富国城镇发展股票型证券投资基金

二 0 二四年中期报告

2024 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： 2024 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 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 6
2.1 基金基本情况 6
2.2 基金产品说明 6
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标和基金净值表现 8
3.1 主要会计数据和财务指标 8
3.2 基金净值表现 8
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
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 14
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
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 15
§6 中期财务报告（未经审计） 16
6.1 资产负债表 16
6.2 利润表 17
6.3 净资产变动表 18
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 42
7.1 期末基金资产组合情况 42

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 42
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 43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 46
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 46
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 46
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 46
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 47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 47
7.12 投资组合报告附注 47
§8 基金份额持有人信息 49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 49
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 49
§9 开放式基金份额变动 50
§10 重大事件揭示 51
10.1 基金份额持有人大会决议 51
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 51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 51
10.4 基金投资策略的改变 51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 51
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 51
10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 52
10.8 其他重大事件 55
§11 影响投资者决策的其他重要信息 56
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 56
§12 备查文件目录 57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国城镇发展股票型证券投资基金
基金简称	富国城镇发展股票
基金主代码	000471
交易代码	前端交易代码：000471 后端交易代码：000472
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 01 月 28 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	541,605,189.94 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于城镇发展相关股票，通过精选个股和风险控制，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要投资于城镇发展主题相关股票，指在国家战略高度布局下受益于中国“新型城镇化”进程的相关股票。通过行业趋势判断及基本面分析精选偏周期类行业股票，通过自下而上的个股成长性分析精选偏成长类行业股票进行投资。本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。本基金的大类资产配置策略、债券投资策略及金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%＋中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金，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。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

	27-30 层	
邮政编码	200120	100033
法定代表人	裴长江	张金良

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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	-23,528,651.53
本期利润	35,402,955.98
加权平均基金份额本期利润	0.0690
本期加权平均净值利润率	3.25%
本期基金份额净值增长率	2.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	633,177,226.76
期末可供分配基金份额利润	1.1691
期末基金资产净值	1,174,782,416.70
期末基金份额净值	2.169
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	171.89%

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

3.2 基金净值表现

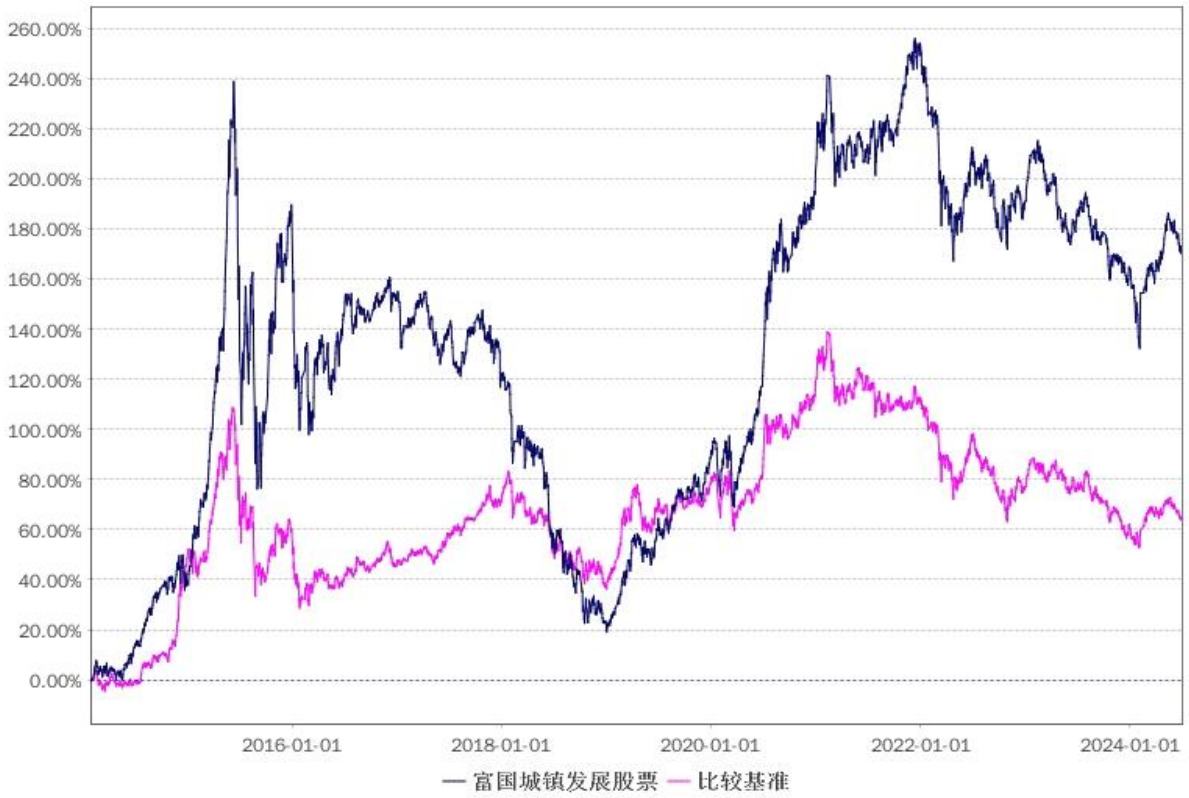
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-2.39%	0.66%	-2.48%	0.38%	0.09%	0.28%
过去三个月	3.29%	0.73%	-1.35%	0.60%	4.64%	0.13%
过去六个月	2.75%	1.01%	1.54%	0.72%	1.21%	0.29%
过去一年	-4.83%	0.86%	-6.80%	0.70%	1.97%	0.16%
过去三年	-13.21%	0.98%	-25.45%	0.84%	12.24%	0.14%

自基金合同生效起至今	171.89%	1.50%	64.42%	1.09%	107.47%	0.41%

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

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



注：1、截止日期为 2024 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2014 年 1 月 28 日成立，建仓期 6 个月，从 2014 年 1 月 28 日起至 2014 年 7 月 27 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：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 2024 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 350 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		
蒲世林	本基金现任基金经理	2018-12-19	-	16	硕士，曾任海通证券股份有限公司行业分析师，中信证券股份有限公司研究员、投资经理；自 2018 年 9 月加入富国基金管理有限公司，历任高级权益投资经理、高级权益

					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 2018 年 12 月起任富国城镇发展股票型证券投资基金基金经理；自 2021 年 12 月起任富国均衡策略混合型证券投资基金基金经理；自 2021 年 12 月起任富国周期优势混合型证券投资基金基金经理；自 2023 年 12 月起任富国远见精选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理；自 2024 年 05 月起任富国远见价值混合型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城镇发展股票型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》、《富国城镇发展股票型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未出现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

2024 年上半年，市场大幅波动，结构显著分化，石油石化、煤炭、银行、电力及公用事业等低估值高股息行业表现靠前，消费者服务、传媒、房地产、医药、食品饮料等跟宏观相关度较大的行业表现靠后。上半年宏观经济仍面临压力，利率水平呈下行趋势，叠加海外因素的扰动，市场整体较弱，风险偏好降低，更加偏好确定性，红利成为上半年表现最好的风格资产。本基金从去年以来布局三大方向：老龄化相关的医药、制造业出海、高股息，从上半年实际表现来看，制造业出海和高股息得到市场的认可，表现突出，组合里的电网设备出海板块以及电力、港口等公用事业板块贡献了较大的超额收益。不过遗憾的是虽然看好高股息

方向，但组合里配置比例不够，而且部分消费相关的高股息个股表现一般。医药板块上半年表现较差，究其原因主要是医疗反腐持续时间超预期、业绩基数问题、医保控费担忧、筹码结构等因素造成。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.169 元；份额累计净值为 2.669 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 2.75%，同期业绩比较基准收益率为 1.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年宏观经济仍然面临压力，而且叠加海外不确定性增加，我们对下半年市场谨慎乐观。虽然企业业绩层面面临压力，但是考虑到市场估值已经极低，已经反映了较为悲观的预期，而且随着利率的下行，股市目前是大类资产里面具备较强吸引力的资产。目前是积极选股为后续行情做储备的阶段。对于风格的判断，上半年一枝独秀的高股息板块能否持续有超额收益？这个问题需要分长期和短期来看，长期维度，经济增速下降和低利率环境下，具备良好自由现金流同时愿意跟中小股东分享的公司始终具有较好的投资机会，短期维度，由于高股息板块的持续上涨以及其他板块的持续下跌导致性价比的收敛，板块之间的机会趋于均衡。展望下半年，之前看好的三个方向仍然看好：医药板块风险释放已经比较充分，不过选股上仍然要规避医保控费影响的个股；制造业出海下半年将面临海外不确定因素的影响，部分具备完备海外产能的出海企业下跌后迎来机会；高股息行情有望持续，但个股会面临分化，需要寻找性价比更高的高股息公司。除了上述三个持续看好的方向，下半年也会关注内需方向的机会，但更多是从供给角度寻找投资机会。有部分行业资本支出周期接近尾声，后续竞争格局改善，折旧摊销减少，现金流量表和利润表都将迎来显著改善和较好的投资机会。

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：富国城镇发展股票型证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	149,707,179.48	109,453,371.11
结算备付金	493,558.63	555,830.05
存出保证金	87,183.63	76,056.22
交易性金融资产	1,023,764,321.62	754,736,577.16
其中：股票投资	1,023,764,321.62	754,736,577.16
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收清算款	2,687,221.30	-
应收股利	-	-
应收申购款	302,032.82	29,016,342.21
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,177,041,497.48	893,838,176.75
负债和净资产	**本期末** 2024 年 06 月 30 日	**上年度末** 2023 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付清算款	-	8,431,471.27
应付赎回款	427,570.04	684,439.15
应付管理人报酬	1,173,505.60	824,422.28
应付托管费	195,584.28	137,403.71

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	462,420.86	500,857.67
负债合计	2,259,080.78	10,578,594.08
净资产：		
实收基金	541,605,189.94	418,497,770.51
其他综合收益	—	—
未分配利润	633,177,226.76	464,761,812.16
净资产合计	1,174,782,416.70	883,259,582.67
负债和净资产总计	1,177,041,497.48	893,838,176.75

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.169 元，基金份额总额 541,605,189.94 份。

6.2 利润表

会计主体：富国城镇发展股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 ）
一、营业总收入	43,060,160.74	-9,153,600.78
1.利息收入	286,795.85	177,533.84
其中：存款利息收入	286,795.85	177,533.84
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	-16,321,340.20	-2,014,067.61
其中：股票投资收益	-35,269,736.55	-14,244,818.16
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	738,546.40
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	18,948,396.35	11,492,204.15
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）	58,931,607.51	-7,633,107.85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	163,097.58	316,040.84
减：二、营业总支出	7,657,204.76	9,185,114.85
1．管理人报酬	6,485,497.33	7,790,012.14
2．托管费	1,080,916.23	1,298,335.40
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	—	0.40
8．其他费用	90,791.20	96,766.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	35,402,955.98	-18,338,715.63
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	35,402,955.98	-18,338,715.63
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	35,402,955.98	-18,338,715.63

6.3 净资产变动表

会计主体：富国城镇发展股票型证券投资基金

本报告期： 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 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	418,497,770.51	464,761,812.16	883,259,582.67
二、本期期初净资产	418,497,770.51	464,761,812.16	883,259,582.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	123,107,419.43	168,415,414.60	291,522,834.03
（一）、综合收益总额	—	35,402,955.98	35,402,955.98
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	123,107,419.43	133,012,458.62	256,119,878.05
其中：1.基金申购款	181,949,539.43	198,875,293.98	380,824,833.41
2.基金赎回款	-58,842,120.00	-65,862,835.36	-124,704,955.36
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—

（四）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	541,605,189.94	633,177,226.76	1,174,782,416.70
项目	上年度可比期间 （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	445,003,920.06	586,603,214.23	1,031,607,134.29
二、本期期初净资产	445,003,920.06	586,603,214.23	1,031,607,134.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-20,386,570.49	-43,399,567.93	-63,786,138.42
（一）、综合收益总额	—	-18,338,715.63	-18,338,715.63
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-20,386,570.49	-25,060,852.30	-45,447,422.79
其中：1.基金申购款	85,420,335.10	118,924,269.93	204,344,605.03
2.基金赎回款	-105,806,905.59	-143,985,122.23	-249,792,027.82
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—
（四）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	424,617,349.57	543,203,646.30	967,820,995.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈 戈	林志松	徐慧
————————	————————	————————
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国城镇发展股票型证券投资基金（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[2013]1019 号《关于核准富国城镇发展股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2014 年 1 月 28 日生效，首次设立募集规模为 437,530,052.94 份基金份额。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（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、存托凭证、固定收益类资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）、衍生工具（权证、股指期货等）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。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：投资于股票及存托凭证的比例占基金资产的 80%—95%，投资于城镇发展相关股票及存托凭证比例不低于非现金基金资产的 80%，权证资产的投资比例占基金资产净值的 0%－3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%＋中债综合指数收益率×20%。

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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

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

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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

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

2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融

商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

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

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的

企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 （2024 年 06 月 30 日）
活期存款	149,707,179.48
等于：本金	149,692,611.24
加：应计利息	14,568.24
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	149,707,179.48

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（2024 年 06 月 30 日）			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,000,000,088.00	-	1,023,764,321.62	23,764,233.62
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		1,000,000,088.00	-	1,023,764,321.62	23,764,233.62

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

注：本报告期末本基金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

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（2024 年 06 月 30 日）
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,602.90
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	324,434.78
其中：交易所市场	324,434.78
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	76,383.18
合计	462,420.86

6.4.7.7实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	418,497,770.51	418,497,770.51
本期申购	181,949,539.43	181,949,539.43
本期赎回（以“-”号填列）	-58,842,120.00	-58,842,120.00
本期末	541,605,189.94	541,605,189.94

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

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	579,298,196.47	-114,536,384.31	464,761,812.16
本期期初	579,298,196.47	-114,536,384.31	464,761,812.16
本期利润	-23,528,651.53	58,931,607.51	35,402,955.98
本期基金份额交易产生的变动数	167,917,453.24	-34,904,994.62	133,012,458.62
其中：基金申购款	247,437,803.26	-48,562,509.28	198,875,293.98
基金赎回款	-79,520,350.02	13,657,514.66	-65,862,835.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	723,686,998.18	-90,509,771.42	633,177,226.76

6.4.7.9存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
活期存款利息收入	266,933.72
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	6,468.44
其他	13,393.69
合计	286,795.85

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
卖出股票成交总额	364,184,103.95
减：卖出股票成本总额	398,494,770.82
减：交易费用	959,069.68
买卖股票差价收入	-35,269,736.55

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

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

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

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30

	日）
股票投资产生的股利收益	18,948,396.35
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	18,948,396.35

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
1.交易性金融资产	58,931,607.51
股票投资	58,931,607.51
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
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	58,931,607.51

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
基金赎回费收入	141,086.32
基金转换费收入	22,011.26
合计	163,097.58

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（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
审计费用	21,383.18
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	408.02
债券账户维护费	9,000.00
合计	90,791.20

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
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

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（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023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	13,019,998.48	1.34	133,357,034.00	10.85
申万宏源	45,625,024.80	4.70	121,088,925.96	9.86

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

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债券交易。

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（2024年01月01日至2024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（%）
海通证券	9,581.63	1.34	4,283.22	1.32
申万宏源	33,576.64	4.70	20,458.65	6.31
关联方名称	上年度可比期间（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（%）
海通证券	96,192.53	10.85	56,812.07	14.44
申万宏源	87,342.37	9.85	83,997.69	21.35

注：1、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。

2、自 2024 年 7 月 1 日起，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的管理费	6,485,497.33	7,790,012.14
其中：支付销售机构的客户维护费	1,377,377.11	1,960,212.31
应支付基金管理人的净	5,108,120.22	5,829,799.83

管理费		

注：2023 年 7 月 10 日前，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提，自 2023 年 7 月 10 日起，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.20%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	1,080,916.23	1,298,335.40

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

托管费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

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固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

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（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 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	149,707,179.48	266,933.72	62,196,636.01	165,513.04

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 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	301565	中仑新材	IPO 网下申购	7,103	84,383.64
海通证券股份有限公司	603344	星德胜	IPO 网下申购	1,813	34,773.34

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 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	688515	裕太微	IPO 网下申购	4,183	386,760.18
海通证券股份有限公司	688507	索辰科技	IPO 网下申购	1,495	367,112.20
海通证券股份有限公司	688531	日联科技	IPO 网下申购	3,460	527,234.80

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：本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024-03-19	6 个月	新股限售	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6 个月	新股限售	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6 个月	新股限售	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024-06-03	2 个月	新股限售_转增	-	15.25	40	-	610.00	-
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	新股限售	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	新股限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	新股限售	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024-05-22	4 个月	新股限售_转增	-	91.24	43	-	3,923.32	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	新股限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	新股限售	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6 个月	新股限售	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6 个月	新股限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-

301588	美新科技	2024-03-06	6 个月	新股限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6 个月	新股限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	新股限售	16.20	15.96	1,019	16,507.80	16,263.24	-
603082	北自科技	2024-01-23	6 个月	新股限售	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月内（含）	新股认购	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新股限售	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024-01-04	6 个月	新股限售	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	新股限售	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024-03-13	6 个月	新股限售	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月	新股限售	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6 个月	新股限售	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	新股限售	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	新股限售	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	新股限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	新股限售	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

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 2024 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 2024 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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末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货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1　利率风险敞口

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

单位：人民币元

本期末（2024 年 06 月 30 日）	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	149,707,179.48	—	—	—	—	—	149,707,179.48
结算备付金	493,558.63	—	—	—	—	—	493,558.63
存出保证金	87,183.63	—	—	—	—	—	87,183.63
交易性金融资产	—	—	—	—	—	1,023,764,321.62	1,023,764,321.62
应收清算款	—	—	—	—	—	2,687,221.30	2,687,221.30
应收申购款	—	—	—	—	—	302,032.82	302,032.82
资产总计	150,287,921.74	—	—	—	—	1,026,753,575.74	1,177,041,497.48
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	427,570.04	427,570.04
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,173,505.60	1,173,505.60
应付托管费	—	—	—	—	—	195,584.28	195,584.28
其他负债	—	—	—	—	—	462,420.86	462,420.86
负债总计	—	—	—	—	—	2,259,080.78	2,259,080.78
利率敏感度缺口	150,287,921.74	—	—	—	—	1,024,494,494.96	1,174,782,416.70
上年度末（2023 年 12 月 31 日）	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	109,453,371.11	—	—	—	—	—	109,453,371.11
结算备付金	555,830.05	—	—	—	—	—	555,830.05
存出保证金	76,056.22	—	—	—	—	—	76,056.22

交易性金融资产	-	-	-	-	-	754,736,577.16	754,736,577.16
应收申购款	-	-	-	-	-	29,016,342.21	29,016,342.21
资产总计	110,085,257.38	-	-	-	-	783,752,919.37	893,838,176.75
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	8,431,471.27	8,431,471.27
应付赎回款	-	-	-	-	-	684,439.15	684,439.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	824,422.28	824,422.28
应付托管费	-	-	-	-	-	137,403.71	137,403.71
其他负债	-	-	-	-	-	500,857.67	500,857.67
负债总计	-	-	-	-	-	10,578,594.08	10,578,594.08
利率敏感度缺口	110,085,257.38	-	-	-	-	773,174,325.29	883,259,582.67

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（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、存托凭证、固定收益类资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）、衍生工具（权证、股指期货等）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：投资于股票及存托凭证的比例占基金资产的 80%—95%，投资于城镇发展相关股票及存托凭证的比例不低于非现金基金资产的 80%，权证资产的投资比例占基金资产净值的 0%－3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2024 年 06 月 30 日）		上年度末（2023 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	1,023,764,321.62	87.15	754,736,577.16	85.45
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	1,023,764,321.62	87.15	754,736,577.16	85.45

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元 ）	
		本期末（2024 年 06 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准增加 1%	13,160,969.26	7,686,011.33
	2.业绩比较基准减少 1%	-13,160,969.26	-7,686,011.33

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（2024 年 06 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
第一层次	1,023,524,245.62	753,844,156.60
第二层次	33,777.27	12,779.88
第三层次	206,298.73	879,640.68
合计	1,023,764,321.62	754,736,577.16

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,023,764,321.62	86.98
	其中：股票	1,023,764,321.62	86.98
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	150,200,738.11	12.76
8	其他各项资产	3,076,437.75	0.26
9	合计	1,177,041,497.48	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	-	-
B	采矿业	22,047,755.40	1.88
C	制造业	777,833,642.33	66.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,032,012.00	3.92
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	117,764,134.04	10.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,802,075.57	1.86
J	金融业	13,395,466.00	1.14
K	房地产业	13,922,409.24	1.19
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	40,122.80	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	10,926,704.24	0.93
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	1,023,764,321.62	87.15

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	002223	鱼跃医疗	1,305,400	49,083,040.00	4.18
2	601985	中国核电	4,318,200	46,032,012.00	3.92
3	002851	麦格米特	1,689,000	43,643,760.00	3.72
4	600426	华鲁恒升	1,583,773	42,191,712.72	3.59
5	002444	巨星科技	1,438,300	35,526,010.00	3.02
6	603277	银都股份	1,098,600	33,001,944.00	2.81
7	300482	万孚生物	1,307,600	31,905,440.00	2.72
8	300760	迈瑞医疗	108,500	31,563,735.00	2.69
9	600398	海澜之家	3,387,816	31,303,419.84	2.66
10	600519	贵州茅台	21,300	31,255,407.00	2.66
11	601298	青岛港	3,073,900	29,386,484.00	2.50
12	601000	唐山港	6,178,800	29,040,360.00	2.47
13	600422	昆药集团	1,550,000	27,636,500.00	2.35
14	000403	派林生物	962,100	25,649,586.00	2.18
15	000538	云南白药	493,140	25,224,111.00	2.15
16	603855	华荣股份	1,101,138	24,346,161.18	2.07
17	002475	立讯精密	616,108	24,219,205.48	2.06
18	000651	格力电器	614,200	24,088,924.00	2.05
19	002332	仙琚制药	2,040,400	23,280,964.00	1.98
20	000100	TCL 科技	5,384,300	23,260,176.00	1.98
21	000552	甘肃能化	6,353,820	22,047,755.40	1.88
22	000630	铜陵有色	5,878,700	21,222,107.00	1.81
23	000333	美的集团	317,824	20,499,648.00	1.74
24	002960	青鸟消防	1,493,435	18,877,018.40	1.61
25	300677	英科医疗	701,885	18,817,536.85	1.60
26	601567	三星医疗	487,150	17,050,250.00	1.45
27	600269	赣粤高速	3,233,000	16,714,610.00	1.42
28	300285	国瓷材料	931,900	16,634,415.00	1.42
29	002588	史丹利	2,173,100	16,363,443.00	1.39
30	600233	圆通速递	1,014,200	15,872,230.00	1.35
31	603167	渤海轮渡	1,816,500	14,840,805.00	1.26
32	600941	中国移动	137,304	14,760,180.00	1.26

33	601677	明泰铝业	1,236,308	14,291,720.48	1.22
34	001914	招商积余	1,389,462	13,922,409.24	1.19
35	300274	阳光电源	218,680	13,564,720.40	1.15
36	603878	武进不锈	1,975,857	12,922,104.78	1.10
37	603556	海兴电力	274,859	12,871,646.97	1.10
38	603713	密尔克卫	222,527	11,909,645.04	1.01
39	601033	永兴股份	674,919	10,926,704.24	0.93
40	603611	诺力股份	533,200	9,085,728.00	0.77
41	002311	海大集团	189,000	8,892,450.00	0.76
42	300910	瑞丰新材	189,300	8,276,196.00	0.70
43	300750	宁德时代	44,680	8,043,740.40	0.68
44	600919	江苏银行	1,048,200	7,788,126.00	0.66
45	002028	思源电气	110,600	7,399,140.00	0.63
46	603901	永创智能	992,300	7,035,407.00	0.60
47	603225	新凤鸣	427,300	6,661,607.00	0.57
48	600406	国电南瑞	266,552	6,653,137.92	0.57
49	600885	宏发股份	211,900	5,865,392.00	0.50
50	601077	渝农商行	1,117,000	5,607,340.00	0.48
51	603338	浙江鼎力	56,000	3,383,520.00	0.29
52	600600	青岛啤酒	30,156	2,194,452.12	0.19
53	000902	新洋丰	43,300	513,971.00	0.04
54	688692	达梦数据	1,745	382,889.35	0.03
55	300887	谱尼测试	5,422	40,122.80	0.00
56	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
57	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
58	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
59	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
60	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
61	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
62	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
63	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
64	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
65	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
66	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
67	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
68	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
69	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
70	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
71	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
72	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
73	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00

74	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
75	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
76	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
77	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
78	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	600398	海澜之家	29,379,321.13	3.33
2	000538	云南白药	27,785,836.69	3.15
3	000403	派林生物	24,205,943.00	2.74
4	000100	TCL 科技	23,643,565.70	2.68
5	000630	铜陵有色	23,090,434.00	2.61
6	000552	甘肃能化	22,225,015.61	2.52
7	601298	青岛港	22,027,168.00	2.49
8	600519	贵州茅台	21,437,311.00	2.43
9	002851	麦格米特	20,883,161.00	2.36
10	002223	鱼跃医疗	20,692,569.08	2.34
11	603167	渤海轮渡	19,258,404.08	2.18
12	300482	万孚生物	19,072,763.00	2.16
13	300285	国瓷材料	17,388,047.94	1.97
14	600233	圆通速递	16,398,793.00	1.86
15	600269	赣粤高速	15,811,671.00	1.79
16	002588	史丹利	15,253,469.00	1.73
17	300677	英科医疗	13,622,925.82	1.54
18	000651	格力电器	12,950,975.00	1.47
19	002444	巨星科技	11,895,942.00	1.35
20	300244	迪安诊断	11,745,608.00	1.33

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	601567	三星医疗	38,400,963.50	4.35
2	002044	美年健康	19,352,571.00	2.19
3	000061	农 产 品	16,401,613.80	1.86
4	603259	药明康德	15,105,375.50	1.71
5	300244	迪安诊断	14,959,138.95	1.69

6	300677	英科医疗	14,349,985.10	1.62
7	301035	润丰股份	13,331,520.00	1.51
8	002028	思源电气	13,196,963.00	1.49
9	603987	康德莱	11,409,358.80	1.29
10	600161	天坛生物	11,180,251.63	1.27
11	002851	麦格米特	10,418,065.93	1.18
12	000333	美的集团	9,346,881.00	1.06
13	300910	瑞丰新材	8,996,151.00	1.02
14	300498	温氏股份	8,617,772.23	0.98
15	600600	青岛啤酒	8,268,839.00	0.94
16	300887	谱尼测试	7,839,656.06	0.89
17	603556	海兴电力	7,823,709.00	0.89
18	601677	明泰铝业	7,487,118.00	0.85
19	600406	国电南瑞	7,379,151.00	0.84
20	000063	中兴通讯	6,982,501.00	0.79

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	608,590,907.77
卖出股票收入（成交）总额	364,184,103.95

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

本基金根据基金合同的约定，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 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	87,183.63
2	应收清算款	2,687,221.30
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	302,032.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,076,437.75

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
63,633	8,511.39	316,072,634.89	58.36	225,532,555.05	41.64

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	529,286.71	0.0977

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014 年 01 月 28 日)基金份额总额	437,530,052.94
报告期期初基金份额总额	418,497,770.51
本报告期基金总申购份额	181,949,539.43
减：本报告期基金总赎回份额	58,842,120.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	541,605,189.94

§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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	富国基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-02-02
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	督察长
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-02-02
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	-

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（%）	
渤海证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	40,931,500.68	4.21	30,121.90	4.21	-
东北证券	2	2,511,084.88	0.26	1,847.88	0.26	-
东财证券	2	5,551,351.00	0.57	4,085.53	0.57	-
方正证券	2	37,146,083.91	3.82	27,335.43	3.82	-
高盛中国	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	15,972,260.86	1.64	11,754.25	1.64	-
广发证券	2	53,820,553.96	5.54	39,602.50	5.54	-
国海证券	2	27,067,787.80	2.79	19,919.85	2.79	-
国盛证券	2	276,901,139.03	28.51	203,768.98	28.51	-
国泰君安	2	28,343,895.90	2.92	20,858.48	2.92	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	21,166,214.13	2.18	15,575.85	2.18	-
海通证券	2	13,019,998.48	1.34	9,581.63	1.34	-
华泰证券	1	81,848,490.94	8.43	60,231.93	8.43	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	45,625,024.80	4.70	33,576.64	4.70	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	109,611,486.61	11.29	80,661.64	11.29	-
西南证券	2	58,866.50	0.01	43.31	0.01	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	35,639,592.27	3.67	26,227.94	3.67	-
兴业证券	1	15,413,843.10	1.59	11,343.64	1.59	-

招商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	35,696,302.01	3.68	26,267.73	3.68	-
中泰证券	2	20,604,204.40	2.12	15,162.33	2.12	-
中信建投	1	16,836,315.03	1.73	12,390.28	1.73	-
中信证券	4	87,440,464.29	9.00	64,343.74	9.00	-
中银证券	1	-	-	-	-	-

注：我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金退租券商交易单元：德邦证券（012561）。

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（%）
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东财证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
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	—	—	—	—	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
中银证券	—	—	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2024年03月14日
2	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2024年06月14日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024-01-01 至 2024-01-03	88,324,321.58	1,179,619.30	1,720,178.37	87,783,762.51	16.21%
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

§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城镇发展股票型证券投资基金的文件 2、富国城镇发展股票型证券投资基金基金合同 3、富国城镇发展股票型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、富国城镇发展股票型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	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话:95105686、4008880688(全国统一,免长途话费)公司网址:http://www.fullgoal.com.cn。