

# 华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华润元大基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	52

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</b>
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 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金	
基金简称	华润元大富时中国 A50 指数	
基金主代码	000835	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 11 月 20 日	
基金管理人	华润元大基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	71,864,938.51 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华润元大富时中国 A50 指数 A	华润元大富时中国 A50 指数 C
下属分级基金的交易代码	000835	010573
报告期末下属分级基金的份额总额	69,912,284.06 份	1,952,654.45 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准表现相当，以便为投资者带来长期收益。
投资策略	本基金采用完全复制法来跟踪富时中国 A50 指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。如有因受股票停牌、股票流动性或其他一些影响指数复制的市场因素的限制，使基金管理人无法依指数权重购买成份股，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对投资组合进行适当调整，以获得更接近标的指数的收益率。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	富时中国 A50 指数收益率×95%+银行活期存款收益率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，属于证券投资基金中的中高预期风险、中高预期收益的投资品种。一般情况下，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 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	华润元大基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	刘豫皓	秦一楠
	联系电话	0755-88399008	010-66060069
	电子邮箱	kf@cryuantafund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4000-1000-89	95599
传真		0755-88399045	010-68121816
注册地址		深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-05 单元	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-05 单元	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518066	100031
法定代表人		费凡	谷澍

## 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	<a href="http://www.cryuantafund.com">http://www.cryuantafund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华润元大基金管理有限公司	深圳市前海深港合作区兴海 大道 3040 号前海世茂金融中 心二期 1 栋 2103-2105 单元

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	华润元大富时中国 A50 指数 A	华润元大富时中国 A50 指数 C
本期已实现收益	-9,430,056.23	-662,313.14
本期利润	-4,593,910.21	-124,305.52
加权平均基金份 额本期利润	-0.0632	-0.0190
本期加权平均净 值利润率	-2.39%	-0.72%
本期基金份额净 值增长率	-2.35%	-2.51%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	107,736,634.04	2,968,707.09
期末可供分配基金份额利润	1.5410	1.5203
期末基金资产净值	177,648,918.10	4,921,361.54
期末基金份额净值	2.5410	2.5203
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	154.10%	152.03%

注：1、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。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（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。

### 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

华润元大富时中国 A50 指数 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	2.24%	0.90%	1.21%	0.90%	1.03%	0.00%
过去三个月	-4.04%	0.83%	-5.36%	0.83%	1.32%	0.00%
过去六个月	-2.35%	0.85%	-3.73%	0.84%	1.38%	0.01%
过去一年	-12.60%	1.02%	-15.76%	1.02%	3.16%	0.00%
过去三年	17.91%	1.18%	-9.74%	1.22%	27.65%	-0.04%
自基金合同生效起至今	154.10%	1.40%	65.20%	1.40%	88.90%	0.00%

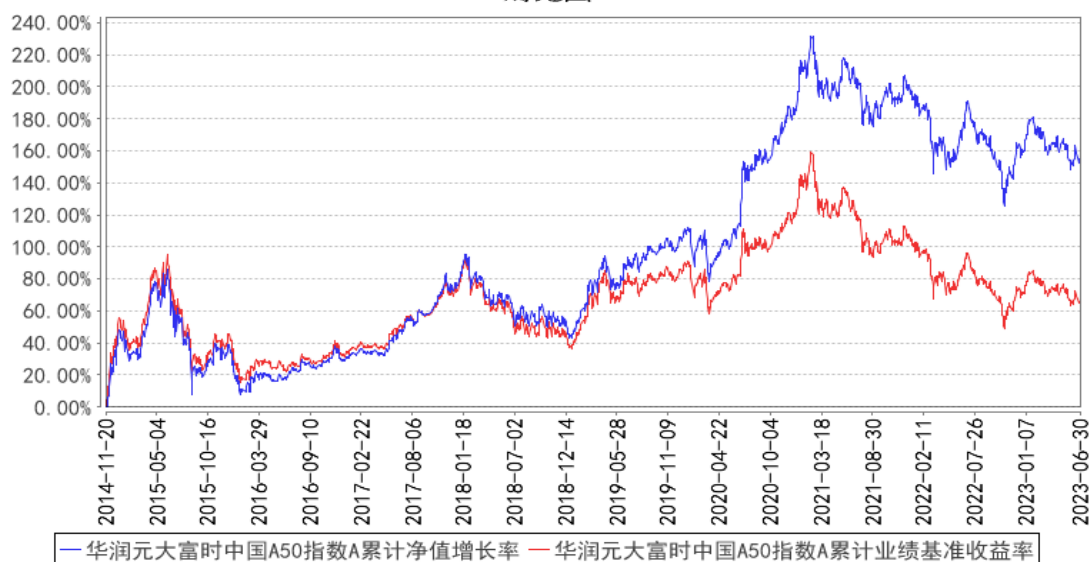
华润元大富时中国 A50 指数 C

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

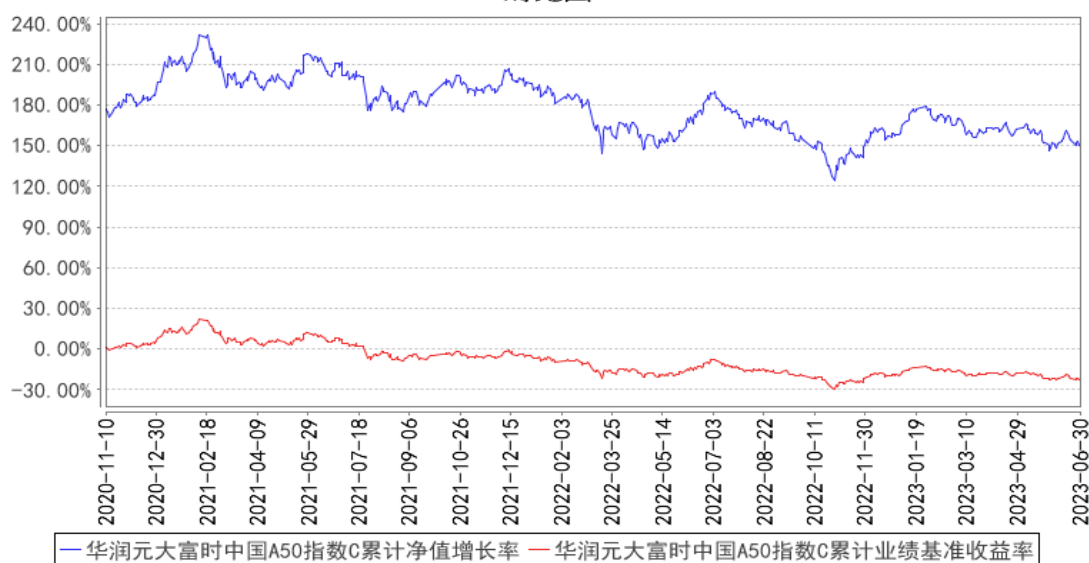
过去一个月	2.20%	0.91%	1.21%	0.90%	0.99%	0.01%
过去三个月	-4.13%	0.84%	-5.36%	0.83%	1.23%	0.01%
过去六个月	-2.51%	0.85%	-3.73%	0.84%	1.22%	0.01%
过去一年	-12.87%	1.02%	-15.76%	1.02%	2.89%	0.00%
自基金合同生效 起至今	152.03%	7.07%	-22.12%	1.20%	174.15 %	5.87%

### 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

华润元大富时中国A50指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华润元大富时中国A50指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





## § 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

华润元大基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2012】1746 号文批准，于 2013 年 1 月 17 日完成工商登记注册，总部位于深圳，注册资本 6 亿元人民币。公司由华润深国投信托有限公司、华润金控投资有限公司、台湾元大证券投资信托股份有限公司共同发起设立，占股比例分别为 51%、24.5%、24.5%。

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理十七只基金产品：华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金、华润元大量化优选混合型证券投资基金、华润元大欣享混合型发起式证券投资基金、华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金、华润元大核心动力混合型证券投资基金、华润元大现金收益货币市场基金、华润元大现金货币市场基金、华润元大稳健收益债券型证券投资基金、华润元大润鑫债券型证券投资基金、华润元大润泽债券型证券投资基金、华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金、华润元大润丰纯债债券型证券投资基金、华润元大润享三个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大臻选回报混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李武群	本基金的基金经理	2017 年 8 月 2 日	-	14 年	曾任中信银行福州分行统计分析岗、华西证券股份有限公司研究所高级研究员和股票投资部投资经理助理；2015 年 8 月 13 日加入华润元大基金管理有限公司，现任公司量化指数部总经理。目前担任华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金、华润元大量化优选混合型证券投资基金、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大欣享混合型发起式证券投资基金、华润元大臻选回报混合型证券投资基金基金经理。
胡永杰	本基金的基金经理	2021 年 1 月 25 日	-	8 年	曾任招商银行总行信息技术部开发工程师、深圳前海金信大数据金融服务有限公司研究员。2017 年加入公司，现担任量化指数部基金经理。目前担任华润元大量化优选混合型证券投资基金、华润元大安鑫

					灵活配置混合型证券投资基金、华润元大富时 A50 指数型证券投资基金、华润元大臻选回报混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：根据 2023 年 8 月 5 日《华润元大基金管理有限公司关于华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金基金经理变更的公告》，自 2023 年 8 月 4 日起，胡永杰不再担任本基金基金经理。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内无上述兼任情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规及公司内部制度关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，未发生违反公平交易制度的行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。基金管理人管理的所有投资组合未存在参与的交易所公开竞价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的 5% 的情形。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 上半年，国内生产总值同比增长 5.5%，比一季度加快 1.0 个百分点，快于去年全年 3% 的经济增速。国内经济呈现弱复苏趋势，内外需复苏放缓，出口相对疲软，消费整体偏弱，地产投资未见改善，制造业投资增速放缓。A 股市场在全球主要市场中表现相对落后，仅沪指录得小幅上涨，深成指及创业板指均为下跌。在缺乏增量资金入场的背景下，A 股市场演绎存量博弈特征，指数及行业表现分化。市场主要赚钱行情集中在数字经济和中特估主线，资产荒下拥抱主题成为市场阻力最小的方向。

本基金作为被动指数型基金，报告期内，本基金采用完全复制法紧密跟踪富时中国 A50 指数，少数关联方股票用同行业的大盘绩优价值股做替代。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华润元大富时中国 A50 指数 A 基金份额净值为 2.5410 元,本报告期基金份额净值增长率为-2.35%,同期业绩基准收益率为-3.73%;华润元大富时中国 A50 指数 C 基金份额净值为 2.5203 元,本报告期基金份额净值增长率为-2.51%,同期业绩基准收益率为-3.73%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 下半年,经济内生动力在政策引导下有望保持稳定向好,市场风险偏好有望改善,市场震荡筑底后或将迎来修复。当前各类宽基指数估值均处于历史底部,性价比高。建议关注充分受益经济复苏的顺周期板块和未来长周期高景气的数字经济板块。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉相关政策法规,并具有丰富的实践经验。同时,根据基金管理机构制定的相关制度,估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—华润元大基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额

持有人利益的行为。

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

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

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为, 华润元大基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定, 基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整, 未发现有损害基金持有人利益的行为。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,768,221.37	930,900.80
结算备付金		8,583,561.38	6,015,712.33
存出保证金		7,923.25	355,720.02
交易性金融资产	6.4.7.2	175,592,176.78	199,606,383.90
其中：股票投资		166,142,704.45	189,882,233.54
基金投资		-	-
债券投资		9,449,472.33	9,724,150.36
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,000,000.00	-295.06
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-

其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		82,257.91	999,128.44
应收股利		-	-
应收申购款		94,195.23	203,216.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	40,962.41
资产总计		191,128,335.92	208,151,729.47
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		5,000,997.26	-
应付清算款		2,595,525.08	11.42
应付赎回款		271,042.28	135,100.18
应付管理人报酬		93,067.82	105,769.40
应付托管费		23,266.97	26,442.38
应付销售服务费		2,562.79	4,961.48
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.31
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	571,594.08	478,727.16
负债合计		8,558,056.28	751,012.33
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	71,864,938.51	79,751,182.64
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	110,705,341.13	127,649,534.50
净资产合计		182,570,279.64	207,400,717.14
负债和净资产总计		191,128,335.92	208,151,729.47

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 71,864,938.51 份，其中华润元大富时中国 A50 指数 A 类基金份额净值人民币 2.5410 元，份额总额 69,912,284.06 份；华润元大富时中国 A50 指数 C 类基金份额净值人民币 2.5203 元，份额总额 1,952,654.45 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-3,671,332.86	-11,110,205.00
1. 利息收入		14,365.75	34,428.21
其中：存款利息收入	6.4.7.10	9,952.28	28,166.66
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,413.47	6,261.55
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-9,084,079.00	-12,054,428.76
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-10,250,973.81	-14,217,415.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	77,745.16	404,389.70
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-906,916.52	-214,533.98
股利收益	6.4.7.16	1,996,066.17	1,973,130.98
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,374,153.64	846,683.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	24,226.75	63,111.85
<b>减：二、营业总支出</b>		1,046,882.87	1,260,977.46
1. 管理人报酬		625,215.19	775,879.48
2. 托管费		156,303.77	193,969.87
3. 销售服务费		26,001.36	78,539.43
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		34,659.83	3,440.91
其中：卖出回购金融资产支出		34,659.83	3,440.91
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		476.99	0.04
8. 其他费用	6.4.7.20	204,225.73	209,147.73

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,718,215.73	-12,371,182.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,718,215.73	-12,371,182.46
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,718,215.73	-12,371,182.46

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	79,751,182.64	-	127,649,534.50	207,400,717.14
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	79,751,182.64	-	127,649,534.50	207,400,717.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,886,244.13	-	-16,944,193.37	-24,830,437.50
（一）、综合收益总额	-	-	-4,718,215.73	-4,718,215.73
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-7,886,244.13	-	-12,225,977.64	-20,112,221.77

(净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	9,116,264.51	-	15,286,831.67	24,403,096.18
2. 基金赎回款	-17,002,508.64	-	-27,512,809.31	-44,515,317.95
(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、本期末净资产(基金净值)	71,864,938.51	-	110,705,341.13	182,570,279.64
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	124,286,661.55	-	245,174,291.22	369,460,952.77
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	124,286,661.55	-	245,174,291.22	369,460,952.77



三、本期 增减变动 额（减少 以“-”号 填列）	-48,057,574.90	-	-99,855,476.20	-147,913,051.10
（一）、综 合收益总 额	-	-	-12,371,182.46	-12,371,182.46
（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）	-48,057,574.90	-	-87,484,293.74	-135,541,868.64
其中：1. 基金申购 款	37,129,418.91	-	61,713,606.48	98,843,025.39
2. 基金赎回 款	-85,186,993.81	-	-149,197,900.22	-234,384,894.03
（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）	76,229,086.65	-	145,318,815.02	221,547,901.67

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：

江先达

基金管理人负责人

张彦军

主管会计工作负责人

张彦军

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金（以下简称“本基金”），经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]989号《关于准予华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金注册的批复》核准，由华润元大基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2014 年 10 月 27 日至 2014 年 11 月 14 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 714,505,762.47 元，经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2014）验字第 61032987\_H08 号验资报告。经向中国证监会备案，《华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金基金合同》于 2014 年 11 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 714,621,124.13 份基金份额，其中认购资金利息折合 115,361.66 份基金份额。

本基金的基金管理人为华润元大基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据法律法规的规定及《华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金基金合同》和《华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金招募说明书》的约定，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，华润基金管理有限公司决定自 2020 年 11 月 9 日起对华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费用，而不计提销售服务费；C 类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用，而在赎回时根据持有期限收取赎回费，且从本类别基金资产中计提销售服务费。两类基金份额分别设置代码，并分别计算基金份额净值。两类份额之间不得相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券、资产支持证券、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货等以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金的投资组合比例为：投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的 90%，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，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：富时中国 A50 指数收益率×95%+银行活期存款收益率（税后）×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金报告期所采用的会计政策、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

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 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) 增值税及附加

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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）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。

### （4）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。

### （5）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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	3,768,221.37
等于：本金	3,767,909.90
加：应计利息	311.47
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	3,768,221.37

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	181,099,570.08	-	166,142,704.45	-14,956,865.63
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	35,372.33	9,449,472.33	-38.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	35,372.33	9,449,472.33	-38.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	190,513,708.08	35,372.33	175,592,176.78	-14,956,903.63

### 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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或衍生金融负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,000,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	535.86
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	164,862.28
其中：交易所市场	164,862.28
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	247,966.53
预提审计费	32,232.48
预提信息披露费	59,507.37
预提指数使用费	66,489.56

合计	571,594.08
----	------------

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 华润元大富时中国 A50 指数 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,291,487.73	72,291,487.73
本期申购	8,760,202.61	8,760,202.61
本期赎回（以“-”号填列）	-11,139,406.28	-11,139,406.28
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	69,912,284.06	69,912,284.06

##### 华润元大富时中国 A50 指数 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,459,694.91	7,459,694.91
本期申购	356,061.90	356,061.90
本期赎回（以“-”号填列）	-5,863,102.36	-5,863,102.36
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,952,654.45	1,952,654.45

注：申购包含基金转入及红利再投资的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

#### 6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

##### 华润元大富时中国 A50 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	127,479,005.03	-11,655,600.13	115,823,404.90
本期利润	-9,430,056.23	4,836,146.02	-4,593,910.21
本期基金份额交易产生的变动数	-4,151,086.21	658,225.56	-3,492,860.65
其中：基金申购款	15,352,951.79	-638,349.34	14,714,602.45
基金赎回款	-19,504,038.00	1,296,574.90	-18,207,463.10
本期已分配利润	-	-	-



本期末	113,897,862.59	-6,161,228.55	107,736,634.04
-----	----------------	---------------	----------------

华润元大富时中国 A50 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,018,696.58	-1,192,566.98	11,826,129.60
本期利润	-662,313.14	538,007.62	-124,305.52
本期基金份额交易产生的变动数	-9,217,312.34	484,195.35	-8,733,116.99
其中：基金申购款	606,668.44	-34,439.22	572,229.22
基金赎回款	-9,823,980.78	518,634.57	-9,305,346.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,139,071.10	-170,364.01	2,968,707.09

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	8,285.15
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,578.94
其他	88.19
合计	9,952.28

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,250,973.81
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-10,250,973.81

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	133,779,064.66

减：卖出股票成本总额	143,693,349.67
减：交易费用	336,688.80
买卖股票差价收入	-10,250,973.81

6.4.7.11.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	126,211.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-48,466.53
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	77,745.16

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	11,756,130.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,552,697.53
减：应计利息总额	251,899.28
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-48,466.53

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-906,916.52

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,996,066.17
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	1,996,066.17

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	5,350,033.64
股票投资	5,311,344.11

债券投资	38,689.53
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	24,120.00
权证投资	-
期货投资	24,120.00
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	5,374,153.64

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	24,157.86
基金转换费收入	68.89
合计	24,226.75

#### 6.4.7.19 信用减值损失

本基金本期无信用减值损失。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	107,451.97
汇款费	5,033.91
合计	204,225.73

#### 6.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### 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，本基金无需作说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内，存在控制关系或其他重大利害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
华润元大基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
华润深国投信托有限公司	基金管理人的股东
元大证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
华润金控投资有限公司	基金管理人的股东
深圳华润元大资产管理有限公司	基金管理人的子公司
珠海华润银行股份有限公司（“珠海华润银行”）	与基金管理人受同一实际控制的公司、基金销售机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人控股股东的联营公司

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

本基金本报告期及上年度可比区间通过关联方交易单元进行交易的情况如下：

##### 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

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
国信证券	2,090,000.00	1.24	-	-

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	625,215.19	775,879.48
其中：支付销售机构的客户维护费	256,250.43	308,653.67

注：(1)基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.6%的年费率计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.6%÷当年天数。

(2)根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	156,303.77	193,969.87

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15%的年费率计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华润元大富时中国 A50 指数 A	华润元大富时中国 A50 指数 C	合计
华润元大基金管理有限公司	-	22,159.44	22,159.44
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		

名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华润元大富时中国 A50 指数 A	华润元大富时中国 A50 指数 C	合计
华润元大基金管理有限公司	-	7,106.86	7,106.86
合计	-	7,106.86	7,106.86

注：销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。本基金 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 0.30% 年费率计提。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金于本期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

#### 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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	3,768,221.37	8,285.15	2,154,506.83	22,346.05

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行间同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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
国信证券股份有限公司	688307	中润光学	网下发行	2,455	58,625.40
国信证券股份有限公司	001260	坤泰股份	网下发行	484	6,906.68
国信证券股份有限公司	603073	彩蝶实业	网下发行	530	10520.5
国信证券股份有限公司	301203	国泰环保	网下发行	1,533	70717.29
国信证券股份有限公司	001360	南矿集团	网下发行	1,244	19132.72
国信证券股份有限公司	688562	航天软件	网下发行	4,526	57389.68
国信证券股份有限公司	301488	豪恩汽电	网下发行	1,645	65438.1
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 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
国信证券股份有限公司	001270	铖昌科技	新股网下发行	568	12,314.24

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2023 年 6 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**

金额单位：人民币元



6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

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
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	非公开发行流通受限	27.93	33.03	89	2,485.77	2,939.67	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	非公开发行流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	非公开发行流通受限	11.88	21.02	363	4,312.44	7,630.26	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	非公开发行流通受限	18.88	19.60	111	2,095.68	2,175.60	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	非公开发行流通受限	20.68	25.49	88	1,819.84	2,243.12	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	非公开发行流通受限	15.38	14.87	125	1,922.50	1,858.75	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	非公开发行流通受限	44.48	39.48	43	1,912.64	1,697.64	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	非公开发行流通受限	28.84	30.78	130	3,749.20	4,001.40	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	202	8,322.40	8,623.38	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	105	5,932.50	5,557.65	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	147	4,998.00	5,134.71	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1-6个月(含)	新股流通受限	25.82	25.82	1,460	37,697.20	37,697.20	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	163	4,208.66	4,208.66	-

301203	C 国泰环	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流 通受限	46.13	34.40	154	7,104.02	5,297.60	-
301210	金杨股 份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	57.88	49.17	131	7,582.28	6,441.27	-
301225	恒勃股 份	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股流 通受限	35.66	33.26	226	8,059.16	7,516.76	-
301232	飞沃科 技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股流 通受限	72.50	58.42	103	7,467.50	6,017.26	-
301246	宏源药 业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流 通受限	50.00	30.71	236	11,800.00	7,247.56	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流 通受限	30.85	23.63	419	12,926.15	9,900.97	-
301261	恒工精 密	2023 年 6 月 29 日	1-6 个 月 (含)	新股流 通受限	36.90	36.90	1,240	45,756.00	45,756.00	-
301262	海看股 份	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流 通受限	30.22	25.50	254	7,675.88	6,477.00	-
301281	科源制 药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流 通受限	31.48	25.10	174	5,478.32	4,367.40	-
301291	明阳电 气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	38.13	31.03	249	9,494.37	7,726.47	-
301292	海科新 源	2023 年 6 月 29 日	1-6 个 月 (含)	新股流 通受限	19.99	19.99	3,377	67,506.23	67,506.23	-
301295	美硕科 技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流 通受限	37.40	36.07	189	7,068.60	6,817.23	-
301301	川宁生 物	2022 年 12 月 20 日	1-6 个 月 (含)	新股流 通受限	5.00	8.96	1,653	8,265.00	14,810.88	-
301305	朗坤环 境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流 通受限	25.25	19.69	335	8,458.75	6,596.15	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14	6 个月	新股流 通受限	32.34	31.86	280	9,055.20	8,920.80	-

		日									
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流 通受限	32.29	51.12	161	5,198.69	8,230.32		-
301317	鑫磊股 份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股流 通受限	20.67	26.17	502	10,376.34	13,137.34		-
301322	绿通科 技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股流 通受限	87.41	53.24	102	8,915.48	5,430.48		-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流 通受限	39.06	39.36	134	5,234.04	5,274.24		-
301325	曼恩斯 特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流 通受限	76.80	107.95	114	8,755.20	12,306.30		-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流 通受限	14.81	13.73	466	6,901.46	6,398.18		-
301337	亚华电 子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流 通受限	32.60	30.37	166	5,411.60	5,041.42		-
301345	涛涛车 业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流 通受限	73.45	46.64	80	5,876.00	3,731.20		-
301355	南王科 技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流 通受限	17.55	16.75	348	6,107.40	5,829.00		-
301357	北方长 龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流 通受限	50.00	48.39	133	6,650.00	6,435.87		-
301358	湖南裕 能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流 通受限	23.77	42.89	260	6,180.20	11,151.40		-
301360	荣旗科 技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流 通受限	71.88	92.60	94	6,756.72	8,704.40		-
301373	凌玮科 技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流 通受限	33.73	31.85	194	6,543.62	6,178.90		-
301376	致欧科 技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流 通受限	24.66	22.51	228	5,622.48	5,132.28		-
301382	蜂助手	2023 年	6 个月	新股流	23.80	32.84	252	5,997.60	8,275.68		-

		5月9日		通受限							
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	227	6,807.73	5,400.33		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1-6个月(含)	新股流通受限	26.68	26.68	2,649	70,675.32	70,675.32		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.68	26.68	295	7,870.60	7,870.60		-
301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	53.27	40.20	136	7,244.72	5,467.20		-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	490	7,957.60	8,305.50		-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	302	7,489.60	13,242.70		-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	209	5,507.15	6,395.40		-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	288	5,757.12	4,867.20		-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1-6个月(含)	新股流通受限	57.66	57.66	1,358	78,302.28	78,302.28		-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1-6个月(含)	新股流通受限	39.78	39.78	1,480	58,874.40	58,874.40		-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	165	6,563.70	6,563.70		-
601061	C 中信金	2023年3月30日	6个月	非公开发行流通受限	6.58	7.58	673	4,428.34	5,101.34		-
601065	C 江盐	2023年3月31日	6个月	非公开发行流通受限	10.36	11.84	234	2,424.24	2,770.56		-
601133	C 柏诚	2023年3月31日	6个月	非公开发行流通受限	11.66	12.26	242	2,821.72	2,966.92		-

603125	C 常青	2023 年 3 月 30 日	6 个月	非公开 发行流 通受限	25.98	24.53	74	1,922.52	1,815.22	-
603135	C 中重	2023 年 3 月 29 日	6 个月	非公开 发行流 通受限	17.80	17.89	226	4,022.80	4,043.14	-
603137	C 恒尚	2023 年 4 月 10 日	6 个月	非公开 发行流 通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	C 万丰	2023 年 4 月 28 日	6 个月	非公开 发行流 通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	C 中船	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流 通受限	36.15	38.13	211	7,627.65	8,045.43	-
688249	C 晶合	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流 通受限	19.86	18.06	1,333	26,473.38	24,073.98	-
688334	C 西高 院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流 通受限	14.16	16.21	392	5,550.72	6,354.32	-
688361	C 飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流 通受限	23.60	64.67	220	5,192.00	14,227.40	-
688429	C 时创	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流 通受限	19.20	25.53	213	4,089.60	5,437.89	-
688433	C 华曙	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股流 通受限	26.66	31.50	203	5,411.98	6,394.50	-
688458	C 美芯 晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流 通受限	75.00	90.76	94	7,050.00	8,531.44	-
688469	C 中芯	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流 通受限	5.69	5.41	2,284	12,995.96	12,356.44	-
688472	C 阿特 斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流 通受限	11.10	17.04	793	8,802.30	13,512.72	-
688478	C 晶升	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流 通受限	32.52	42.37	253	8,227.56	10,719.61	-
688479	C 友车	2023 年 5 月 4	6 个月	新股流 通受限	33.99	29.49	150	5,098.50	4,423.50	-

		日									
688484	C 南芯	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流 通受限	39.99	36.71	211	8,437.89	7,745.81		-
688512	C 慧智 微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流 通受限	20.92	19.16	346	7,238.32	6,629.36		-
688531	C 日联	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股流 通受限	152.38	135.97	75	11,428.50	10,197.75		-
688535	C 华海	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流 通受限	35.00	51.23	140	4,900.00	7,172.20		-
688543	C 国科	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流 通受限	43.67	53.05	130	5,677.10	6,896.50		-
688552	C 南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流 通受限	21.17	23.50	304	6,435.68	7,144.00		-
688562	C 航天	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流 通受限	12.68	22.31	453	5,744.04	10,106.43		-
688581	C 安杰 思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流 通受限	125.80	118.03	57	7,170.60	6,727.71		-
688582	C 芯动	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	26.74	40.68	212	5,668.88	8,624.16		-
688593	C 新相 微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股流 通受限	11.18	14.59	522	5,835.96	7,615.98		-
688603	C 天承	2023 年 6 月 30 日	1-6 个 月 (含)	新股流 通受限	55.00	55.00	1,008	55,440.00	55,440.00		-
688620	C 安凯 微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流 通受限	10.68	12.34	533	5,692.44	6,577.22		-
688623	C 双元	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流 通受限	125.88	86.79	56	7,049.28	4,860.24		-
688629	C 华丰	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流 通受限	9.26	18.59	488	4,518.88	9,071.92		-
688631	C 莱斯	2023 年	6 个月	新股流	25.28	29.87	148	3,741.44	4,420.76		-

		6 月 19 日		通受限						
873576	天力复合	2023 年 6 月 29 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限	9.35	9.35	1,600	14,960.00	14,960.00	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 5,000,997.26 元，均于 2023 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金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由涉及金融工具产生的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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、监事会、董事会下设风险控制委员会，督察长、管理层下设风险管理委员会，合规管理部、风险管理部和各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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基

金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（上年度末：同）。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	9,449,472.33	-
合计	9,449,472.33	-

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

（2）未评级债券包括债券期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金与本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	9,724,150.36
合计	-	9,724,150.36

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

（2）未评级债券包括债券期限大于一年的国债、政策性金融债和央行票据。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。



### 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。

#### 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模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。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，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了

分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	3,768,221.37	-	-	-	-	3,768,221.37
结算备付金	8,583,561.38	-	-	-	-	8,583,561.38
存出保证金	7,923.25	-	-	-	-	7,923.25
交易性金融资产	-9,449,472.33	-	-	-	166,142,704.45	175,592,176.78
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	-	3,000,000.00
应收申购款	-	-	-	-	94,195.23	94,195.23
应收清算款	-	-	-	-	82,257.91	82,257.91
资产总计	15,359,706.00	9,449,472.33	-	-	166,319,157.59	191,128,335.92
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	271,042.28	271,042.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	93,067.82	93,067.82
应付托管费	-	-	-	-	23,266.97	23,266.97
应付清算款	-	-	-	-	2,595,525.08	2,595,525.08
卖出回购金融资产款	5,000,997.26	-	-	-	-	5,000,997.26
应付销售服务费	-	-	-	-	2,562.79	2,562.79
其他负债	-	-	-	-	505,104.52	505,104.52
负债总计	5,000,997.26	-	-	-	3,490,569.46	8,491,566.72
利率敏感度缺口	10,358,708.74	9,449,472.33	-	-	162,828,588.13	182,636,769.20
上年度末 2022 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	930,900.80	-	-	-	-	930,900.80
结算备付金	6,015,712.33	-	-	-	-	6,015,712.33
存出保证金	355,720.02	-	-	-	-	355,720.02
交易性金融资产	-9,724,150.36	-	-	-	189,882,233.54	199,606,383.90
买入返售金融资产	-	-	-	-	-295.06	-295.06
应收申购款	-	-	-	-	203,216.63	203,216.63
应收清算款	-	-	-	-	999,128.44	999,128.44
其他资产	-	-	-	-	40,962.41	40,962.41
资产总计	7,302,333.15	9,724,150.36	-	-	191,125,245.96	208,151,729.47
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	135,100.18	135,100.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	105,769.40	105,769.40
应付托管费	-	-	-	-	26,442.38	26,442.38
应付清算款	-	-	-	-	11.42	11.42
应付销售服务费	-	-	-	-	4,961.48	4,961.48

应交税费	-	-	-	-	0.31	0.31
其他负债	-	-	-	-	478,727.16	478,727.16
负债总计	-	-	-	-	751,012.33	751,012.33
利率敏感度缺口	7,302,333.15	9,724,150.36	-	-	-190,374,233.63	207,400,717.14

注：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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	市场利率减少 25 个基点	19,112.22	12,003.87
	市场利率增加 25 个基点	-19,035.30	-12,002.44

#### 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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金投资于基金合同和相关法律法规及监管机构允许范围内的投资品种，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，所面临的最大其他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其他价格风险，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。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	166,142,704.45	91.00	189,882,233.54	91.55

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	9,449,472.33	5.18	9,724,150.36	4.69
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	175,592,176.78	96.18	199,606,383.90	96.24

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“富时中国 A50 指数”以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	富时中国 A50 指数上升 5%	8,468,522.42	10,067,445.00
	富时中国 A50 指数下降 5%	-8,468,522.42	-10,067,445.00

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	165,125,559.90	189,116,782.17
第二层次	9,897,326.72	9,724,150.36

第三层次	569,290.16	765,451.37
合计	175,592,176.78	199,606,383.90

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于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

无。

## § 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	166,142,704.45	86.93
	其中：股票	166,142,704.45	86.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,449,472.33	4.94
	其中：债券	9,449,472.33	4.94
	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	3,000,000.00	1.57
	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	12,351,782.75	6.46
8	其他各项资产	184,376.39	0.10
9	合计	191,128,335.92	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	2,597,367.30	1.42
B	采矿业	11,593,700.00	6.35
C	制造业	86,190,637.46	47.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,912,297.65	3.24
E	建筑业	2,715,196.43	1.49
F	批发和零售业	26,169.38	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	4,172,393.00	2.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,370.51	0.03
J	金融业	46,623,343.51	25.54
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,431,660.00	1.33
M	科学研究和技术服务业	1,866,665.76	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	11,893.75	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,948,009.70	1.07
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	166,142,704.45	91.00

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	14,100	23,843,100.00	13.06
2	300750	宁德时代	46,240	10,579,249.60	5.79
3	600036	招商银行	232,212	7,607,265.12	4.17
4	000858	五粮液	43,684	7,145,391.88	3.91
5	000568	泸州老窖	29,200	6,119,444.00	3.35
6	600900	长江电力	266,403	5,876,850.18	3.22
7	601318	中国平安	121,905	5,656,392.00	3.10

8	002594	比亚迪	20,400	5,268,708.00	2.89
9	601658	邮储银行	1,016,600	4,971,174.00	2.72
10	601398	工商银行	867,101	4,179,426.82	2.29
11	300760	迈瑞医疗	13,600	4,077,280.00	2.23
12	601166	兴业银行	233,900	3,660,535.00	2.01
13	601138	工业富联	140,600	3,543,120.00	1.94
14	600276	恒瑞医药	71,785	3,438,501.50	1.88
15	600309	万华化学	35,300	3,100,752.00	1.70
16	600030	中信证券	137,362	2,717,020.36	1.49
17	601668	中国建筑	472,100	2,709,854.00	1.48
18	601899	紫金矿业	231,800	2,635,566.00	1.44
19	002475	立讯精密	80,222	2,603,203.90	1.43
20	002714	牧原股份	61,622	2,597,367.30	1.42
21	603288	海天味业	55,127	2,582,699.95	1.41
22	601328	交通银行	441,813	2,562,515.40	1.40
23	300059	东方财富	178,517	2,534,941.40	1.39
24	002352	顺丰控股	55,100	2,484,459.00	1.36
25	000001	平安银行	218,500	2,453,755.00	1.34
26	601088	中国神华	79,600	2,447,700.00	1.34
27	601012	隆基绿能	85,346	2,446,869.82	1.34
28	600028	中国石化	382,400	2,432,064.00	1.33
29	601888	中国中免	22,000	2,431,660.00	1.33
30	600000	浦发银行	330,443	2,392,407.32	1.31
31	002304	洋河股份	16,952	2,226,645.20	1.22
32	601857	中国石油	280,300	2,093,841.00	1.15
33	600887	伊利股份	72,000	2,039,040.00	1.12
34	601601	中国太保	77,100	2,003,058.00	1.10
35	601225	陕西煤业	109,100	1,984,529.00	1.09
36	601988	中国银行	504,699	1,973,373.09	1.08
37	300015	爱尔眼科	105,014	1,948,009.70	1.07
38	002142	宁波银行	74,300	1,879,790.00	1.03
39	603259	药明康德	28,840	1,797,020.40	0.98
40	600438	通威股份	50,700	1,739,517.00	0.95
41	601816	京沪高铁	320,900	1,687,934.00	0.92
42	600690	海尔智家	71,000	1,667,080.00	0.91
43	300999	金龙鱼	21,800	871,782.00	0.48
44	000651	格力电器	22,700	828,777.00	0.45
45	601633	长城汽车	31,000	780,270.00	0.43
46	601319	中国人保	120,000	700,800.00	0.38
47	601939	建设银行	108,000	676,080.00	0.37
48	601998	中信银行	109,500	654,810.00	0.36
49	688502	C 茂莱	995	191,040.00	0.10
50	688981	中芯国际	2,000	101,040.00	0.06

51	301291	明阳电气	2,488	80,717.87	0.04
52	301395	仁信新材	2,944	78,545.92	0.04
53	301486	致尚科技	1,358	78,302.28	0.04
54	688334	C 西高院	3,916	69,645.36	0.04
55	301292	海科新源	3,377	67,506.23	0.04
56	301488	豪恩汽电	1,645	65,438.10	0.04
57	688603	C 天承	1,008	55,440.00	0.03
58	688623	C 二元	552	50,427.76	0.03
59	301261	恒工精密	1,240	45,756.00	0.03
60	301202	朗威股份	1,623	41,905.86	0.02
61	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
62	688249	C 晶合	1,333	24,073.98	0.01
63	873576	天力复合	1,600	14,960.00	0.01
64	301301	川宁生物	1,653	14,810.88	0.01
65	688361	C 飞测	220	14,227.40	0.01
66	688472	C 阿特斯	793	13,512.72	0.01
67	301419	阿莱德	302	13,242.70	0.01
68	301317	鑫磊股份	502	13,137.34	0.01
69	688469	C 中芯	2,284	12,356.44	0.01
70	301325	曼恩斯特	114	12,306.30	0.01
71	301358	湖南裕能	260	11,151.40	0.01
72	688478	C 晶升	253	10,719.61	0.01
73	688531	C 日联	75	10,197.75	0.01
74	688562	C 航天	453	10,106.43	0.01
75	301260	格力博	419	9,900.97	0.01
76	688629	C 华丰	488	9,071.92	0.00
77	301307	美利信	280	8,920.80	0.00
78	301360	荣旗科技	94	8,704.40	0.00
79	688582	C 芯动	212	8,624.16	0.00
80	301141	中科磁业	202	8,623.38	0.00
81	688458	C 美芯晟	94	8,531.44	0.00
82	301408	华人健康	490	8,305.50	0.00
83	301382	蜂助手	252	8,275.68	0.00
84	301315	威士顿	161	8,230.32	0.00
85	688146	C 中船	211	8,045.43	0.00
86	688484	C 南芯	211	7,745.81	0.00
87	001287	中电港	363	7,630.26	0.00
88	688593	C 新相微	522	7,615.98	0.00
89	301225	恒勃股份	226	7,516.76	0.00
90	301246	宏源药业	236	7,247.56	0.00
91	688535	C 华海	140	7,172.20	0.00
92	688552	C 南湖	304	7,144.00	0.00
93	688543	C 国科	130	6,896.50	0.00



94	301295	美硕科技	189	6,817.23	0.00
95	688581	C 安杰思	57	6,727.71	0.00
96	688512	C 慧智微	346	6,629.36	0.00
97	301305	朗坤环境	335	6,596.15	0.00
98	688620	C 安凯微	533	6,577.22	0.00
99	301262	海看股份	254	6,477.00	0.00
100	301210	金杨股份	131	6,441.27	0.00
101	301357	北方长龙	133	6,435.87	0.00
102	301332	德尔玛	466	6,398.18	0.00
103	301428	世纪恒通	209	6,395.40	0.00
104	688433	C 华曙	203	6,394.50	0.00
105	301373	凌玮科技	194	6,178.90	0.00
106	301232	飞沃科技	103	6,017.26	0.00
107	301355	南王科技	348	5,829.00	0.00
108	301157	华塑科技	105	5,557.65	0.00
109	301397	溯联股份	136	5,467.20	0.00
110	688429	C 时创	213	5,437.89	0.00
111	301322	绿通科技	102	5,430.48	0.00
112	301386	未来电器	227	5,400.33	0.00
113	301203	C 国泰环	154	5,297.60	0.00
114	301323	新莱福	134	5,274.24	0.00
115	301170	锡南科技	147	5,134.71	0.00
116	301376	致欧科技	228	5,132.28	0.00
117	601061	C 中信金	673	5,101.34	0.00
118	301337	亚华电子	166	5,041.42	0.00
119	301439	泓淋电力	288	4,867.20	0.00
120	688479	C 友车	150	4,423.50	0.00
121	688631	C 莱斯	148	4,420.76	0.00
122	301281	科源制药	174	4,367.40	0.00
123	603135	C 中重	226	4,043.14	0.00
124	001380	华纬科技	130	4,001.40	0.00
125	301345	涛涛车业	80	3,731.20	0.00
126	601133	C 柏诚	242	2,966.92	0.00
127	001282	三联锻造	89	2,939.67	0.00
128	601065	C 江盐	234	2,770.56	0.00
129	603137	C 恒尚	139	2,375.51	0.00
130	001328	登康口腔	88	2,243.12	0.00
131	001324	长青科技	111	2,175.60	0.00
132	603172	C 万丰	122	1,967.86	0.00
133	001360	南矿集团	125	1,858.75	0.00
134	603125	C 常青	74	1,815.22	0.00
135	001367	海森药业	43	1,697.64	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	600036	招商银行	9,345,529.00	4.51
2	000568	泸州老窖	7,580,600.10	3.66
3	600519	贵州茅台	6,992,824.44	3.37
4	300015	爱尔眼科	5,579,488.00	2.69
5	601658	邮储银行	4,099,395.00	1.98
6	601318	中国平安	3,697,395.00	1.78
7	601138	工业富联	3,656,086.00	1.76
8	603288	海天味业	3,554,310.28	1.71
9	002594	比亚迪	3,117,738.00	1.50
10	000858	五粮液	3,072,846.00	1.48
11	601668	中国建筑	2,985,047.00	1.44
12	601899	紫金矿业	2,916,241.00	1.41
13	002714	牧原股份	2,877,478.00	1.39
14	600028	中国石化	2,619,622.00	1.26
15	601012	隆基绿能	2,566,134.00	1.24
16	002475	立讯精密	2,550,276.52	1.23
17	300760	迈瑞医疗	2,531,329.00	1.22
18	603259	药明康德	2,106,041.60	1.02
19	600276	恒瑞医药	2,057,754.00	0.99
20	600309	万华化学	1,963,527.00	0.95

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	9,956,033.00	4.80
2	000858	五粮液	9,406,815.00	4.54
3	002304	洋河股份	5,466,372.00	2.64
4	000568	泸州老窖	5,098,893.00	2.46
5	601398	工商银行	4,215,173.00	2.03
6	601318	中国平安	4,095,350.00	1.97
7	603288	海天味业	3,798,762.68	1.83
8	601138	工业富联	3,726,009.00	1.80
9	002594	比亚迪	3,652,412.00	1.76
10	600519	贵州茅台	3,470,387.00	1.67
11	601668	中国建筑	3,331,415.00	1.61
12	601899	紫金矿业	3,271,921.00	1.58

13	002714	牧原股份	2,985,791.00	1.44
14	300015	爱尔眼科	2,982,579.00	1.44
15	600028	中国石化	2,937,770.00	1.42
16	300760	迈瑞医疗	2,923,359.00	1.41
17	601012	隆基绿能	2,747,578.00	1.32
18	002475	立讯精密	2,738,887.00	1.32
19	300750	宁德时代	2,570,113.00	1.24
20	600276	恒瑞医药	2,378,492.00	1.15

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	114,642,476.47
卖出股票收入（成交）总额	133,779,064.66

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	9,449,472.33	5.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,449,472.33	5.18

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019703	23 国债 10	94,000	9,449,472.33	5.18

注：本基金本报告期末仅持有 1 只债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以套期保值为目的进行股指期货交易，利用股指期货提高交易效率，降低申购赎回和仓位频繁调整对投资组合的影响。

## 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

本基金本报告期末持仓国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持仓国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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

招商银行股份有限公司贷款“三查”不尽职导致贷款被挪用等七项违规行为，中国银行保险监督管理委员会对其作出处以罚款的监管措施。

因邮储银行股份有限公司管理不善导致金融许可证遗失等二十五项违规行为，中国银行保险监督管理委员会对其作出处以罚款的监管措施。

因工商银行股份有限公司信息安全和员工行为管理不到位等二十四项违规行为，中国银行保险监督管理委员会对其作出处以罚款的监管措施。

报告期内，本基金管理人严格遵循基金投资管理相关制度要求，上述证券发行主体的违法违规行行为暂不会造成重大负面影响，投资决策程序符合法律法规和公司制度的规定。

### 7.12.2 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

本报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,923.25
2	应收清算款	82,257.91

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	94,195.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	184,376.39

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
华润元大富时中国 A50 指数 A	8,259	8,464.98	482,122.00	0.69	69,430,162.06	99.31
华润元大富时中国 A50 指数 C	148	13,193.61	0.00	0.00	1,952,654.45	100.00
合计	8,407	8,548.23	482,122.00	0.67	71,382,816.51	99.33

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持	华润元大富时中国 A50 指数 A	5,760.19	0.0082
	华润元大富时中国 A50 指数 C	375.62	0.0192

有本基金			
	合计	6,135.81	0.0085

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	华润元大富时中国 A50 指数 A	0~10
	华润元大富时中国 A50 指数 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华润元大富时中国 A50 指数 A	0
	华润元大富时中国 A50 指数 C	0
	合计	0

注：1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

2、截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华润元大富时中国 A50 指数 A	华润元大富时中国 A50 指数 C
基金合同生效日（2014 年 11 月 20 日）基金份额总额	714,621,124.13	-
本报告期期初基金份额总额	72,291,487.73	7,459,694.91
本报告期基金总申购份额	8,760,202.61	356,061.90
减：本报告期基金总赎回份额	11,139,406.28	5,863,102.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	69,912,284.06	1,952,654.45

注：本基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人发生重大人事变动如下：2023 年 1 月 19 日，华润元大基金管理有限公司召开 2023 年第一次临时股东会，改选吴宏焯女士为华润元大基金管理有限公司董事，陈矛女士不再担任公司董事。上述变更已按照规定报相关监管机构备案，并进行公告。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计的会计师事务所。本报告期内未改聘为本基金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

管理人及其高级管理人员本报告期内未发生受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

			(%)		(%)	
国盛证券	1	130,196,734.43	54.05	95,213.00	52.42	-
山西证券	2	70,901,705.78	29.44	51,850.61	28.55	-
安信证券	2	27,431,142.01	11.39	25,546.34	14.06	-
粤开证券	3	10,474,652.51	4.35	7,660.17	4.22	-
中信证券	3	1,395,452.34	0.58	1,032.67	0.57	-
财通证券	1	463,847.53	0.19	339.21	0.19	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门



定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性  
及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在  
比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专  
用交易单元。本基金本报告期内租用了山西证券、东方财富、中邮证券的基金专用交易单元，退  
租了江海证券的基金专用交易单元。

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 (%)
国盛证券	22,821,779.00	100.00	62,550,000.00	37.09	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	88,000,000.00	52.18	-	-
粤开证券	-	-	13,000,000.00	7.71	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	3,000,000.00	1.78	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	2,090,000.00	1.24	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中山证 券	-	-	-	-	-	-
中邮证 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	关于华润元大基金管理有限公司董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 12 日
2	华润元大基金管理有限公司 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
3	华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
4	华润元大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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 8 日
5	华润元大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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 9 日
6	关于警惕冒用华润元大基金管理有限公司名义进行诈骗活动的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 24 日
7	华润元大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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 9 日
8	华润元大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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 28 日
9	华润元大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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 31 日
10	华润元大基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日	2023 年 3 月 31 日

		报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	
11	华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金 2022 年年度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 31 日
12	华润元大基金管理有限公司关于官方微信公众号交易平台上线公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 14 日
13	华润元大基金管理有限公司 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 21 日
14	华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 21 日
15	华润元大基金管理有限公司关于旗下产品参与公司网上直销平台费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 4 日
16	华润元大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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 13 日
17	华润元大基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 26 日
18	华润元大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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 22 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

无

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日