

富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金

二〇二三年中期报告

2023年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023年08月31日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录 .....	2
1.1	重要提示 .....	2
1.2	目录 .....	3
§2	基金简介 .....	6
2.1	基金基本情况 .....	6
2.2	基金产品说明 .....	6
2.3	基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4	信息披露方式 .....	7
2.5	其他相关资料 .....	7
§3	主要财务指标和基金净值表现 .....	8
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	8
3.2	基金净值表现 .....	9
§4	管理人报告 .....	12
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	16
§5	托管人报告 .....	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	17
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	17
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	17
§6	中期财务报告（未经审计） .....	18
6.1	资产负债表 .....	18
6.2	利润表 .....	19
6.3	净资产（基金净值）变动表 .....	20
6.4	报表附注 .....	22
§7	投资组合报告 .....	47
7.1	期末基金资产组合情况 .....	47

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	57
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12	市场中性策略执行情况.....	58
7.13	投资组合报告附注.....	58
§8	基金份额持有人信息.....	60
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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的情况.....	60
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况.....	61
§9	开放式基金份额变动.....	62
§10	重大事件揭示.....	63
10.1	基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4	基金投资策略的改变.....	63
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8	其他重大事件.....	67
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	68
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.....	68
§12	备查文件目录.....	69



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金	
基金简称	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式	
基金主代码	001641	
基金运作方式	契约型，本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。	
基金合同生效日	2015年09月17日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	96,710,744.07份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式A	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式C
下属分级基金的交易代码	001641	009149
报告期末下属分级基金的份额总额	71,557,323.29份	25,153,420.78份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	富国基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

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

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	富国基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

##### (1) 富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年01月01日至2023年06月30日)
本期已实现收益	166,772.72
本期利润	286,391.08
加权平均基金份额本期利润	0.0038
本期加权平均净值利润率	0.30%
本期基金份额净值增长率	0.32%
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	8,757,591.59
期末可供分配基金份额利润	0.1224
期末基金资产净值	89,831,914.01
期末基金份额净值	1.255
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	25.50%

##### (2) 富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年01月01日至2023年06月30日)
本期已实现收益	-68,117.06
本期利润	-10,884.29
加权平均基金份额本期利润	-0.0004
本期加权平均净值利润率	-0.03%
本期基金份额净值增长率	-0.08%
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	2,255,363.92
期末可供分配基金份额利润	0.0897
期末基金资产净值	30,767,981.10
期末基金份额净值	1.223
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	-0.24%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### (1) 富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.08%	0.18%	0.37%	0.01%	-0.45%	0.17%
过去三个月	-0.63%	0.22%	1.12%	0.01%	-1.75%	0.21%
过去六个月	0.32%	0.23%	2.23%	0.02%	-1.91%	0.21%
过去一年	-1.95%	0.23%	4.50%	0.01%	-6.45%	0.22%
过去三年	-4.92%	0.35%	13.49%	0.01%	-18.41%	0.34%
自基金合同生效起至今	25.50%	0.30%	35.06%	0.01%	-9.56%	0.29%

##### (2) 富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C

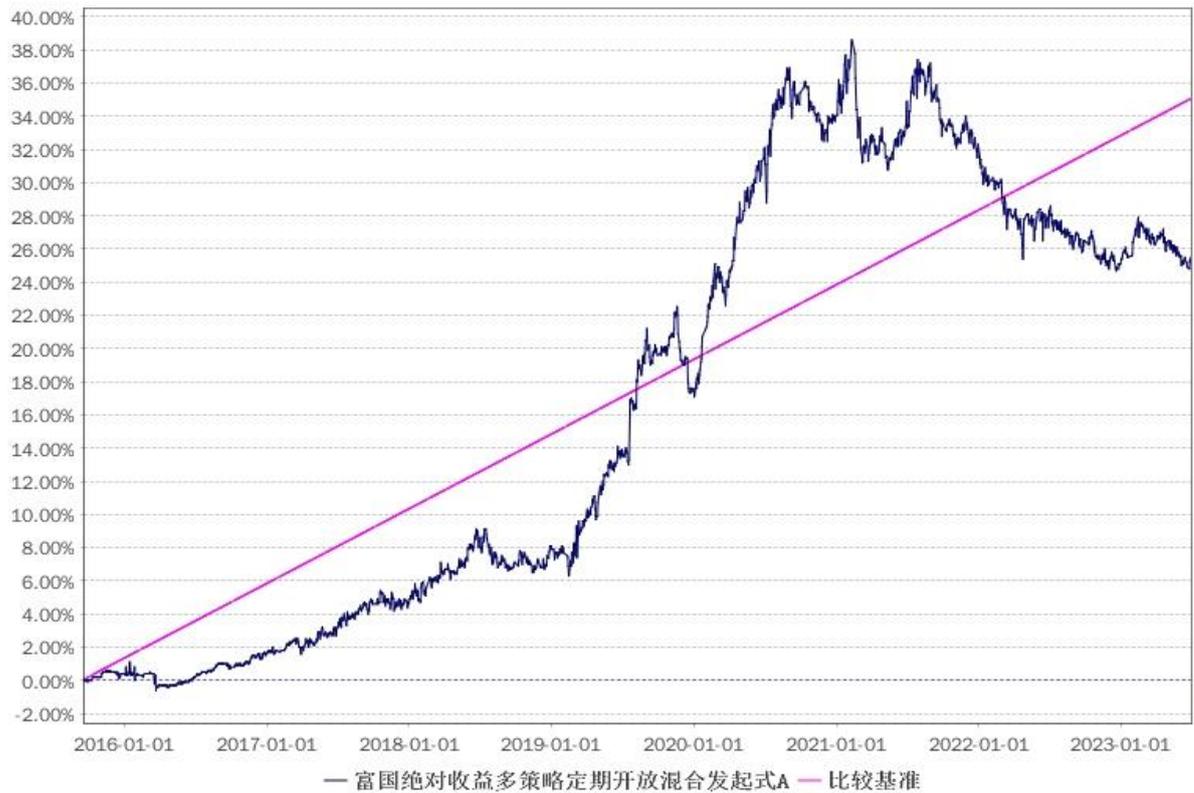
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.16%	0.18%	0.37%	0.01%	-0.53%	0.17%
过去三个月	-0.81%	0.22%	1.12%	0.01%	-1.93%	0.21%
过去六个月	-0.08%	0.23%	2.23%	0.02%	-2.31%	0.21%
过去一年	-2.78%	0.23%	4.50%	0.01%	-7.28%	0.22%
过去三年	-7.14%	0.35%	13.49%	0.01%	-20.63%	0.34%
自基金分级生效日起至今	-0.24%	0.35%	14.71%	0.01%	-14.95%	0.34%

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

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

##### (1) 自基金合同生效以来富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A 基金累计

## 净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2023年6月30日。

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

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



注：1、截止日期为2023年6月30日。

2、本基金自2020年3月23日起增加C类份额，相关数据按实际存续期计算。

## § 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 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 304 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
于鹏	本基金现任基金经理	2015-11-26	—	15	博士，曾任 HSBC BANK PLC（汇丰银行）固定收益证券策略分析师，中国国际金融（香港）有限公司高级固定收益证券策略分析师，Millennium Capital Partners

					LLP（英国千禧资本）固定收益策略分析师；自2013年4月加入富国基金管理有限公司，历任固定收益投资经理、权益基金经理；现任富国基金权益投资部权益投资总监助理兼高级权益基金经理。自2015年11月起任富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理；自2017年11月起任富国研究量化精选混合型证券投资基金基金经理；自2022年07月起任富国中证500基本面精选股票型发起式证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及

授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现3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**

本基金在报告期内根据不同的对冲标的构建现货组合，力争获取相应的超额收益。通过股指期货工具，本基金将相应相对收益转化为绝对收益。

本基金在报告期内维持一定多头头寸，这部分暴露在报告期内相对中性。

在报告期内，股指期货基差贴水并不显著，考虑市场分红水平，基差负面影响已经减弱很多。在一定程度上，考虑到新股收益水平在近期已经大幅收敛，我们认识股指期货基差环境会持续有利于市场中性产品运作。

在现货组合构建中，我们认为个股选择和组合管理是获得相对收益的关键，前者的核心在于对标的的基本面的判断，而后的关键是控制组合和跟踪标的之间的差异。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值 A 级为 1.255 元，C 级为 1.223 元；份额累计净值 A 级为 1.255 元，C 级为 1.223 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为 0.32%，C 级为-0.08%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 2.23%，C 级为 2.23%。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

AI 相关主题形成上半年权益市场主线，但从市场风格来看，价值风格超额收益还在持续。在报告期内，A 股市场宏观层面博弈主要体现在对国内经济预期别的波动，在经历了一季度中向好的经济数据后，二季度伴随着进出口数据波动，市场也对经济增长预期进一步修正。

从海外来看，市场对美联储加息预期见顶比较充分，整体权益市场体现也比较充分，但从全球来看，美股美元相对强势，也对新兴市场形成压力。

从中长期来看，我们认为 A 股市场具备较好的配置价值。市场股息利率差已经接近历史极值，整体估值分位也在历史较低位置，相关指标都提示市场具备上涨的空间。虽然短期存量博弈的格局短期不会改变，但市场整体资金存量也会让结构性机会更加显著。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，

本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

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

## § 6 中期财务报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	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	9,376,959.39	14,748,756.83
结算备付金	11,212,294.68	12,100,509.99
存出保证金	9,582,132.43	10,074,636.27
交易性金融资产	90,865,741.63	87,682,970.36
其中：股票投资	90,853,740.76	87,616,026.54
基金投资	—	—
债券投资	12,000.87	66,943.82
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	—	73,280.58
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	121,037,128.13	124,680,154.03
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末</b> 2023年06月 30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	—	—
应付管理人报酬	102,088.23	122,065.53
应付托管费	25,522.06	30,516.42
应付销售服务费	20,333.90	27,794.94
应付投资顾问费	—	—
应交税费	—	0.35

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	289,288.83	313,710.57
负债合计	437,233.02	494,087.81
<b>净资产：</b>		
实收基金	96,710,744.07	99,828,359.91
其他综合收益	—	—
未分配利润	23,889,151.04	24,357,706.31
净资产合计	120,599,895.11	124,186,066.22
负债和净资产总计	121,037,128.13	124,680,154.03

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.247 元，基金份额总额 96,710,744.07 份。其中：富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A 份额净值 1.255 元，份额总额 71,557,323.29 份；富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C 份额净值 1.223 元，份额总额 25,153,420.78 份。基金资产净值（暂估附加管理费前）120,599,895.11 元，暂估附加管理费金额 0.00 元，基金资产净值（暂估附加管理费后）120,599,895.11 元。

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

## 6.2 利润表

会计主体：富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 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)	上年度可比期间 (2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	1,274,069.02	-9,958,556.75
1.利息收入	78,533.42	232,408.66
其中：存款利息收入	78,533.42	232,408.66
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	—	—
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	1,018,482.37	-4,313,751.61
其中：股票投资收益	2,767,829.99	-41,855,357.35
基金投资收益	—	—
债券投资收益	38,938.24	194,053.87
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	-2,784,030.64	35,992,391.01
股利收益	995,744.78	1,355,160.86
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）	176,851.13	-6,068,656.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	202.10	191,442.60
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>998,562.23</b>	<b>1,953,878.97</b>
1. 管理人报酬	622,445.38	1,316,013.34
2. 托管费	155,611.40	329,003.31
3. 销售服务费	125,161.21	40,101.88
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	0.03	168,391.83
8. 其他费用	95,344.21	100,368.61
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>275,506.79</b>	<b>-11,912,435.72</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>275,506.79</b>	<b>-11,912,435.72</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>275,506.79</b>	<b>-11,912,435.72</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净	99,828,359.91	24,357,706.31	124,186,066.22

值)			
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	99,828,359.91	24,357,706.31	124,186,066.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,117,615.84	-468,555.27	-3,586,171.11
（一）、综合收益总额	—	275,506.79	275,506.79
（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）	-3,117,615.84	-744,062.06	-3,861,677.90
其中：1.基金申购款	4,287,247.13	1,139,166.02	5,426,413.15
2.基金赎回款	-7,404,862.97	-1,883,228.08	-9,288,091.05
（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）	96,710,744.07	23,889,151.04	120,599,895.11
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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	291,073,243.07	93,816,460.94	384,889,704.01
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	291,073,243.07	93,816,460.94	384,889,704.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	—	—	—
	181,687,347.07	63,290,662.03	244,978,009.10
（一）、综合收益总额	—	—	—
	—	11,912,435.72	-11,912,435.72
（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）	—	—	—
	181,687,347.07	51,378,226.31	233,065,573.38
其中：1.基金申购款	191,380.70	53,074.13	244,454.83
2.基金赎回款	—	—	—
	181,878,727.77	51,431,300.44	233,310,028.21
（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）	109,385,896.00	30,525,798.91	139,911,694.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈 戈	林志松	徐 慧
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、股指期货、权证、债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

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

托凭证市值、买入股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类多头工具价值的合计值。

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

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

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

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 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净值变动情况。

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

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

#### 6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

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

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

##### 2 增值税

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

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

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

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

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

### 3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

### 4 企业所得税

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

### 5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 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	9,376,959.39
等于：本金	9,375,742.89
加：应计利息	1,216.50
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	9,376,959.39

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2023年06月30日）			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	93,220,454.66	—	90,853,740.76	—
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	12,000.00	12,000.87	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	12,000.00	12,000.87	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	93,232,454.66	0.87	90,865,741.63	—
				2,366,713.90

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末（2023年06月30日）			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	-82,415,962.87	—	—	—
IF2309	-39,226,123.64	—	—	—
IC2307	-22,858,169.23	—	—	—
IC2309	-14,604,640.00	—	—	—
IF2307	-3,426,090.00	—	—	—
IF2308	-2,300,940.00	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	-82,415,962.87	—	—	—

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

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2308	IF2308	-2.00	—	1,140.00

			2,299,800.00	
IF2307	IF2307	-3.00	3,447,360.00	-21,270.00
IC2309	IC2309	-12.00	14,328,000.00	276,640.00
IC2307	IC2307	-19.00	22,765,040.00	93,129.23
IF2309	IF2309	-32.00	36,854,400.00	2,371,723.64
合计				2,721,362.87
减：可抵销期货暂收款				2,721,362.87
净额				—

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

#### 6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2023年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	169,924.62
其中：交易所市场	169,924.62
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	59,364.21
合计	289,288.83

#### 6.4.7.7 实收基金

富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A:

金额单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	73,929,872.12	73,929,872.12
本期申购	4,272,668.15	4,272,668.15
本期赎回（以“-”号填列）	-6,645,216.98	-6,645,216.98
本期末	71,557,323.29	71,557,323.29

富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C:

金额单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,898,487.79	25,898,487.79
本期申购	14,578.98	14,578.98
本期赎回（以“-”号填列）	-759,645.99	-759,645.99
本期末	25,153,420.78	25,153,420.78

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	8,888,916.54	9,671,863.75	18,560,780.29
本期利润	166,772.72	119,618.36	286,391.08
本期基金份额交易产生的变动数	-298,097.67	-274,482.98	-572,580.65
其中：基金申购款	540,770.61	594,972.39	1,135,743.00
基金赎回款	-838,868.28	-869,455.37	-1,708,323.65
本期已分配利润	—	—	—
本期末	8,757,591.59	9,516,999.13	18,274,590.72

富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,394,294.57	3,402,631.45	5,796,926.02
本期利润	-68,117.06	57,232.77	-10,884.29
本期基金份额交易产生的变动数	-70,813.59	-100,667.82	-171,481.41
其中：基金申购款	1,409.54	2,013.48	3,423.02
基金赎回款	-72,223.13	-102,681.30	-174,904.43
本期已分配利润	—	—	—
本期末	2,255,363.92	3,359,196.40	5,614,560.32

#### 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	9,809.72
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	68,571.84
其他	151.86
合计	78,533.42

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
卖出股票成交总额	247,842,689.78
减：卖出股票成本总额	244,427,957.65
减：交易费用	646,902.14
买卖股票差价收入	2,767,829.99

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
债券投资收益——利息收入	22.13
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	38,916.11
合计	38,938.24

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	196,058.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	157,100.00
减：应计利息总额	34.67
减：交易费用	7.86
债券投资收益-差价收入	38,916.11

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
股指期货投资收益	-2,784,030.64

#### 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	995,744.78
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	995,744.78

#### 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	-1,495,618.69
股票投资	-1,482,687.89
债券投资	-12,930.80
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	1,672,469.82
权证投资	—
股指期货-套保卖出股指期货	1,672,469.82
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	176,851.13

#### 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	113.87
基金转换费收入	88.23
合计	202.10

#### 6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
审计费用	16,364.21
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	380.00
债券账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	95,344.21

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构、基金发起人
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（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（%）
海通证券	57,153,358.08	11.51	43,760,626.22	4.94
申万宏源	52,531,868.44	10.58	179,168,664.87	20.23

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（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	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
申万宏源	17,406.15	8.88	—	—

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）

	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	41,223.64	11.45	4,084.21	2.40
申万宏源	37,891.13	10.53	13,924.19	8.19
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)			
	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
申万宏源	163,520.07	20.23	22,337.18	10.00
海通证券	40,181.79	4.97	31,660.81	14.17

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。

#### 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	622,445.38	1,316,013.34
其中：支付销售机构的客户维护费	229,851.37	261,090.16

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

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

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金基本管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

### 6.4.10.2.2 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	155,611.40	329,003.31

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	合计
富国基金管理有限公司	—	18,167.72	18,167.72
合计	—	18,167.72	18,167.72

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06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	合计
富国基金管理有限公司	—	2,168.70	2,168.70
合计	—	2,168.70	2,168.70

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0.80%年费率计提。销售服务费计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

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）	
	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C
基金合同生效日（2015年09月17日）持有的基金份额	10,007,200.72	—	10,007,200.72	—
期初持有的基金份额	—	—	—	—
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	—	—	—	—
期末持有的基金份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	—	—	—

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。

#### 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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 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
中国建设银行股份有限公司	9,376,959.39	9,809.72	15,493,574.08	43,864.35

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	688062	迈威生物	IPO网下申购	8,578	300,006.97
海通证券股份有限公司	688220	翱捷科技	IPO网下申购	1,999	330,560.04

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（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

###### 6.4.12.1.1 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位： 张)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
111014	李子转债	2023-06-20	1个月内 (含)	认购新发 证券	100.00	100.01	120	12,000.00	12,000.87	—

###### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2023年06月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年06月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2023 年 06 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
AAA	—	—
AAA 以下	12,000.87	66,943.82
未评级	—	—
合计	12,000.87	66,943.82

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

#### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带

来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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

本基金采用定期开放的运作方式，封闭期内不得申请申购、赎回本基金。在开放期内，本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### **6.4.13.4 市场风险**

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

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

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

###### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

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

单位：人民币元

本期末（2023年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,376,959.39	—	—	—	—	—	9,376,959.39
结算备付金	11,212,294.68	—	—	—	—	—	11,212,294.68
存出保证金	18,780.43	—	—	—	—	9,563,352.00	9,582,132.43
交易性金融资产	—	—	12,000.87	—	—	90,853,740.76	90,865,741.63
资产总计	20,608,034.50	—	12,000.87	—	—	100,417,092.76	121,037,128.13
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	102,088.23	102,088.23
应付托管费	—	—	—	—	—	25,522.06	25,522.06
应付销售服务费	—	—	—	—	—	20,333.90	20,333.90
其他负债	—	—	—	—	—	289,288.83	289,288.83
负债总计	—	—	—	—	—	437,233.02	437,233.02
利率敏感度缺口	20,608,034.50	—	12,000.87	—	—	99,979,859.74	120,599,895.11
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							
银行存款	14,748,756.83	—	—	—	—	—	14,748,756.83
结算备付金	12,100,509.99	—	—	—	—	—	12,100,509.99
存出保证金	21,498.67	—	—	—	—	10,053,137.60	10,074,636.27
交易性金融资产	—	—	66,943.82	—	—	87,616,026.54	87,682,970.36
应收清算款	—	—	—	—	—	73,280.58	73,280.58

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、权证、债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类空头工具价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类多头工具价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2023 年 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	90,853,740.76	75.33	87,616,026.54	70.55
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	12,000.87	0.01	66,943.82	0.05
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	90,865,741.63	75.34	87,682,970.36	70.61

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

假设	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	相关风险变量的变动	本期末（2023 年 06 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	1. 市场基准增加 1%	137,651.84	143,947.12
	2. 市场基准减少 1%	-137,651.84	-143,947.12

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 (2023年06月30日)	上年度末 (2022年12月31日)
第一层次	90,853,740.76	87,497,783.60
第二层次	12,000.87	129,526.80
第三层次	—	55,659.96
合计	90,865,741.63	87,682,970.36

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

---

#### **6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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

#### **6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### 6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	90,853,740.76	75.06
	其中：股票	90,853,740.76	75.06
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	12,000.87	0.01
	其中：债券	12,000.87	0.01
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	20,589,254.07	17.01
8	其他各项资产	9,582,132.43	7.92
9	合计	121,037,128.13	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	545,230.00	0.45
B	采矿业	2,581,076.00	2.14
C	制造业	57,787,587.05	47.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,482,835.62	2.06
E	建筑业	1,639,988.00	1.36
F	批发和零售业	995,475.00	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	3,146,920.00	2.61
H	住宿和餐饮业	348,735.00	0.29
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,418,977.00	4.49
J	金融业	11,727,745.50	9.72
K	房地产业	1,082,907.00	0.90
L	租赁和商务服务业	512,789.82	0.43
M	科学研究和技术服务业	534,540.89	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	105,362.88	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	110,852.00	0.09
Q	卫生和社会工作	583,932.00	0.48
R	文化、体育和娱乐业	834,786.00	0.69
S	综合	414,001.00	0.34
	合计	90,853,740.76	75.33

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,206	2,039,346.00	1.69
2	601318	中国平安	32,093	1,489,115.20	1.23
3	300750	宁德时代	5,715	1,307,534.85	1.08
4	000333	美的集团	21,432	1,262,773.44	1.05
5	601818	光大银行	400,000	1,228,000.00	1.02
6	000858	五粮液	7,109	1,162,819.13	0.96
7	002594	比亚迪	4,400	1,136,388.00	0.94
8	601398	工商银行	229,200	1,104,744.00	0.92
9	002926	华西证券	125,500	1,042,905.00	0.86
10	600155	华创云信	166,000	1,032,520.00	0.86
11	000563	陕国投A	327,000	997,350.00	0.83
12	000568	泸州老窖	4,400	922,108.00	0.76
13	600900	长江电力	38,737	854,538.22	0.71
14	300115	长盈精密	70,900	844,419.00	0.70
15	300760	迈瑞医疗	2,400	719,520.00	0.60
16	601816	京沪高铁	132,800	698,528.00	0.58
17	000400	许继电气	29,400	677,670.00	0.56
18	000100	TCL科技	166,800	657,192.00	0.54
19	600507	方大特钢	140,700	651,441.00	0.54
20	600426	华鲁恒升	20,860	638,941.80	0.53
21	600782	新钢股份	171,000	634,410.00	0.53
22	603659	璞泰来	16,491	630,286.02	0.52
23	002709	天赐材料	15,300	630,207.00	0.52
24	600409	三友化工	113,100	616,395.00	0.51
25	000830	鲁西化工	58,000	612,480.00	0.51
26	600623	华谊集团	97,200	605,556.00	0.50
27	601006	大秦铁路	79,900	593,657.00	0.49
28	300741	华宝股份	27,500	589,050.00	0.49
29	601088	中国神华	19,100	587,325.00	0.49
30	300482	万孚生物	21,900	583,197.00	0.48
31	000977	浪潮信息	11,860	575,210.00	0.48
32	002250	联化科技	54,600	571,116.00	0.47

33	002244	滨江集团	62,800	553,896.00	0.46
34	000988	华工科技	14,500	551,145.00	0.46
35	600887	伊利股份	19,200	543,744.00	0.45
36	002142	宁波银行	21,139	534,816.70	0.44
37	002958	青农商行	196,000	533,120.00	0.44
38	600999	招商证券	38,860	527,330.20	0.44
39	002444	巨星科技	24,000	525,120.00	0.44
40	000970	中科三环	40,900	524,338.00	0.43
41	600018	上港集团	99,200	520,800.00	0.43
42	600038	中直股份	13,000	517,660.00	0.43
43	300059	东方财富	36,137	513,145.40	0.43
44	603688	石英股份	4,500	512,280.00	0.42
45	603501	韦尔股份	5,200	509,808.00	0.42
46	600118	中国卫星	18,000	507,780.00	0.42
47	002985	北摩高科	11,500	507,380.00	0.42
48	002056	横店东磁	27,500	500,775.00	0.42
49	601997	贵阳银行	97,000	500,520.00	0.42
50	600273	嘉化能源	53,000	499,260.00	0.41
51	600967	内蒙一机	49,300	497,930.00	0.41
52	600667	太极实业	68,500	497,310.00	0.41
53	600566	济川药业	17,100	496,584.00	0.41
54	600707	彩虹股份	103,500	492,660.00	0.41
55	000060	中金岭南	103,200	490,200.00	0.41
56	601168	西部矿业	46,500	488,715.00	0.41
57	601838	成都银行	40,000	488,400.00	0.40
58	002745	木林森	52,500	483,000.00	0.40
59	002273	水晶光电	40,300	481,182.00	0.40
60	600276	恒瑞医药	9,993	478,664.70	0.40
61	002867	周大生	26,800	476,504.00	0.40
62	603882	金域医学	6,233	470,591.50	0.39
63	600809	山西汾酒	2,539	469,892.73	0.39
64	000938	紫光股份	14,700	468,195.00	0.39
65	300618	寒锐钴业	14,400	466,704.00	0.39
66	002738	中矿资源	8,900	453,366.00	0.38
67	600489	中金黄金	43,500	449,355.00	0.37
68	600580	卧龙电驱	30,400	444,144.00	0.37
69	600499	科达制造	38,500	437,360.00	0.36
70	000063	中兴通讯	9,600	437,184.00	0.36
71	600585	海螺水泥	18,300	434,442.00	0.36
72	000690	宝新能源	61,600	432,432.00	0.36
73	300257	开山股份	28,500	432,345.00	0.36

74	688002	睿创微纳	9,500	425,600.00	0.35
75	600050	中国联通	88,400	424,320.00	0.35
76	601668	中国建筑	73,200	420,168.00	0.35
77	000009	中国宝安	34,300	414,001.00	0.34
78	002223	鱼跃医疗	11,500	413,885.00	0.34
79	002415	海康威视	12,461	412,583.71	0.34
80	300316	晶盛机电	5,800	411,220.00	0.34
81	601666	平煤股份	54,400	410,176.00	0.34
82	601288	农业银行	114,500	404,185.00	0.34
83	600547	山东黄金	17,200	403,856.00	0.33
84	600436	片仔癀	1,400	400,904.00	0.33
85	300850	新强联	10,700	399,966.00	0.33
86	601717	郑煤机	31,700	394,665.00	0.33
87	603444	吉比特	800	392,888.00	0.33
88	601601	中国太保	15,000	389,700.00	0.32
89	600511	国药股份	10,000	388,500.00	0.32
90	002249	大洋电机	68,000	387,600.00	0.32
91	300014	亿纬锂能	6,400	387,200.00	0.32
92	000998	隆平高科	25,000	383,750.00	0.32
93	002850	科达利	2,900	383,525.00	0.32
94	688390	固德威	2,264	377,771.04	0.31
95	002373	千方科技	27,300	372,372.00	0.31
96	600066	宇通客车	25,000	368,500.00	0.31
97	600060	海信视像	14,800	366,300.00	0.30
98	300677	英科医疗	16,600	365,200.00	0.30
99	600718	东软集团	34,200	364,572.00	0.30
100	688208	道通科技	12,000	363,720.00	0.30
101	002506	协鑫集成	124,000	363,320.00	0.30
102	603927	中科软	9,400	362,464.00	0.30
103	000997	新大陆	19,000	359,100.00	0.30
104	600885	宏发股份	11,200	356,720.00	0.30
105	002422	科伦药业	12,000	356,160.00	0.30
106	300363	博腾股份	12,000	355,080.00	0.29
107	300308	中际旭创	2,400	353,880.00	0.29
108	300001	特锐德	17,000	353,260.00	0.29
109	600760	中航沈飞	7,840	352,800.00	0.29
110	600926	杭州银行	30,000	352,500.00	0.29
111	300617	安靠智电	9,000	352,350.00	0.29
112	600062	华润双鹤	20,200	351,884.00	0.29
113	002468	申通快递	32,400	350,568.00	0.29
114	603000	人民网	12,000	350,400.00	0.29

115	002531	天顺风能	23,000	350,290.00	0.29
116	002221	东华能源	39,900	345,135.00	0.29
117	688289	圣湘生物	20,319	342,171.96	0.28
118	603056	德邦股份	22,100	340,782.00	0.28
119	002230	科大讯飞	5,000	339,800.00	0.28
120	603855	华荣股份	12,700	337,820.00	0.28
121	300017	网宿科技	47,500	337,725.00	0.28
122	002408	齐翔腾达	53,000	337,610.00	0.28
123	688111	金山办公	700	330,554.00	0.27
124	000089	深圳机场	47,000	326,650.00	0.27
125	601000	唐山港	89,500	315,935.00	0.26
126	002304	洋河股份	2,400	315,240.00	0.26
127	301035	润丰股份	4,000	314,280.00	0.26
128	002030	达安基因	31,100	310,067.00	0.26
129	300012	华测检测	15,600	304,200.00	0.25
130	601828	美凯龙	63,500	304,165.00	0.25
131	600309	万华化学	3,400	298,656.00	0.25
132	000596	古井贡酒	1,200	296,856.00	0.25
133	001914	招商积余	19,500	293,475.00	0.24
134	000869	张裕A	9,500	291,270.00	0.24
135	601800	中国交建	26,000	283,660.00	0.24
136	600167	联美控股	40,100	279,497.00	0.23
137	000598	兴蓉环境	51,400	279,102.00	0.23
138	603317	天味食品	19,060	278,466.60	0.23
139	688099	晶晨股份	3,300	278,256.00	0.23
140	600597	光明乳业	26,500	275,600.00	0.23
141	002372	伟星新材	13,400	275,236.00	0.23
142	002886	沃特股份	13,400	271,752.00	0.23
143	600027	华电国际	40,500	270,945.00	0.22
144	688981	中芯国际	5,296	267,553.92	0.22
145	600008	首创环保	92,900	267,552.00	0.22
146	601628	中国人寿	7,500	262,200.00	0.22
147	600153	建发股份	24,000	261,840.00	0.22
148	300136	信维通信	13,000	261,040.00	0.22
149	600487	亨通光电	17,800	260,948.00	0.22
150	601689	拓普集团	3,200	258,240.00	0.21
151	601126	四方股份	16,800	255,192.00	0.21
152	000012	南玻A	42,100	250,916.00	0.21
153	688012	中微公司	1,600	250,320.00	0.21
154	601857	中国石油	32,200	240,534.00	0.20
155	002739	万达电影	19,000	238,260.00	0.20

156	000002	万 科A	16,800	235,536.00	0.20
157	002131	利欧股份	99,500	228,850.00	0.19
158	300567	精测电子	2,400	228,360.00	0.19
159	600820	隧道股份	37,000	222,370.00	0.18
160	600258	首旅酒店	11,700	221,715.00	0.18
161	002042	华孚时尚	69,600	218,544.00	0.18
162	000156	华数传媒	24,900	216,630.00	0.18
163	002081	金 螳 螂	48,000	216,480.00	0.18
164	002311	海大集团	4,500	210,780.00	0.17
165	300058	蓝色光标	20,500	198,235.00	0.16
166	601799	星宇股份	1,600	197,760.00	0.16
167	601928	凤凰传媒	17,200	196,080.00	0.16
168	688498	源杰科技	688	196,080.00	0.16
169	002371	北方华创	600	190,590.00	0.16
170	002821	凯莱英	1,600	188,576.00	0.16
171	600406	国电南瑞	8,160	188,496.00	0.16
172	600373	中文传媒	13,800	183,816.00	0.15
173	300454	深信服	1,600	181,200.00	0.15
174	603899	晨光股份	4,000	178,560.00	0.15
175	601718	际华集团	60,000	178,200.00	0.15
176	601728	中国电信	31,600	177,908.00	0.15
177	603355	莱克电气	7,000	177,870.00	0.15
178	600398	海澜之家	25,700	176,816.00	0.15
179	300418	昆仑万维	4,100	165,148.00	0.14
180	000921	海信家电	6,000	161,700.00	0.13
181	300498	温氏股份	8,800	161,480.00	0.13
182	600612	老凤祥	2,300	160,724.00	0.13
183	000423	东阿阿胶	2,900	155,005.00	0.13
184	300496	中科创达	1,600	154,160.00	0.13
185	603288	海天味业	3,208	150,294.80	0.12
186	002028	思源电气	3,200	149,504.00	0.12
187	000913	钱江摩托	8,200	149,486.00	0.12
188	300403	汉宇集团	13,400	147,266.00	0.12
189	002409	雅克科技	2,000	145,760.00	0.12
190	688303	大全能源	3,600	145,620.00	0.12
191	605337	李子园	7,880	144,046.40	0.12
192	002410	广联达	4,400	142,956.00	0.12
193	300033	同花顺	800	140,224.00	0.12
194	603496	恒为科技	7,440	139,723.20	0.12
195	600085	同仁堂	2,400	138,144.00	0.11
196	603986	兆易创新	1,300	138,125.00	0.11

197	601211	国泰君安	9,700	135,703.00	0.11
198	300458	全志科技	4,800	130,800.00	0.11
199	603129	春风动力	800	129,520.00	0.11
200	300718	长盛轴承	5,800	129,050.00	0.11
201	600754	锦江酒店	3,000	127,020.00	0.11
202	300638	广和通	5,600	127,008.00	0.11
203	300347	泰格医药	1,900	122,626.00	0.10
204	603799	华友钴业	2,670	122,579.70	0.10
205	603085	天成自控	12,200	121,268.00	0.10
206	300349	金卡智能	8,600	119,368.00	0.10
207	002979	雷赛智能	5,000	118,800.00	0.10
208	002284	亚太股份	13,000	116,610.00	0.10
209	002801	微光股份	4,300	116,358.00	0.10
210	603351	威尔药业	4,300	115,326.00	0.10
211	002614	奥佳华	14,100	114,774.00	0.10
212	300667	必创科技	5,800	114,202.00	0.09
213	003006	百亚股份	6,600	114,048.00	0.09
214	000920	沃顿科技	11,200	113,344.00	0.09
215	300015	爱尔眼科	6,110	113,340.50	0.09
216	603358	华达科技	5,900	112,454.00	0.09
217	002283	天润工业	17,400	111,708.00	0.09
218	688636	智明达	2,016	110,880.00	0.09
219	605098	行动教育	2,800	110,852.00	0.09
220	002986	宇新股份	4,000	110,320.00	0.09
221	002730	电光科技	11,500	110,170.00	0.09
222	600761	安徽合力	5,500	109,615.00	0.09
223	300833	浩洋股份	1,000	109,430.00	0.09
224	688186	广大特材	3,360	109,300.80	0.09
225	301087	可孚医疗	2,200	108,460.00	0.09
226	603897	长城科技	5,400	108,324.00	0.09
227	002026	山东威达	11,500	108,100.00	0.09
228	603806	福斯特	2,900	107,851.00	0.09
229	601865	福莱特	2,800	107,828.00	0.09
230	002066	瑞泰科技	9,000	107,550.00	0.09
231	603239	浙江仙通	6,600	107,382.00	0.09
232	002196	方正电机	15,200	107,008.00	0.09
233	688377	迪威尔	4,240	106,212.00	0.09
234	003015	日久光电	11,200	106,064.00	0.09
235	002937	兴瑞科技	4,300	105,780.00	0.09
236	300909	汇创达	4,000	105,680.00	0.09
237	002782	可立克	6,900	105,501.00	0.09

238	002884	凌霄泵业	6,900	105,225.00	0.09
239	603568	伟明环保	6,000	105,060.00	0.09
240	603035	常熟汽饰	5,400	104,922.00	0.09
241	603330	天洋新材	9,400	104,434.00	0.09
242	002655	共达电声	8,000	103,920.00	0.09
243	603366	日出东方	17,800	103,418.00	0.09
244	002050	三花智控	3,398	102,823.48	0.09
245	002054	德美化工	14,700	102,606.00	0.09
246	300105	龙源技术	15,200	101,992.00	0.08
247	000919	金陵药业	13,000	101,660.00	0.08
248	002588	史丹利	16,600	100,928.00	0.08
249	002996	顺博合金	8,300	100,430.00	0.08
250	300404	博济医药	9,600	100,320.00	0.08
251	002947	恒铭达	4,800	100,032.00	0.08
252	300219	鸿利智汇	13,600	99,960.00	0.08
253	603303	得邦照明	7,200	99,432.00	0.08
254	300752	隆利科技	5,800	98,774.00	0.08
255	600803	新奥股份	5,200	98,696.00	0.08
256	601579	会稽山	8,300	97,857.00	0.08
257	603886	元祖股份	5,300	97,202.00	0.08
258	300858	科拓生物	6,000	97,020.00	0.08
259	688085	三友医疗	3,606	94,693.56	0.08
260	603507	振江股份	2,600	94,276.00	0.08
261	600019	宝钢股份	16,400	92,168.00	0.08
262	605377	华旺科技	5,100	92,055.00	0.08
263	603309	维力医疗	5,900	91,273.00	0.08
264	300881	盛德鑫泰	2,480	81,716.00	0.07
265	603260	合盛硅业	1,100	77,022.00	0.06
266	600941	中国移动	800	74,640.00	0.06
267	603369	今世缘	1,400	73,920.00	0.06
268	600588	用友网络	3,600	73,800.00	0.06
269	002459	晶澳科技	1,764	73,558.80	0.06
270	688126	沪硅产业	3,300	68,970.00	0.06
271	002432	九安医疗	1,900	66,899.00	0.06
272	603486	科沃斯	800	62,216.00	0.05
273	000708	中信特钢	3,315	52,509.60	0.04
274	002423	中粮资本	6,300	50,400.00	0.04
275	688063	派能科技	120	23,790.00	0.02
276	601888	中国中免	94	10,389.82	0.01
277	605117	德业股份	60	8,973.00	0.01
278	688621	阳光诺和	95	5,587.90	0.00

279	603658	安图生物	100	5,173.00	0.00
280	688396	华润微	72	3,773.52	0.00
281	002557	洽洽食品	59	2,451.45	0.00
282	000895	双汇发展	85	2,081.65	0.00
283	603259	药明康德	29	1,806.99	0.00
284	002648	卫星化学	109	1,630.64	0.00
285	603225	新凤鸣	118	1,303.90	0.00
286	000729	燕京啤酒	100	1,247.00	0.00
287	601958	金钼股份	100	1,115.00	0.00
288	600031	三一重工	66	1,097.58	0.00
289	600109	国金证券	100	867.00	0.00
290	000651	格力电器	23	839.73	0.00
291	603187	海容冷链	40	799.60	0.00
292	000951	中国重汽	40	674.00	0.00
293	300285	国瓷材料	20	548.00	0.00
294	300026	红日药业	100	542.00	0.00
295	000157	中联重科	75	506.25	0.00
296	600323	瀚蓝环境	16	302.88	0.00
297	601016	节能风电	20	73.40	0.00
298	000636	风华高科	3	46.02	0.00
299	688006	杭可科技	1	30.47	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600155	华创云信	2,347,449.00	1.89
2	002002	鸿达兴业	1,582,646.00	1.27
3	600201	生物股份	1,484,706.00	1.20
4	601168	西部矿业	1,318,020.00	1.06
5	600809	山西汾酒	1,277,354.00	1.03
6	601818	光大银行	1,272,000.00	1.02
7	002850	科达利	1,271,617.00	1.02
8	600519	贵州茅台	1,267,965.00	1.02
9	000333	美的集团	1,210,756.00	0.97
10	600900	长江电力	1,210,226.00	0.97
11	002738	中矿资源	1,208,163.00	0.97
12	600566	济川药业	1,179,633.00	0.95
13	002250	联化科技	1,176,595.00	0.95
14	600667	太极实业	1,158,668.00	0.93
15	002745	木林森	1,142,271.00	0.92

16	300001	特锐德	1,127,977.00	0.91
17	300630	普利制药	1,126,412.00	0.91
18	002594	比亚迪	1,123,293.00	0.90
19	000568	泸州老窖	1,115,395.00	0.90
20	603444	吉比特	1,108,385.00	0.89

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002738	中矿资源	1,694,189.20	1.36
2	600201	生物股份	1,580,230.00	1.27
3	002002	鸿达兴业	1,488,195.00	1.20
4	300373	扬杰科技	1,441,403.00	1.16
5	300390	天华新能	1,318,018.00	1.06
6	600901	江苏金租	1,284,458.00	1.03
7	300037	新宙邦	1,278,948.40	1.03
8	600900	长江电力	1,249,774.00	1.01
9	000415	渤海租赁	1,232,614.00	0.99
10	601969	海南矿业	1,216,764.00	0.98
11	000970	中科三环	1,200,674.36	0.97
12	600155	华创云信	1,178,561.00	0.95
13	601186	中国铁建	1,150,545.00	0.93
14	600216	浙江医药	1,104,643.00	0.89
15	601231	环旭电子	1,103,578.00	0.89
16	000623	吉林敖东	1,069,821.50	0.86
17	000553	安道麦 A	1,055,533.00	0.85
18	000651	格力电器	1,047,544.00	0.84
19	600887	伊利股份	1,028,461.35	0.83
20	601899	紫金矿业	1,023,818.00	0.82

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	249,148,359.76
卖出股票收入（成交）总额	247,842,689.78

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	12,000.87	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	12,000.87	0.01

## 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

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	111014	李子转债	120	12,000.87	0.01

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金不允许投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 90,853,740.76 元，占基金资产净值的比例为 75.33%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 79,694,600.00 元，占基金资产净值的比例为 66.08%，空头合约市值占股票资产的比例为 87.72%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-16,200.65 元，公允价值变动损益为 189,781.93 元。

### 7.13 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国平安保险(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司在报告期内曾被中国银行间市场交易商协会立案调查。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

#### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,582,132.43
2	应收清算款	—

3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	9,582,132.43

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

#### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	8,321	8,599.61	6,188,122.29	8.65	65,369,201.00	91.35
富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	250	100,613.68	19,806,222.00	78.74	5,347,198.78	21.26
合计	8,571	11,283.48	25,994,344.29	26.88	70,716,399.78	73.12

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	89,680.42	0.1253
	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	8.93	0.0000
	合计	89,689.35	0.0927

### 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的情况

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

	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	0
	合计	0

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国绝对收益多策略 定期开放混合发起式 A	富国绝对收益多策略 定期开放混合发起式 C
基金合同生效日(2015年09月17日) 基金份额总额	465,664,314.43	—
报告期期初基金份额总额	73,929,872.12	25,898,487.79
本报告期基金总申购份额	4,272,668.15	14,578.98
减：本报告期基金总赎回份额	6,645,216.98	759,645.99
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	71,557,323.29	25,153,420.78

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	2	—	—	—	—	—
渤海证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	1	2,903,787.19	0.58	2,675.20	0.74	—
长江证券	3	18,829,403.36	3.79	13,581.91	3.77	—

德邦证券	2	—	—	—	—	—
东北证券	2	30,977.84	0.01	22.34	0.01	—
东财证券	2	3,047,905.00	0.61	2,198.43	0.61	—
方正证券	2	1,198,205.35	0.24	864.25	0.24	—
高盛中国	1	5,413,819.93	1.09	4,987.93	1.39	—
光大证券	2	12,084.80	0.00	8.72	0.00	—
广发证券	2	3,229,120.03	0.65	2,329.24	0.65	—
国海证券	2	15,983,305.60	3.22	11,528.64	3.20	—
国盛证券	2	24,185,078.20	4.87	17,445.47	4.85	—
国泰君安	2	1,142,187.99	0.23	823.93	0.23	—
国信证券	2	—	—	—	—	—
海通证券	2	57,153,358.08	11.51	41,223.64	11.45	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	52,531,868.44	10.58	37,891.13	10.53	—
太平洋证券	2	42,468,199.81	8.55	30,632.69	8.51	—
天风证券	2	32,182,709.63	6.48	23,214.08	6.45	—
西南证券	2	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	1	36,814,695.05	7.41	26,555.87	7.38	—
招商证券	1	19,974,133.86	4.02	14,407.30	4.00	—
中航证券	2	24,163,889.24	4.86	17,428.96	4.84	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
中泰证券	2	99,323,096.57	20.00	71,640.60	19.90	—
中信建投	1	22,438,076.23	4.52	16,184.97	4.50	—
中信证券	2	33,703,746.80	6.79	24,309.96	6.75	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
安信证券	—	—	—	—	—	—
渤海证券	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东财证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	71,560.24	36.50	—	—	—	—
高盛中国	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	14,943.46	7.62	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—
上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	17,406.15	8.88	—	—	—	—
太平洋证券	1,781.01	0.91	—	—	—	—
天风证券	—	—	—	—	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中航证券	63,458.16	32.37	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—

---

中信建投	19,937.50	10.17	—	—	—	—
中信证券	6,972.12	3.56	—	—	—	—
中银证券	—	—	—	—	—	—

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金第 30 个开放期开放申购、赎回和转换业务的公告	规定披露媒介	2023 年 03 月 16 日
2	富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金第 31 个开放期开放申购、赎回和转换业务的公告	规定披露媒介	2023 年 06 月 15 日

---

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

## § 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金的文件	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话:95105686、4008880688(全国统一,免长途话费)公司网址: <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。
2、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同		
3、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议		
4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件		
5、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金财务报表及报表附注		
6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告		