

# 富安达中证 500 指数增强型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月25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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
§12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富安达中证500指数增强型证券投资基金
基金简称	富安达中证500指数增强
基金主代码	007943
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年11月19日
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,117,346.23份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的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%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的的业绩水平</p>
投资策略	<p>本基金股票投资比例范围为基金资产的90%—95%。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。基金以量化评估因子为基础，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>本基金以中证500指数为标的指数，通过量化组合管理方法，从优选个股、风险控制、成本控制等角度优化投资组合，力争在稳定跟踪标的指数外获取超额收益。</p>
业绩比较基准	<p>中证500指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%</p>
风险收益特征	<p>本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场</p>

	基金。同时，本基金主要投资于标的指数成分股及其备选成分股，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	------------------------------------------------

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富安达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李理想	陆志俊
	联系电话	021-61870999	95559
	电子邮箱	service@fadfunds.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-630-6999	95559
传真		021-61870888	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区世纪大道156 8号29楼	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道156 8号29楼	中国（上海）长宁区仙霞路1 8号
邮政编码		200122	200336
法定代表人		张睿	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fadfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	富安达基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)
本期已实现收益	1,323,852.95
本期利润	1,701,845.79
加权平均基金份额本期利润	0.0595
本期加权平均净值利润率	4.71%
本期基金份额净值增长率	5.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)
期末可供分配利润	8,298,733.41
期末可供分配基金份额利润	0.2584
期末基金资产净值	40,416,079.64
期末基金份额净值	1.2584
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	25.84%

注：

- ① 所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- ② 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。
- ③ 期末可供分配利润为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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④

				④		
过去一个月	0.52%	0.72%	-0.77%	0.89%	1.29%	-0.17%
过去三个月	-2.22%	0.64%	-5.10%	0.78%	2.88%	-0.14%
过去六个月	5.70%	0.66%	2.20%	0.75%	3.50%	-0.09%
过去一年	-2.04%	0.81%	-6.65%	0.91%	4.61%	-0.10%
过去三年	14.45%	1.12%	2.48%	1.13%	11.97%	-0.01%
自基金合同生效起至今	25.84%	1.16%	21.86%	1.21%	3.98%	-0.05%

注：

1. 本基金业绩比较基准为：95%×中证500指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后），

2. 本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

$$\text{Return } t = 95\% \times [\text{中证500指数收益率 } t - \text{中证500指数收益率}(t-1)] + 5\% \times [\text{商业银行活期存款利率（税后） } t - \text{商业银行活期存款利率（税后）}(t-1)]$$

$$\text{Benchmark } t = (1 + \text{Return } t) \times \text{Benchmark}(t-1)$$

其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$ 表示时间截至日。

### 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

富安达中证500指数增强型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年11月19日-2023年06月30日)





## §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

富安达基金管理有限公司由南京证券股份有限公司、江苏交通控股有限公司、南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司三家单位共同发起设立。2021年6月29日，经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】2276号文批准，江苏交通控股有限公司将其持有的本公司股权转让给江苏云杉资本管理有限公司。公司办公地点为上海浦东世纪大道1568号中建大厦，注册资本8.18亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念，以基金持有人利益最大化为首要经营目标，为客户提供卓越的理财服务。

截至2023年6月30日，公司共管理二十三只开放式基金：富安达优势成长混合型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金、富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达现金货币市场证券投资基金、富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金、富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金、富安达消费主题灵活配置混合型证券投资基金、富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、富安达富利纯债债券型证券投资基金、富安达中证500指数增强型证券投资基金、富安达科技领航混合型证券投资基金、富安达科技创新混合型发起式证券投资基金、富安长三角区域主题混合型发起式证券投资基金、富安达医药创新混合型证券投资基金、富安达中小盘六个月持有期混合型发起式证券投资基金、富安达成成长价值一年持有期混合型证券投资基金、富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金、富安达先进制造混合型发起式证券投资基金、富安达产业优选混合型证券投资基金、富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金、富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金。

#### 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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
纪青	本基金的基金经理、指数与量化投资部副经理（主	2019-1-19	-	15年	硕士。历任中海基金投研中心金融工程分析师。201

	持工作)			3年4月加入富安达基金管理有限公司。2016年12月起担任富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金(2016年12月16日至2021年11月3日期间)、富安达中证500指数增强型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金(2021年8月11日至2022年10月28日期间)、富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金的基金经理。2022年7月至2022年11月兼任投资经理。
--	------	--	--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：

- 1.任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，任职日期为基金合同生效日。
- 2.证券从业年限计算标准遵从中国证监会《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》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和其他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,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》，并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系，涵盖了所有投资组合，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节，确保公平对待旗下的每一个投资组合。本报告期

内，公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截止报告日，公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析，按照特定计算周期，分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异，未发现公平交易异常情形。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023年上半年，人工智能主题和“中特估”主题无疑是A股市场最亮眼的两条主线。从市场风格表现来看，小市值风格、低估值高分红风格因子表现较好，而成长性风格则表现不佳。由于经济恢复动能低于预期，行业层面表现出了一定的结构化差异，上半年表现最好的通信、传媒、计算机行业和表现最差的消费者服务行业收益率相差平均超过60%。所以，整体平淡，局部火热，是上半年A股市场的典型特征。而本基金于报告期内立足量化策略，在严格控制组合在相关行业、板块的相对风险暴露基础上，较好地适应了结构化市场特征，同时多因子组合也为产品持续贡献了超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达中证500指数增强基金份额净值为1.2584元，本报告期内，基金份额净值增长率为5.70%，同期业绩比较基准收益率为2.20%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入下半年，考虑到人工智能产业链整体的高波动性以及可能受到的美国限制风险，后续对细分产业及标的的选择提出了更高的筛选要求；而在国内经济复苏层面，虽然当前一些经济指标仍在回落，但回落幅度有不同程度的收窄，显现逐步趋稳的态势。同时，政策层面虽然有较强的定力，但逆周期调节也将进入关键阶段，即全面的支持政策可期，因此当前不宜对A股抱以过于悲观的情绪。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司总经理担任估值委员会主席，估值委员会成员由公司总经理、督察长、首席信息官、基金经理、以及投资研究部、固定收益部、多资

产投资部、监察稽核部和基金事务部负责人组成，公司其他高级管理人员可列席参会。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议；可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，参与估值程度和估值技术的讨论，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行收益分配。

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

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。针对该情形，本基金管理人的解决方案为：稳健运作，做好基金业绩，稳定基金规模；积极沟通，整合资源，有序推进营销工作。上述方案已按《公开募集证券投资基金运作管理办法》要求向中国证监会备案并落实解决措施。

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在富安达中证500指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，富安达基金管理有限公司在富安达中证500指数增强型证券投资基金投资运作、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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由富安达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富安达中证500指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：富安达中证500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,745,178.19	3,151,405.30
结算备付金		242,969.65	119,789.11
存出保证金		12,318.75	6,298.72
交易性金融资产	6.4.7.2	37,757,805.16	23,581,283.33
其中：股票投资		37,757,805.16	23,581,283.33
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-

应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,132.37	4,840,353.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		40,760,404.12	31,699,129.59
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1,388,086.44
应付赎回款		19.58	-
应付管理人报酬		24,725.93	15,639.23
应付托管费		4,945.18	3,127.86
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	314,633.79	234,881.07
负债合计		344,324.48	1,641,734.60
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	32,117,346.23	25,247,903.29
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	8,298,733.41	4,809,491.70
净资产合计		40,416,079.64	30,057,394.99
负债和净资产总计		40,760,404.12	31,699,129.59

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额净值1.2584元，基金份额总额32,117,346.23份。

## 6.2 利润表

会计主体：富安达中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		2,023,065.71	-2,000,122.85
1.利息收入		11,813.26	5,993.71
其中：存款利息收入	6.4.7.9	11,813.26	5,993.71
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		1,531,026.29	-3,657,820.39
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,084,373.61	-3,812,794.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	446,652.68	154,974.04
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)	6.4.7.16	377,992.84	1,649,173.82
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	102,233.32	2,530.01
<b>减：二、营业总支出</b>		321,219.92	238,990.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	134,668.79	78,574.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	26,933.76	15,714.96
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	159,617.37	144,700.98
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		1,701,845.79	-2,239,113.32
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		1,701,845.79	-2,239,113.32
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,701,845.79	-2,239,113.32

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：富安达中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日



	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	25,247,903.29	-	4,809,491.70	30,057,394.99
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	25,247,903.29	-	4,809,491.70	30,057,394.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,869,442.94	-	3,489,241.71	10,358,684.65
（一）、综合收益总额	-	-	1,701,845.79	1,701,845.79
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	6,869,442.94	-	1,787,395.92	8,656,838.86
其中：1.基金申购款	17,849,530.10	-	4,984,065.04	22,833,595.14
2.基金赎回款	-10,980,087.16	-	-3,196,669.12	-14,176,756.28
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-

（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	32,117,346.23	-	8,298,733.41	40,416,079.64
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	17,499,339.69	-	7,083,899.82	24,583,239.51
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	17,499,339.69	-	7,083,899.82	24,583,239.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-961,213.91	-	-2,376,820.91	-3,338,034.82
（一）、综合收益总额	-	-	-2,239,113.32	-2,239,113.32
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-961,213.91	-	-137,707.59	-1,098,921.50
其中：1.基金申购款	540,695.39	-	134,296.74	674,992.13

2.基金赎回款	-1,501,909.30	-	-272,004.33	-1,773,913.63
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	16,538,125.78	-	4,707,078.91	21,245,204.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

王胜

孙爱民

王雪

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富安达中证500指数增强型证券投资基金(以下简称"本基金")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[2019]1329号《关于准予富安达中证500指数增强型证券投资基金注册的批复》注册,由富安达基金管理有限公司(以下简称"富安达基金")依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币297,120,955.39元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第1900474号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》于2019年11月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为297,167,480.72份基金份额,其中认购资金利息折合46,525.33份基金份额。本基金的基金管理人为富安达基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股(包含主板、中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具(股指期货、国债期货等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例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、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金(不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率 $\times$ 95%+商业银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于2023年8月25日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁

日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	2,745,178.19
等于：本金	2,744,710.82
加：应计利息	467.37
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	2,745,178.19

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2023年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		38,101,593.55	-	37,757,805.16	-343,788.39
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		38,101,593.55	-	37,757,805.16	-343,788.39

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.04
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	155,126.38
其中：交易所市场	155,126.38
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,507.37
其他应付	50,000.00
合计	314,633.79

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,247,903.29	25,247,903.29
本期申购	17,849,530.10	17,849,530.10
本期赎回（以“-”号填列）	-10,980,087.16	-10,980,087.16
本期末	32,117,346.23	32,117,346.23

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	9,446,318.91	-4,636,827.21	4,809,491.70
本期利润	1,323,852.95	377,992.84	1,701,845.79
本期基金份额交易产生的变动数	2,850,415.53	-1,063,019.61	1,787,395.92
其中：基金申购款	7,484,456.13	-2,500,391.09	4,984,065.04
基金赎回款	-4,634,040.60	1,437,371.48	-3,196,669.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,620,587.39	-5,321,853.98	8,298,733.41

#### 6.4.7.9 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06月30日
活期存款利息收入	9,794.21
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,710.32
其他	308.73
合计	11,813.26

**6.4.7.10 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06月30日
卖出股票成交总额	160,867,903.72
减：卖出股票成本总额	159,314,148.42
减：交易费用	469,381.69
买卖股票差价收入	1,084,373.61

**6.4.7.11 债券投资收益**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	446,652.68
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	446,652.68

#### 6.4.7.16 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06月30日
1.交易性金融资产	377,992.84
——股票投资	377,992.84
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	377,992.84

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	102,233.32
合计	102,233.32

注：

- 1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。
- 2.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
汇划手续费	110.00
指数使用费	100,000.00
合计	159,617.37

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，关联方关系未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富安达资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司
南京证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
富安达基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

注：

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
南京证券股份有限公司	128,408,488.54	38.45%	-	-

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

南京证券股份有限公司	119,587.36	42.37%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
南京证券股份有限公司	-	-	-	-

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 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等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	134,668.79	78,574.53
其中：支付销售机构的客户维护费	24,970.80	13,647.09

注：

1. 支付基金管理人富安达基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：  
日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。
2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

**6.4.10.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	26,933.76	15,714.96

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
基金合同生效日（2019年11月19日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	3,381,196.43	0.00

报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	3,381,196.43	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.53%	0.00%

注：基金管理人投资本基金适用的费率按照招募说明书的规定执行，下同。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年06月30日		上年度末 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
富安达资产管理（上海）有限公司	16,312,550.05	50.79%	8,499,000.00	33.66%

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	2,745,178.19	9,794.21	1,463,865.14	4,848.28

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 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	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023-06-28	拟筹划重大资产重组	6.97	2023-07-03	7.40	56,100	383,806.31	391,017.00	-

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。



#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成分股及其备选成分股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的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%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的的业绩水平。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。

本基金的基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系，贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。本基金的基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金的基金管理人在公司层面建立的风险控制委员会以及在董事会层面建立的合规与风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金的基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本基金的基金管理人设立了独立于各业务部门的监察稽核部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期出具监察稽核报告，报公司督察长、董事。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交

收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2023年6月30日，本基金无债券投资(2022年12月31日：同)。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2023年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。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投

资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年0 6月30	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----------------------	------	------	------	-----	----

日					
资产					
银行存款	2,745,178.19	-	-	-	2,745,178.19
结算备付金	242,969.65	-	-	-	242,969.65
存出保证金	12,318.75	-	-	-	12,318.75
交易性金融资产	-	-	-	37,757,805.16	37,757,805.16
应收申购款	-	-	-	2,132.37	2,132.37
资产总计	3,000,466.59	-	-	37,759,937.53	40,760,404.12
负债					
应付赎回款	-	-	-	19.58	19.58
应付管理人报酬	-	-	-	24,725.93	24,725.93
应付托管费	-	-	-	4,945.18	4,945.18
其他负债	-	-	-	314,633.79	314,633.79
负债总计	-	-	-	344,324.48	344,324.48
利率敏感度缺口	3,000,466.59	-	-	37,415,613.05	40,416,079.64
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,151,405.30	-	-	-	3,151,405.30
结算备付金	119,789.11	-	-	-	119,789.11
存出保证金	6,298.72	-	-	-	6,298.72
交易性金融资产	-	-	-	23,581,283.33	23,581,283.33

应收申购款	-	-	-	4,840,353.13	4,840,353.13
资产总计	3,277,493.13	-	-	28,421,636.46	31,699,129.59
负债					
应付清算款	-	-	-	1,388,086.44	1,388,086.44
应付管理人报酬	-	-	-	15,639.23	15,639.23
应付托管费	-	-	-	3,127.86	3,127.86
其他负债	-	-	-	234,881.07	234,881.07
负债总计	-	-	-	1,641,734.60	1,641,734.60
利率敏感度缺口	3,277,493.13	-	-	26,779,901.86	30,057,394.99

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2022年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022年12月31日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格

实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30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	37,757,805.16	93.42	23,581,283.33	78.45
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	37,757,805.16	93.42	23,581,283.33	78.45

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证500指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	1. 中证500指数上升5%	1,674,181.08	942,308.08
	2. 中证500指数下降5%	-1,674,181.08	-942,308.08

注：本基金本期末其他价格风险的敏感性计算中所使用的 $\beta$ 系数为股票组合的 $\beta$ 系数，即资产负债表日投资组合内各个股票的 $\beta$ 加权平均。

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	37,366,788.16	23,581,283.33
第二层次	391,017.00	-
第三层次	-	-
合计	37,757,805.16	23,581,283.33

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	37,757,805.16	92.63
	其中：股票	37,757,805.16	92.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,988,147.84	7.33
8	其他各项资产	14,451.12	0.04
9	合计	40,760,404.12	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

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	475,115.00	1.18
B	采矿业	1,375,846.00	3.40
C	制造业	20,712,744.36	51.25



D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	658,936.00	1.63
E	建筑业	446,543.00	1.10
F	批发和零售业	979,029.80	2.42
G	交通运输、仓储和邮政业	724,030.00	1.79
H	住宿和餐饮业	214,135.00	0.53
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,728,104.00	4.28
J	金融业	3,473,966.00	8.60
K	房地产业	479,110.00	1.19
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	858,500.00	2.12
S	综合	-	-
	合计	32,126,059.16	79.49

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,295,942.00	10.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	744,674.00	1.84
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	345,210.00	0.85
J	金融业	245,920.00	0.61
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,631,746.00	13.93

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通投资股票投资组合。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300724	捷佳伟创	5,800	651,630.00	1.61
2	600580	卧龙电驱	38,300	559,563.00	1.38
3	002422	科伦药业	18,800	557,984.00	1.38
4	002223	鱼跃医疗	14,900	536,251.00	1.33
5	000423	东阿阿胶	9,800	523,810.00	1.30

6	002600	领益智造	75,600	522,396.00	1.29
7	002025	航天电器	8,000	510,400.00	1.26
8	600060	海信视像	20,500	507,375.00	1.26
9	601233	桐昆股份	37,000	490,250.00	1.21
10	000738	航发控制	20,000	488,000.00	1.21
11	002056	横店东磁	26,700	486,207.00	1.20
12	000630	铜陵有色	167,900	485,231.00	1.20
13	002673	西部证券	75,900	481,965.00	1.19
14	000728	国元证券	73,500	479,220.00	1.19
15	000400	许继电气	20,600	474,830.00	1.17
16	300866	安克创新	5,400	472,500.00	1.17
17	600486	扬农化工	5,400	472,068.00	1.17
18	603233	大参林	16,780	470,007.80	1.16
19	600497	驰宏锌锗	93,100	467,362.00	1.16
20	002273	水晶光电	39,000	465,660.00	1.15
21	600549	厦门钨业	24,300	462,429.00	1.14
22	600528	中铁工业	46,800	462,384.00	1.14
23	300088	长信科技	75,600	455,868.00	1.13
24	300136	信维通信	22,700	455,816.00	1.13
25	000878	云南铜业	40,900	451,945.00	1.12
26	600582	天地科技	77,500	451,825.00	1.12
27	600637	东方明珠	57,400	448,868.00	1.11
28	000997	新大陆	23,700	447,930.00	1.11
29	600566	济川药业	15,400	447,216.00	1.11
30	600820	隧道股份	74,300	446,543.00	1.10
31	688819	天能股份	12,104	445,911.36	1.10
32	600282	南钢股份	132,200	445,514.00	1.10
33	688281	华秦科技	2,200	445,500.00	1.10
34	002128	电投能源	33,600	444,192.00	1.10
35	002244	滨江集团	50,300	443,646.00	1.10
36	301029	怡合达	9,920	443,225.60	1.10

37	002958	青农商行	162,800	442,816.00	1.10
38	600369	西南证券	120,900	441,285.00	1.09
39	002500	山西证券	79,000	440,820.00	1.09
40	688188	柏楚电子	2,300	433,688.00	1.07
41	601231	环旭电子	28,900	432,344.00	1.07
42	603737	三棵树	6,580	430,463.60	1.07
43	603160	汇顶科技	9,300	430,125.00	1.06
44	002985	北摩高科	9,700	427,964.00	1.06
45	002745	木林森	46,500	427,800.00	1.06
46	600271	航天信息	31,000	424,390.00	1.05
47	600517	国网英大	74,100	422,370.00	1.05
48	002078	太阳纸业	39,400	421,186.00	1.04
49	002152	广电运通	35,900	420,748.00	1.04
50	600500	中化国际	75,500	419,780.00	1.04
51	002250	联化科技	39,100	408,986.00	1.01
52	688029	南微医学	5,000	407,800.00	1.01
53	000563	陕国投 A	133,400	406,870.00	1.01
54	603883	老百姓	13,400	399,990.00	0.99
55	600598	北大荒	30,000	399,900.00	0.99
56	000887	中鼎股份	30,400	397,936.00	0.98
57	600718	东软集团	37,300	397,618.00	0.98
58	600782	新钢股份	106,200	394,002.00	0.97
59	601158	重庆水务	70,600	392,536.00	0.97
60	601298	青岛港	56,100	391,017.00	0.97
61	600801	华新水泥	31,600	390,260.00	0.97
62	000156	华数传媒	41,800	363,660.00	0.90
63	601997	贵阳银行	69,500	358,620.00	0.89
64	688516	奥特维	1,900	357,960.00	0.89
65	000937	冀中能源	55,800	356,004.00	0.88
66	601098	中南传媒	28,900	335,240.00	0.83
67	601228	广州港	103,100	333,013.00	0.82

68	300618	寒锐钴业	9,400	304,654.00	0.75
69	000155	川能动力	18,500	266,400.00	0.66
70	300888	稳健医疗	6,140	255,853.80	0.63
71	002867	周大生	13,500	240,030.00	0.59
72	300438	鹏辉能源	4,900	235,396.00	0.58
73	600258	首旅酒店	11,300	214,135.00	0.53
74	601928	凤凰传媒	14,000	159,600.00	0.39
75	002465	海格通信	11,800	122,012.00	0.30
76	600056	中国医药	8,400	109,032.00	0.27
77	600985	淮北矿业	9,400	108,288.00	0.27
78	002110	三钢闽光	25,300	106,766.00	0.26
79	000998	隆平高科	4,900	75,215.00	0.19
80	300308	中际旭创	300	44,235.00	0.11
81	300073	当升科技	800	40,264.00	0.10
82	600208	新湖中宝	14,300	35,464.00	0.09

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600612	老凤祥	5,900	412,292.00	1.02
2	600288	大恒科技	32,700	394,689.00	0.98
3	002588	史丹利	62,300	378,784.00	0.94
4	600309	万华化学	4,300	377,712.00	0.93
5	000858	五粮液	2,300	376,211.00	0.93
6	003816	中国广核	120,400	374,444.00	0.93
7	600674	川投能源	24,600	370,230.00	0.92
8	002004	华邦健康	73,000	365,000.00	0.90
9	002594	比亚迪	1,400	361,578.00	0.89
10	600941	中国移动	3,700	345,210.00	0.85
11	600519	贵州茅台	200	338,200.00	0.84

12	688163	赛伦生物	15,000	320,250.00	0.79
13	000596	古井贡酒	1,100	272,118.00	0.67
14	601318	中国平安	5,300	245,920.00	0.61
15	002130	沃尔核材	29,400	238,728.00	0.59
16	688050	爱博医疗	800	164,264.00	0.41
17	002734	利民股份	16,400	151,208.00	0.37
18	600881	亚泰集团	51,800	109,298.00	0.27
19	600585	海螺水泥	1,500	35,610.00	0.09

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603605	珀莱雅	1,432,798.00	4.77
2	600566	济川药业	1,393,937.00	4.64
3	600528	中铁工业	1,391,414.60	4.63
4	002745	木林森	1,305,783.57	4.34
5	002128	电投能源	1,232,108.94	4.10
6	601158	重庆水务	1,230,086.00	4.09
7	002273	水晶光电	1,150,558.00	3.83
8	603737	三棵树	1,132,777.00	3.77
9	002078	太阳纸业	1,112,227.00	3.70
10	600352	浙江龙盛	1,108,212.00	3.69
11	002465	海格通信	1,107,929.00	3.69
12	000997	新大陆	1,105,461.00	3.68
13	600500	中化国际	1,078,472.00	3.59
14	600497	驰宏锌锗	1,075,694.00	3.58
15	000630	铜陵有色	1,054,986.00	3.51
16	002152	广电运通	1,030,189.99	3.43
17	002056	横店东磁	1,023,051.00	3.40

18	601997	贵阳银行	1,021,289.00	3.40
19	000156	华数传媒	1,001,716.00	3.33
20	000623	吉林敖东	989,950.00	3.29
21	000878	云南铜业	981,179.00	3.26
22	002048	宁波华翔	974,817.00	3.24
23	600867	通化东宝	970,149.59	3.23
24	002673	西部证券	968,859.00	3.22
25	600535	天士力	948,285.00	3.15
26	002625	光启技术	935,638.00	3.11
27	688009	中国通号	934,027.49	3.11
28	600642	申能股份	931,967.00	3.10
29	600582	天地科技	920,435.00	3.06
30	601106	中国一重	907,522.00	3.02
31	600060	海信视像	907,336.00	3.02
32	600637	东方明珠	901,871.00	3.00
33	688819	天能股份	888,171.80	2.95
34	600373	中文传媒	887,154.00	2.95
35	000898	鞍钢股份	876,923.00	2.92
36	000869	张裕 A	876,071.00	2.91
37	000559	万向钱潮	867,917.00	2.89
38	002130	沃尔核材	852,301.00	2.84
39	003816	中国广核	851,727.00	2.83
40	000728	国元证券	841,932.00	2.80
41	600170	上海建工	840,906.00	2.80
42	600299	安迪苏	827,895.99	2.75
43	601298	青岛港	818,059.00	2.72
44	688385	复旦微电	810,185.21	2.70
45	600008	首创环保	795,210.00	2.65
46	600157	永泰能源	795,140.00	2.65
47	601211	国泰君安	794,850.00	2.64
48	601318	中国平安	779,501.00	2.59

49	600755	厦门国贸	775,205.00	2.58
50	600985	淮北矿业	772,795.00	2.57
51	600517	国网英大	764,222.00	2.54
52	601138	工业富联	758,406.00	2.52
53	600350	山东高速	758,022.68	2.52
54	000887	中鼎股份	746,923.00	2.48
55	603589	口子窖	731,376.00	2.43
56	000563	陕国投 A	730,230.00	2.43
57	601607	上海医药	718,064.12	2.39
58	000937	冀中能源	717,083.00	2.39
59	601699	潞安环能	716,598.00	2.38
60	600143	金发科技	713,286.00	2.37
61	600519	贵州茅台	698,228.00	2.32
62	000783	长江证券	696,555.00	2.32
63	002603	以岭药业	687,011.00	2.29
64	600271	航天信息	676,908.00	2.25
65	600064	南京高科	673,056.00	2.24
66	002422	科伦药业	669,714.00	2.23
67	000807	云铝股份	667,716.00	2.22
68	600704	物产中大	653,640.00	2.17
69	600380	健康元	648,711.00	2.16
70	002439	启明星辰	647,547.00	2.15
71	000932	华菱钢铁	641,734.00	2.14
72	002384	东山精密	639,628.00	2.13
73	603688	石英股份	637,583.00	2.12
74	002958	青农商行	635,768.00	2.12
75	300136	信维通信	633,793.00	2.11
76	300144	宋城演艺	628,002.00	2.09
77	600161	天坛生物	623,325.00	2.07
78	603658	安图生物	615,635.00	2.05
79	601231	环旭电子	614,692.00	2.05



80	688122	西部超导	612,649.54	2.04
81	002294	信立泰	605,790.00	2.02
82	600369	西南证券	602,251.00	2.00

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603605	珀莱雅	1,353,440.00	4.50
2	601106	中国一重	1,251,710.00	4.16
3	600373	中文传媒	1,182,806.28	3.94
4	600157	永泰能源	1,154,978.00	3.84
5	601607	上海医药	1,126,735.00	3.75
6	000623	吉林敖东	1,068,655.00	3.56
7	000783	长江证券	1,059,161.00	3.52
8	600352	浙江龙盛	1,058,709.00	3.52
9	002465	海格通信	1,043,302.00	3.47
10	002384	东山精密	1,026,576.00	3.42
11	600528	中铁工业	1,024,987.00	3.41
12	600566	济川药业	1,009,405.00	3.36
13	688122	西部超导	1,006,615.68	3.35
14	600867	通化东宝	1,001,964.00	3.33
15	600535	天士力	997,538.00	3.32
16	600143	金发科技	992,325.00	3.30
17	000997	新大陆	991,629.00	3.30
18	600380	健康元	985,686.00	3.28
19	688009	中国通号	981,458.98	3.27
20	002273	水晶光电	961,985.00	3.20
21	601138	工业富联	955,820.00	3.18
22	000156	华数传媒	954,578.00	3.18

23	600008	首创环保	951,326.00	3.17
24	002625	光启技术	944,465.00	3.14
25	600642	申能股份	925,152.00	3.08
26	600500	中化国际	916,512.58	3.05
27	600350	山东高速	913,828.00	3.04
28	601997	贵阳银行	903,403.00	3.01
29	002745	木林森	893,308.00	2.97
30	002048	宁波华翔	892,439.00	2.97
31	002266	浙富控股	887,095.00	2.95
32	000898	鞍钢股份	886,491.00	2.95
33	600667	太极实业	885,721.00	2.95
34	000559	万向钱潮	882,632.00	2.94
35	000050	深天马 A	879,898.15	2.93
36	300003	乐普医疗	875,626.00	2.91
37	600170	上海建工	859,434.00	2.86
38	000869	张裕 A	858,394.00	2.86
39	000878	云南铜业	856,601.00	2.85
40	601158	重庆水务	852,226.61	2.84
41	600873	梅花生物	849,166.00	2.83
42	600623	华谊集团	845,847.00	2.81
43	000630	铜陵有色	842,681.00	2.80
44	601211	国泰君安	836,276.00	2.78
45	688385	复旦微电	831,364.29	2.77
46	603156	养元饮品	827,113.28	2.75
47	601727	上海电气	825,164.00	2.75
48	600998	九州通	824,157.00	2.74
49	600022	山东钢铁	816,565.00	2.72
50	600755	厦门国贸	812,954.00	2.70
51	600299	安迪苏	810,330.00	2.70
52	002128	电投能源	804,732.00	2.68
53	600160	巨化股份	796,313.00	2.65

54	600739	辽宁成大	791,786.00	2.63
55	601298	青岛港	781,733.00	2.60
56	601699	潞安环能	774,375.00	2.58
57	600489	中金黄金	770,173.32	2.56
58	601880	辽港股份	765,949.00	2.55
59	000725	京东方 A	748,457.00	2.49
60	600582	天地科技	744,756.00	2.48
61	600985	淮北矿业	741,299.00	2.47
62	600648	外高桥	738,567.00	2.46
63	600704	物产中大	716,461.00	2.38
64	300017	网宿科技	712,618.00	2.37
65	600482	中国动力	709,043.00	2.36
66	000807	云铝股份	699,692.00	2.33
67	600064	南京高科	693,494.00	2.31
68	300699	光威复材	692,174.80	2.30
69	600959	江苏有线	672,426.00	2.24
70	600871	石化油服	670,206.00	2.23
71	002078	太阳纸业	667,038.00	2.22
72	600161	天坛生物	665,004.14	2.21
73	002603	以岭药业	664,377.00	2.21
74	000785	居然之家	662,850.00	2.21
75	603589	口子窖	655,749.00	2.18
76	300231	银信科技	653,689.00	2.17
77	603606	东方电缆	650,719.00	2.16
78	603737	三棵树	650,056.00	2.16
79	002065	东华软件	644,329.00	2.14
80	600271	航天信息	644,191.00	2.14
81	002294	信立泰	640,928.00	2.13
82	002439	启明星辰	629,675.00	2.09
83	600705	中航产融	627,971.00	2.09
84	603688	石英股份	624,958.00	2.08

85	002130	沃尔核材	624,888.00	2.08
86	600655	豫园股份	612,889.00	2.04
87	300009	安科生物	611,207.00	2.03
88	600497	驰宏锌锗	610,405.00	2.03
89	002391	长青股份	609,302.00	2.03
90	000932	华菱钢铁	606,551.00	2.02
91	600967	内蒙一机	606,209.00	2.02

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	173,112,677.41
卖出股票收入（成交）总额	160,867,903.72

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.12.2** 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	12,318.75
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,132.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,451.12

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
461	69,668.86	23,686,419.24	73.75%	8,430,926.99	26.25%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	5,004.21	0.02%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

1、基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为0。

2、本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年11月19日)基金份额总额	297,167,480.72
本报告期期初基金份额总额	25,247,903.29
本报告期基金总申购份额	17,849,530.10
减：本报告期基金总赎回份额	10,980,087.16
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期期末基金份额总额

32,117,346.23

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于2023年6月6日发布公告，自2023年6月5日起聘任王胜为总经理。  
本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。  
本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	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	佣金	占当期佣金总量的比	

	数量		的比例		例	
安信证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	36,773,457.74	11.01%	34,248.28	12.14%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	24,828,952.00	7.43%	23,123.25	8.19%	-
申港证券	1	31,737,694.85	9.50%	23,210.39	8.22%	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-



长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	35,167,042.24	10.53%	25,717.26	9.11%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华龙证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	6,003,838.42	1.80%	4,390.58	1.56%	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	2	128,408,488.54	38.45%	119,587.36	42.37%	-

山西 证券	2	71,034,173.33	21.27%	51,947.01	18.41%	-
上海 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源	2	-	-	-	-	-
首创 证券	2	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
西部 证券	2	-	-	-	-	-
兴业 证券	2	-	-	-	-	-
招商 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-
中银 国际 证券	2	-	-	-	-	-

注：

1、交易单元的选择标准和程序：

我公司制定了选择券商的标准，即：

(1) 财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与公司具有互补性、最近一年内无重大违法违规行发生；

(2) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(3) 能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及其他信息咨询服务；

(4) 能根据公司特定要求，提供专门研究报告；

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；能够提供很好的交易执行。

投资研究部对潜在签约券商进行必要的尽职调查，将相应的交易单元租用协议、证券综合服务协议作为附件，发起相应OA审批流程，经审批后用印。

2、在上述租用的券商交易单元中，（56920）山西证券、（016338）五矿证券为本基金本期新增的交易单元。本基金本期剔除交易单元：（55327）大同证券。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期未通过交易单元进行其他证券投资。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2023-01-05
2	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加深圳市金斧子基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2023-01-11
3	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	规定媒介	2023-01-20
4	富安达中证500指数增强型证券投资基金2022年第4季度报告	规定媒介	2023-01-20
5	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2023-03-22
6	富安达基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	规定媒介	2023-03-30
7	富安达中证500指数增强型证券投资基金2022年年度报告	规定媒介	2023-03-30
8	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性	规定媒介	2023-04-21

	公告		
9	富安达中证500指数增强型证券投资基金2023年第1季度报告	规定媒介	2023-04-21
10	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2023-04-26
11	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2023-05-11
12	富安达基金管理有限公司关于旗下基金所持股票“富瀚微”(300613)估值调整的公告	规定媒介	2023-05-17
13	富安达基金管理有限公司关于参加平安银行股份有限公司行E通平台费率优惠活动的公告	规定媒介	2023-05-20
14	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京度小满基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2023-05-30
15	富安达基金管理有限公司关于总经理变更的公告	规定媒介	2023-06-06
16	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2023-06-20

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机	1	20230101-20230630	8,499,000.00	7,813,550.05	0.00	16,312,550.05	50.79%

构							
个人	1	20230330-20230406	0.00	9,380,814.64	9,380,814.64	0.00	0.00%
产品特有风险							
当持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大的冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。							

注：

- ① "申购份额" 包含份额申购、转换转入、红利再投等导致份额增加的情况；
- ② "赎回份额" 包含份额赎回、转换转出等导致份额减少的情况。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予富安达中证500指数增强型证券投资基金注册的文件：
  - 《富安达中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》；
  - 《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》；
  - 《富安达中证500指数增强型证券投资基金托管协议》。
- 2、《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 3、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 4、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 5、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.fadfunds.com](http://www.fadfunds.com)）查阅。

富安达基金管理有限公司  
二〇二三年八月二十九日