
本期加权平均净值利润率	-4.72%	-22.78%	-1.55%
本期基金份额净值增长率	-0.35%	-14.58%	3.42%
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	510,673,263.40	247,866,030.86	169,127,030.53
期末可供分配基金份额利润	0.6379	0.6543	0.8332
期末基金资产净值	1,452,591,912.27	689,834,837.39	432,679,564.61
期末基金份额净值	1.8145	1.8209	2.1316
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	-11.96%	-11.65%	3.42%
-------------	---------	---------	-------

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) 富国中证 1000 指数增强 (LOF) 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	-1.97%	0.94%	-2.98%	0.98%	1.01%	-0.04%
过去六个月	-7.22%	0.92%	-10.28%	0.95%	3.06%	-0.03%
过去一年	-0.15%	0.88%	-5.91%	0.90%	5.76%	-0.02%
过去三年	8.82%	1.17%	-10.58%	1.21%	19.40%	-0.04%
过去五年	115.65%	1.31%	31.93%	1.37%	83.72%	-0.06%
自基金合同生效起至今	82.31%	1.29%	-4.50%	1.39%	86.81%	-0.10%

##### (2) 富国中证 1000 指数增强 (LOF) C

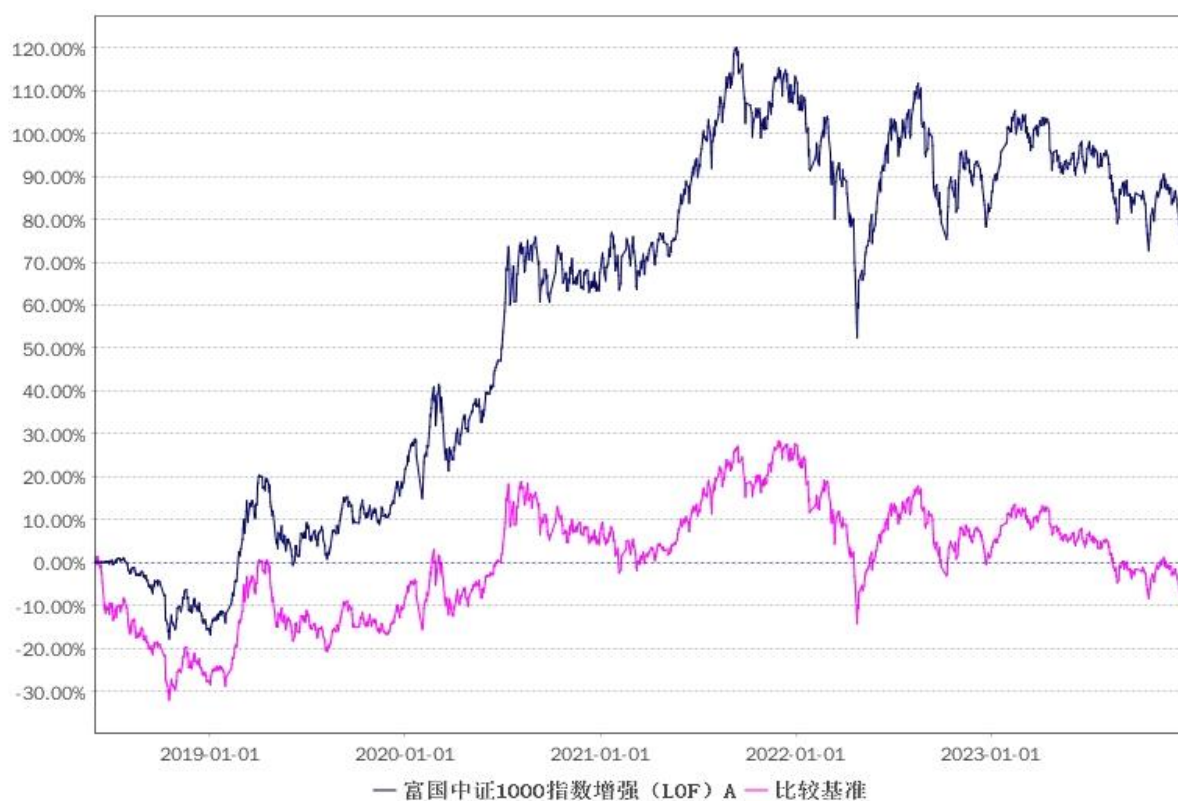
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.01%	0.94%	-2.98%	0.98%	0.97%	-0.04%
过去六个月	-7.31%	0.92%	-10.28%	0.95%	2.97%	-0.03%
过去一年	-0.35%	0.88%	-5.91%	0.90%	5.56%	-0.02%
自基金分级生效日起至今	-11.96%	1.19%	-20.01%	1.23%	8.05%	-0.04%

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中证 1000 指数增强 (LOF) A 基金累计净值增长

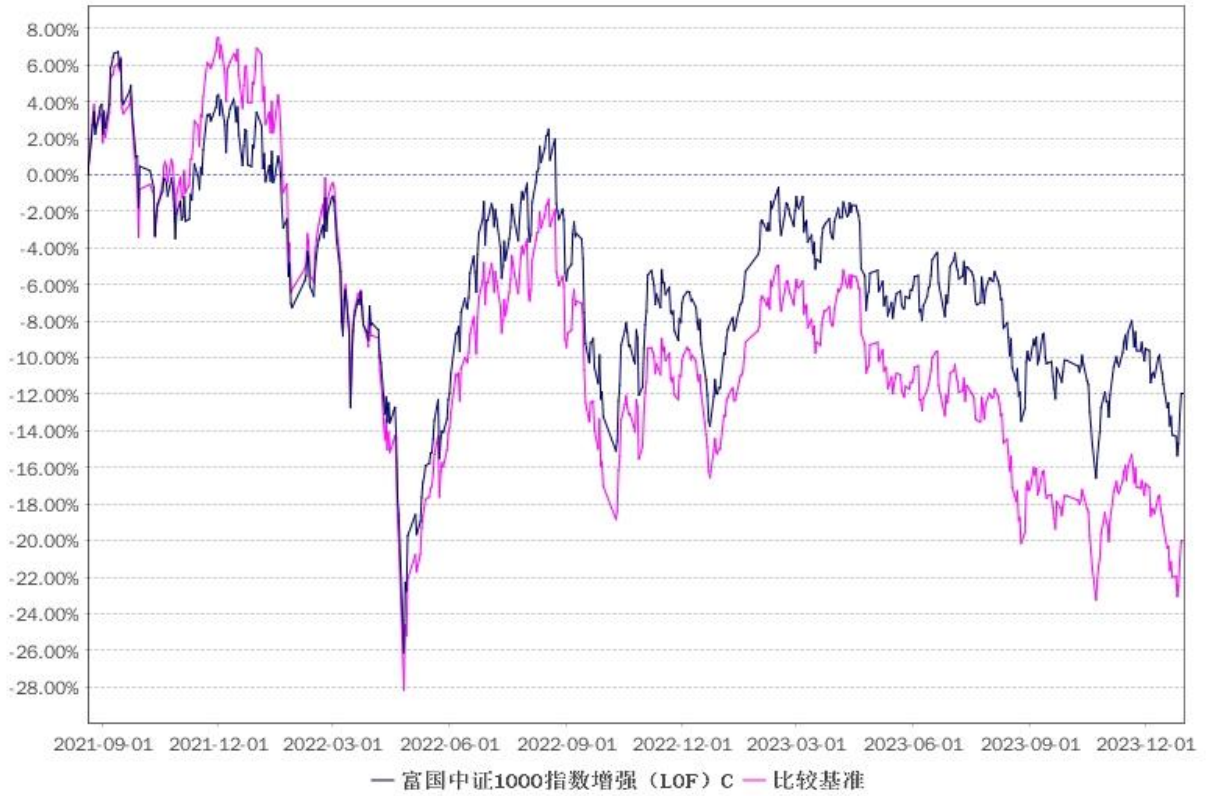
### 率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2023年12月31日。

2、本基金于2018年5月31日成立，建仓期6个月，从2018年5月31日起至2018年11月29日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2) 自基金合同生效以来富国中证1000指数增强(LOF)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

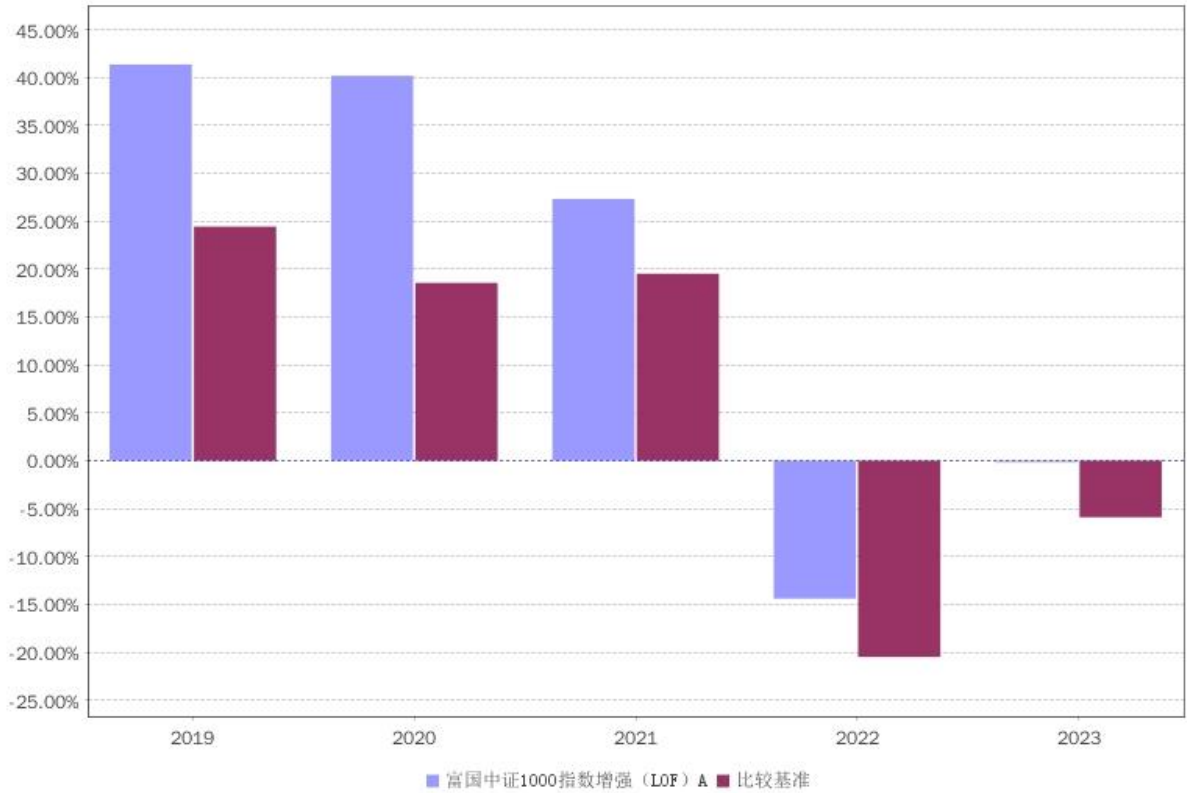


注：1、截止日期为 2023 年 12 月 31 日。

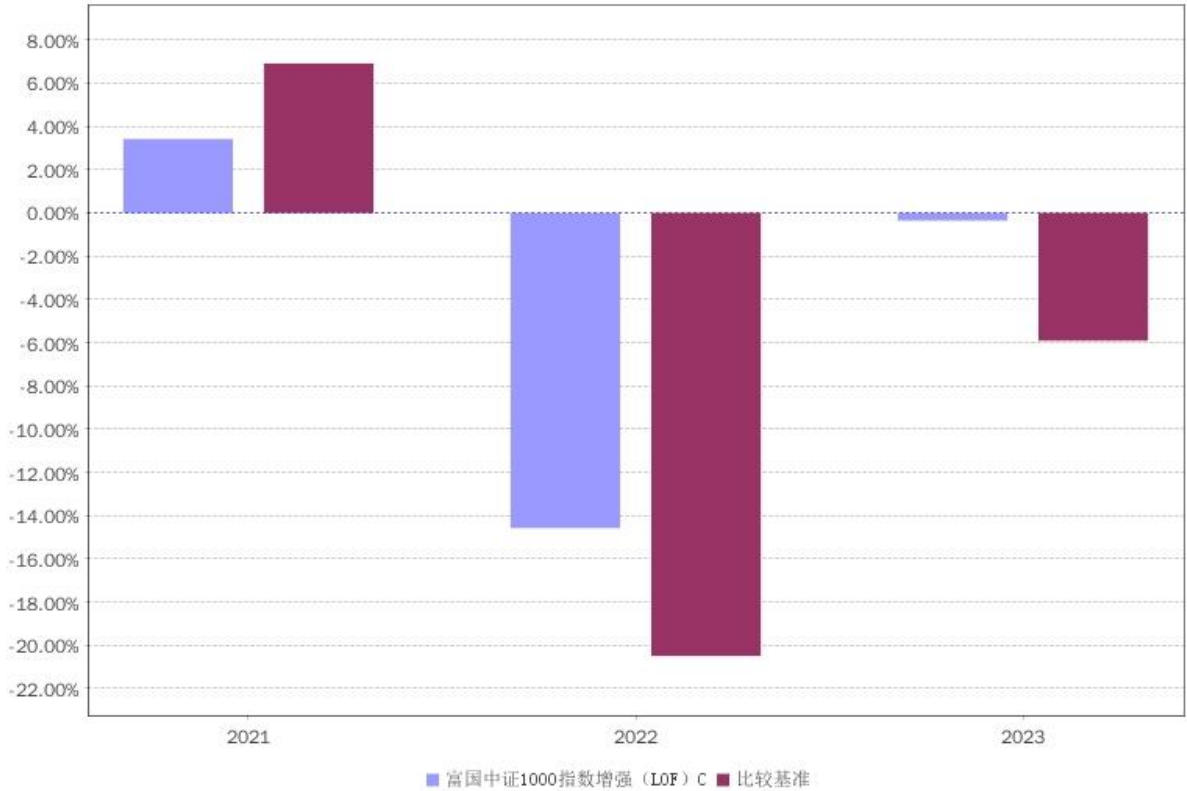
2、本基金自 2021 年 8 月 19 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

### 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) 过去五年以来富国中证 1000 指数增强 (LOF) 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) 过去五年以来富国中证 1000 指数增强 (LOF) 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2021年8月20日起有基金份额。2021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) 富国中证 1000 指数增强 (LOF) A

注：过往三年本基金未进行利润分配。

(2) 富国中证 1000 指数增强 (LOF) 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		
王保合	本基金现任基金经理	2022-10-27	—	18	博士，自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监、量化与海外投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。自 2011 年 03 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2011 年 03 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2015 年 04 月起任富国中证国有企业改革指数型证券投资基金（原富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金）基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证全指证券公司指数型证券投资基金（原富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金）基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证银行指数型证券投资基金（原富国中证银行指数分级证券投资基金）基金经理；自 2019 年 11 月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2019 年 12 月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2020 年 09 月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2022 年 10 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国创业板增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 09 月起任富国致弘量化选股股票型证券投资基金基金经理；自

					2023年12月起任富国致航量化选股股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
徐幼华	本基金现任基金经理	2018-05-31	—	19	硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资部经理助理；自2006年7月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监，量化与海外投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部副总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。自2011年05月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自2018年05月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金基金经理；自2018年05月起任富国中证1000指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自2018年07月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理；自2018年12月起任富国MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
方旻	本基金现任基金经理	2018-05-31	—	14	硕士，自2010年2月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、高级定量基金经理、量化投资部量化投资副总监、量化投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼资深定量基金经理。自2014年11月起任富国沪深300增强证券投资基金基金经理；自2014年11月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自2014年11月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自2014年11月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自2015

					<p>年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2018 年 05 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2019 年 01 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自 2020 年 02 月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	--	---

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）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 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）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25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

2023 年初以来，随着主要城市疫情高峰过去，疫情对经济的冲击逐步减小，投资者对 2023 年经济复苏预期变动更加乐观，A 股迎来开门红。进入 3 月，由于两会政府工作报告公布的 GDP 增速目标低于市场预期，市场迎来一轮快速调整。4 月以来，由于 3 月 PMI 验证经济进一步向好，提振市场信心。在经济弱复苏，流动性宽裕的背景下，人工智能相关板块迎来加速上涨。石油化工、建筑等板块在中特估及一带一路等主题概念的驱动下也迎来靓丽表现。进入 5 月中旬，由于金融、通胀数据均回落，指向经济内生动能不强，复苏斜率放缓压制市场情绪，同时海外银行业危机和债务违约风险持续发酵，引发市场担忧加剧，各板块均迎来快速调整。2023 年下半年以来，由于国内经济增长压力仍然较大，二季度 GDP 数据不及预期，人民币贬值压力再度加大，市场出现调整。7 月末，随着政治局会议超预期释放利好，美联储如期加息 25bps 但表态偏鸽，指数强势回升。进入 8 月，由于 7 月多项经济金融数据超预期回落，政治局会议后政策出台密度和力度不及预期，同时美债收益率大幅攀升、美联储连续放鹰等外部冲击持续，北向资金大幅流出。进入 4 季度，由于公布的 9 月地产数据超预期下行、物价延续走低等引发市场担忧，资金面出现赎回等负反馈，沪指下破 3000 点。另外，美十年期国债突破新高、巴以冲突等海外风险持续压制全球风险资产。随着中央汇金持续增持 ETF，叠加万亿国债增发出台，市场悲观情绪缓解，走出底部反弹态势，沪指重回 3000 点以上。11 月，海外利率快速下行带动市场走出谷底，但国内经济复苏依然偏缓，市场波折震荡。12 月，海外抢跑降息预期，但国内经济复苏再次放缓叠加政策预期较低，市场创出年内新低。总体来看，2023 年上证综指下跌 3.7%，沪深 300 下跌 11.38%，创业板指下跌 19.41%，中证 500 指数下跌 7.42%。在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极获取超额收益率。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值 A 级为 1.8231 元，C 级为 1.8145 元；份额累计净值 A 级为 1.8231 元，C 级为 1.8145 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为-0.15%，C 级为-0.35%，同期业绩比较基准收益率 A 级为-5.91%，C 级为-5.91%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，随着年初的快速调整，市场整体风险进一步释放，已具备较高的中长期配置价值。从政策层面看，呵护力度显著提升。其中，央行超预期降准，且下调支农支小再贷款、再贴现利率。房地产政策开始加码发力，“做好经营性物业贷款管理，满足房地产企业合理融资需求”，上海、苏州、广州等地购房政策进一步放开。从估值来看，1 月末市场估值处于历史低位，性价比凸显。沪深 300 指数股权风险溢价再次突破+2x 标准差，其估值分位数回落至近十年 13% 分位附近，创业板指已处于历史估值较低位。从中长期来看，市场具备较高的配置价值。

#### 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**

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一富国基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### **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**

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### **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**

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和

披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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_B109 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	富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）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，后附的富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）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，公允反映了富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）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，我们独立于富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵

	<p>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>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<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中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制</p>

	<p>之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所 (特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	王珊珊   费泽旭
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2024 年 03 月 28 日

## § 7 年度财务报告

### 7.1 资产负债表

会计主体: 富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2023 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	本期末	上年度末
----	-----	------



	2023年12月 31日	2022年12月31 日
<b>资产：</b>		
货币资金	183,593,140.66	197,909,774.22
结算备付金	18,671,402.26	26,050,676.79
存出保证金	202,439.33	602,264.58
交易性金融资产	3,066,626,126.6 2	2,487,674,308.26
其中：股票投资	3,057,404,834.2 3	2,486,337,207.56
基金投资	—	—
债券投资	9,221,292.39	1,337,100.70
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	152,859.71	150,009.92
应收股利	—	—
应收申购款	50,989,836.44	3,207,481.64
递延所得税资产	—	—
其他资产	501.29	9,599.14
资产总计	3,320,236,306.3 1	2,715,604,114.55
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末</b> 2023年12月 31日	<b>上年度末</b> 2022年12月31 日
<b>负 债：</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	—	—
应付赎回款	8,014,881.79	1,477,749.79
应付管理人报酬	2,809,097.88	2,456,465.38
应付托管费	421,364.71	368,469.82
应付销售服务费	243,499.57	135,494.58
应付投资顾问费	—	—
应交税费	114.66	2,005.21
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	3,226,818.21	4,276,370.77
负债合计	14,715,776.82	8,716,555.55

<b>净资产：</b>		
实收基金	1,816,900,462.5 6	1,483,528,856.30
其他综合收益	—	—
未分配利润	1,488,620,066.9 3	1,223,358,702.70
净资产合计	3,305,520,529.4 9	2,706,887,559.00
负债和净资产总计	3,320,236,306.3 1	2,715,604,114.55

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.8193 元，基金份额总额 1,816,900,462.56 份。其中：富国中证 1000 指数增强（LOF）A 份额净值 1.8231 元，份额总额 1,016,344,929.26 份；富国中证 1000 指数增强（LOF）C 份额净值 1.8145 元，份额总额 800,555,533.30 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

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)
<b>一、营业总收入</b>	3,632,941.47	-469,049,629.31
1.利息收入	2,312,139.35	3,815,657.83
其中：存款利息收入	2,147,131.79	2,601,950.66
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	165,007.56	1,213,707.17
2.投资收益（损失以“-”填列）	20,582,076.50	-207,957,785.77
其中：股票投资收益	-18,250,764.28	-225,931,729.53
基金投资收益	—	—
债券投资收益	3,272,417.26	1,764,306.28
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	-11,323,970.16
股利收益	35,560,423.52	27,533,607.64
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）	-20,278,818.45	-267,512,349.08
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,017,544.07	2,604,847.71
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>38,289,090.21</b>	<b>34,414,678.34</b>
1. 管理人报酬	30,997,967.11	28,317,113.40
2. 托管费	4,649,695.13	4,247,567.00
3. 销售服务费	1,960,076.31	1,187,797.45
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	601.54	19,245.29
8. 其他费用	680,750.12	642,955.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-34,656,148.74</b>	<b>-503,464,307.65</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-34,656,148.74</b>	<b>-503,464,307.65</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>	<b>—</b>	<b>—</b>
<b>六、综合收益总额</b>	<b>-34,656,148.74</b>	<b>-503,464,307.65</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

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	1,483,528,856.30	1,223,358,702.70	2,706,887,559.00
二、本期期初净资产	1,483,528,856.30	1,223,358,702.70	2,706,887,559.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	333,371,606.26	265,261,364.23	598,632,970.49
（一）、综合收益总额	—	34,656,148.74	34,656,148.74
（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）	333,371,606.26	299,917,512.97	633,289,119.23
其中：1. 基金申购款	1,497,275,928.85	1,388,887,621.68	2,886,163,550.53
2. 基金赎回款	—	—	—
	1,163,904,322.59	1,088,970,108.71	2,252,874,431.30

(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	1,816,900,462.56	1,488,620,066.93	3,305,520,529.49
	上年度可比期间 (2022年01月01日至2022年12月31日)		
项目	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,018,427,188.78	1,153,714,265.30	2,172,141,454.08
二、本期期初净资产	1,018,427,188.78	1,153,714,265.30	2,172,141,454.08
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	465,101,667.52	69,644,437.40	534,746,104.92
(一)、综合收益总额	—	503,464,307.65	503,464,307.65
(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)	465,101,667.52	573,108,745.05	1,038,210,412.57
其中：1.基金申购款	2,255,291,709.21	2,189,930,830.42	4,445,222,539.63
2.基金赎回款	—	—	—
	1,790,190,041.69	1,616,822,085.37	3,407,012,127.06
(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	1,483,528,856.30	1,223,358,702.70	2,706,887,559.00

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

富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]30号

文《关于准予富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）注册的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集。基金合同于 2018 年 5 月 31 日正式生效，首次设立募集规模为 512,114,043.76 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人于 2021 年 8 月 17 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自 2021 年 8 月 19 日起，本基金增加 C 类份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，A 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，C 类基金份额的注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 1000 指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与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：本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股的资产（均含存托凭证）不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，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 1000 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

#### **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) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入。出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入计入投资收益；

(8) 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分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额的持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(2) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、监管部门规定以及基金合同的约定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，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，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

#### **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	183,593,140.66	197,909,774.22
等于：本金	183,545,449.23	197,868,162.23
加：应计利息	47,691.43	41,611.99
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	183,593,140.66	197,909,774.22

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	3,269,316,203.49	—	3,057,404,834.23	211,911,369.26	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	9,049,156.00	170,112.39	9,221,292.39	2,024.00
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	9,049,156.00	170,112.39	9,221,292.39	2,024.00
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	

其他	—	—	—	—
合计	3,278,365,35 9.49	170,112.39	3,066,626,12 6.62	211,909,345. 26
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	2,678,190,58 9.17	—	2,486,337,20 7.56	— 191,853,381. 61
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	1,114,000.00	245.90	1,337,100.70 222,854.80
	银行间市场	—	—	—
	合计	1,114,000.00	245.90	1,337,100.70 222,854.80
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,679,304,58 9.17	245.90	2,487,674,30 8.26	— 191,630,526. 81

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购中取得的债券。

### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
应收利息	—	—
其他应收款	—	—
待摊费用	—	—
转融通证券出借利息	501.29	9,599.14



合计	501.29	9,599.14
----	--------	----------

#### 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	2,591.91	1,992.76
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	2,922,658.85	3,976,775.82
其中：交易所市场	2,922,658.85	3,976,775.82
银行间市场	—	—
应付利息	—	—
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提审计费	55,000.00	55,000.00
应付指数使用费	126,567.45	122,602.19
合计	3,226,818.21	4,276,370.77

#### 7.4.7.7 实收基金

富国中证1000指数增强（LOF）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	1,104,692,396.88	1,104,692,396.88
本期申购	395,169,213.30	395,169,213.30
本期赎回（以“-”号填列）	-483,516,680.92	-483,516,680.92
本期末	1,016,344,929.26	1,016,344,929.26

富国中证1000指数增强（LOF）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	378,836,459.42	378,836,459.42
本期申购	1,102,106,715.55	1,102,106,715.55
本期赎回（以“-”号填列）	-680,387,641.67	-680,387,641.67
本期末	800,555,533.30	800,555,533.30

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

富国中证1000指数增强（LOF）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	728,380,062.65	183,980,262.08	912,360,324.73
本期期初	728,380,062.65	183,980,262.08	912,360,324.73

本期利润	2,743,100.37	8,936,182.00	11,679,282.37
本期基金份额交易产生的变动数	-73,815,600.04	-13,640,319.10	-87,455,919.14
其中：基金申购款	265,432,614.13	101,136,011.91	366,568,626.04
基金赎回款	-	-	-454,024,545.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	657,307,562.98	179,276,124.98	836,583,687.96

富国中证1000指数增强（LOF）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	247,866,030.86	63,132,347.11	310,998,377.97
本期期初	247,866,030.86	63,132,347.11	310,998,377.97
本期利润	-17,120,430.66	-29,215,000.45	-46,335,431.11
本期基金份额交易产生的变动数	279,927,663.20	107,445,768.91	387,373,432.11
其中：基金申购款	749,582,942.86	272,736,052.78	1,022,318,995.64
基金赎回款	-	-	-634,945,563.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	510,673,263.40	141,363,115.57	652,036,378.97

#### 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	1,672,325.93	2,226,470.39
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	317,409.52	244,498.51
其他	157,396.34	130,981.76
合计	2,147,131.79	2,601,950.66

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

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）
股票投资收益——买卖股票差价收入	-18,250,764.28	-225,931,729.53
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-

合计	-18,250,764.28	-225,931,729.53
----	----------------	-----------------

#### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（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	8,732,284,283.99	7,996,928,689.90
减：卖出股票成本总额	8,728,510,699.53	8,198,361,851.04
减：交易费用	22,024,348.74	24,498,568.39
买卖股票差价收入	-18,250,764.28	-225,931,729.53

#### 7.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 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	115,922.65	2,088.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,156,494.61	1,762,217.34
合计	3,272,417.26	1,764,306.28

##### 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	15,428,442.69	9,077,871.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,269,000.00	7,313,500.00
减：应计利息总额	2,330.89	1,949.27
减：交易费用	617.19	205.29

买卖债券差价收入	3,156,494.61	1,762,217.34
----------	--------------	--------------

#### 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	—	-11,323,970.16

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（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	35,560,423.52	27,533,607.64
其中：证券出借权益补偿收入	19,127.75	1,027,632.87
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	35,560,423.52	27,533,607.64

#### 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	-20,278,818.45	-267,512,349.08
股票投资	-20,057,987.65	-267,694,658.48
债券投资	-220,830.80	182,309.40
资产支持证券投资	—	—
基金投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他	—	—
2. 衍生工具	—	—
权证投资	—	—
3. 其他	—	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—	—
合计	-20,278,818.45	-267,512,349.08

#### 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	1,012,435.91	2,598,019.35
基金转换费收入	5,108.16	6,828.36
合计	1,017,544.07	2,604,847.71

#### 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	55,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
银行费用	9,756.77	14,881.39
指数使用费	495,967.48	453,073.81
其他	25.87	—
合计	680,750.12	642,955.20

## 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
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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
海通期货股份有限公司	基金管理人的股东控制的子公司、基金代销机构
申万宏源西部证券有限公司	基金管理人的股东控制的子公司、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
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
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金
富国鑫汇养老目标日期 2045 五年持有期混合发起式（FOF）	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 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	1,957,121,895.05	10.86	2,062,437,722.12	12.19
申万宏源	1,566,678,497.62	8.69	1,624,779,404.09	9.60

#### 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	1,156,528.00	4.77	621,055.91	6.84
申万宏源	609,625.51	2.52	2,577,311.23	28.39

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（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	1,424,117.78	10.89	593,455.09	20.31
申万宏源	1,140,861.09	8.73	477,267.96	16.33
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	1,802,585.05	12.02	552,981.40	13.91
申万宏源	1,439,739.86	9.60	245,192.31	6.17

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	30,997,967.11	28,317,113.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,760,669.63	5,592,198.70
应支付基金管理人的净管理费	25,237,297.48	22,724,914.70

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.0%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（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	4,649,695.13	4,247,567.00

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）
------------	-----------------------------



关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国中证 1000 指数增强 (LOF) A	富国中证 1000 指数增强 (LOF) C	合计
富国基金管理有限公司	—	1,198,300.70	1,198,300.70
海通证券股份有限公司	—	146.88	146.88
申万宏源西部证券有限公司	—	1.58	1.58
申万宏源证券有限公司	—	565.64	565.64
合计	—	1,199,014.80	1,199,014.80

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		
	富国中证 1000 指数增强 (LOF) A	富国中证 1000 指数增强 (LOF) C	合计
富国基金管理有限公司	—	606,880.40	606,880.40
海通期货股份有限公司	—	0.18	0.18
海通证券股份有限公司	—	166.62	166.62
申万宏源西部证券有限公司	—	4.51	4.51
申万宏源证券有限公司	—	468.65	468.65
合计	—	607,520.36	607,520.36

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

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

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

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

销售服务费每日计提，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

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	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
海通证券	10,580,220.00	6,853.24	—	—
申万宏源	22,507,091.00	14,510.79	—	—

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。

##### 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

金额单位：人民币元

本期（2023年01月01日至2023年12月31日）						
关联方名称	交易金额	费率区间（%）	加权平均费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
海通证券	2,828,161.00	3.10~7.00	4.10	4,018.03	—	—
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	交易金额	费率区间（%）	加权平均费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
海通证券	5,716,782.00	3.20	3.20	7,105.71	—	—

申万宏源	3,318,228.00	3.20~ 3.40	3.26	4,084.45	—	—
------	--------------	---------------	------	----------	---	---

#### 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

份额单位：份

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）	
	富国中证1000指数增强（LOF）A	富国中证1000指数增强（LOF）C	富国中证1000指数增强（LOF）A	富国中证1000指数增强（LOF）C
基金合同生效日（2018年05月31日）持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	14,851,583.18	485.18	14,851,583.18	485.18
期间申购/买入总份额	—	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	485.18	—	—
期末持有的基金份额	14,851,583.18	—	14,851,583.18	485.18
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.46%	—	1.34%	0.00%

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

##### 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

富国中证1000指数增强（LOF）C：

份额单位：份

关联方名称	本期末（2023年12月31日）		上期末（2022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（%）
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	6,224,605.66	0.78	—	—

富国鑫汇养老目标日期2045五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	2,546,471.24	0.32	—	—
-------------------------------------	--------------	------	---	---

#### 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
中国农业银行股份有限公司	183,593,140.66	1,672,325.93	197,909,774.22	2,226,470.39

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2023年01月01日至2023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	301525	儒竞科技	IPO网下申购	2,660	264,856.20
海通证券股份有限公司	301568	思泰克	IPO网下申购	2,456	57,052.88
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	603193	润本股份	IPO网下申购	3,022	52,522.36
海通证券股份有限公司	688347	华虹公司	IPO网下申购	82,606	4,295,512.00
海通证券股份有限公司	688469	芯联集成	IPO网下申购	137,994	785,185.86
海通证券股份有限公司	688507	索辰科技	IPO网下申购	1,495	367,112.20
海通证券股份有限公司	688515	裕太微	IPO网下申购	4,183	386,760.18
海通证券股份有限公司	688531	日联科技	IPO网下申购	3,460	527,234.80
海通证券股份有限公司	688548	广钢气体	IPO网下申购	40,476	399,498.12

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	688271	联影医疗	IPO网下申购	7,365	813,312.53
海通证券股份有限公司	688220	翱捷科技	IPO网下申购	11,039	1,825,438.85
海通证券股份有限公司	688062	迈威生物	IPO网下申购	27,002	944,367.95
海通证券股份有限公司	688073	毕得医药	IPO网下申购	2,544	224,991.36
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	688267	中触媒	IPO网下申购	3,390	142,751.21

#### 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：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
001239	永达股份	2023-12-04	6个月	新股限售	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	—
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月	新股限售	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	—
001326	联域股份	2023-11-01	6个月	新股限售	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	—
001358	兴欣新材	2023-12-14	6个月	新股限售	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	—
001378	德冠新材	2023-10-23	6个月	新股限售	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	—
300904	威力传动	2023-08-02	6个月	新股限售	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	—
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股限售	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	—
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	新股限售	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	—
301251	威尔高	2023-08-30	6个月	新股限售	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	—
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股限售	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	—
301272	英华特	2023-07-06	6个月	新股限售	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	—
301329	信音电子	2023-07-05	6个月	新股限售	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	—

301348	蓝箭电子	2023-08-01	6个月	新股限售	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	—
301362	民爆光电	2023-07-27	6个月	新股限售	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	—
301372	科净源	2023-08-03	6个月	新股限售	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	—
301393	昊帆生物	2023-07-05	6个月	新股限售	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	—
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新股限售	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	—
301413	安培龙	2023-12-11	6个月	新股限售	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	—
301418	协昌科技	2023-08-10	6个月	新股限售	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	—
301421	波长光电	2023-08-16	6个月	新股限售	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	—
301456	盘古智能	2023-07-06	6个月	新股限售	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	—
301468	博盈特焊	2023-07-12	6个月	新股限售	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	—
301469	恒达新材	2023-08-10	6个月	新股限售	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	—
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	新股限售	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	—
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股限售	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	—
301489	思泉新材	2023-10-16	6个月	新股限售	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	—
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6个月	新股限售	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	—
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月	新股限售	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	—
301505	苏州规划	2023-07-12	6个月	新股限售	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	—
301508	中机认检	2023-11-23	6个月	新股限售	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	—
301509	金凯生科	2023-07-26	6个月	新股限售	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	—
301510	固高科技	2023-08-04	6个月	新股限售	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	—
301511	德福科技	2023-08-08	6个月	新股限售	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	—
301515	港通医疗	2023-07-13	6个月	新股限售	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	—
301516	中远通	2023-12-01	6个月	新股限售	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	—
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月	新股限售	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	—
301518	长华化学	2023-07-26	6个月	新股限售	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	—
301520	万邦医药	2023-09-18	6个月	新股限售	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	—
301525	儒竞科技	2023-08-23	6个月	新股限售	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	—
301528	多浦乐	2023-08-17	6个月	新股限售	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	—
301533	威马农机	2023-08-07	6个月	新股限售	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	—
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月	新股限售	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	—
301555	惠柏新材	2023-10-24	6个月	新股限售	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	—
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	新股限售	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	—
301568	思泰克	2023-11-21	6个月	新股限售	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	—
301578	辰奕智能	2023-12-21	6个月	新股限售	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	—
601083	锦江航运	2023-11-28	6个月	新股限售	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	—
601096	宏盛华源	2023-12-15	6个月	新股限售	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	—
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6个月	新股限售	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	—
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6个月	新股限售	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	—
603107	上海汽配	2023-10-25	6个月	新股限售	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	—
603193	润本股份	2023-10-09	6个月	新股限售	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	—
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6个月	新股限售	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	—

603275	众辰科技	2023-08-16	6个月	新股限售	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	—
603276	恒兴新材	2023-09-18	6个月	新股限售	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	—
603296	华勤技术	2023-08-01	6个月	新股限售	80.80	77.75	593	47,914.40	46,105.75	—
603373	安邦护卫	2023-12-13	6个月	新股限售	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	—
688347	华虹公司	2023-07-27	6个月	新股限售	52.00	42.06	57,825	3,006,900.00	2,432,119.50	—
688548	广钢气体	2023-08-08	6个月	新股限售	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	—
688563	航材股份	2023-07-12	6个月	新股限售	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	—
688591	泰凌微	2023-08-18	6个月	新股限售	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	—
688592	司南导航	2023-08-07	6个月	新股限售	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	—
688602	康鹏科技	2023-07-13	6个月	新股限售	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	—
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股限售	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	—
688610	埃科光电	2023-07-10	6个月	新股限售	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	—
688612	威迈斯	2023-07-19	6个月	新股限售	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	—
688627	精智达	2023-07-11	6个月	新股限售	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	—
688638	誉辰智能	2023-07-04	6个月	新股限售	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	—
688646	逸飞激光	2023-07-21	6个月	新股限售	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	—
688648	中邮科技	2023-11-06	6个月	新股限售	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	—
688651	盛邦安全	2023-07-19	6个月	新股限售	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	—
688652	京仪装备	2023-11-22	6个月	新股限售	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	—
688653	康希通信	2023-11-10	6个月	新股限售	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	—
688671	碧兴物联	2023-08-02	6个月	新股限售	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	—
688702	盛科通信	2023-09-06	6个月	新股限售	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	—
688719	爱科赛博	2023-09-20	6个月	新股限售	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	—
688720	艾森股份	2023-11-29	6个月	新股限售	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	—

#### 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113069	博23转债	2023-12-22	1个月内(含)	认购新发证券	100.00	100.01	1,940	194,000.00	194,012.76	—
127100	神码转债	2023-12-21	1个月内(含)	认购新发证券	100.00	100.01	563	56,300.00	56,304.07	—

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	--------------	--------	--------	----

						价				
688337	普源精电	2023年12月25日	重大事项停牌	43.87	2024年01月09日	41.72	69,137.00	3,405,861.50	3,033,040.19	-

### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000521	长虹美菱	2024年01月04日-2024年01月11日	5.63	13,000	73,190.00
2	688403	汇成股份	2024年01月04日	10.55	12,400	130,820.00
3	600826	兰生股份	2024年01月05日-2024年01月09日	8.84	11,700	103,428.00
4	002060	粤水电	2024年01月03日	4.91	6,600	32,406.00
5	300634	彩讯股份	2024年01月04日	20.47	6,000	122,820.00
6	600869	远东股份	2024年01月03日	4.39	4,200	18,438.00
7	688510	航亚科技	2024年01	17.62	4,000	70,480.00



			月 12 日			
8	688147	微导纳米	2024 年 01 月 05 日- 2024 年 01 月 11 日	38.99	3,400	132,566.00
9	688258	卓易信息	2024 年 01 月 12 日	49.50	2,600	128,700.00
10	002108	沧州明珠	2024 年 01 月 03 日	4.11	2,500	10,275.00
11	300693	盛弘股份	2024 年 01 月 03 日	29.91	2,500	74,775.00
12	688503	聚和材料	2024 年 01 月 04 日- 2024 年 01 月 11 日	53.60	2,400	128,640.00
13	300842	帝科股份	2024 年 01 月 10 日	70.55	1,800	126,990.00
14	603688	石英股份	2024 年 01 月 11 日	86.88	1,600	139,008.00
15	600888	新疆众和	2024 年 01 月 03 日	7.24	1,600	11,584.00
16	603906	龙蟠科技	2024 年 01 月 03 日	12.46	1,200	14,952.00
17	002458	益生股份	2024 年 01 月 02 日	10.76	1,000	10,760.00
18	600711	盛屯矿业	2024 年 01 月 03 日	4.34	1,000	4,340.00
19	300394	天孚通信	2024 年 01 月 09 日	91.52	1,000	91,520.00
20	300182	捷成股份	2024 年 01 月 08 日	5.08	1,000	5,080.00
21	301278	快可电子	2024 年 01 月 04 日	58.25	1,000	58,250.00
合计	-	-	-	-	82,500.00	1,489,022.00

#### 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	250,316.83	1,337,100.70
未评级	—	—
合计	250,316.83	1,337,100.70

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。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末无重大流动性风险。

#### **7.4.13.4 市场风险**

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

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为货币资金、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	183,593,140.66	—	—	—	—	—	183,593,140.66
结算备付金	18,671,402.26	—	—	—	—	—	18,671,402.26
存出保证金	202,439.33	—	—	—	—	—	202,439.33
交易性金融资产	8,970,975.56	—	250,316.83	—	—	3,057,404,834.23	3,066,626,126.62
应收清算款	—	—	—	—	—	152,859.71	152,859.71
其他资产	—	—	—	—	—	501.29	501.29
应收申购款	30,027,348.39	—	—	—	—	20,962,488.05	50,989,836.44
资产总计	241,465,306.20	—	250,316.83	—	—	3,078,520,683.28	3,320,236,306.31
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	8,014,881.79	8,014,881.79
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,809,097.88	2,809,097.88
应付托管费	—	—	—	—	—	421,364.71	421,364.71
应付销售服务费	—	—	—	—	—	243,499.57	243,499.57
应交税费	—	—	—	—	—	114.66	114.66
其他负债	—	—	—	—	—	3,226,818.21	3,226,818.21
负债总计	—	—	—	—	—	14,715,776.82	14,715,776.82
利率敏感度缺口	241,465,306.20	—	250,316.83	—	—	3,063,804,906.46	3,305,520,529.49
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	197,909,774.22	—	—	—	—	—	197,909,774.22
结算备付金	26,050,676.79	—	—	—	—	—	26,050,676.79
存出保证金	602,264.58	—	—	—	—	—	602,264.58
交易性金融资产	—	—	1,337,100.70	—	—	2,486,337,207.56	2,487,674,308.26
应收清算款	—	—	—	—	—	150,009.92	150,009.92
其他资产	—	—	—	—	—	9,599.14	9,599.14
应收申购款	43,366.88	—	—	—	—	3,164,114.76	3,207,481.64
资产总计	224,606,082.47	—	1,337,100.70	—	—	2,489,660,931.38	2,715,604,114.55
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	1,477,749.79	1,477,749.79
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,456,465.38	2,456,465.38
应付托管费	—	—	—	—	—	368,469.82	368,469.82
应付销售服务费	—	—	—	—	—	135,494.58	135,494.58
应交税费	—	—	—	—	—	2,005.21	2,005.21
其他负债	—	—	—	—	—	4,276,370.77	4,276,370.77
负债总计	—	—	—	—	—	8,716,555.55	8,716,555.55
利率敏感度缺口	224,606,082.47	—	1,337,100.70	—	—	2,480,944,375.83	2,706,887,559.00

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。		
	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）
分析	1. 基准点利率增加 0.1%	-368.71	—
	2. 基准点利率减少 0.1%	368.71	—

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 1000 指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换

债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（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	3,057,404,834.23	92.49	2,486,337,207.56	91.85
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	9,221,292.39	0.28	1,337,100.70	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	3,066,626,126.62	92.77	2,487,674,308.26	91.90

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

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



	相关风险变量的变动	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）
分析	1. 业绩比较基准增加 1%	31,937,908.62	25,978,030.64
	2. 业绩比较基准减少 1%	-31,937,908.62	-25,978,030.64

#### 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	3,050,919,053.54	2,466,201,715.84
第二层次	12,267,112.46	1,998,109.50
第三层次	3,439,960.62	19,474,482.92
合计	3,066,626,126.62	2,487,674,308.26

###### 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	—	19,474,482.92	19,474,482.92
当期购买	—	22,842,205.50	22,842,205.50
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	37,319,954.95	37,319,954.95
当期利得或损失总额	—	-1,556,772.85	-1,556,772.85
其中：计入损益的利得或损失	—	-1,556,772.85	-1,556,772.85
期末余额	—	3,439,960.62	3,439,960.62
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	—	-506,814.17	-506,814.17
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	—	39,387,018.25	39,387,018.25
当期购买	—	23,935,229.38	23,935,229.38
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	31,097,478.30	31,097,478.30
当期利得或损失总额	—	-12,750,286.41	-12,750,286.41
其中：计入损益的利得或损失	—	-12,750,286.41	-12,750,286.41
期末余额	—	19,474,482.92	19,474,482.92

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	—	-4,460,746.46	-4,460,746.46
--	---	---------------	---------------

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	3,439,960.62	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	0.1462-2.1775	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	19,474,482.92	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2127-2.4756	负相关

#### 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	3,057,404,834.23	92.08
	其中：股票	3,057,404,834.23	92.08
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	9,221,292.39	0.28
	其中：债券	9,221,292.39	0.28
	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	202,264,542.92	6.09
8	其他各项资产	51,345,636.77	1.55
9	合计	3,320,236,306.31	100.00

注：本基金通过转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 1,489,022.00 元，占资产净值比例为 0.05%。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

##### 8.2.1.1 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,168,320.00	0.07
B	采矿业	41,902,160.00	1.27
C	制造业	318,680,523.79	9.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,274,272.00	0.83
E	建筑业	2,355,543.00	0.07
F	批发和零售业	21,233,952.42	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	9,838,579.41	0.30
H	住宿和餐饮业	3,353,820.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,350,893.63	1.61
J	金融业	3,812,661.60	0.12

K	房地产业	5,905,361.00	0.18
L	租赁和商务服务业	3,440,330.55	0.10
M	科学研究和技术服务业	11,881,252.52	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	4,014,856.29	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	4,579,686.11	0.14
R	文化、体育和娱乐业	22,245,000.20	0.67
S	综合	—	—
	合计	536,037,212.52	16.22

### 8.2.1.2 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,609,423.77	0.08
B	采矿业	45,144,221.00	1.37
C	制造业	1,715,716,804.78	51.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,181,266.10	1.52
E	建筑业	44,993,984.48	1.36
F	批发和零售业	56,186,383.16	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	18,744,133.40	0.57
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	395,679,825.45	11.97
J	金融业	50,632,007.36	1.53
K	房地产业	45,256,216.21	1.37
L	租赁和商务服务业	6,118,022.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	21,362,238.24	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	2,715,884.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	11,935,448.00	0.36
R	文化、体育和娱乐业	52,312,379.76	1.58
S	综合	1,779,384.00	0.05
	合计	2,521,367,621.71	76.28

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

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

					(%)
1	600572	康恩贝	5,373,070	27,134,003.50	0.82
2	000650	仁和药业	3,887,100	25,771,473.00	0.78
3	603328	依顿电子	2,756,200	22,463,030.00	0.68
4	002085	万丰奥威	4,477,680	22,119,739.20	0.67
5	300303	聚飞光电	3,266,300	19,369,159.00	0.59
6	002421	达实智能	5,994,400	19,301,968.00	0.58
7	002130	沃尔核材	2,494,400	18,832,720.00	0.57
8	002646	天佑德酒	1,344,890	18,303,952.90	0.55
9	600797	浙大网新	2,746,800	18,019,008.00	0.55
10	601212	白银有色	6,666,100	17,931,809.00	0.54
11	600812	华北制药	3,132,500	17,855,250.00	0.54
12	601369	陕鼓动力	2,218,502	17,703,645.96	0.54
13	002390	信邦制药	3,922,700	17,416,788.00	0.53
14	000969	安泰科技	1,927,273	17,326,184.27	0.52
15	300319	麦捷科技	1,789,200	17,247,888.00	0.52
16	000758	中色股份	3,814,802	17,166,609.00	0.52
17	600312	平高电气	1,277,100	16,206,399.00	0.49
18	600285	羚锐制药	937,092	16,033,644.12	0.49
19	601801	皖新传媒	2,255,100	15,672,945.00	0.47
20	001696	宗申动力	2,272,400	15,066,012.00	0.46
21	000682	东方电子	1,861,669	14,986,435.45	0.45
22	002488	金固股份	2,050,900	14,725,462.00	0.45
23	000597	东北制药	2,747,600	14,699,660.00	0.44
24	688158	优刻得	863,251	14,200,478.95	0.43
25	300271	华宇软件	1,709,524	14,001,001.56	0.42
26	300369	绿盟科技	1,468,900	13,851,727.00	0.42
27	600711	盛屯矿业	3,159,000	13,710,060.00	0.41
28	002174	游族网络	1,180,800	13,531,968.00	0.41
29	300457	赢合科技	730,376	13,468,133.44	0.41
30	601375	中原证券	3,480,300	13,329,549.00	0.40
31	603920	世运电路	720,800	13,176,224.00	0.40
32	603236	移远通信	244,234	13,127,577.50	0.40
33	300497	富祥药业	1,353,162	12,665,596.32	0.38
34	002467	二六三	2,709,387	12,571,555.68	0.38
35	603881	数据港	631,680	12,519,897.60	0.38
36	600761	安徽合力	686,780	12,506,263.80	0.38
37	300366	创意信息	918,849	12,055,298.88	0.36
38	600480	凌云股份	1,306,900	11,905,859.00	0.36
39	600562	国睿科技	846,200	11,711,408.00	0.35
40	300233	金城医药	702,100	11,696,986.00	0.35

41	603123	翠微股份	1,069,432	11,389,450.80	0.34
42	300109	新开源	622,015	11,221,150.60	0.34
43	002171	楚江新材	1,486,300	11,117,524.00	0.34
44	600273	嘉化能源	1,285,500	11,042,445.00	0.33
45	600391	航发科技	562,700	10,758,824.00	0.33
46	600578	京能电力	3,621,300	10,719,048.00	0.32
47	002274	华昌化工	1,405,300	10,610,015.00	0.32
48	600869	远东股份	2,410,100	10,580,339.00	0.32
49	600073	上海梅林	1,550,612	10,559,667.72	0.32
50	300476	胜宏科技	572,100	10,555,245.00	0.32
51	002617	露笑科技	1,682,900	10,433,980.00	0.32
52	300596	利安隆	350,600	10,363,736.00	0.31
53	600252	中恒集团	4,120,003	10,341,207.53	0.31
54	002768	国恩股份	476,300	10,202,346.00	0.31
55	603323	苏农银行	2,414,395	10,043,883.20	0.30
56	002484	江海股份	625,100	10,039,106.00	0.30
57	603985	恒润股份	403,300	10,022,005.00	0.30
58	300166	东方国信	1,060,600	9,969,640.00	0.30
59	688368	晶丰明源	90,367	9,754,213.98	0.30
60	300134	大富科技	943,600	9,737,952.00	0.29
61	603989	艾华集团	451,085	9,707,349.20	0.29
62	300068	南都电源	748,774	9,689,135.56	0.29
63	002283	天润工业	1,635,200	9,565,920.00	0.29
64	300613	富瀚微	223,400	9,481,096.00	0.29
65	000921	海信家电	461,000	9,404,400.00	0.28
66	601019	山东出版	996,900	9,350,922.00	0.28
67	688100	威胜信息	319,162	9,230,165.04	0.28
68	000990	诚志股份	1,097,700	9,012,117.00	0.27
69	002456	欧菲光	1,020,300	8,886,813.00	0.27
70	601606	长城军工	725,600	8,837,808.00	0.27
71	300639	凯普生物	945,628	8,832,165.52	0.27
72	002396	星网锐捷	486,000	8,782,020.00	0.27
73	000517	荣安地产	3,536,400	8,664,180.00	0.26
74	301308	江波龙	94,000	8,652,700.00	0.26
75	002838	道恩股份	668,000	8,557,080.00	0.26
76	300352	北信源	1,782,826	8,468,423.50	0.26
77	300451	创业慧康	1,274,800	8,349,940.00	0.25
78	000951	中国重汽	623,070	8,324,215.20	0.25
79	600267	海正药业	887,100	8,303,256.00	0.25
80	002261	拓维信息	550,500	8,279,520.00	0.25
81	600266	城建发展	1,707,700	8,265,268.00	0.25

82	002097	山河智能	1,340,400	8,216,652.00	0.25
83	603766	隆鑫通用	1,586,100	8,184,276.00	0.25
84	603530	神马电力	392,000	8,130,080.00	0.25
85	002534	西子洁能	646,427	8,073,873.23	0.24
86	603010	万盛股份	747,200	8,062,288.00	0.24
87	000811	冰轮环境	593,200	8,049,724.00	0.24
88	002332	仙琚制药	629,000	8,032,330.00	0.24
89	601609	金田股份	1,179,300	7,983,861.00	0.24
90	000901	航天科技	849,200	7,914,544.00	0.24
91	600110	诺德股份	1,396,800	7,877,952.00	0.24
92	300079	数码视讯	1,378,500	7,843,665.00	0.24
93	688106	金宏气体	324,078	7,807,039.02	0.24
94	300671	富满微	236,400	7,642,812.00	0.23
95	601949	中国出版	942,000	7,611,360.00	0.23
96	601869	长飞光纤	276,602	7,595,490.92	0.23
97	002581	未名医药	516,600	7,542,360.00	0.23
98	000950	重药控股	1,517,400	7,541,478.00	0.23
99	603888	新华网	299,200	7,536,848.00	0.23
100	600151	航天机电	1,141,500	7,522,485.00	0.23
101	603678	火炬电子	283,800	7,512,186.00	0.23
102	600888	新疆众和	1,018,482	7,373,809.68	0.22
103	600556	天下秀	1,223,900	7,233,249.00	0.22
104	688139	海尔生物	177,750	7,202,430.00	0.22
105	600623	华谊集团	1,108,800	7,140,672.00	0.22
106	600750	江中药业	341,400	7,128,432.00	0.22
107	002307	北新路桥	1,675,602	7,104,552.48	0.21
108	600120	浙江东方	1,977,400	7,098,866.00	0.21
109	002194	武汉凡谷	715,000	7,049,900.00	0.21
110	688586	江航装备	631,856	7,007,283.04	0.21
111	600320	振华重工	2,110,240	7,005,996.80	0.21
112	603100	川仪股份	249,100	6,905,052.00	0.21
113	300463	迈克生物	450,700	6,792,049.00	0.21
114	600284	浦东建设	1,067,494	6,725,212.20	0.20
115	300409	道氏技术	602,200	6,708,508.00	0.20
116	002697	红旗连锁	1,341,500	6,680,670.00	0.20
117	688298	东方生物	185,938	6,649,142.88	0.20
118	300170	汉得信息	799,900	6,647,169.00	0.20
119	600559	老白干酒	294,298	6,636,419.90	0.20
120	688680	海优新材	100,569	6,602,354.85	0.20
121	002004	华邦健康	1,407,400	6,558,484.00	0.20
122	688403	汇成股份	619,400	6,534,670.00	0.20



123	688048	长光华芯	104,100	6,523,947.00	0.20
124	601311	骆驼股份	796,969	6,383,721.69	0.19
125	688209	英集芯	356,226	6,362,196.36	0.19
126	603308	应流股份	443,600	6,356,788.00	0.19
127	002839	张家港行	1,636,660	6,350,240.80	0.19
128	603301	振德医疗	258,800	6,340,600.00	0.19
129	000555	神州信息	548,534	6,192,948.86	0.19
130	000676	智度股份	707,600	6,177,348.00	0.19
131	600201	生物股份	569,100	6,129,207.00	0.19
132	000543	皖能电力	959,000	6,003,340.00	0.18
133	603368	柳药集团	316,358	5,985,493.36	0.18
134	002424	贵州百灵	733,600	5,949,496.00	0.18
135	300470	中密控股	156,439	5,913,394.20	0.18
136	002649	博彦科技	479,803	5,887,182.81	0.18
137	002913	奥士康	191,200	5,860,280.00	0.18
138	300232	洲明科技	662,500	5,830,000.00	0.18
139	601015	陕西黑猫	1,298,630	5,817,862.40	0.18
140	600776	东方通信	514,985	5,814,180.65	0.18
141	688133	泰坦科技	125,275	5,806,496.25	0.18
142	003039	顺控发展	380,300	5,765,348.00	0.17
143	603567	珍宝岛	473,800	5,761,408.00	0.17
144	600478	科力远	1,167,900	5,746,068.00	0.17
145	603171	税友股份	162,100	5,735,098.00	0.17
146	601333	广深铁路	2,210,500	5,725,195.00	0.17
147	002206	海利得	1,136,500	5,705,230.00	0.17
148	603599	广信股份	383,115	5,555,167.50	0.17
149	600197	伊力特	254,390	5,532,982.50	0.17
150	688262	国芯科技	186,100	5,460,174.00	0.17
151	000528	柳工	807,878	5,445,097.72	0.16
152	600037	歌华有线	700,900	5,417,957.00	0.16
153	300768	迪普科技	363,386	5,370,845.08	0.16
154	600389	江山股份	308,285	5,364,159.00	0.16
155	300183	东软载波	353,400	5,332,806.00	0.16
156	600216	浙江医药	494,600	5,307,058.00	0.16
157	300887	谱尼测试	449,014	5,302,855.34	0.16
158	688568	中科星图	105,318	5,166,901.08	0.16
159	300123	亚光科技	702,400	5,148,592.00	0.16
160	688707	振华新材	250,880	5,143,040.00	0.16
161	601908	京运通	1,115,500	5,097,835.00	0.15
162	000686	东北证券	717,800	5,096,380.00	0.15
163	600064	南京高科	842,900	5,091,116.00	0.15

164	600210	紫江企业	1,079,174	5,072,117.80	0.15
165	601921	浙版传媒	660,683	5,047,618.12	0.15
166	300188	国投智能	315,000	5,046,300.00	0.15
167	002061	浙江交科	1,381,400	5,042,110.00	0.15
168	300080	易成新能	1,036,092	5,014,685.28	0.15
169	688388	嘉元科技	246,544	4,999,912.32	0.15
170	301060	兰卫医学	374,000	4,970,460.00	0.15
171	002405	四维图新	557,600	4,962,640.00	0.15
172	000927	中国铁物	1,856,200	4,956,054.00	0.15
173	600717	天津港	1,194,800	4,910,628.00	0.15
174	002446	盛路通信	589,500	4,892,850.00	0.15
175	688389	普门科技	216,257	4,867,945.07	0.15
176	605376	博迁新材	171,900	4,847,580.00	0.15
177	000690	宝新能源	1,089,500	4,826,485.00	0.15
178	000902	新洋丰	423,600	4,824,804.00	0.15
179	600172	黄河旋风	1,285,100	4,806,274.00	0.15
180	002378	章源钨业	848,680	4,803,528.80	0.15
181	600635	大众公用	1,585,581	4,788,454.62	0.14
182	300416	苏试试验	259,830	4,773,077.10	0.14
183	600986	浙文互联	872,000	4,761,120.00	0.14
184	600835	上海机电	396,200	4,702,894.00	0.14
185	002741	光华科技	316,100	4,700,407.00	0.14
186	301087	可孚医疗	123,600	4,684,440.00	0.14
187	688381	帝奥微	182,600	4,623,432.00	0.14
188	600996	贵广网络	514,900	4,613,504.00	0.14
189	688206	概伦电子	210,424	4,587,243.20	0.14
190	002990	盛视科技	132,800	4,585,584.00	0.14
191	600098	广州发展	852,600	4,578,462.00	0.14
192	002645	华宏科技	403,800	4,562,940.00	0.14
193	300208	青岛中程	681,937	4,555,339.16	0.14
194	600929	雪天盐业	704,917	4,546,714.65	0.14
195	600667	太极实业	642,900	4,519,587.00	0.14
196	002626	金达威	276,500	4,515,245.00	0.14
197	300618	寒锐钴业	159,400	4,509,426.00	0.14
198	600718	东软集团	487,400	4,508,450.00	0.14
199	688128	中国电研	219,400	4,502,088.00	0.14
200	002516	旷达科技	912,000	4,496,160.00	0.14
201	300267	尔康制药	1,392,100	4,468,641.00	0.14
202	600993	马应龙	183,797	4,444,211.46	0.13
203	603876	鼎胜新材	353,640	4,431,109.20	0.13
204	002237	恒邦股份	403,800	4,352,964.00	0.13

205	300855	图南股份	143,120	4,322,224.00	0.13
206	688608	恒玄科技	27,956	4,312,772.12	0.13
207	000737	北方铜业	730,000	4,234,000.00	0.13
208	000550	江铃汽车	221,600	4,217,048.00	0.13
209	600696	岩石股份	234,400	4,216,856.00	0.13
210	002651	利君股份	602,600	4,169,992.00	0.13
211	300039	上海凯宝	626,500	4,166,225.00	0.13
212	688018	乐鑫科技	40,461	4,165,459.95	0.13
213	300702	天宇股份	191,200	4,150,952.00	0.13
214	002706	良信股份	458,200	4,045,906.00	0.12
215	300382	斯莱克	406,500	4,036,545.00	0.12
216	600740	山西焦化	798,000	4,021,920.00	0.12
217	002537	海联金汇	602,323	4,011,471.18	0.12
218	603063	禾望电气	160,400	4,010,000.00	0.12
219	300077	国民技术	349,600	3,946,984.00	0.12
220	600691	阳煤化工	1,226,500	3,937,065.00	0.12
221	600850	电科数字	180,700	3,930,225.00	0.12
222	002063	远光软件	632,300	3,907,614.00	0.12
223	688800	瑞可达	95,746	3,847,074.28	0.12
224	002498	汉缆股份	960,861	3,843,444.00	0.12
225	600446	金证股份	329,100	3,807,687.00	0.12
226	300133	华策影视	645,600	3,789,672.00	0.11
227	000062	深圳华强	335,600	3,782,212.00	0.11
228	300327	中颖电子	165,500	3,773,400.00	0.11
229	003012	东鹏控股	454,900	3,752,925.00	0.11
230	002023	海特高新	412,300	3,751,930.00	0.11
231	002434	万里扬	499,800	3,723,510.00	0.11
232	000813	德展健康	1,117,600	3,654,552.00	0.11
233	603718	海利生物	337,083	3,610,158.93	0.11
234	688088	虹软科技	87,793	3,603,024.72	0.11
235	002190	成飞集成	189,900	3,602,403.00	0.11
236	600459	贵研铂业	250,720	3,600,339.20	0.11
237	300113	顺网科技	257,000	3,598,000.00	0.11
238	000913	钱江摩托	286,928	3,577,992.16	0.11
239	000503	国新健康	270,900	3,570,462.00	0.11
240	601619	嘉泽新能	1,010,400	3,566,712.00	0.11
241	000928	中钢国际	607,300	3,540,559.00	0.11
242	601222	林洋能源	553,900	3,539,421.00	0.11
243	603118	共进股份	392,800	3,519,488.00	0.11
244	600685	中船防务	137,200	3,505,460.00	0.11
245	688083	中望软件	35,200	3,503,808.00	0.11

246	002724	海洋王	425,700	3,499,254.00	0.11
247	601918	新集能源	662,400	3,490,848.00	0.11
248	300627	华测导航	112,500	3,489,750.00	0.11
249	002091	江苏国泰	444,400	3,479,652.00	0.11
250	603533	掌阅科技	174,900	3,477,012.00	0.11
251	601126	四方股份	243,600	3,449,376.00	0.10
252	002583	海能达	579,300	3,446,835.00	0.10
253	600012	皖通高速	312,600	3,444,852.00	0.10
254	603187	海容冷链	226,540	3,434,346.40	0.10
255	600420	国药现代	349,000	3,416,710.00	0.10
256	000718	苏宁环球	1,318,260	3,414,293.40	0.10
257	002891	中宠股份	128,900	3,396,515.00	0.10
258	002079	苏州固锝	301,000	3,395,280.00	0.10
259	300065	海兰信	332,165	3,378,118.05	0.10
260	002003	伟星股份	306,330	3,323,680.50	0.10
261	600882	妙可蓝多	205,800	3,307,206.00	0.10
262	002946	新乳业	284,600	3,267,208.00	0.10
263	600710	苏美达	459,400	3,257,146.00	0.10
264	600063	皖维高新	753,100	3,238,330.00	0.10
265	600477	杭萧钢构	983,900	3,237,031.00	0.10
266	002201	正威新材	439,080	3,174,548.40	0.10
267	300185	通裕重工	1,318,900	3,165,360.00	0.10
268	002215	诺普信	376,900	3,113,194.00	0.09
269	002746	仙坛股份	440,600	3,101,824.00	0.09
270	601952	苏垦农发	302,600	3,098,624.00	0.09
271	600225	卓朗科技	809,900	3,077,620.00	0.09
272	600577	精达股份	739,000	3,059,460.00	0.09
273	300775	三角防务	109,400	3,052,260.00	0.09
274	600602	云赛智联	263,500	3,048,695.00	0.09
275	688337	普源精电	69,137	3,033,040.19	0.09
276	600007	中国国贸	155,800	3,019,404.00	0.09
277	688372	伟测科技	38,100	2,987,040.00	0.09
278	002585	双星新材	367,200	2,977,992.00	0.09
279	002987	京北方	159,480	2,963,138.40	0.09
280	300525	博思软件	196,775	2,935,883.00	0.09
281	688711	宏微科技	70,562	2,927,617.38	0.09
282	600531	豫光金铅	481,400	2,912,470.00	0.09
283	300458	全志科技	127,700	2,897,513.00	0.09
284	002643	万润股份	173,850	2,884,171.50	0.09
285	300348	长亮科技	276,300	2,848,653.00	0.09
286	688173	希荻微	161,400	2,839,026.00	0.09

287	688261	东微半导	33,900	2,833,701.00	0.09
288	300203	聚光科技	177,900	2,819,715.00	0.09
289	688499	利元亨	73,932	2,815,330.56	0.09
290	002258	利尔化学	234,540	2,807,443.80	0.08
291	688739	成大生物	86,200	2,802,362.00	0.08
292	600185	格力地产	383,800	2,774,874.00	0.08
293	002053	云南能投	285,700	2,748,434.00	0.08
294	600507	方大特钢	593,600	2,736,496.00	0.08
295	688278	特宝生物	51,734	2,708,274.90	0.08
296	600100	同方股份	368,100	2,705,535.00	0.08
297	300623	捷捷微电	168,800	2,678,856.00	0.08
298	300027	华谊兄弟	999,300	2,678,124.00	0.08
299	002212	天融信	273,300	2,672,874.00	0.08
300	600596	新安股份	292,400	2,666,688.00	0.08
301	688617	惠泰医疗	6,803	2,642,965.50	0.08
302	002541	鸿路钢构	121,480	2,639,760.40	0.08
303	002932	明德生物	114,898	2,639,207.06	0.08
304	301039	中集车辆	281,100	2,636,718.00	0.08
305	301165	锐捷网络	69,200	2,621,988.00	0.08
306	601890	亚星锚链	262,900	2,602,710.00	0.08
307	600510	黑牡丹	458,900	2,592,785.00	0.08
308	002354	天娱数科	469,600	2,592,192.00	0.08
309	600612	老凤祥	37,300	2,573,700.00	0.08
310	603098	森特股份	189,000	2,572,290.00	0.08
311	300143	盈康生命	241,800	2,570,334.00	0.08
312	688023	安恒信息	23,128	2,564,663.92	0.08
313	002217	合力泰	938,400	2,552,448.00	0.08
314	000860	顺鑫农业	119,600	2,546,284.00	0.08
315	002219	新里程	839,300	2,543,079.00	0.08
316	688556	高测股份	65,133	2,539,535.67	0.08
317	605009	豪悦护理	66,400	2,534,488.00	0.08
318	601068	中铝国际	544,586	2,515,987.32	0.08
319	000767	晋控电力	834,400	2,511,544.00	0.08
320	000090	天健集团	544,900	2,506,540.00	0.08
321	600490	鹏欣资源	835,800	2,499,042.00	0.08
322	000719	中原传媒	256,400	2,494,772.00	0.08
323	600409	三友化工	452,100	2,482,029.00	0.08
324	601399	国机重装	872,340	2,468,722.20	0.07
325	600502	安徽建工	529,700	2,463,105.00	0.07
326	000881	中广核技	339,300	2,459,925.00	0.07
327	600955	维远股份	136,100	2,442,995.00	0.07

328	300455	航天智装	203,300	2,427,402.00	0.07
329	300398	飞凯材料	153,800	2,423,888.00	0.07
330	688116	天奈科技	83,418	2,422,458.72	0.07
331	300726	宏达电子	80,200	2,421,238.00	0.07
332	002351	漫步者	133,300	2,355,411.00	0.07
333	603919	金徽酒	94,500	2,326,590.00	0.07
334	300735	光弘科技	97,400	2,292,796.00	0.07
335	002245	蔚蓝锂芯	269,000	2,291,880.00	0.07
336	600601	方正科技	792,300	2,289,747.00	0.07
337	600649	城投控股	611,939	2,264,174.30	0.07
338	603033	三维股份	142,940	2,259,881.40	0.07
339	600057	厦门象屿	332,700	2,232,417.00	0.07
340	688676	金盘科技	62,300	2,232,209.00	0.07
341	688235	百济神州	16,045	2,230,896.80	0.07
342	600688	上海石化	776,400	2,220,504.00	0.07
343	600217	中再资环	503,900	2,207,082.00	0.07
344	300377	赢时胜	283,200	2,197,632.00	0.07
345	002335	科华数据	79,200	2,192,256.00	0.07
346	600422	昆药集团	104,600	2,181,956.00	0.07
347	002287	奇正藏药	96,700	2,174,783.00	0.07
348	603396	金辰股份	39,700	2,169,605.00	0.07
349	603093	南华期货	179,600	2,155,200.00	0.07
350	000567	海德股份	202,140	2,148,748.20	0.07
351	000019	深粮控股	281,500	2,122,510.00	0.06
352	688508	芯朋微	42,806	2,106,483.26	0.06
353	300035	中科电气	198,900	2,096,406.00	0.06
354	300770	新媒股份	53,444	2,067,213.92	0.06
355	600206	有研新材	165,300	2,048,067.00	0.06
356	002941	新疆交建	155,800	2,028,516.00	0.06
357	601567	三星医疗	98,000	2,009,000.00	0.06
358	002214	大立科技	174,155	1,997,557.85	0.06
359	300772	运达股份	186,460	1,983,934.40	0.06
360	002267	陕天然气	270,656	1,983,908.48	0.06
361	688326	经纬恒润	17,000	1,972,850.00	0.06
362	688578	艾力斯	47,206	1,966,601.96	0.06
363	300602	飞荣达	108,400	1,958,788.00	0.06
364	300638	广和通	102,880	1,957,806.40	0.06
365	300777	中简科技	65,500	1,953,865.00	0.06
366	300260	新莱应材	63,800	1,941,434.00	0.06
367	300119	瑞普生物	118,000	1,934,020.00	0.06
368	688686	奥普特	17,200	1,926,400.00	0.06

369	300674	宇信科技	117,400	1,911,272.00	0.06
370	601069	西部黄金	156,900	1,892,214.00	0.06
371	300130	新国都	78,004	1,887,696.80	0.06
372	000627	天茂集团	662,949	1,882,775.16	0.06
373	300696	爱乐达	108,100	1,882,021.00	0.06
374	688598	金博股份	26,362	1,842,703.80	0.06
375	300393	中来股份	177,400	1,834,316.00	0.06
376	300747	锐科激光	77,400	1,821,222.00	0.06
377	300206	理邦仪器	178,300	1,820,443.00	0.06
378	002832	比音勒芬	57,185	1,812,764.50	0.05
379	600963	岳阳林纸	307,100	1,808,819.00	0.05
380	603730	岱美股份	124,800	1,808,352.00	0.05
381	300741	华宝股份	84,000	1,798,440.00	0.05
382	600550	保变电气	368,200	1,796,816.00	0.05
383	002550	千红制药	304,900	1,792,812.00	0.05
384	603212	赛伍技术	103,000	1,789,110.00	0.05
385	600770	综艺股份	362,400	1,779,384.00	0.05
386	601028	玉龙股份	166,000	1,777,860.00	0.05
387	688037	芯源微	13,233	1,768,061.13	0.05
388	002145	中核钛白	392,000	1,756,160.00	0.05
389	000736	中交地产	178,069	1,743,295.51	0.05
390	603027	千禾味业	107,220	1,733,747.40	0.05
391	002859	洁美科技	68,700	1,714,065.00	0.05
392	300298	三诺生物	55,900	1,699,360.00	0.05
393	300036	超图软件	81,100	1,694,990.00	0.05
394	603936	博敏电子	160,200	1,672,488.00	0.05
395	603179	新泉股份	32,800	1,663,288.00	0.05
396	000795	英洛华	264,800	1,649,704.00	0.05
397	300323	华灿光电	224,800	1,645,536.00	0.05
398	300224	正海磁材	140,400	1,645,488.00	0.05
399	603103	横店影视	90,900	1,616,202.00	0.05
400	002139	拓邦股份	165,000	1,610,400.00	0.05
401	688110	东芯股份	46,400	1,597,552.00	0.05
402	688027	国盾量子	12,400	1,585,960.00	0.05
403	300634	彩讯股份	77,200	1,580,284.00	0.05
404	603300	华铁应急	246,200	1,575,680.00	0.05
405	002847	盐津铺子	22,650	1,573,722.00	0.05
406	300002	神州泰岳	177,800	1,573,530.00	0.05
407	300054	鼎龙股份	64,470	1,560,174.00	0.05
408	688575	亚辉龙	68,201	1,559,756.87	0.05
409	600363	联创光电	44,800	1,523,200.00	0.05

410	600586	金晶科技	227,200	1,517,696.00	0.05
411	600876	凯盛新能	108,100	1,516,643.00	0.05
412	300226	上海钢联	53,200	1,515,668.00	0.05
413	001338	永顺泰	125,200	1,509,912.00	0.05
414	300653	正海生物	51,800	1,503,236.00	0.05
415	688639	华恒生物	11,935	1,502,616.50	0.05
416	301291	明阳电气	52,800	1,497,408.00	0.05
417	002125	湘潭电化	139,300	1,489,117.00	0.05
418	000915	华特达因	51,400	1,488,544.00	0.05
419	600618	氯碱化工	162,600	1,479,660.00	0.04
420	002158	汉钟精机	66,200	1,473,612.00	0.04
421	002291	遥望科技	157,000	1,472,660.00	0.04
422	300693	盛弘股份	48,049	1,437,145.59	0.04
423	002038	双鹭药业	140,600	1,432,714.00	0.04
424	688033	天宜上佳	84,700	1,431,430.00	0.04
425	600587	新华医疗	55,400	1,428,766.00	0.04
426	000088	盐田港	291,900	1,424,472.00	0.04
427	002773	康弘药业	77,200	1,423,568.00	0.04
428	000061	农产品	217,500	1,407,225.00	0.04
429	002961	瑞达期货	94,300	1,405,070.00	0.04
430	688239	航宇科技	29,400	1,404,438.00	0.04
431	601677	明泰铝业	123,538	1,400,920.92	0.04
432	002978	安宁股份	44,100	1,396,206.00	0.04
433	002151	北斗星通	44,200	1,395,836.00	0.04
434	600400	红豆股份	497,680	1,388,527.20	0.04
435	601137	博威合金	89,000	1,382,170.00	0.04
436	300180	华峰超纤	312,600	1,381,692.00	0.04
437	603055	台华新材	114,100	1,373,764.00	0.04
438	000875	吉电股份	311,800	1,371,920.00	0.04
439	300624	万兴科技	14,300	1,352,780.00	0.04
440	688016	心脉医疗	6,900	1,342,947.00	0.04
441	688596	正帆科技	33,800	1,339,494.00	0.04
442	000560	我爱我家	592,800	1,333,800.00	0.04
443	600123	兰花科创	120,300	1,328,112.00	0.04
444	300679	电连技术	31,900	1,323,850.00	0.04
445	000818	航锦科技	42,100	1,321,098.00	0.04
446	688798	艾为电子	19,135	1,320,889.05	0.04
447	301153	中科江南	16,700	1,307,109.00	0.04
448	002124	天邦食品	359,700	1,305,711.00	0.04
449	603699	纽威股份	94,100	1,304,226.00	0.04
450	002612	朗姿股份	67,474	1,297,525.02	0.04



451	000426	兴业银锡	142,700	1,295,716.00	0.04
452	601969	海南矿业	196,200	1,292,958.00	0.04
453	301239	普瑞眼科	15,000	1,290,000.00	0.04
454	002458	益生股份	119,500	1,285,820.00	0.04
455	600158	中体产业	164,100	1,276,698.00	0.04
456	300827	上能电气	42,093	1,273,734.18	0.04
457	603197	保隆科技	22,400	1,263,360.00	0.04
458	688050	爱博医疗	7,300	1,255,892.00	0.04
459	002539	云图控股	151,900	1,253,175.00	0.04
460	001287	中电港	59,400	1,237,302.00	0.04
461	603906	龙蟠科技	99,100	1,234,786.00	0.04
462	600395	盘江股份	198,600	1,225,362.00	0.04
463	600211	西藏药业	25,000	1,220,000.00	0.04
464	002320	海峡股份	209,100	1,219,053.00	0.04
465	688439	振华风光	13,400	1,194,074.00	0.04
466	001269	欧晶科技	22,300	1,191,935.00	0.04
467	688127	蓝特光学	51,016	1,188,162.64	0.04
468	002249	大洋电机	238,000	1,182,860.00	0.04
469	300182	捷成股份	232,800	1,182,624.00	0.04
470	600648	外高桥	119,900	1,182,214.00	0.04
471	688066	航天宏图	27,762	1,172,666.88	0.04
472	300655	晶瑞电材	120,500	1,172,465.00	0.04
473	600366	宁波韵升	150,000	1,165,500.00	0.04
474	603583	捷昌驱动	57,800	1,157,734.00	0.04
475	002254	泰和新材	77,272	1,155,989.12	0.03
476	002837	英维克	41,986	1,153,775.28	0.03
477	002815	崇达技术	120,300	1,152,474.00	0.03
478	601208	东材科技	93,040	1,151,835.20	0.03
479	002204	大连重工	251,600	1,149,812.00	0.03
480	002950	奥美医疗	120,700	1,144,236.00	0.03
481	603439	贵州三力	60,300	1,138,464.00	0.03
482	003006	百亚股份	75,000	1,137,000.00	0.03
483	688232	新点软件	31,400	1,136,680.00	0.03
484	600639	浦东金桥	112,400	1,136,364.00	0.03
485	603005	晶方科技	51,200	1,124,352.00	0.03
486	603279	景津装备	50,700	1,120,977.00	0.03
487	600728	佳都科技	195,800	1,119,976.00	0.03
488	301301	川宁生物	130,600	1,097,040.00	0.03
489	601163	三角轮胎	74,700	1,076,427.00	0.03
490	600775	南京熊猫	81,000	1,073,250.00	0.03
491	002545	东方铁塔	150,100	1,073,215.00	0.03

492	000049	德赛电池	39,481	1,070,724.72	0.03
493	002276	万马股份	103,500	1,057,770.00	0.03
494	000685	中山公用	144,200	1,054,102.00	0.03
495	300737	科顺股份	171,300	1,051,782.00	0.03
496	301219	腾远钴业	26,630	1,048,423.10	0.03
497	002573	清新环境	211,300	1,045,935.00	0.03
498	002048	宁波华翔	80,300	1,044,703.00	0.03
499	002605	姚记科技	46,500	1,033,230.00	0.03
500	002993	奥海科技	27,000	1,028,700.00	0.03
501	000791	甘肃能源	182,900	1,018,753.00	0.03
502	002068	黑猫股份	87,800	1,018,480.00	0.03
503	000727	冠捷科技	378,500	1,014,380.00	0.03
504	600751	海航科技	387,000	1,013,940.00	0.03
505	301095	广立微	13,500	1,008,855.00	0.03
506	600125	铁龙物流	165,400	1,000,670.00	0.03
507	002851	麦格米特	40,400	993,840.00	0.03
508	601886	江河集团	149,000	992,340.00	0.03
509	002967	广电计量	66,100	992,161.00	0.03
510	002088	鲁阳节能	69,460	989,805.00	0.03
511	600458	时代新材	107,400	989,154.00	0.03
512	605123	派克新材	10,800	984,960.00	0.03
513	601811	新华文轩	72,000	983,520.00	0.03
514	301200	大族数控	26,000	982,020.00	0.03
515	688031	星环科技-U	15,061	980,019.27	0.03
516	601965	中国汽研	44,400	979,464.00	0.03
517	688392	骄成超声	11,700	975,897.00	0.03
518	603169	兰石重装	157,500	970,200.00	0.03
519	301238	瑞泰新材	55,200	967,656.00	0.03
520	688238	和元生物	106,949	961,471.51	0.03
521	688131	皓元医药	18,400	957,904.00	0.03
522	600277	亿利洁能	364,100	957,583.00	0.03
523	600449	宁夏建材	52,200	935,946.00	0.03
524	301175	中科环保	187,100	933,629.00	0.03
525	000989	九芝堂	90,400	914,848.00	0.03
526	000006	深振业A	199,200	914,328.00	0.03
527	600138	中青旅	85,000	902,700.00	0.03
528	605020	永和股份	35,900	897,859.00	0.03
529	300687	赛意信息	41,200	897,336.00	0.03
530	000552	甘肃能化	292,000	890,600.00	0.03
531	002222	福晶科技	29,200	862,276.00	0.03

532	301047	义翘神州	10,400	856,960.00	0.03
533	600633	浙数文化	77,300	854,938.00	0.03
534	300343	联创股份	126,800	836,880.00	0.03
535	600595	中孚实业	240,200	835,896.00	0.03
536	688322	奥比中光	22,200	834,276.00	0.03
537	301090	华润材料	76,400	829,704.00	0.03
538	000034	神州数码	27,500	822,525.00	0.02
539	002051	中工国际	100,400	815,248.00	0.02
540	600821	金开新能	130,800	800,496.00	0.02
541	600248	陕建股份	196,764	790,991.28	0.02
542	603983	丸美股份	31,300	790,951.00	0.02
543	603489	八方股份	14,100	774,795.00	0.02
544	300894	火星人	47,600	773,024.00	0.02
545	603556	海兴电力	26,400	766,392.00	0.02
546	301316	慧博云通	32,700	759,948.00	0.02
547	000030	富奥股份	142,300	759,882.00	0.02
548	002314	南山控股	257,600	747,040.00	0.02
549	301180	万祥科技	41,200	745,308.00	0.02
550	300593	新雷能	50,400	744,408.00	0.02
551	600475	华光环能	70,800	736,320.00	0.02
552	688315	诺禾致源	31,356	731,849.04	0.02
553	603733	仙鹤股份	45,300	731,142.00	0.02
554	300856	科思股份	11,550	718,756.50	0.02
555	000582	北部湾港	95,300	715,703.00	0.02
556	603105	芯能科技	60,000	694,800.00	0.02
557	603043	广州酒家	35,400	691,362.00	0.02
558	301246	宏源药业	26,400	685,872.00	0.02
559	002807	江阴银行	190,000	674,500.00	0.02
560	600933	爱柯迪	29,400	645,036.00	0.02
561	688526	科前生物	31,300	637,894.00	0.02
562	600059	古越龙山	68,400	636,120.00	0.02
563	002610	爱康科技	294,200	635,472.00	0.02
564	301035	润丰股份	9,000	630,000.00	0.02
565	600163	中闽能源	142,400	622,288.00	0.02
566	002233	塔牌集团	86,300	611,004.00	0.02
567	300860	锋尚文化	11,128	607,922.64	0.02
568	002461	珠江啤酒	76,700	605,930.00	0.02
569	002108	沧州明珠	146,800	603,348.00	0.02
570	002226	江南化工	137,600	602,688.00	0.02
571	688409	富创精密	7,600	595,156.00	0.02
572	002060	广东建工	118,400	581,344.00	0.02

573	603132	金徽股份	42,400	580,032.00	0.02
574	300762	上海瀚讯	37,600	567,008.00	0.02
575	301267	华夏眼科	17,500	561,575.00	0.02
576	688318	财富趋势	4,445	561,403.50	0.02
577	688700	东威科技	9,100	555,282.00	0.02
578	002324	普利特	42,200	554,930.00	0.02
579	301217	铜冠铜箔	44,800	531,328.00	0.02
580	600328	中盐化工	67,400	527,068.00	0.02
581	002006	精工科技	34,400	525,632.00	0.02
582	300633	开立医疗	11,100	525,030.00	0.02
583	603566	普莱柯	23,100	523,215.00	0.02
584	002991	甘源食品	7,300	521,658.00	0.02
585	688266	泽璟制药	9,700	513,518.00	0.02
586	600874	创业环保	92,000	510,600.00	0.02
587	600403	大有能源	133,600	507,680.00	0.02
588	000821	京山轻机	31,800	505,302.00	0.02
589	605111	新洁能	13,140	497,086.20	0.02
590	300358	楚天科技	45,600	487,920.00	0.01
591	300767	震安科技	28,000	486,640.00	0.01
592	301207	华兰疫苗	17,300	480,940.00	0.01
593	603609	禾丰股份	55,700	476,792.00	0.01
594	002960	青鸟消防	34,400	476,096.00	0.01
595	002036	联创电子	46,500	474,765.00	0.01
596	600966	博汇纸业	74,900	465,129.00	0.01
597	300346	南大光电	16,804	463,958.44	0.01
598	600861	北京人力	23,600	442,264.00	0.01
599	603208	江山欧派	14,530	431,395.70	0.01
600	688400	凌云光	14,400	388,800.00	0.01
601	600295	鄂尔多斯	39,600	384,120.00	0.01
602	600872	中炬高新	13,600	382,160.00	0.01
603	601101	昊华能源	58,200	367,824.00	0.01
604	688380	中微半导	15,000	357,900.00	0.01
605	301177	迪阿股份	11,600	342,084.00	0.01
606	002163	海南发展	36,000	326,880.00	0.01
607	603229	奥翔药业	24,600	324,966.00	0.01
608	603997	继峰股份	24,000	323,280.00	0.01
609	603801	志邦家居	19,200	321,984.00	0.01
610	300773	拉卡拉	19,200	307,968.00	0.01
611	002099	海翔药业	42,500	305,575.00	0.01
612	603871	嘉友国际	19,140	303,560.40	0.01
613	600456	宝钛股份	9,600	301,344.00	0.01

614	300261	雅本化学	39,000	290,940.00	0.01
615	002948	青岛银行	94,500	288,225.00	0.01
616	002959	小熊电器	5,500	285,615.00	0.01
617	002043	兔宝宝	32,000	283,520.00	0.01
618	002389	航天彩虹	15,200	282,720.00	0.01
619	002077	大港股份	18,500	282,125.00	0.01
620	002745	木林森	32,500	281,450.00	0.01
621	002677	浙江美大	27,500	278,025.00	0.01
622	300083	创世纪	42,400	268,392.00	0.01
623	603306	华懋科技	9,700	262,967.00	0.01
624	002349	精华制药	28,900	256,343.00	0.01
625	000848	承德露露	31,600	248,060.00	0.01
626	001270	铖昌科技	3,500	219,485.00	0.01
627	600340	华夏幸福	125,100	217,674.00	0.01
628	002123	梦网科技	19,200	214,080.00	0.01
629	603298	杭叉集团	6,400	159,232.00	0.00
630	600908	无锡银行	31,400	158,570.00	0.00
631	002727	一心堂	6,500	150,540.00	0.00
632	603299	苏盐井神	15,000	127,800.00	0.00
633	688408	中信博	1,641	117,741.75	0.00
634	002020	京新药业	7,300	92,856.00	0.00
635	300031	宝通科技	4,800	88,992.00	0.00
636	000012	南玻A	10,800	60,156.00	0.00
637	000966	长源电力	13,500	59,805.00	0.00
638	300821	东岳硅材	7,000	58,100.00	0.00
639	002428	云南锗业	4,600	56,718.00	0.00
640	688559	海目星	1,330	47,481.00	0.00
641	301078	孩子王	2,800	22,988.00	0.00
642	000735	罗牛山	3,101	17,892.77	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300900	广联航空	833,191	20,563,153.88	0.62
2	603096	新经典	756,940	14,896,579.20	0.45
3	600489	中金黄金	1,347,300	13,419,108.00	0.41
4	000975	银泰黄金	783,500	11,752,500.00	0.36
5	600941	中国移动	98,900	9,838,572.00	0.30
6	600066	宇通客车	723,100	9,581,075.00	0.29
7	601168	西部矿业	647,900	9,245,533.00	0.28

8	000338	潍柴动力	656,400	8,959,860.00	0.27
9	000725	京东方A	2,207,900	8,610,810.00	0.26
10	603916	苏博特	818,554	8,341,065.26	0.25
11	600398	海澜之家	1,079,900	8,012,858.00	0.24
12	600276	恒瑞医药	163,300	7,386,059.00	0.22
13	600426	华鲁恒升	266,500	7,352,735.00	0.22
14	601928	凤凰传媒	834,100	7,348,421.00	0.22
15	688009	中国通号	1,591,400	6,970,332.00	0.21
16	000513	丽珠集团	195,670	6,850,406.70	0.21
17	600795	国电电力	1,576,400	6,557,824.00	0.20
18	300594	朗进科技	296,900	6,199,272.00	0.19
19	600350	山东高速	861,900	5,981,586.00	0.18
20	688819	天能股份	198,944	5,554,516.48	0.17
21	603258	电魂网络	238,200	5,473,836.00	0.17
22	002001	新和成	293,700	4,981,152.00	0.15
23	688035	德邦科技	93,025	4,963,814.00	0.15
24	000423	东阿阿胶	100,480	4,955,673.60	0.15
25	002422	科伦药业	163,900	4,761,295.00	0.14
26	002517	恺英网络	417,200	4,660,124.00	0.14
27	002044	美年健康	762,011	4,579,686.11	0.14
28	300371	汇中股份	370,400	4,515,176.00	0.14
29	300286	安科瑞	171,700	4,452,181.00	0.13
30	600011	华能国际	567,000	4,365,900.00	0.13
31	600998	九州通	605,642	4,245,550.42	0.13
32	000630	铜陵有色	1,282,700	4,207,256.00	0.13
33	603228	景旺电子	185,000	4,173,600.00	0.13
34	300760	迈瑞医疗	13,700	3,981,220.00	0.12
35	600737	中粮糖业	482,300	3,974,152.00	0.12
36	300870	欧陆通	89,600	3,966,592.00	0.12
37	688160	步科股份	68,000	3,956,240.00	0.12
38	688661	和林微纳	86,000	3,940,520.00	0.12
39	600583	海油工程	663,200	3,939,408.00	0.12
40	300955	嘉亨家化	177,700	3,928,947.00	0.12
41	000938	紫光股份	200,400	3,877,740.00	0.12
42	600901	江苏金租	787,740	3,812,661.60	0.12
43	002602	世纪华通	712,500	3,676,500.00	0.11
44	603859	能科科技	95,200	3,591,896.00	0.11
45	688248	南网科技	143,800	3,590,686.00	0.11
46	688501	青达环保	211,700	3,541,741.00	0.11
47	603639	海利尔	221,230	3,473,311.00	0.11
48	603659	璞泰来	161,300	3,376,009.00	0.10

49	688095	福昕软件	47,571	3,322,834.35	0.10
50	600511	国药股份	115,300	3,299,886.00	0.10
51	601985	中国核电	434,500	3,258,750.00	0.10
52	600383	金地集团	743,000	3,239,480.00	0.10
53	600886	国投电力	245,000	3,229,100.00	0.10
54	688690	纳微科技	112,000	3,071,040.00	0.09
55	600161	天坛生物	98,900	3,059,966.00	0.09
56	688150	莱特光电	141,300	3,050,667.00	0.09
57	603214	爱婴室	179,300	2,933,348.00	0.09
58	300452	山河药辅	199,200	2,836,608.00	0.09
59	301278	快可电子	48,630	2,832,697.50	0.09
60	300622	博士眼镜	142,800	2,831,724.00	0.09
61	601600	中国铝业	498,100	2,809,284.00	0.08
62	600481	双良节能	327,600	2,771,496.00	0.08
63	301011	华立科技	114,700	2,683,980.00	0.08
64	002968	新大正	213,100	2,665,881.00	0.08
65	300395	菲利华	71,500	2,614,040.00	0.08
66	600900	长江电力	109,500	2,555,730.00	0.08
67	600863	内蒙华电	653,800	2,549,820.00	0.08
68	000100	TCL 科技	586,620	2,522,466.00	0.08
69	002472	双环传动	95,200	2,477,104.00	0.07
70	688347	华虹公司	57,825	2,432,119.50	0.07
71	688105	诺唯赞	75,653	2,422,409.06	0.07
72	600027	华电国际	469,800	2,414,772.00	0.07
73	603163	圣晖集成	71,100	2,355,543.00	0.07
74	603939	益丰药房	56,300	2,254,252.00	0.07
75	600096	云天化	143,300	2,235,480.00	0.07
76	603218	日月股份	180,400	2,231,548.00	0.07
77	002234	民和股份	179,200	2,168,320.00	0.07
78	000157	中联重科	330,300	2,156,859.00	0.07
79	002475	立讯精密	61,800	2,129,010.00	0.06
80	301181	标榜股份	75,400	2,128,542.00	0.06
81	688099	晶晨股份	33,000	2,066,790.00	0.06
82	603039	泛微网络	43,900	2,058,910.00	0.06
83	600760	中航沈飞	48,740	2,055,853.20	0.06
84	601816	京沪高铁	413,300	2,033,436.00	0.06
85	689009	九号公司	68,200	2,022,812.00	0.06
86	300510	金冠股份	334,500	1,996,965.00	0.06
87	603040	新坐标	75,600	1,976,940.00	0.06
88	688668	鼎通科技	35,438	1,960,430.16	0.06
89	002185	华天科技	227,300	1,936,596.00	0.06

90	002128	电投能源	135,000	1,926,450.00	0.06
91	603233	大参林	76,500	1,904,850.00	0.06
92	603601	再升科技	434,900	1,870,070.00	0.06
93	002373	千方科技	166,400	1,865,344.00	0.06
94	688121	卓然股份	89,955	1,819,789.65	0.06
95	603444	吉比特	7,400	1,813,888.00	0.05
96	002925	盈趣科技	92,700	1,804,869.00	0.05
97	688291	金橙子	62,105	1,766,887.25	0.05
98	300763	锦浪科技	25,203	1,761,689.70	0.05
99	300009	安科生物	172,300	1,760,906.00	0.05
100	603886	元祖股份	95,700	1,744,611.00	0.05
101	000425	徐工机械	318,400	1,738,464.00	0.05
102	600085	同仁堂	31,100	1,670,070.00	0.05
103	688146	中船特气	48,611	1,653,260.11	0.05
104	688768	容知日新	44,200	1,627,002.00	0.05
105	002027	分众传媒	256,400	1,620,448.00	0.05
106	688032	禾迈股份	5,948	1,605,960.00	0.05
107	000060	中金岭南	360,400	1,556,928.00	0.05
108	301162	国能日新	30,000	1,556,400.00	0.05
109	002533	金杯电工	188,000	1,519,040.00	0.05
110	600875	东方电气	103,685	1,515,874.70	0.05
111	600826	兰生股份	170,000	1,502,800.00	0.05
112	301220	亚香股份	45,100	1,490,555.00	0.05
113	600258	首旅酒店	95,400	1,490,148.00	0.05
114	002410	广联达	85,340	1,462,727.60	0.04
115	688107	安路科技	39,500	1,452,810.00	0.04
116	300378	鼎捷软件	67,700	1,442,687.00	0.04
117	600380	健康元	116,000	1,441,880.00	0.04
118	600600	青岛啤酒	19,200	1,435,200.00	0.04
119	688003	天准科技	37,717	1,415,141.84	0.04
120	002284	亚太股份	161,100	1,412,847.00	0.04
121	601607	上海医药	84,200	1,408,666.00	0.04
122	002153	石基信息	141,600	1,379,184.00	0.04
123	600755	厦门国贸	194,400	1,354,968.00	0.04
124	300383	光环新网	135,200	1,314,144.00	0.04
125	603186	华正新材	37,600	1,304,720.00	0.04
126	688287	观典防务	130,500	1,288,035.00	0.04
127	688503	聚和材料	23,663	1,268,336.80	0.04
128	300349	金卡智能	101,500	1,260,630.00	0.04
129	002032	苏泊尔	23,500	1,245,735.00	0.04
130	603757	大元泵业	51,300	1,243,512.00	0.04



131	605007	五洲特纸	84,500	1,242,995.00	0.04
132	688080	映翰通	30,300	1,229,574.00	0.04
133	000933	神火股份	72,500	1,218,000.00	0.04
134	688036	传音控股	8,800	1,217,920.00	0.04
135	301302	华如科技	46,700	1,172,637.00	0.04
136	002414	高德红外	159,000	1,160,700.00	0.04
137	600372	中航机载	87,800	1,157,204.00	0.04
138	002371	北方华创	4,700	1,154,837.00	0.03
139	603136	天目湖	62,300	1,144,451.00	0.03
140	603099	长白山	76,300	1,142,974.00	0.03
141	300308	中际旭创	10,100	1,140,391.00	0.03
142	600461	洪城环境	124,500	1,137,930.00	0.03
143	300217	东方电热	211,100	1,135,718.00	0.03
144	601007	金陵饭店	137,400	1,110,192.00	0.03
145	000589	贵州轮胎	177,000	1,083,240.00	0.03
146	300394	天孚通信	11,800	1,079,936.00	0.03
147	300253	卫宁健康	146,300	1,051,897.00	0.03
148	688593	新相微	70,500	1,037,760.00	0.03
149	002803	吉宏股份	48,800	1,003,328.00	0.03
150	300490	华自科技	86,400	1,003,104.00	0.03
151	603379	三美股份	29,500	1,003,000.00	0.03
152	300592	华凯易佰	40,400	1,000,708.00	0.03
153	600817	宇通重工	104,000	998,400.00	0.03
154	605166	聚合顺	99,200	984,064.00	0.03
155	601021	春秋航空	19,500	978,900.00	0.03
156	688102	斯瑞新材	73,800	973,422.00	0.03
157	603611	诺力股份	51,300	971,109.00	0.03
158	688510	航亚科技	55,000	969,100.00	0.03
159	688147	微导纳米	24,400	951,356.00	0.03
160	300404	博济医药	106,200	950,490.00	0.03
161	300572	安车检测	52,400	946,868.00	0.03
162	688078	龙软科技	23,171	934,254.72	0.03
163	688234	天岳先进	14,100	931,587.00	0.03
164	300774	倍杰特	89,900	925,071.00	0.03
165	688489	三未信安	18,800	883,976.00	0.03
166	002624	完美世界	73,500	870,240.00	0.03
167	300842	帝科股份	12,300	867,765.00	0.03
168	000625	长安汽车	51,300	863,379.00	0.03
169	603225	新凤鸣	60,000	852,000.00	0.03
170	600548	深高速	92,400	830,676.00	0.03
171	603688	石英股份	9,400	816,672.00	0.02

172	600019	宝钢股份	135,400	802,922.00	0.02
173	002007	华兰生物	35,100	776,763.00	0.02
174	688258	卓易信息	15,567	770,566.50	0.02
175	002601	龙佰集团	44,700	765,711.00	0.02
176	601225	陕西煤业	36,100	754,129.00	0.02
177	600754	锦江酒店	25,200	753,480.00	0.02
178	603866	桃李面包	98,100	751,446.00	0.02
179	601231	环旭电子	49,200	743,412.00	0.02
180	688369	致远互联	20,309	702,894.49	0.02
181	603324	盛剑环境	23,100	701,547.00	0.02
182	002563	森马服饰	119,100	687,207.00	0.02
183	000063	中兴通讯	25,600	677,888.00	0.02
184	600642	申能股份	102,300	656,766.00	0.02
185	600419	天润乳业	54,600	640,458.00	0.02
186	688246	嘉和美康	19,000	634,980.00	0.02
187	002557	洽洽食品	18,200	633,724.00	0.02
188	300389	艾比森	36,500	632,910.00	0.02
189	301179	泽宇智能	24,100	625,395.00	0.02
190	002478	常宝股份	112,300	612,035.00	0.02
191	688056	莱伯泰科	16,395	549,396.45	0.02
192	000539	粤电力A	112,000	547,680.00	0.02
193	688045	必易微	12,600	539,658.00	0.02
194	603966	法兰泰克	65,600	536,608.00	0.02
195	603337	杰克股份	24,800	535,680.00	0.02
196	600497	驰宏锌锗	93,600	472,680.00	0.01
197	605399	晨光新材	33,510	454,395.60	0.01
198	002398	垒知集团	90,100	429,777.00	0.01
199	000521	长虹美菱	72,400	407,612.00	0.01
200	300866	安克创新	4,500	398,700.00	0.01
201	600348	华阳股份	40,200	392,352.00	0.01
202	688625	呈和科技	10,000	392,200.00	0.01
203	688302	海创药业	7,380	384,276.60	0.01
204	002152	广电运通	30,800	377,608.00	0.01
205	002922	伊戈尔	24,300	360,855.00	0.01
206	000830	鲁西化工	35,100	352,053.00	0.01
207	002033	丽江股份	39,500	319,555.00	0.01
208	603569	长久物流	25,345	314,024.55	0.01
209	688401	路维光电	10,000	307,200.00	0.01
210	300617	安靠智电	10,000	303,600.00	0.01
211	002641	公元股份	60,000	301,800.00	0.01
212	688308	欧科亿	10,745	299,785.50	0.01

213	300628	亿联网络	10,000	295,500.00	0.01
214	002568	百润股份	11,900	292,859.00	0.01
215	002266	浙富控股	85,600	291,040.00	0.01
216	688169	石头科技	1,000	282,950.00	0.01
217	300724	捷佳伟创	3,300	244,233.00	0.01
218	002810	山东赫达	10,900	230,971.00	0.01
219	688398	赛特新材	7,200	227,520.00	0.01
220	300918	南山智尚	21,300	220,029.00	0.01
221	605060	联德股份	10,900	203,830.00	0.01
222	600054	黄山旅游	16,700	181,696.00	0.01
223	000683	远兴能源	19,400	113,878.00	0.00
224	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
225	688390	固德威	568	74,169.44	0.00
226	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
227	600887	伊利股份	1,900	50,825.00	0.00
228	603296	华勤技术	593	46,105.75	0.00
229	688208	道通科技	1,800	42,750.00	0.00
230	600050	中国联通	7,600	33,288.00	0.00
231	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
232	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
233	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
234	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
235	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
236	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
237	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
238	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
239	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
240	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
241	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
242	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
243	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
244	000997	新大陆	900	17,649.00	0.00
245	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
246	600399	抚顺特钢	1,700	16,524.00	0.00
247	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
248	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
249	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
250	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
251	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
252	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
253	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00

254	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
255	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
256	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
257	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
258	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
259	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
260	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
261	300384	三联虹普	700	11,172.00	0.00
262	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
263	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
264	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
265	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
266	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
267	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
268	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
269	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
270	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
271	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
272	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
273	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
274	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
275	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
276	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
277	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
278	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
279	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
280	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
281	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
282	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
283	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
284	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
285	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
286	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
287	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
288	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
289	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
290	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
291	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
292	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
293	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
294	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00

295	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
296	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
297	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
298	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
299	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
300	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
301	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
302	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
303	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
304	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
305	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
306	603373	安邦护卫	88	3,058.00	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	600276	恒瑞医药	40,479,572.60	1.50
2	600789	鲁抗医药	35,958,905.30	1.33
3	000969	安泰科技	33,369,480.40	1.23
4	600888	新疆众和	33,367,110.46	1.23
5	600572	康恩贝	33,049,850.00	1.22
6	000650	仁和药业	31,564,935.00	1.17
7	002421	达实智能	30,891,901.00	1.14
8	601369	陕鼓动力	30,806,323.78	1.14
9	002130	沃尔核材	30,802,821.00	1.14
10	300502	新易盛	29,537,985.53	1.09
11	002446	盛路通信	27,512,859.00	1.02
12	603299	苏盐井神	27,417,390.43	1.01
13	300319	麦捷科技	27,163,694.00	1.00
14	002390	信邦制药	27,008,751.64	1.00
15	300377	赢时胜	26,899,326.00	0.99
16	300079	数码视讯	26,777,029.73	0.99
17	603328	依顿电子	26,422,124.00	0.98
18	000950	重药控股	25,794,957.24	0.95
19	300457	赢合科技	25,787,921.92	0.95
20	300438	鹏辉能源	25,774,174.30	0.95

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	600789	鲁抗医药	56,025,352.50	2.07
2	300502	新易盛	40,323,117.47	1.49
3	600531	豫光金铅	37,146,965.13	1.37
4	300170	汉得信息	36,550,899.07	1.35
5	600276	恒瑞医药	35,814,095.20	1.32
6	300134	大富科技	31,347,372.24	1.16
7	002055	得润电子	31,332,113.50	1.16
8	600481	双良节能	30,077,914.50	1.11
9	300377	赢时胜	29,022,034.59	1.07
10	600184	光电股份	28,714,474.40	1.06
11	603118	共进股份	28,433,573.04	1.05
12	603299	苏盐井神	27,964,737.94	1.03
13	300118	东方日升	27,159,818.87	1.00
14	002446	盛路通信	26,651,541.00	0.98
15	600559	老白干酒	26,255,150.00	0.97
16	600993	马应龙	25,985,546.19	0.96
17	300080	易成新能	25,802,849.74	0.95
18	002649	博彦科技	25,645,340.00	0.95
19	300457	赢合科技	25,306,080.52	0.93
20	300634	彩讯股份	25,181,187.00	0.93

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	9,319,636,313.85
卖出股票收入（成交）总额	8,732,284,283.99

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	8,970,975.56	0.27
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）	250,316.83	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	9,221,292.39	0.28

### 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	019694	23 国债 01	88,000	8,970,975.56	0.27
2	113069	博 23 转债	1,940	194,012.76	0.01
3	127100	神码转债	563	56,304.07	0.00

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

### 8.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	202,439.33
2	应收清算款	152,859.71
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	50,989,836.44
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	应计出借证券利息	501.29
9	其他	—
10	合计	51,345,636.77

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。



## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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(%)
富国中证1000指数增强(LOF)A	94,819	10,718.79	596,725,865.11	58.71	419,619,064.15	41.29
富国中证1000指数增强(LOF)C	29,167	27,447.30	696,520,952.49	87.00	104,034,580.81	13.00
合计	123,986	14,654.08	1,293,246,817.60	71.18	523,653,644.96	28.82

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

富国中证1000指数增强(LOF)A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	北京新湖巨源投资管理有限公司—新湖巨源泓湖百世风险平衡1号私募证券投资基金	1,289,313.00	5.67
2	廖昌清	1,170,483.00	5.15
3	付小珍	1,016,648.00	4.47
4	陈颖	688,322.00	3.03
5	熊振国	573,600.00	2.52
6	刘树航	481,890.00	2.12
7	赵国义	450,000.00	1.98
8	陈实	403,094.00	1.77
9	李群	400,023.00	1.76
10	周曲	268,100.00	1.18

### 9.3 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	富国中证1000指数增强(LOF)A	728,243.78	0.0717

	富国中证 1000 指数 增强 (LOF) C	88,227.92	0.0110
	合计	816,471.70	0.0449

#### 9.4 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	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	富国中证 1000 指 数增强 (LOF) A	0~10
	富国中证 1000 指 数增强 (LOF) C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放 式基金	富国中证 1000 指 数增强 (LOF) A	10~50
	富国中证 1000 指 数增强 (LOF) C	0
	合计	10~50

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	富国中证 1000 指数增 强 (LOF) A	富国中证 1000 指数增 强 (LOF) C
基金合同生效日(2018 年 05 月 31 日) 基金份额总额	512,114,043.76	—
报告期期初基金份额总额	1,104,692,396.88	378,836,459.42
本报告期基金总申购份额	395,169,213.30	1,102,106,715.55
减：本报告期基金总赎回份额	483,516,680.92	680,387,641.67
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,016,344,929.26	800,555,533.30

### § 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。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 5.5 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：无

### 11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国投证券	2	324,355,499.28	1.80	236,494.67	1.81	—
德邦证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	2	668,990,750.53	3.71	486,470.77	3.72	—
东方证券	4	1,701,317,560.53	9.44	1,227,315.62	9.39	—
国海证券	2	710,037,694.97	3.94	515,810.80	3.95	—
国联证券	1	1,496,714,768.71	8.30	1,084,130.44	8.29	—
国泰君安	2	804,660,656.86	4.46	580,416.32	4.44	—
海通证券	1	1,957,121,895.05	10.86	1,424,117.78	10.89	—

华兴证券	1	—	—	—	—	—
汇丰前海	2	—	—	—	—	—
开源证券	4	3,713,864,050.83	20.61	2,682,895.05	20.52	—
申万宏源	4	1,566,678,497.62	8.69	1,140,861.09	8.73	—
兴业证券	2	3,601,117,240.06	19.98	2,620,228.55	20.04	—
浙商证券	1	—	—	—	—	—
中泰证券	1	883,507,657.99	4.90	642,306.62	4.91	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中信证券	3	594,144,049.81	3.30	431,415.70	3.30	—

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（50404）。本报告期本基金新增券商交易单元：中信证券（58565），东方证券（722162、722163）。

### 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	68,228.44	0.28	—	—	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	1,238,507.11	5.11	—	—	—	—
东方证券	934,118.95	3.86	—	—	—	—
国海证券	782,529.14	3.23	—	—	—	—
国联证券	9,309,162.57	38.42	—	—	—	—
国泰君安	332,649.24	1.37	—	—	—	—
海通证券	1,156,528.00	4.77	—	—	—	—
华兴证券	—	—	—	—	—	—
汇丰前海	—	—	—	—	—	—
开源证券	2,126,678.86	8.78	—	—	—	—
申万宏源	609,625.51	2.52	—	—	—	—
兴业证券	6,201,841.12	25.60	—	—	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中泰证券	567,336.17	2.34	—	—	—	—

---

中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	900,093.58	3.72	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年02月02日
2	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年03月25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	2023年04月11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	2023年05月04日
5	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年07月28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	2023年08月09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	2023年08月24日
8	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年10月10日
9	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	2023年11月22日

10	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
----	-------------------------	--------	-------------

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023-01-01 至 2023-02-06; 2023-02-14 至 2023-02-16; 2023-02-24 至 2023-03-27; 2023-04-25 至 2023-12-31	343,495,679.69	51,937,543.49	—	395,433,223.18	21.76%
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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中证 1000 指数增强型证券	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富

<p>投资基金（LOF）的文件</p> <p>2、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同</p> <p>3、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议</p> <p>4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件</p> <p>5、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）财务报表及报表附注</p> <p>6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告</p>	<p>公楼二座 27-30 层</p>	<p>国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）</p> <p>公司网址：  <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a>。</p>
---	---------------------	--