

富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金

二〇二二年中期报告

2022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：招商银行股份有限公司

送出日期：2022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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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	7
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标、基金净值表现	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	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	16
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	52
7.1	期末基金资产组合情况	52

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	52
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.....	53
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
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.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	58
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12	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
§9	开放式基金份额变动.....	61
§10	重大事件揭示.....	62
10.1	基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4	基金投资策略的改变.....	62
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
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.....	65
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	66
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.....	66
§12	备查文件目录.....	67



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金		
基金简称	富国沪港深价值精选灵活配置混合		
基金主代码	001371		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年06月24日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额（单位：份）	3,245,989,152.15		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	富国沪港深价值精选灵活配置混合 A	富国沪港深价值精选灵活配置混合 C	
下属分级基金的交易代码	前端	后端	011131
	001371	001372	
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	3,210,658,353.03		35,330,799.12

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于质地优良、估值合理的上市公司股票，通过精选个股和严格风险控制，追求基金长期资产增值，并争取实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例；本基金管理人将坚持行业配置策略与个股精选策略相结合；个股选择层面，遵循自下而上的积极策略。本基金对境内股票及港股通标的股票的选择，主要采取价值型选股策略，以公司行业研究员的基本分析为基础，同时结合数量化的系统选股方法，精选价值被低估的投资品种；本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资；本基金将进行以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，根据需要适度进行债券投资。本基金的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×45%+恒生指数收益率×45%+中债综合财富指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	张燕
	联系电话	021-20361818	0755-83199084
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95555
传真		021-20361616	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		裴长江	缪建民

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.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 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道7088号招商银行大厦

### 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、基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

##### (1) 富国沪港深价值精选灵活配置混合 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日至2022年06月30日)
本期已实现收益	-871,891,221.27
本期利润	-786,730,400.10
加权平均基金份额本期利润	-0.2210
本期加权平均净值利润率	-17.53%
本期基金份额净值增长率	-11.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年06月30日)
期末可供分配利润	-50,127,341.03
期末可供分配基金份额利润	-0.0156
期末基金资产净值	4,150,628,001.49
期末基金份额净值	1.293
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	96.28%

##### (2) 富国沪港深价值精选灵活配置混合 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日至2022年06月30日)
本期已实现收益	-9,293,373.04
本期利润	-7,870,066.50
加权平均基金份额本期利润	-0.2127
本期加权平均净值利润率	-17.04%
本期基金份额净值增长率	-12.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年06月30日)
期末可供分配利润	-999,190.61
期末可供分配基金份额利润	-0.0283
期末基金资产净值	45,250,261.63
期末基金份额净值	1.281
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-18.25%

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) 富国沪港深价值精选灵活配置混合 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	8.02%	1.10%	5.24%	1.18%	2.78%	-0.08%
过去三个月	7.30%	1.17%	2.74%	1.35%	4.56%	-0.18%
过去六个月	-11.98%	1.37%	-6.59%	1.51%	-5.39%	-0.14%
过去一年	-23.65%	1.29%	-16.68%	1.25%	-6.97%	0.04%
过去三年	38.37%	1.38%	-2.04%	1.13%	40.41%	0.25%
自基金合同生效起至今	96.28%	1.18%	-5.94%	1.10%	102.22%	0.08%

##### (2) 富国沪港深价值精选灵活配置混合 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	8.01%	1.11%	5.24%	1.18%	2.77%	-0.07%
过去三个月	7.11%	1.18%	2.74%	1.35%	4.37%	-0.17%
过去六个月	-12.26%	1.37%	-6.59%	1.51%	-5.67%	-0.14%
过去一年	-24.13%	1.29%	-16.68%	1.25%	-7.45%	0.04%
自基金分级生效日起至今	-18.25%	1.36%	-11.78%	1.18%	-6.47%	0.18%

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沪港深价值精选灵活配置混合 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 2022 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2015 年 6 月 24 日成立，建仓期 6 个月，从 2015 年 6 月 24 日起至 2015 年 12 月 23 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沪港深价值精选灵活配置混合 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2022年6月30日。

2、本基金自2020年12月29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

#### 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国际信托股份有限公司。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 2022 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、富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、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 267 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）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		
汪孟海	本基金基金经理	2015-10-09	—	12.0	博士，曾任中国人保资产管理股份有限公司研究员；自 2014 年 8 月加入富国基金管理有限公司，历任

					<p>QDII 基金经理助理、QDII 基金经理、高级 QDII 基金经理、海外权益投资部海外权益投资副总监；现任富国基金海外权益投资部海外权益投资总监兼资深 QDII 基金经理。2015 年 10 月起任富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 12 月起任富国沪港深行业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2017 年 12 月至 2021 年 1 月任富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、富国研究优选沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 2 月起任富国消费升级混合型证券投资基金基金经理，2020 年 4 月起任富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）基金经理，2021 年 5 月起任富国港股通策略精选混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国沪港深价值精选灵活配置混合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》、《富国沪港深价值精选灵活配置混合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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现1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**

上半年，俄乌局势导致全球大宗商品巨幅波动，叠加国内局部疫情反复和房地产销售低迷，对国内经济增长形成一定的压力。中概股退市预期对香港资本市

市场形成较大的拖拽效应。而美联储的加息进程又影响着全球流动性。鉴于香港市场主要是由内地的基本面，全球的流动性和投资者情绪主导。在连续三年明显跑输 A 股市场之后，今年香港市场表现仍然不尽如人意。

过去两年，A 股市场以光伏风电，新能源车，半导体，军工等为代表的硬科技板块表现尤为突出。一方面是因为相应板块景气度较高，另一个方面也是因为投资者对经济增长的信心不足。但香港市场的上市主体是金融地产和互联网，硬科技个股稀缺。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值 A/B 级为 1.293 元，C 级为 1.281 元；份额累计净值 A/B 级为 1.900 元，C 级为 1.441 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A/B 级为-11.98%，C 级为-12.26%，同期业绩比较基准收益率 A/B 级为-6.59%，C 级为-6.59%

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

我们的主要想法，还是尽可能的在两地选择优质的企业，在估值可接受的时候买入。我们不是极度看重估值保护的深度价值投资者，也不是看淡估值的景气赛道投资者。

我们长期仍然坚定看好中国经济的韧性和全球竞争力。看好消费，科技，新能源，医药，互联网等板块的长期方向。看好中国制造业的迭代进步。

#### **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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2022年06月 30日	上年度末 2021年12月31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	608,970,817.96	1,344,053,997.37
结算备付金	474,596.56	41,051,306.60
存出保证金	1,292,560.45	2,519,841.00
交易性金融资产	3,687,449,716.2 9	5,089,508,058.02
其中：股票投资	3,687,449,716.2 9	5,089,508,058.02
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	11,615,079.87	140,220,058.59
应收股利	5,728,456.16	—
应收申购款	2,987,977.01	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	165,068.95
资产总计	4,318,519,204.3 0	6,617,518,330.53
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末</b> 2022年06月 30日	<b>上年度末</b> 2021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	94,439,103.80	16,695,821.62
应付赎回款	19,704,457.13	12,411,878.66
应付管理人报酬	4,996,607.69	8,691,626.68
应付托管费	832,767.94	1,448,604.41

应付销售服务费	20,325.35	31,794.65
应付投资顾问费	—	—
应交税费	16.88	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	2,647,662.39	8,456,467.75
负债合计	122,640,941.18	47,736,193.77
<b>净资产：</b>		
实收基金	3,245,989,152.15	4,471,840,937.40
其他综合收益	—	—
未分配利润	949,889,110.97	2,097,941,199.36
净资产合计	4,195,878,263.12	6,569,782,136.76
负债和净资产总计	4,318,519,204.30	6,617,518,330.53

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.293 元，基金份额总额 3,245,989,152.15 份。其中：富国沪港深价值精选灵活配置混合 A 份额净值 1.293 元，份额总额 3,210,658,353.03 份；富国沪港深价值精选灵活配置混合 C 份额净值 1.281 元，份额总额 35,330,799.12 份。

比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	-754,658,037.27	182,168,128.70
1.利息收入	2,674,958.02	4,601,401.74
其中：存款利息收入	2,674,958.02	4,600,127.39

债券利息收入	—	1,274.35
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）	-844,885,144.31	398,728,664.06
其中：股票投资收益	-871,935,702.45	358,068,534.67
基金投资收益	—	—
债券投资收益	2,283,713.89	—
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	24,766,844.25	40,660,129.39
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）	86,584,127.71	-229,820,756.01
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	968,021.31	8,658,818.91
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>39,942,429.33</b>	<b>116,115,524.74</b>
1. 管理人报酬	33,988,843.44	75,758,171.63
2. 托管费	5,664,807.24	12,626,362.00
3. 销售服务费	138,344.97	518,340.93
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	5.42	0.90
8. 其他费用	150,428.26	27,212,649.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-794,600,466.60</b>	<b>66,052,603.96</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-794,600,466.60</b>	<b>66,052,603.96</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>-794,600,466.60</b>	<b>66,052,603.96</b>

注：比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期： 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (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)	4,471,840,937.40	2,097,941,199.36	6,569,782,136.76
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产 (基金净值)	4,471,840,937.40	2,097,941,199.36	6,569,782,136.76
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	—	—	—
(一)、综合收益总额	1,225,851,785.25	1,148,052,088.39	2,373,903,873.64
(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)	—	—	—
其中：1. 基金申购款	1,225,851,785.25	-353,451,621.79	1,579,303,407.04
2. 基金赎回款	303,294,827.85	80,656,679.04	383,951,506.89
(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)	3,245,989,152.15	949,889,110.97	4,195,878,263.12
项目	上年度可比期间 (2021 年 01 月 01 日至 2021 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)	4,166,332,908.81	3,319,391,803.90	7,485,724,712.71
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产 (基金净值)	4,166,332,908.81	3,319,391,803.90	7,485,724,712.71
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	—	—	—
(一)、综合收益总额	1,406,982,114.14	1,202,256,690.18	2,609,238,804.32
(二)、本期基金份额 交易产生的基金净值	—	66,052,603.96	66,052,603.96
	1,406,982,114.14	1,428,392,277.90	2,835,374,392.04

变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	3,394,236,071.82	3,104,484,203.19	6,498,720,275.01
2.基金赎回款	- 1,987,253,957.68	- 1,676,091,925.29	-3,663,345,882.97
(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)	-	-292,188,191.68	-292,188,191.68
(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)	5,573,315,022.95	4,521,648,494.08	10,094,963,517.03

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  
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

富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]877号《关于准予富国沪港深价值精选灵活配置混合型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6月24日生效,首次设立募集规模为1,029,199,705.41份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。根据基金管理人于2020年12月26日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下由招商银行股份有限公司托管的部分基金投资范围增加存托凭证、增加C类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》,自2020年12月29日起,本基金增加C类份额。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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围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)、港股通标的股票、存托凭证、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债券、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(含

超短期融资券)、公募可交换债券、证券公司发行的短期公司债券、资产支持证券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款等、衍生工具(权证、股指期货)以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具(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:股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 0-95%(其中,投资于国内依法发行上市的股票及存托凭证的比例占基金资产的 0-95%,投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%),其中投资于沪港深价值型相关股票及存托凭证不低于非现金基金资产的 80%,权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后,现金或者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 $\times$ 45%+恒生指数收益率 $\times$ 45%+中债综合财富指数收益率 $\times$ 10%。

#### **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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 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**

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、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。

##### **6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类**

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

###### **(1) 金融资产分类**

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

###### **(2) 金融负债分类**

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

##### **6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金



按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

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

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

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本

基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理,根据衔接规定,对可比期间信息不予调整,首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式,确定了三个主要的计量类别:摊余成本;以公允价值计量且其变动计入其他综合收益;以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式,以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”,适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中,并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中,不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目,反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中,其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日(2022 年 1 月 1 日),原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述:

以摊余成本计量的金融资产:

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,344,053,997.37 元,自应收利息转入的重分类金额为人民币 150,816.23 元,重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后,银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,344,204,813.60 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 41,051,306.60 元,自应收利息转入的重分类金额为人民币 12,941.89 元,重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后,

结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 41,064,248.49 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,519,841.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,310.83 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,521,151.83 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 165,068.95 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 150,816.23 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 12,941.89 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 1,310.83 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

#### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **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暂行条例（2011年修订）》、《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 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 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 (2022 年 06 月 30 日)
活期存款	608,970,817.96
等于：本金	608,909,325.40
加：应计利息	61,492.56
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	608,970,817.96

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 (2022 年 06 月 30 日)			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,731,077,356.23	—	3,687,449,716.29	43,627,639.94

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	3,731,077,356.23	—	3,687,449,716.29	43,627,639.94

#### 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（2022年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	16,570.79
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	2,447,371.30
其中：交易所市场	2,447,371.30
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	123,720.30
合计	2,647,662.39

#### 6.4.7.7 实收基金

富国沪港深价值精选灵活配置混合 A：

金额单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
----	-----------------------------



	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,431,896,377.99	4,431,896,377.99
本期申购	294,000,519.68	294,000,519.68
本期赎回（以“-”号填列）	-1,515,238,544.64	-1,515,238,544.64
本期末	3,210,658,353.03	3,210,658,353.03

富国沪港深价值精选灵活配置混合 C:

金额单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,944,559.41	39,944,559.41
本期申购	9,294,308.17	9,294,308.17
本期赎回（以“-”号填列）	-13,908,068.46	-13,908,068.46
本期末	35,330,799.12	35,330,799.12

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

富国沪港深价值精选灵活配置混合 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	975,221,462.87	1,104,349,488.22	2,079,570,951.09
本期利润	-871,891,221.27	85,160,821.17	-786,730,400.10
本期基金份额交易产生的变动数	-153,457,582.63	-199,413,319.90	-352,870,902.53
其中：基金申购款	24,750,197.18	53,500,171.11	78,250,368.29
基金赎回款	-178,207,779.81	-252,913,491.01	-431,121,270.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-50,127,341.03	990,096,989.49	939,969,648.46

富国沪港深价值精选灵活配置混合 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	8,361,861.38	10,008,386.89	18,370,248.27
本期利润	-9,293,373.04	1,423,306.54	-7,870,066.50
本期基金份额交易产生的变动数	-67,678.95	-513,040.31	-580,719.26
其中：基金申购款	500,935.74	1,905,375.01	2,406,310.75
基金赎回款	-568,614.69	-2,418,415.32	-2,987,030.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-999,190.61	10,918,653.12	9,919,462.51

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
活期存款利息收入	2,430,866.08
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	213,495.61
其他	30,596.33
合计	2,674,958.02

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
卖出股票成交总额	5,119,182,510.45
减：卖出股票成本总额	5,974,951,570.84
减：交易费用	16,166,642.06
买卖股票差价收入	-871,935,702.45

#### 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（2022年01月01日至2022年06月30日）
债券投资收益——利息收入	4,577.91
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,279,135.98
合计	2,283,713.89

##### 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（2022年01月01日至2022年06月30日）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,449,769.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,166,000.00
减：应计利息总额	4,623.15
减：交易费用	10.27
债券投资收益-差价收入	2,279,135.98

#### 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。

#### 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（2022年01月01日至2022年06月30日）
股票投资产生的股利收益	24,766,844.25
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	24,766,844.25

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
1. 交易性金融资产	86,584,127.71
股票投资	86,584,127.71
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	86,584,127.71

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
基金赎回费收入	968,021.31
合计	968,021.31

#### 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（2022年01月01日至2022年06月30日）
审计费用	33,720.30
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	9,894.95
其他	46,813.01
合计	150,428.26

#### 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
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
海通证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
申万宏源证券承销保荐有限责任公司（“申万宏源承销保荐”）	基金管理人的股东控制的子公司

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（2022年01月01日至2022年06月30日）		上年度可比期间（2021年01月01日至2021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（%）
申万宏源	1,178,545,985.44	12.29	3,163,029,370.85	17.80

#### 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 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（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	920,226.71	12.46	350,082.59	14.30
关联方名称	上年度可比期间（2021年01月01日至2021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	2,657,003.44	20.79	1,528,395.45	24.19

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（2022年01月01日至 2022年06月30日）	上年度可比期间（2021年01月 01日至2021年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	33,988,843.44	75,758,171.63
其中：支付销售机构的客户维护费	7,362,647.52	9,515,827.35

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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（2022年01月01 日至2022年06月30 日）	上年度可比期间（2021年01 月01日至2021年06月30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	5,664,807.24	12,626,362.00

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。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

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关 联方名称	本期（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		
	富国沪港深价值精选 灵活配置混合 A	富国沪港深价值精选 灵活配置混合 C	合计
富国基金管理有限公司	—	26,765.80	26,765.80
招商银行股份有限公司	—	510.25	510.25

合计	—	27,276.05	27,276.05
----	---	-----------	-----------

金额单位：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（2021年01月01日至2021年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国沪港深价值精选灵活配置混合 A	富国沪港深价值精选灵活配置混合 C	合计
富国基金管理有限公司	—	414,423.10	414,423.10
合计	—	414,423.10	414,423.10

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 0.60% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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算，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 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）		上年度可比期间（2021年01月01日至2021年06月30日）	
	富国沪港深价值精选灵活配置混合 A	富国沪港深价值精选灵活配置混合 C	富国沪港深价值精选灵活配置混合 A	富国沪港深价值精选灵活配置混合 C
基金合同生效日（2015年06月24日）持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	7,563,540.09	—	7,563,540.09	579.71
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	7,563,540.09	—	7,563,540.09	579.71
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.24%	—	0.14%	0.00%

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

#### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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（2022年01月01日至2022年06月30日）		上年度可比期间（2021年01月01日至2021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
招商银行股份有限公司	608,970,817.96	2,430,866.08	2,256,199,165.32	3,979,722.18

#### 6.4.10.6 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（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	27,002	944,367.95
海通证券股份有限公司	688220	翱捷科技	IPO网下申购	12,371	2,045,701.96

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2021年01月01日至2021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	300981	中红医疗	IPO网下申购	6,003	291,685.77
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	300937	药易购	IPO网下申购	2,434	29,816.50
海通证券股份有限公司	688217	睿昂基因	IPO网下申购	1,040	19,252.58
海通证券股份有限公司	688685	迈信林	IPO网下申购	2,612	23,678.04
海通证券股份有限公司	688682	霍莱沃	IPO网下申购	946	43,467.38
海通证券股份有限公司	688092	爱科科技	IPO网下	1,137	21,836.71



公司			申购		
海通证券股份有限 公司	688626	翔宇医疗	IPO 网下 申购	3,652	105,776.89
海通证券股份有限 公司	688329	艾隆科技	IPO 网下 申购	1,846	31,186.42
海通证券股份有限 公司	688665	四方光电	IPO 网下 申购	1,687	50,066.20
海通证券股份有限 公司	688687	凯因科技	IPO 网下 申购	5,354	102,127.01

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 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（2022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
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月	新股限售	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	—
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月	新股限售	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	—
301162	国能日新	2022-04-19	6个月	新股限售	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	—
301181	标榜股份	2022-02-11	6个月	新股限售	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	—
301196	唯科科技	2022-01-04	6个月	新股限售	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	—
301200	大族数控	2022-02-18	6个月	新股限售	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	—
301206	三元生物	2022-01-26	6个月	新股限售	109.30	45.69	630	68,859.00	28,784.70	—
301206	三元生物	2022-06-17	2个月	新股限售_ 转增	—	45.69	315	—	14,392.35	—
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月	新股限售	173.98	87.82	321	55,847.58	28,190.22	—
301219	腾远钴业	2022-05-24	4个月	新股限售_ 转增	—	87.82	257	—	22,569.74	—
301235	华康医疗	2022-01-21	6个月	新股限售	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	—
688349	三一重能	2022-06-15	6个月	新股限售	29.80	36.94	32,650	972,970.00	1,206,091.00	—

##### 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 2022 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 2022 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。本基金本期末及上年度末均未持有信用债、资产支持证券和同业存单。

### 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（2022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	608,970,817.96	—	—	—	—	—	608,970,817.96
结算备付金	474,596.56	—	—	—	—	—	474,596.56
存出保证金	1,292,560.45	—	—	—	—	—	1,292,560.45
交易性金融资产	—	—	—	—	—	3,687,449,716.29	3,687,449,716.29
应收清算款	—	—	—	—	—	11,615,079.87	11,615,079.87
应收股利	—	—	—	—	—	5,728,456.16	5,728,456.16
应收申购款	—	—	—	—	—	2,987,977.01	2,987,977.01
资产总计	610,737,974.97	—	—	—	—	3,707,781,229.33	4,318,519,204.30
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	94,439,103.80	94,439,103.80
应付赎回款	—	—	—	—	—	19,704,457.13	19,704,457.13
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	4,996,607.69	4,996,607.69
应付托管费	—	—	—	—	—	832,767.94	832,767.94
应付销售服务费	—	—	—	—	—	20,325.35	20,325.35
应交税费	—	—	—	—	—	16.88	16.88
其他负债	—	—	—	—	—	2,647,662.39	2,647,662.39
负债总计	—	—	—	—	—	122,640,941.18	122,640,941.18
利率敏感度缺口	610,737,974.97	—	—	—	—	3,585,140,288.15	4,195,878,263.12
上年度末（2021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	1,344,053,997.37	—	—	—	—	—	1,344,053,997.37
结算备付金	41,051,306.60	—	—	—	—	—	41,051,306.60
存出保证金	2,519,841.00	—	—	—	—	—	2,519,841.00
交易性金融资产	—	—	—	—	—	5,089,508,058.02	5,089,508,058.02
应收清算款	—	—	—	—	—	140,220,058.59	140,220,058.59
其他资产	—	—	—	—	—	165,068.95	165,068.95
资产总计	1,387,625,144.97	—	—	—	—	5,229,893,185.56	6,617,518,330.53
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	16,695,821.62	16,695,821.62
应付赎回款	—	—	—	—	—	12,411,878.66	12,411,878.66
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	8,691,626.68	8,691,626.68
应付托管费	—	—	—	—	—	1,448,604.41	1,448,604.41
应付销售服务费	—	—	—	—	—	31,794.65	31,794.65
其他负债	—	—	—	—	—	8,456,467.75	8,456,467.75
负债总计	—	—	—	—	—	47,736,193.77	47,736,193.77
利率敏感度缺口	1,387,625,144.97	—	—	—	—	5,182,156,991.79	6,569,782,136.76

#### 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

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末（2022年06月30日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
交易性金融资产	—	1,260,512,360.0 0	—	—	1,260,512,360.0 0
应收股利	—	5,728,456.16	—	—	5,728,456.16
资产合计	—	1,266,240,816.1 6	—	—	1,266,240,816.1 6
以外币计价的负债					
—	—	—	—	—	—
负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	—	1,266,240,816.1 6	—	—	1,266,240,816.1 6
项目	上年度末（2021年12月31日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
交易性金融资产	—	1,317,423,569.0 0	—	—	1,317,423,569.0 0
资产合计	—	1,317,423,569.0 0	—	—	1,317,423,569.0 0
以外币计价的负债					
—	—	—	—	—	—
负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	—	1,317,423,569.0 0	—	—	1,317,423,569.0 0

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化 1%，其他变量不变；(2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口。		
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（2022 年 06 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币贬值 1%	-12,662,408.16	-13,174,235.69
	港币相对人民币升值 1%	12,662,408.16	13,174,235.69

#### 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）、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债券、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（含超短期融资券）、公募可交换债券、证券公司发行的短期公司债券、资产支持证券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款等、衍生工具（权证、股指期货）以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 0-95%（其中，投资于国内依法发行上市的股票及存托凭证的比例占基金资产的 0-95%，投



投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%)，其中投资于沪港深价值型相关股票及存托凭证不低于非现金基金资产的 80%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，现金或者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（2022年06月30日）		上年度末（2021年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	3,687,449,716.29	87.88	5,089,508,058.02	77.47
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	3,687,449,716.29	87.88	5,089,508,058.02	77.47

#### 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（2022年06月30日）	上年度末（2021年12月31日）

1. 业绩比较基准增加 1%	34,649,196.98	72,934,862.75
2. 业绩比较基准减少 1%	-34,649,196.98	-72,934,862.75

#### 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 (2022年06月30日)	上年度末 (2021年12月31日)
第一层次	3,686,017,510.92	5,028,867,500.53
第二层次	—	—
第三层次	1,432,205.37	60,640,557.49
合计	3,687,449,716.29	5,089,508,058.02

###### 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	3,687,449,716.29	85.39
	其中：股票	3,687,449,716.29	85.39
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	609,445,414.52	14.11
8	其他各项资产	21,624,073.49	0.50
9	合计	4,318,519,204.30	100.00

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 988,715,690.00 元，占资产净值比例为 23.56%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 271,796,670.00 元，占资产净值比例为 6.48%。

### 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	—	—
C	制造业	2,187,396,020.91	52.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	20,460,000.00	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,738,612.74	0.97
J	金融业	64,461,222.90	1.54

K	房地产业	20,509,295.00	0.49
L	租赁和商务服务业	92,007,350.00	2.19
M	科学研究和技术服务业	15,854.74	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	1,349,000.00	0.03
	合计	2,426,937,356.29	57.84

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
金融	269,351,000.00	6.42
非日常生活消费品	222,021,840.00	5.29
医疗保健	193,342,800.00	4.61
通信服务	153,203,950.00	3.65
日常消费品	122,275,400.00	2.91
信息技术	105,379,300.00	2.51
房地产	86,060,500.00	2.05
工业	57,108,970.00	1.36
公用事业	32,400,000.00	0.77
原材料	19,368,600.00	0.46
合计	1,260,512,360.00	30.04

注：1、以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

2、以上行业分类的统计中已包含沪港通深港通投资的股票。

### 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	167,003	341,521,135.00	8.14
2	00388	香港交易所	610,000	201,361,000.00	4.80
3	000568	泸州老窖	797,200	196,541,688.00	4.68
4	00700	腾讯控股	470,000	142,447,600.00	3.39
5	300750	宁德时代	230,000	122,820,000.00	2.93
6	03690	美团-W	700,000	116,256,000.00	2.77
7	03759	康龙化成	1,530,000	102,785,400.00	2.45
8	00168	青岛啤酒股份	1,430,000	99,785,400.00	2.38

9	601888	中国中免	395,000	92,007,350.00	2.19
10	02359	药明康德	980,000	87,582,600.00	2.09
11	600809	山西汾酒	258,000	83,798,400.00	2.00
12	002475	立讯精密	2,000,065	67,582,196.35	1.61
13	002142	宁波银行	1,800,090	64,461,222.90	1.54
14	002384	东山精密	2,700,000	61,911,000.00	1.48
15	300122	智飞生物	530,036	58,839,296.36	1.40
16	002245	蔚蓝锂芯	2,332,500	54,137,325.00	1.29
17	06049	保利物业	1,177,000	50,328,520.00	1.20
18	002463	沪电股份	3,243,300	47,871,108.00	1.14
19	601717	郑煤机	2,500,000	36,025,000.00	0.86
19	00564	郑煤机	1,500,000	11,805,000.00	0.28
20	002028	思源电气	1,300,000	46,358,000.00	1.10
21	03898	时代电气	1,368,700	45,303,970.00	1.08
22	06030	中信证券	3,000,000	45,000,000.00	1.07
23	002371	北方华创	157,200	43,563,264.00	1.04
24	000661	长春高新	185,000	43,182,700.00	1.03
25	002271	东方雨虹	813,803	41,886,440.41	1.00
26	300661	圣邦股份	230,000	41,864,600.00	1.00
27	600885	宏发股份	989,940	41,428,989.00	0.99
28	01928	金沙中国有限公司	2,548,000	40,793,480.00	0.97
29	603501	韦尔股份	234,300	40,540,929.00	0.97
30	000858	五粮液	200,000	40,386,000.00	0.96
31	603198	迎驾贡酒	615,014	40,062,011.96	0.95
32	000596	古井贡酒	159,309	39,773,084.94	0.95
33	300274	阳光电源	400,000	39,300,000.00	0.94
34	600436	片仔癀	110,000	39,240,300.00	0.94
35	002353	杰瑞股份	973,300	39,223,990.00	0.93
36	06865	福莱特玻璃	1,600,000	37,760,000.00	0.90
36	601865	福莱特	3,300	125,730.00	0.00
37	601799	星宇股份	220,000	37,620,000.00	0.90
38	603678	火炬电子	800,000	37,448,000.00	0.89
39	603456	九洲药业	700,063	36,193,257.10	0.86
40	688599	天合光能	550,074	35,892,328.50	0.86
41	01209	华润万象生活	1,074,000	35,731,980.00	0.85
42	603290	斯达半导	91,973	35,492,380.70	0.85
43	300760	迈瑞医疗	110,900	34,733,880.00	0.83
44	000887	中鼎股份	1,860,060	33,927,494.40	0.81
45	600660	福耀玻璃	800,000	33,448,000.00	0.80

46	601012	隆基绿能	500,000	33,315,000.00	0.79
47	300496	中科创达	250,000	32,620,000.00	0.78
48	00916	龙源电力	2,500,000	32,400,000.00	0.77
49	00968	信义光能	3,000,000	31,080,000.00	0.74
50	002916	深南电路	327,538	30,693,585.98	0.73
51	603986	兆易创新	200,000	28,442,000.00	0.68
52	601567	三星医疗	2,050,000	27,224,000.00	0.65
53	09868	小鹏汽车一 W	250,000	27,025,000.00	0.64
54	000913	钱江摩托	1,480,500	25,997,580.00	0.62
55	02331	李宁	400,000	24,868,000.00	0.59
56	600298	安琪酵母	500,000	24,375,000.00	0.58
57	01610	中粮家佳康	6,920,000	22,490,000.00	0.54
58	600419	天润乳业	1,604,949	21,634,712.52	0.52
59	02328	中国财险	3,000,000	20,940,000.00	0.50
60	601155	新城控股	806,500	20,509,295.00	0.49
61	600976	健民集团	400,000	20,460,000.00	0.49
62	600285	羚锐制药	1,500,000	18,795,000.00	0.45
63	600933	爱柯迪	1,093,100	17,904,978.00	0.43
64	300969	恒帅股份	199,700	16,906,602.00	0.40
65	00189	东岳集团	1,854,000	15,573,600.00	0.37
66	688120	华海清科	60,000	14,904,000.00	0.36
67	00268	金蝶国际	900,000	14,166,000.00	0.34
68	02238	广汽集团	2,000,000	12,980,000.00	0.31
69	02013	微盟集团	2,500,000	11,450,000.00	0.27
70	002937	兴瑞科技	600,900	11,110,641.00	0.26
71	00354	中国软件国 际	1,590,000	10,923,300.00	0.26
72	02400	心动公司	615,000	10,756,350.00	0.26
73	002126	银轮股份	939,148	10,753,244.60	0.26
74	600406	国电南瑞	300,020	8,100,540.00	0.19
75	300207	欣旺达	200,000	6,320,000.00	0.15
76	01378	中国宏桥	500,000	3,795,000.00	0.09
77	01521	方达控股	1,110,000	2,974,800.00	0.07
78	002139	拓邦股份	209,700	2,573,019.00	0.06
79	01339	中国人民保 险集团	1,000,000	2,050,000.00	0.05
80	000009	中国宝安	100,000	1,349,000.00	0.03
81	603737	三棵树	10,000	1,294,300.00	0.03
82	688349	三一重能	32,650	1,206,091.00	0.03
83	300601	康泰生物	11,840	534,931.20	0.01

84	688390	固德威	1,400	438,214.00	0.01
85	06690	海尔智家	4,000	99,360.00	0.00
86	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
87	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
88	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
89	000768	中航西飞	1,400	42,406.00	0.00
90	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
91	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
92	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
93	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
94	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
95	301181	标榜股份	257	7,861.63	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	02318	中国平安	130,415,185.76	1.99
1	601318	中国平安	53,447,715.29	0.81
2	03690	美团-W	182,485,808.58	2.78
3	000568	泸州老窖	179,571,906.79	2.73
4	00388	香港交易所	177,942,625.20	2.71
5	00700	腾讯控股	168,250,969.49	2.56
6	300750	宁德时代	136,865,046.00	2.08
7	01024	快手-W	133,400,569.31	2.03
8	600519	贵州茅台	122,082,005.40	1.86
9	02202	万科 A	55,533,764.37	0.85
9	000002	万科 A	48,119,761.00	0.73
10	600887	伊利股份	84,849,707.00	1.29
11	002142	宁波银行	67,600,624.90	1.03
12	02388	中银香港	67,038,712.94	1.02
13	603259	药明康德	51,260,523.02	0.78
13	02359	药明康德	12,046,866.53	0.18
14	000333	美的集团	61,881,672.80	0.94
15	01299	友邦保险	59,257,313.15	0.90
16	300059	东方财富	58,103,116.15	0.88
17	600702	舍得酒业	57,861,487.99	0.88
18	002384	东山精密	56,189,925.00	0.86
19	00016	新鸿基地产	55,485,999.14	0.84
20	002028	思源电气	53,454,330.75	0.81

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	00700	腾讯控股	222,232,919.44	3.38
2	603806	福斯特	202,517,419.40	3.08
3	02318	中国平安	122,999,535.39	1.87
3	601318	中国平安	50,539,716.00	0.77
4	000858	五粮液	162,995,071.20	2.48
5	300274	阳光电源	154,967,756.23	2.36
6	03690	美团-W	144,153,563.06	2.19
7	601012	隆基绿能	121,145,158.00	1.84
8	601888	中国中免	120,096,533.80	1.83
9	002484	江海股份	119,279,403.48	1.82
10	300750	宁德时代	110,875,649.45	1.69
11	600563	法拉电子	109,047,198.00	1.66
12	01024	快手-W	104,479,294.12	1.59
13	02202	万科 A	53,684,222.71	0.82
13	000002	万科 A	43,325,839.00	0.66
14	02382	舜宇光学科 技	89,669,956.86	1.36
15	603259	药明康德	59,874,868.00	0.91
15	02359	药明康德	25,901,006.30	0.39
16	600887	伊利股份	84,506,298.72	1.29
17	002812	恩捷股份	72,391,200.95	1.10
18	02388	中银香港	71,562,712.95	1.09
19	002190	成飞集成	66,572,186.90	1.01
20	002304	洋河股份	63,431,195.98	0.97

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	4,486,309,101.40
卖出股票收入（成交）总额	5,119,182,510.45

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 申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，美团在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，腾讯控股有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。

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。

#### 7.12.2 申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	1,292,560.45
2	应收清算款	11,615,079.87
3	应收股利	5,728,456.16
4	应收利息	—
5	应收申购款	2,987,977.01
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	21,624,073.49

#### 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

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(%)
富国沪港深价值精选灵活配置混合 A	216,308	14,842.99	1,318,867,675.14	41.08	1,891,790,677.89	58.92
富国沪港深价值精选灵活配置混合 C	3,650	9,679.67	10,279,093.26	29.09	25,051,705.86	70.91
合计	219,958	14,757.31	1,329,146,768.40	40.95	1,916,842,383.75	59.05

### 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(%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	富国沪港深价值精选灵活配置混合 A	6,353,747.11	0.1979
	富国沪港深价值精选灵活配置混合 C	14.34	0.0000
	合计	6,353,761.45	0.1957

### 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	富国沪港深价值精选灵活配置混合 A	>100
	富国沪港深价值精选灵活配置混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	富国沪港深价值精选灵活配置混合 A	10~50
	富国沪港深价值精选灵活配置混合 C	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国沪港深价值精选 灵活配置混合 A	富国沪港深价值精选 灵活配置混合 C
基金合同生效日(2015年06月24日) 基金份额总额	1,029,199,705.41	—
报告期期初基金份额总额	4,431,896,377.99	39,944,559.41
本报告期基金总申购份额	294,000,519.68	9,294,308.17
减：本报告期基金总赎回份额	1,515,238,544.64	13,908,068.46
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	3,210,658,353.03	35,330,799.12

---

## § 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		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 (%)	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 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
东方证券	2	870,206,478.91	9.07	—	—	—	—	—	—	795,162.45	10.76	—
国金证券	2	870,213,381.94	9.07	—	—	—	—	—	—	795,814.29	10.77	—
国盛证券	2	306,315,402.64	3.19	2,736,929.50	26.19	—	—	—	—	282,209.18	3.82	—
国泰君安	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
恒泰证券	2	3,190,024.00	0.03	—	—	—	—	—	—	2,939.01	0.04	—
华创证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华泰证券	2	496,701,830.51	5.18	—	—	—	—	—	—	453,243.13	6.14	—
申万宏源	1	1,178,545,985.44	12.29	—	—	—	—	—	—	920,226.71	12.46	—
信达证券	2	313,638,047.32	3.27	—	—	—	—	—	—	285,962.23	3.87	—
野村证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	2	1,145,062,631.68	11.94	—	—	—	—	—	—	1,044,343.01	14.14	—
中金财富	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

中金公司	1	499,263,435.74	5.21	10,152.00	0.10	—	—	—	—	458,098.01	6.20	—
中信建投	2	248,748,693.49	2.59	—	—	—	—	—	—	227,053.37	3.07	—
中信山东	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	2	3,659,386,695.51	38.15	7,702,687.90	73.71	—	—	—	—	2,122,636.44	28.73	—
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。本报告期本基金新增券商交易单元：中信建投（723277），国盛证券（008450、54952），华创证券（014941）。



## 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	富国基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	规定披露媒介	—

## § 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	2022-01-25 至 2022-01-26	840,872,469.10	—	366,151,805.09	474,720,664.01	14.62%
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							

## § 12 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沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金的文件 2、富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同 3、富国沪港深价值精选灵活配置混合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、富国沪港深价值精选灵活配置混合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） 公司地址： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。