

富安达中证 500 指数增强型证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2025 年 03 月 28 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2024年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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的说明	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	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
8.3 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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	82
8.6 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	82
8.7 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	82
8.8 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	82
8.9 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	82
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	82

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	82
8.12 投资组合报告附注	82
§9 基金份额持有人信息	83
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	83
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
9.3 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	84
§10 开放式基金份额变动	85
§11 重大事件揭示	85
11.1 基金份额持有人大会决议	85
11.2 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	86
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	86
11.4 基金投资策略的改变	86
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	86
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	86
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	86
11.8 其他重大事件	91
§12 影响投资者决策的其他重要信息	95
12.1 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	95
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	95
§13 备查文件目录	95
13.1 备查文件目录	95
13.2 存放地点	96
13.3 查阅方式	96

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富安达中证500指数增强型证券投资基金	
基金简称	富安达中证500指数增强	
基金主代码	007943	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年11月19日	
基金管理人	富安达基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	41,397,774.23份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富安达中证500指数增强A	富安达中证500指数增强C
下属分级基金的交易代码	007943	019808
报告期末下属分级基金的份额总额	39,221,327.08份	2,176,447.15份

注：本基金自2023年10月20日起新增C类份额。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的的业绩水平
投资策略	本基金股票投资比例范围为基金资产的90%—95%。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。基金以量化评估因子为基础，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。 本基金以中证500指数为标的指数，通过量化组合管理方法，从优选个股、风险控制、成本控制等角度优化投资组合，力争在稳定跟踪标的指数外获取超额

	收益。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成分股及其备选成分股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富安达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李理想	方圆
	联系电话	021-61870999	95559
	电子邮箱	service@fadfunds.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-630-6999	95559
传真		021-61870888	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区世纪大道156 8号29楼	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道156 8号29楼	中国（上海）长宁区仙霞路1 8号
邮政编码		200122	200336
法定代表人		王胜	任德奇

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
注册登记机构	富安达基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2024年		2023年		2022年	
	富安达中证500指数增强A	富安达中证500指数增强C	富安达中证500指数增强A	富安达中证500指数增强C	富安达中证500指数增强A	富安达中证500指数增强C
本期已实现收益	3,100,296.66	-761,262.68	-797,721.67	-156.30	-2,642,911.05	-
本期利润	3,329,352.50	-626,335.19	-907,108.55	-100.20	-3,735,891.03	-
加权平均基金份额本期利润	0.1053	-0.0407	-0.0300	-0.0089	-0.2101	-
本期加权平均净值利润率	8.69%	-3.41%	-2.42%	-0.75%	-16.99%	-
本期基金份额净值增长率	10.55%	10.24%	-1.44%	0.45%	-15.25%	-
3.1.2 期末数据和指标	2024年末		2023年末		2022年末	
期末可供分配利润	11,656,658.56	480,285.16	5,222,565.84	3,832.51	4,809,491.70	-
期末可供分配基金份额利润	0.2972	0.2207	0.1734	0.1668	0.1905	-
期末基金资产净值	50,877,985.64	2,814,129.84	35,336,037.94	26,951.32	30,057,394.99	-
期末基金份额净值	1.2972	1.2930	1.1734	1.1729	1.1905	-

3.1.3 累计期末指标	2024年末		2023年末		2022年末	
基金份额累计净值增长率	29.72%	10.73%	17.34%	0.45%	19.05%	-

注：

- 1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
- 4、本基金自2023年10月20日起新增C类份额。

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

富安达中证500指数增强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
过去三个月	-2.27%	1.63%	-0.23%	1.93%	-2.04%	-0.30%
过去六个月	11.83%	1.62%	15.13%	1.91%	-3.30%	-0.29%
过去一年	10.55%	1.49%	5.40%	1.73%	5.15%	-0.24%
过去三年	-7.66%	1.18%	-20.91%	1.33%	13.25%	-0.15%
过去五年	28.86%	1.21%	8.93%	1.31%	19.93%	-0.10%
自基金合同生效起至今	29.72%	1.20%	16.86%	1.30%	12.86%	-0.10%

富安达中证500指数增强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
过去三个月	-2.33%	1.62%	-0.23%	1.93%	-2.10%	-0.31%

过去六个月	11.68%	1.62%	15.13%	1.91%	-3.45%	-0.29%
过去一年	10.24%	1.49%	5.40%	1.73%	4.84%	-0.24%
自基金合同生效起至今	10.73%	1.38%	4.77%	1.61%	5.96%	-0.23%

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

2. 本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

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

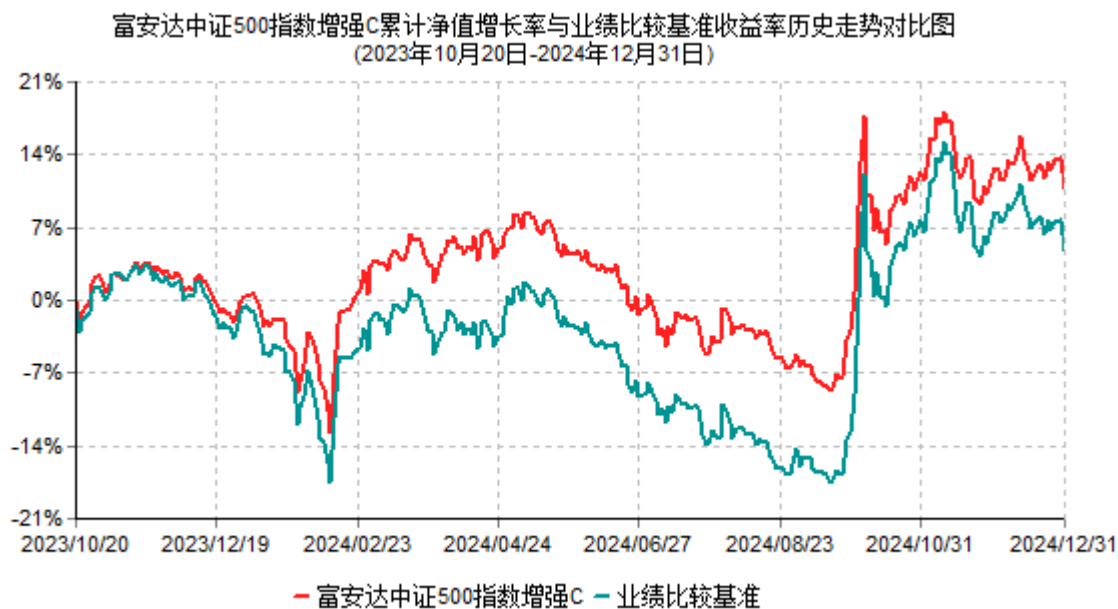
$\text{Benchmark } t = (1 + \text{Return } t) \times \text{Benchmark}(t-1)$

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

3. 本基金自2023年10月20日起新增C类份额。

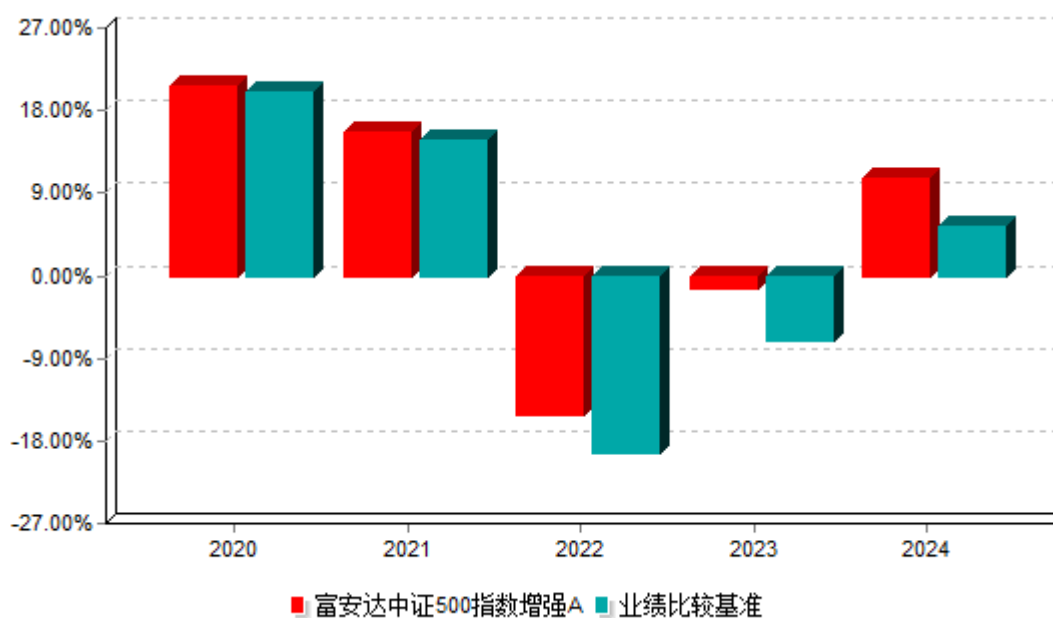
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

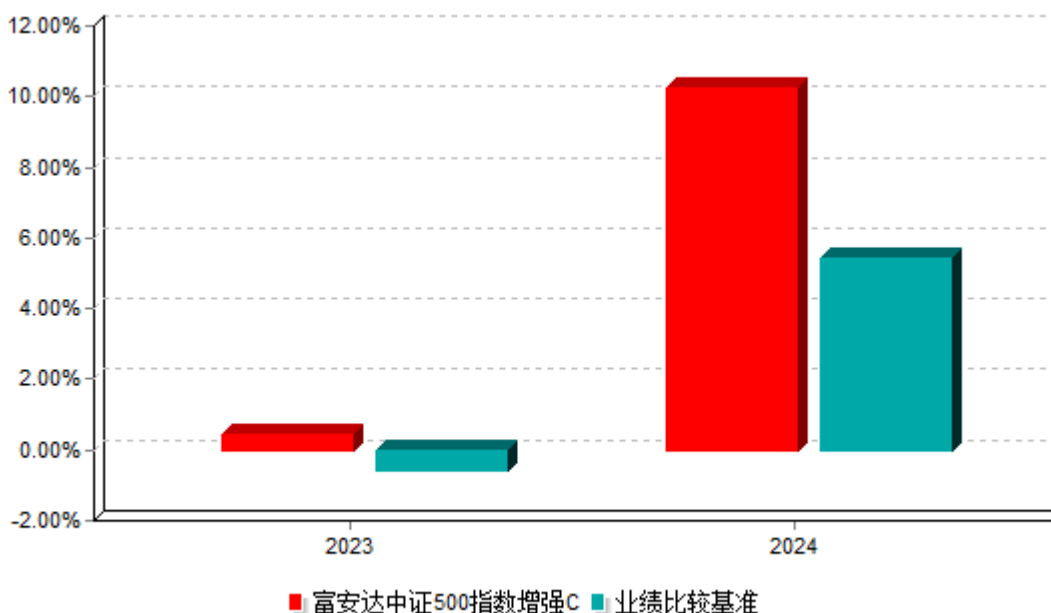




注：本基金自2023年10月20日起新增C类份额。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注:1.本基金合同于2019年11月19日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

2.本基金自2023年10月20日起新增C类份额,份额新增当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2024年12月31日,公司共管理二十八只开放式基金:富安达优势成长混合型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金、富安达增强收益债券型证

券投资基金、富安达现金货币市场证券投资基金、富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金、富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金、富安达消费主题灵活配置混合型证券投资基金、富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、富安达富利纯债债券型证券投资基金、富安达中证500指数增强型证券投资基金、富安达科技领航混合型证券投资基金、富安达科技创新混合型发起式证券投资基金、富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金、富安达医药创新混合型证券投资基金、富安达中小盘六个月持有期混合型发起式证券投资基金、富安达成长价值一年持有期混合型证券投资基金、富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金、富安达先进制造混合型发起式证券投资基金、富安达产业优选混合型证券投资基金、富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金、富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、富安达富祥利率债债券型证券投资基金、富安达富禧纯债30天持有期债券型证券投资基金、富安达睿选增利债券型证券投资基金、富安达上海清算所0-3年政策性金融债指数证券投资基金、富安达沪深300指数增强型证券投资基金。

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		
纪青	本基金的基金经理、指数与量化投资部副经理（主持工作）	2019-11-19	-	16年	硕士。历任中海基金投研中心金融工程分析师。2013年加入富安达基金管理有限公司。现任指数与量化投资部副经理（主持工作）、富安达中证500指数增强型证券投资基金、富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金、富安达中小盘六个月持有期混合型发起式证券投资基金、富安达沪深300指数增强型证券投资基金的基金经理。曾任富安达

					健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2022年7月至2022年11月兼任投资经理。
--	--	--	--	--	---

注：

- 1.任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，任职日期为基金合同生效日。
- 2.证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年，A股市场整体在国内外经济及环境较为复杂的背景下，也呈现出较大的波动率，从年初的雪球产品集中敲入触发市场快速下跌，之后市场整体风险偏好持续偏低，再到9月下旬中央政治局会议超预期召开等积极信号出现，一揽子意在改善资本市场信心及环境，以及提振经济的大力度政策，以组合拳的形式一举点燃A股市场的投资情绪，A股市场交易活跃度快速回升，甚至创出天量成交额。伴随市场风格快速切换，指数增强类产品整体获取超额收益的难度继续加大，波动也有所放大，不同风格的策略也在大幅波动的行情中表现出分化。本基金在高波动的市场环境下，继续坚持以量化模型实现指数增强目标，在严格的风险控制框架下，较好地避开小市值因子大幅波动及回撤的影响，同时抓住收益持续贡献度较大的因子，全年相对基准指数积累了较好的超额收益。但四季度初期的量化选股因子，在10月份增量资金交易踊跃、非机构资金驱动的市场行情下，出现了持续回撤的表现，叠加9月底的净申购资金对于本基金仓位的影响，对基金9月底到10月初的超额收益形成明显的扰动。未来我们需要对于极端行情下的异动影响做出更好的应对。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达中证500指数增强A基金份额净值为1.2972元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.55%，同期业绩比较基准收益率为5.40%；截至报告期末富安达中证500指数增强C基金份额净值为1.2930元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.24%，同期业绩比较基准收益率为5.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024年9月底以来政策的支持态度是毫无疑问的，因此虽然在国内经济保持稳定增长，但内生动能逐步恢复的宏观背景下，资本市场交易活跃度有极大的提升。一方面，管理层频吹暖风，表示将加大宏观政策逆周期调节，实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，支持民营企业和中小企业发展，推动经济稳定增长；另一方面，DEEPSEEK概念的崛起显著提升了市场情绪以及信心，尤其对于科技股和AI相关板块，且影响仍在持续蔓延。AI概念的持续发酵，推动着云计算、智慧医疗、网络安全、国产软硬件等相关“AI+产业”概念股走势上扬。与此同时，多家海外机构认为AI行业的发展，或将为我国科技股带来中长期价值重估的机会。展望2025年，我们仍需紧密关注货币政策和财政政策的调整预期，特别是在消费、投资和出口等领域的政策信号，其对经济预期的重要影响决定着A股市场底部夯实程度；而中国科技无疑将是未来中长期的重要主线，政策支持和市场需求的双重驱动将为相关行业带来持续的投资机会。AI产业

正在从事件驱动的主题投资走向业绩驱动的基本面投资，个股层面逐渐分化。未来自下而上选股需要更看重业绩支撑和基本面兑现的差异性。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人持续推进内控体系和机制建设，强化内部管理，不断提升自身合规风控能力。报告期内，公司进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程，强化内控基础建设；牵头开展了多形式的合规培训，强化员工职业道德教育和合规意识培育，从源头上防范合规风险；建立健全防控内幕交易机制，确保基金投资的独立性、公平性和合规性；加强业务日常合规审核和合规监测，并加大对重要业务和关键业务环节的监督检查，确保各项法规和管理制度有效落实，使业务在可稽可控的范围内有序开展。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，建立健全全面风险管理体系，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保护基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行收益分配。

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

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，富安达基金管理有限公司在富安达中证500指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第2500181号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	富安达中证500指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了后附的富安达中证500指数增强型证券投资基金(以下简称"该基金")财务报表,包括2024年12月31日的资产负债表、2024年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称"企业会计准则")及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金2024年12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称"审计准则")的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	该基金管理人富安达基金管理有限公司(以下简称"该基金管理人")管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金2024年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

	结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运

	用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控
--	--

	制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	虞京京	楚济铭
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层	
审计报告日期	2025-03-27	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富安达中证500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	3,607,837.83	2,319,336.10
结算备付金		219,003.66	205,636.65
存出保证金		27,289.88	7,779.72
交易性金融资产	7.4.7.2	50,222,953.57	33,128,891.52
其中：股票投资		50,222,953.57	33,128,891.52
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		28,488.66	1,438.74

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		54,105,573.60	35,663,082.73
负债和净资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		113,796.13	432.72
应付管理人报酬		33,921.94	22,561.39
应付托管费		6,784.42	4,512.28
应付销售服务费		799.94	5.05
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	258,155.69	272,582.03
负债合计		413,458.12	300,093.47
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	41,397,774.23	30,136,450.73
未分配利润	7.4.7.8	12,294,341.25	5,226,538.53
净资产合计		53,692,115.48	35,362,989.26
负债和净资产总计		54,105,573.60	35,663,082.73

注：报告截止日2024年12月31日，富安达中证500指数增强A份额净值1.2972元，基金份额总额39,221,327.08份，富安达中证500指数增强C份额净值1.2930元，基金份额总额2,176,447.15份，总份额合计41,397,774.23份。

7.2 利润表

会计主体：富安达中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2 023年12月31日
一、营业总收入		3,577,709.75	-292,469.94
1.利息收入		24,953.46	23,214.22
其中：存款利息收入	7.4.7.9	24,953.46	23,214.22
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		3,124,413.27	-337,295.69
其中：股票投资收益	7.4.7.10	1,837,898.71	-1,041,761.77
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,286,514.56	704,466.08
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.17	363,983.33	-109,330.78
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号 填列）	7.4.7.18	64,359.69	130,942.31

减：二、营业总支出		874,692.44	614,738.81
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	423,554.22	281,254.80
2.托管费	7.4.10.2.2	84,710.87	56,250.98
3.销售服务费	7.4.10.2.3	54,727.35	8.03
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	7.4.7.19	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	7.4.7.20	311,700.00	277,225.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,703,017.31	-907,208.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,703,017.31	-907,208.75
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,703,017.31	-907,208.75

7.3 净资产变动表

会计主体：富安达中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	30,136,450.73	5,226,538.53	35,362,989.26
二、本期期初净资产	30,136,450.73	5,226,538.53	35,362,989.26
三、本期增减变动	11,261,323.50	7,067,802.72	18,329,126.22

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	2,703,017.31	2,703,017.31
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	11,261,323.50	4,364,785.41	15,626,108.91
其中：1.基金申购款	78,679,217.88	17,551,509.90	96,230,727.78
2.基金赎回款	-67,417,894.38	-13,186,724.49	-80,604,618.87
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	41,397,774.23	12,294,341.25	53,692,115.48
项 目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	25,247,903.29	4,809,491.70	30,057,394.99
二、本期期初净资产	25,247,903.29	4,809,491.70	30,057,394.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,888,547.44	417,046.83	5,305,594.27
（一）、综合收益总额	-	-907,208.75	-907,208.75
（二）、本期基金份额交易产生的净	4,888,547.44	1,324,255.58	6,212,803.02

资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	21,344,575.54	5,659,221.59	27,003,797.13
2.基金赎回款	-16,456,028.10	-4,334,966.01	-20,790,994.11
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	30,136,450.73	5,226,538.53	35,362,989.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

王胜

孙爱民

王雪

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

根据《富安达基金管理有限公司关于富安达中证500指数增强型证券投资基金增设C类基金份额并修订基金合同和托管协议的公告》，本基金自2023年10月20日(含)起增加

C类基金份额，原份额变更为A类基金份额。本基金根据申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为C类基金份额。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股(包含主板、中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具(股指期货、国债期货等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金(不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率 $\times$ 95%+商业银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2024年12月31日的财务状况、2024年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金通常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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：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其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定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

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金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；

- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内（若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬，托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《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》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

b) 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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计

算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

d) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
活期存款	3,607,837.83	2,319,336.10
等于：本金	3,607,471.00	2,318,877.09
加：应计利息	366.83	459.01
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	3,607,837.83	2,319,336.10
----	--------------	--------------

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		50,690,082.25	-	50,222,953.57	-467,128.68
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		50,690,082.25	-	50,222,953.57	-467,128.68
项目		上年度末 2023年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		33,960,003.53	-	33,128,891.52	-831,112.01
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		33,960,003.53	-	33,128,891.52	-831,112.01

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产 / 负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	16.74	0.61
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	46,638.95	145,581.42
其中：交易所市场	46,638.95	145,581.42
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费用	31,500.00	27,000.00
应付信息披露费	130,000.00	50,000.00
其他	50,000.00	50,000.00
合计	258,155.69	272,582.03

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 富安达中证500指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (富安达中证500指数增强A)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日
-----------------------	-------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,113,472.10	30,113,472.10
本期申购	22,764,368.80	22,764,368.80
本期赎回（以“-”号填列）	-13,656,513.82	-13,656,513.82
本期末	39,221,327.08	39,221,327.08

7.4.7.7.2 富安达中证500指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (富安达中证500指数增强C)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,978.63	22,978.63
本期申购	55,914,849.08	55,914,849.08
本期赎回（以“-”号填列）	-53,761,380.56	-53,761,380.56
本期末	2,176,447.15	2,176,447.15

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 富安达中证500指数增强A

单位：人民币元

项目 (富安达中证500指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,848,867.45	-5,626,301.61	5,222,565.84
本期期初	10,848,867.45	-5,626,301.61	5,222,565.84
本期利润	3,100,296.66	229,055.84	3,329,352.50
本期基金份额交易产生的变动数	2,434,697.02	670,043.20	3,104,740.22
其中：基金申购款	6,735,823.24	-1,688,480.68	5,047,342.56
基金赎回款	-4,301,126.22	2,358,523.88	-1,942,602.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,383,861.13	-4,727,202.57	11,656,658.56

7.4.7.8.2 富安达中证500指数增强C

单位：人民币元

项目 (富安达中证500指数 增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,832.51	140.18	3,972.69
本期期初	3,832.51	140.18	3,972.69
本期利润	-761,262.68	134,927.49	-626,335.19
本期基金份额交易产 生的变动数	1,237,715.33	22,329.86	1,260,045.19
其中：基金申购款	9,278,334.11	3,225,833.23	12,504,167.34
基金赎回款	-8,040,618.78	-3,203,503.37	-11,244,122.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	480,285.16	157,397.53	637,682.69

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
活期存款利息收入	19,704.53	19,484.38
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	4,898.52	3,340.93
其他	350.41	388.91
合计	24,953.46	23,214.22

注：其他为存出保证金利息收入和应收申购款利息收入。

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
卖出股票成交总额	477,497,103.91	309,874,016.56
减：卖出股票成本总额	474,899,354.99	310,085,248.14
减：交易费用	759,850.21	830,530.19
买卖股票差价收入	1,837,898.71	-1,041,761.77

7.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股票投资证券出借差价收入。

7.4.7.11 基金投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.12 债券投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,286,514.56	704,466.08
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	1,286,514.56	704,466.08

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
1.交易性金融资产	363,983.33	-109,330.78
——股票投资	363,983.33	-109,330.78
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	363,983.33	-109,330.78

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
基金赎回费收入	62,578.83	130,920.36
基金转出费收入	1,780.86	21.95
其他	-	-
合计	64,359.69	130,942.31

7.4.7.19 信用减值损失

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
审计费用	31,500.00	27,000.00
信息披露费	80,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划手续费	200.00	225.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	311,700.00	277,225.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富安达资产管理（上海）有限公司("富安达资管")	基金管理人的全资子公司
南京证券股份有限公司("南京证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金销售机构
富安达基金管理有限公司("富安达基金")	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司("南京河西")	基金管理人的股东
江苏云杉资本管理有限公司("江苏云杉")	基金管理人的股东

注：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，下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
南京证券	-	-	176,595,954.80	28.05%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
南京证券	-	-	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
南京证券	164,464.72	31.17%	-	-

注：1、上述佣金按协议约定的佣金计算，佣金率参考市场价格经协议签订方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括本基金管理人从南京证券获得证券研究综合服务；

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	423,554.22	281,254.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	103,078.06	54,314.38
应支付基金管理人的净管理费	320,476.16	226,940.42

注：1、支付基金管理人富安达基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	84,710.87	56,250.98

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

7.4.10.2.3 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 2024年01月01日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达中证500指数增强A	富安达中证500指数增强C	合计
富安达基金	0.00	105.28	105.28
南京证券	0.00	3,160.13	3,160.13
合计	0.00	3,265.41	3,265.41
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达中证500指数增强A	富安达中证500指数增强C	合计
富安达基金	0.00	0.80	0.80
合计	0.00	0.80	0.80

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日C类资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.30% / 当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

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

7.4.10.4.2 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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

富安达中证500指数增强A

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年12月31日
报告期初持有的基金份额	3,381,196.43	3,381,196.43
报告期间申购/买入总份额	9,420,404.38	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	12,801,600.81	3,381,196.43
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	32.64%	11.23%

注：

1. 本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未发生运用固有资金投资富安达中证500指数增强C的情况。
2. 基金管理人投资本基金适用的费率按照招募说明书的规定执行，下同。
3. 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。

7.4.10.5.2 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

富安达中证500指数增强A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
富安达资管	6,412,550.05	16.35%	16,312,550.05	54.17%

注：

- 1、本期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未发生投资富安达中证500指数增强C的情况。
- 2、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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	3,607,837.83	19,704.53	2,319,336.10	19,484.38

注：本基金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2024年12月31日的相关余额为人民币219,003.66元。（2023年12月31日：人民币205,636.65元）

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金在本报告期内未进行过利润分配。（2023年：无）

7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于2024年12月31日，本基金未持有因认购新发或增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2024年12月31日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于2024年12月31日，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2024年12月31日，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于2024年12月31日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成分股及其备选成分股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的的业绩水平。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。

本基金的基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系，贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。本基金的基

金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金的基金管理人在公司层面建立的风险控制委员会以及在董事会层面建立的合规与风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金的基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

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

7.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2024年12月31日，本基金无债券投资(2023年12月31日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2024年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2024年12月31日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2024年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,607,837.83	-	-	-	3,607,837.83
结算备付金	219,003.66	-	-	-	219,003.66
存出保证金	27,289.88	-	-	-	27,289.88
交易性金融资产	-	-	-	50,222,953.57	50,222,953.57
应收申购款	-	-	-	28,488.66	28,488.66
资产总计	3,854,131.37	-	-	50,251,442.23	54,105,573.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	113,796.13	113,796.13
应付管	-	-	-	33,921.94	33,921.94

理人报酬					
应付托管费	-	-	-	6,784.42	6,784.42
应付销售服务费	-	-	-	799.94	799.94
其他负债	-	-	-	258,155.69	258,155.69
负债总计	-	-	-	413,458.12	413,458.12
利率敏感度缺口	3,854,131.37	-	-	49,837,984.11	53,692,115.48
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,319,336.10	-	-	-	2,319,336.10
结算备付金	205,636.65	-	-	-	205,636.65
存出保证金	7,779.72	-	-	-	7,779.72
交易性金融资产	-	-	-	33,128,891.52	33,128,891.52
应收申购款	-	-	-	1,438.74	1,438.74
资产总计	2,532,752.47	-	-	33,130,330.26	35,663,082.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	432.72	432.72
应付管	-	-	-	22,561.39	22,561.39

理人报酬					
应付托管费	-	-	-	4,512.28	4,512.28
应付销售服务费	-	-	-	5.05	5.05
其他负债	-	-	-	272,582.03	272,582.03
负债总计	-	-	-	300,093.47	300,093.47
利率敏感度缺口	2,532,752.47	-	-	32,830,236.79	35,362,989.26

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2024年12月31日，本基金未持有交易性金融资产-债券投资 (2023年12月31日：同) 。因此，市场利率的变动对本基金净资产无重大影响（2023年12月31日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用自上而下的富安达多维经济模型，通过对全球经济发展形势，国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，结合FED模型，对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势作出预测，并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	50,222,953.57	93.54	33,128,891.52	93.68
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	50,222,953.57	93.54	33,128,891.52	93.68

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证500指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
	1.中证500指数上升5%	2,480,511.68	1,377,499.31
	2.中证500指数下降5%	-2,480,511.68	-1,377,499.31

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

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	50,222,953.57	33,128,891.52
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	50,222,953.57	33,128,891.52

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期内及上年度可比期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	

期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	30,600.25	30,600.25
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	30,600.25	30,600.25
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层	-	-	-

次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益			
-----------------------------------	--	--	--

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2023年12月31日：无)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2024年12月31日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	50,222,953.57	92.82
	其中：股票	50,222,953.57	92.82
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	3,826,841.49	7.07
8	其他各项资产	55,778.54	0.10
9	合计	54,105,573.60	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,270,510.00	4.23
C	制造业	30,394,408.00	56.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,811,891.00	3.37
E	建筑业	448,149.00	0.83
F	批发和零售业	904,187.00	1.68
G	交通运输、仓储和邮政业	350,523.00	0.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,762,595.87	5.15
J	金融业	4,601,937.00	8.57
K	房地产业	438,059.90	0.82
L	租赁和商务服务业	306,104.00	0.57
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	670,552.00	1.25
S	综合	-	-
	合计	44,958,916.77	83.73

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,120,995.80	7.68
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	257,349.00	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	492,931.00	0.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	198,432.00	0.37
L	租赁和商务服务业	194,329.00	0.36
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,264,036.80	9.80

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通投资股票投资组合。

8.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002625	光启技术	17,600	841,280.00	1.57
2	600418	江淮汽车	18,900	708,750.00	1.32
3	000988	华工科技	13,800	597,540.00	1.11
4	002384	东山精密	18,700	546,040.00	1.02
5	300207	欣旺达	22,400	499,744.00	0.93
6	603893	瑞芯微	4,500	495,270.00	0.92
7	601555	东吴证券	63,300	493,740.00	0.92
8	002281	光迅科技	9,400	490,398.00	0.91
9	000423	东阿阿胶	7,800	489,216.00	0.91
10	002273	水晶光电	21,700	482,174.00	0.90
11	600096	云天化	21,100	470,530.00	0.88
12	688777	中控技术	9,361	464,960.87	0.87
13	002138	顺络电子	14,700	462,756.00	0.86
14	301165	锐捷网络	6,300	454,860.00	0.85
15	600352	浙江龙盛	43,700	449,673.00	0.84
16	300866	安克创新	4,600	449,144.00	0.84
17	600079	人福医药	18,600	434,868.00	0.81
18	002472	双环传动	14,100	431,742.00	0.80
19	600177	雅戈尔	48,400	430,760.00	0.80
20	002223	鱼跃医疗	11,700	426,933.00	0.80
21	000400	许继电气	15,400	423,962.00	0.79
22	300699	光威复材	12,200	422,730.00	0.79
23	000066	中国长城	29,000	422,530.00	0.79

24	002595	豪迈科技	8,300	416,577.00	0.78
25	601997	贵阳银行	68,400	410,400.00	0.76
26	600298	安琪酵母	11,300	407,365.00	0.76
27	300136	信维通信	15,800	401,952.00	0.75
28	600143	金发科技	46,300	400,032.00	0.75
29	002128	电投能源	20,400	399,432.00	0.74
30	688122	西部超导	9,250	396,085.00	0.74
31	601696	中银证券	35,300	393,948.00	0.73
32	000878	云南铜业	32,100	391,299.00	0.73
33	601198	东兴证券	35,500	390,855.00	0.73
34	002850	科达利	4,000	390,720.00	0.73
35	002532	天山铝业	49,600	390,352.00	0.73
36	600497	驰宏锌锗	69,800	388,786.00	0.72
37	002821	凯莱英	5,100	388,059.00	0.72
38	002558	巨人网络	30,500	387,045.00	0.72
39	000733	振华科技	9,100	383,747.00	0.71
40	300919	中伟股份	10,600	382,872.00	0.71
41	600282	南钢股份	80,600	378,014.00	0.70
42	600369	西南证券	80,800	377,336.00	0.70
43	300496	中科创达	6,300	375,228.00	0.70
44	000034	神州数码	10,600	371,530.00	0.69
45	000738	航发控制	16,600	369,184.00	0.69
46	601717	郑煤机	28,100	364,738.00	0.68
47	601456	国联证券	26,900	363,688.00	0.68
48	600737	中粮糖业	35,400	361,434.00	0.67
49	600566	济川药业	12,300	357,684.00	0.67
50	002958	青农商行	117,000	355,680.00	0.66
51	300474	景嘉微	3,800	355,262.00	0.66
52	600008	首创环保	108,300	355,224.00	0.66
53	600380	健康元	31,500	355,005.00	0.66
54	000921	海信家电	12,200	352,580.00	0.66

55	688002	睿创微纳	7,500	352,575.00	0.66
56	600021	上海电力	38,400	352,128.00	0.66
57	300529	健帆生物	12,000	352,080.00	0.66
58	000050	深天马 A	38,900	351,267.00	0.65
59	601866	中远海发	134,300	350,523.00	0.65
60	000039	中集集团	45,100	350,427.00	0.65
61	000887	中鼎股份	26,700	350,304.00	0.65
62	300001	特锐德	15,900	349,005.00	0.65
63	603087	甘李药业	7,900	348,390.00	0.65
64	600141	兴发集团	16,000	347,200.00	0.65
65	600348	华阳股份	48,900	346,701.00	0.65
66	000623	吉林敖东	20,000	345,400.00	0.64
67	000997	新大陆	17,300	345,135.00	0.64
68	600879	航天电子	38,400	344,064.00	0.64
69	301308	江波龙	4,000	344,000.00	0.64
70	300373	扬杰科技	7,900	343,808.00	0.64
71	000683	远兴能源	61,500	343,785.00	0.64
72	600170	上海建工	129,500	343,175.00	0.64
73	002653	海思科	10,300	342,475.00	0.64
74	002926	华西证券	41,200	342,372.00	0.64
75	000060	中金岭南	73,000	342,370.00	0.64
76	002500	山西证券	54,500	342,260.00	0.64
77	002409	雅克科技	5,900	341,905.00	0.64
78	600549	厦门钨业	17,700	341,079.00	0.64
79	002683	广东宏大	12,800	338,944.00	0.63
80	600739	辽宁成大	32,300	334,305.00	0.62
81	600132	重庆啤酒	5,300	334,006.00	0.62
82	603486	科沃斯	7,100	333,700.00	0.62
83	603179	新泉股份	7,800	333,060.00	0.62
84	300601	康泰生物	19,400	332,710.00	0.62
85	601155	新城控股	27,700	331,292.00	0.62

86	600968	海油发展	77,300	330,071.00	0.61
87	600637	东方明珠	42,400	329,024.00	0.61
88	300144	宋城演艺	35,200	327,008.00	0.61
89	300751	迈为股份	3,100	325,965.00	0.61
90	300763	锦浪科技	5,300	323,671.00	0.60
91	300212	易华录	13,800	322,920.00	0.60
92	002080	中材科技	24,100	315,228.00	0.59
93	600295	鄂尔多斯	31,600	308,416.00	0.57
94	600755	厦门国贸	46,100	306,104.00	0.57
95	600688	上海石化	100,900	304,718.00	0.57
96	002608	江苏国信	39,700	304,499.00	0.57
97	000937	冀中能源	47,900	302,728.00	0.56
98	600995	南网储能	29,900	302,588.00	0.56
99	600098	广州发展	47,000	301,740.00	0.56
100	600517	国网英大	54,600	300,846.00	0.56
101	603707	健友股份	22,300	295,921.00	0.55
102	600329	达仁堂	9,600	295,680.00	0.55
103	000709	河钢股份	133,400	294,814.00	0.55
104	002572	索菲亚	17,100	293,778.00	0.55
105	601568	北元集团	69,600	292,320.00	0.54
106	600927	永安期货	22,000	290,180.00	0.54
107	300957	贝泰妮	6,200	264,678.00	0.49
108	600959	江苏有线	78,900	264,315.00	0.49
109	601168	西部矿业	15,800	253,906.00	0.47
110	600928	西安银行	69,300	250,173.00	0.47
111	000987	越秀资本	34,700	243,594.00	0.45
112	601567	三星医疗	7,900	243,004.00	0.45
113	301498	乖宝宠物	3,000	234,960.00	0.44
114	300633	开立医疗	7,700	226,303.00	0.42
115	300735	光弘科技	8,000	223,920.00	0.42
116	688676	金盘科技	4,900	202,958.00	0.38

117	601666	平煤股份	20,000	200,400.00	0.37
118	300251	光线传媒	21,200	200,128.00	0.37
119	600704	物产中大	39,200	198,352.00	0.37
120	600578	京能电力	55,600	195,712.00	0.36
121	600500	中化国际	47,800	192,156.00	0.36
122	300002	神州泰岳	16,300	188,917.00	0.35
123	600839	四川长虹	19,500	188,175.00	0.35
124	601921	浙版传媒	18,200	143,416.00	0.27
125	600007	中国国贸	4,365	106,767.90	0.20
126	600820	隧道股份	14,600	104,974.00	0.20
127	600871	石化油服	48,200	98,328.00	0.18
128	601106	中国一重	32,700	95,157.00	0.18
129	000401	冀东水泥	17,500	91,525.00	0.17
130	300339	润和软件	1,700	85,051.00	0.16
131	603160	汇顶科技	600	48,324.00	0.09
132	002423	中粮资本	3,500	46,865.00	0.09
133	002557	洽洽食品	1,600	46,480.00	0.09

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	2,100	314,559.00	0.59
2	000977	浪潮信息	5,700	295,716.00	0.55
3	000938	紫光股份	10,500	292,215.00	0.54
4	002371	北方华创	700	273,700.00	0.51
5	600887	伊利股份	8,900	268,602.00	0.50
6	300750	宁德时代	1,000	266,000.00	0.50
7	688063	派能科技	6,496	260,164.80	0.48
8	600436	片仔癀	1,200	257,400.00	0.48

9	300274	阳光电源	3,400	251,022.00	0.47
10	600017	日照港	77,800	248,960.00	0.46
11	301379	天山电子	12,300	248,460.00	0.46
12	688012	中微公司	1,300	245,908.00	0.46
13	601008	连云港	63,700	243,971.00	0.45
14	002228	合兴包装	77,600	232,800.00	0.43
15	002909	集泰股份	44,700	222,159.00	0.41
16	000632	三木集团	55,100	202,217.00	0.38
17	600533	栖霞建设	84,800	198,432.00	0.37
18	601888	中国中免	2,900	194,329.00	0.36
19	603987	康德莱	25,900	185,962.00	0.35
20	002249	大洋电机	27,200	159,664.00	0.30
21	002860	星帅尔	14,400	141,264.00	0.26
22	600391	航发科技	5,600	111,160.00	0.21
23	600784	鲁银投资	16,000	94,240.00	0.18
24	000905	厦门港务	7,700	55,132.00	0.10

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600885	宏发股份	3,693,641.00	10.44
2	600141	兴发集团	3,384,386.76	9.57
3	002273	水晶光电	3,354,258.00	9.49
4	600079	人福医药	2,956,776.00	8.36
5	000933	神火股份	2,834,424.00	8.02
6	002128	电投能源	2,796,813.00	7.91
7	601997	贵阳银行	2,794,317.00	7.90
8	600549	厦门钨业	2,778,030.00	7.86

9	000997	新大陆	2,755,919.00	7.79
10	600096	云天化	2,754,889.00	7.79
11	600566	济川药业	2,626,444.00	7.43
12	600066	宇通客车	2,624,878.00	7.42
13	000709	河钢股份	2,538,654.00	7.18
14	600482	中国动力	2,527,415.00	7.15
15	000050	深天马 A	2,520,816.00	7.13
16	601958	金钼股份	2,519,112.00	7.12
17	000887	中鼎股份	2,500,278.00	7.07
18	603160	汇顶科技	2,491,895.00	7.05
19	002138	顺络电子	2,487,339.00	7.03
20	002558	巨人网络	2,456,677.00	6.95
21	600177	雅戈尔	2,431,021.00	6.87
22	600598	北大荒	2,413,211.00	6.82
23	002223	鱼跃医疗	2,377,758.00	6.72
24	000060	中金岭南	2,365,085.00	6.69
25	600928	西安银行	2,351,417.90	6.65
26	002500	山西证券	2,343,862.00	6.63
27	600352	浙江龙盛	2,318,418.00	6.56
28	601666	平煤股份	2,314,545.00	6.55
29	600582	天地科技	2,307,220.00	6.52
30	600170	上海建工	2,306,248.00	6.52
31	300383	光环新网	2,300,584.00	6.51
32	000623	吉林敖东	2,257,350.00	6.38
33	000738	航发控制	2,230,195.00	6.31
34	002444	巨星科技	2,181,046.00	6.17
35	600873	梅花生物	2,171,414.00	6.14
36	002409	雅克科技	2,170,064.00	6.14
37	600535	天士力	2,163,441.00	6.12
38	600737	中粮糖业	2,142,521.00	6.06
39	600985	淮北矿业	2,124,480.00	6.01

40	688169	石头科技	2,120,502.66	6.00
41	002028	思源电气	2,113,694.00	5.98
42	000027	深圳能源	2,068,918.00	5.85
43	600879	航天电子	2,063,107.00	5.83
44	002595	豪迈科技	2,043,227.00	5.78
45	300296	利亚德	2,020,890.00	5.71
46	000651	格力电器	2,004,897.00	5.67
47	300394	天孚通信	1,998,448.00	5.65
48	600707	彩虹股份	1,980,708.00	5.60
49	002532	天山铝业	1,968,230.00	5.57
50	600008	首创环保	1,955,870.00	5.53
51	002958	青农商行	1,946,698.00	5.50
52	601233	桐昆股份	1,940,648.00	5.49
53	000683	远兴能源	1,939,463.00	5.48
54	603893	瑞芯微	1,930,224.00	5.46
55	600637	东方明珠	1,913,972.00	5.41
56	000400	许继电气	1,864,747.00	5.27
57	000039	中集集团	1,828,801.00	5.17
58	002422	科伦药业	1,825,299.00	5.16
59	601555	东吴证券	1,818,106.00	5.14
60	000728	国元证券	1,808,817.00	5.12
61	600282	南钢股份	1,805,229.00	5.10
62	000921	海信家电	1,800,472.00	5.09
63	002465	海格通信	1,770,306.58	5.01
64	002152	广电运通	1,765,862.00	4.99
65	002600	领益智造	1,760,705.00	4.98
66	000423	东阿阿胶	1,757,318.00	4.97
67	600909	华安证券	1,754,462.00	4.96
68	601158	重庆水务	1,743,981.00	4.93
69	002463	沪电股份	1,736,559.70	4.91
70	600578	京能电力	1,732,236.00	4.90

71	002449	国星光电	1,725,557.00	4.88
72	600871	石化油服	1,714,542.00	4.85
73	300144	宋城演艺	1,712,807.00	4.84
74	600867	通化东宝	1,712,464.00	4.84
75	600332	白云山	1,700,239.00	4.81
76	002056	横店东磁	1,691,484.00	4.78
77	002064	华峰化学	1,689,707.00	4.78
78	000598	兴蓉环境	1,685,369.00	4.77
79	000830	鲁西化工	1,670,337.00	4.72
80	600967	内蒙一机	1,670,313.00	4.72
81	600998	九州通	1,635,399.00	4.62
82	000937	冀中能源	1,628,354.00	4.60
83	603077	和邦生物	1,626,436.00	4.60
84	688213	思特威	1,604,233.82	4.54
85	000878	云南铜业	1,597,929.00	4.52
86	601077	渝农商行	1,596,116.00	4.51
87	002384	东山精密	1,593,124.00	4.51
88	688122	西部超导	1,587,124.88	4.49
89	603228	景旺电子	1,579,080.00	4.47
90	601216	君正集团	1,574,548.00	4.45
91	600755	厦门国贸	1,570,169.00	4.44
92	002797	第一创业	1,566,093.00	4.43
93	600517	国网英大	1,563,258.00	4.42
94	600863	内蒙华电	1,561,743.00	4.42
95	600887	伊利股份	1,558,533.00	4.41
96	601058	赛轮轮胎	1,556,163.00	4.40
97	600528	中铁工业	1,549,998.00	4.38
98	000725	京东方 A	1,549,149.00	4.38
99	000513	丽珠集团	1,545,433.00	4.37
100	600959	江苏有线	1,542,252.00	4.36
101	601717	郑煤机	1,540,706.00	4.36

102	002472	双环传动	1,528,744.00	4.32
103	605208	永茂泰	1,526,867.00	4.32
104	603858	步长制药	1,524,861.00	4.31
105	300003	乐普医疗	1,523,350.00	4.31
106	601989	中国重工	1,512,976.00	4.28
107	601198	东兴证券	1,501,801.00	4.25
108	600398	海澜之家	1,475,940.00	4.17
109	601568	北元集团	1,460,892.00	4.13
110	601000	唐山港	1,456,799.00	4.12
111	600663	陆家嘴	1,446,431.00	4.09
112	300207	欣旺达	1,433,424.00	4.05
113	002294	信立泰	1,426,468.00	4.03
114	601168	西部矿业	1,405,484.00	3.97
115	000750	国海证券	1,403,902.00	3.97
116	600098	广州发展	1,402,924.00	3.97
117	600500	中化国际	1,400,813.00	3.96
118	600161	天坛生物	1,389,905.00	3.93
119	002340	格林美	1,382,180.00	3.91
120	000778	新兴铸管	1,366,399.00	3.86
121	601880	辽港股份	1,361,973.00	3.85
122	002010	传化智联	1,349,803.00	3.82
123	000975	山金国际	1,344,425.00	3.80
124	300002	神州泰岳	1,342,607.00	3.80
125	000960	锡业股份	1,335,964.00	3.78
126	000066	中国长城	1,333,973.00	3.77
127	300009	安科生物	1,327,834.00	3.75
128	601615	明阳智能	1,318,904.00	3.73
129	600380	健康元	1,301,456.00	3.68
130	300253	卫宁健康	1,295,776.00	3.66
131	002517	恺英网络	1,281,776.00	3.62
132	300502	新易盛	1,280,314.00	3.62

133	601636	旗滨集团	1,266,240.00	3.58
134	002373	千方科技	1,266,079.00	3.58
135	600968	海油发展	1,264,582.00	3.58
136	600271	航天信息	1,250,687.00	3.54
137	600848	上海临港	1,245,424.00	3.52
138	600655	豫园股份	1,240,716.00	3.51
139	002065	东华软件	1,240,497.00	3.51
140	600390	五矿资本	1,240,452.00	3.51
141	600673	东阳光	1,215,714.00	3.44
142	000559	万向钱潮	1,212,461.00	3.43
143	601992	金隅集团	1,196,710.00	3.38
144	600143	金发科技	1,195,803.00	3.38
145	600820	隧道股份	1,195,608.00	3.38
146	002078	太阳纸业	1,186,991.00	3.36
147	000156	华数传媒	1,174,827.00	3.32
148	002195	岩山科技	1,174,064.00	3.32
149	002945	华林证券	1,164,650.00	3.29
150	002266	浙富控股	1,162,863.00	3.29
151	603826	坤彩科技	1,158,570.00	3.28
152	002608	江苏国信	1,153,975.00	3.26
153	601016	节能风电	1,145,684.00	3.24
154	603658	安图生物	1,129,685.00	3.19
155	300146	汤臣倍健	1,117,188.00	3.16
156	002032	苏泊尔	1,086,423.00	3.07
157	002185	华天科技	1,081,352.00	3.06
158	601399	国机重装	1,068,796.00	3.02
159	600276	恒瑞医药	1,057,998.00	2.99
160	000563	陕国投 A	1,041,775.00	2.95
161	002008	大族激光	1,041,217.00	2.94
162	688538	和辉光电	1,040,077.00	2.94
163	000703	恒逸石化	1,037,601.00	2.93

164	000988	华工科技	1,030,822.00	2.91
165	002533	金杯电工	1,028,350.00	2.91
166	002557	洽洽食品	1,027,181.00	2.90
167	600479	千金药业	1,017,927.00	2.88
168	603589	口子窖	1,017,591.00	2.88
169	600583	海油工程	1,016,739.00	2.88
170	301165	锐捷网络	1,012,962.00	2.86
171	600977	中国电影	1,007,450.00	2.85
172	601611	中国核建	1,002,889.00	2.84
173	601727	上海电气	1,002,501.00	2.83
174	600704	物产中大	989,124.00	2.80
175	002025	航天电器	983,520.00	2.78
176	688728	格科微	977,072.90	2.76
177	601228	广州港	972,752.00	2.75
178	600536	中国软件	969,090.00	2.74
179	000100	TCL科技	968,820.00	2.74
180	601728	中国电信	965,046.00	2.73
181	000785	居然智家	964,983.00	2.73
182	300724	捷佳伟创	960,079.00	2.71
183	688234	天岳先进	958,339.66	2.71
184	603568	伟明环保	955,757.00	2.70
185	600309	万华化学	951,031.00	2.69
186	600418	江淮汽车	950,291.00	2.69
187	601888	中国中免	946,894.00	2.68
188	603786	科博达	944,940.00	2.67
189	600104	上汽集团	944,232.00	2.67
190	600050	中国联通	940,658.00	2.66
191	600062	华润双鹤	934,706.00	2.64
192	000650	仁和药业	928,379.00	2.63
193	002508	老板电器	926,869.00	2.62
194	600126	杭钢股份	925,672.00	2.62

195	002984	森麒麟	921,562.00	2.61
196	600369	西南证券	919,721.00	2.60
197	600298	安琪酵母	912,442.00	2.58
198	688188	柏楚电子	899,710.45	2.54
199	688050	爱博医疗	896,397.67	2.53
200	000932	华菱钢铁	885,534.00	2.50
201	002925	盈趣科技	878,021.00	2.48
202	600120	浙江东方	876,853.00	2.48
203	688099	晶晨股份	870,452.00	2.46
204	600699	均胜电子	863,058.00	2.44
205	600038	中直股份	858,882.00	2.43
206	688425	铁建重工	857,641.42	2.43
207	002439	启明星辰	853,669.00	2.41
208	600739	辽宁成大	852,094.00	2.41
209	600497	驰宏锌锗	849,669.00	2.40
210	600763	通策医疗	847,228.00	2.40
211	601128	常熟银行	846,891.00	2.39
212	002202	金风科技	844,929.00	2.39
213	300114	中航电测	843,167.00	2.38
214	000739	普洛药业	841,891.00	2.38
215	601608	中信重工	839,756.00	2.37
216	601928	凤凰传媒	838,810.00	2.37
217	000967	盈峰环境	838,536.00	2.37
218	688659	元琛科技	830,736.06	2.35
219	002347	泰尔股份	830,612.00	2.35
220	300054	鼎龙股份	828,497.00	2.34
221	600765	中航重机	826,882.00	2.34
222	002826	易明医药	826,400.00	2.34
223	300543	朗科智能	826,157.00	2.34
224	002001	新 和 成	825,374.00	2.33
225	301057	汇隆新材	821,547.00	2.32

226	601567	三星医疗	816,487.00	2.31
227	600007	中国国贸	815,563.75	2.31
228	600776	东方通信	812,938.00	2.30
229	002966	苏州银行	812,838.00	2.30
230	300245	天玑科技	812,790.00	2.30
231	601988	中国银行	812,688.00	2.30
232	300088	长信科技	807,395.00	2.28
233	002027	分众传媒	799,133.00	2.26
234	002601	龙佰集团	791,637.00	2.24
235	601139	深圳燃气	789,244.00	2.23
236	601106	中国一重	785,562.00	2.22
237	688208	道通科技	783,300.19	2.22
238	000429	粤高速 A	783,222.00	2.21
239	600499	科达制造	780,492.00	2.21
240	000930	中粮科技	780,234.00	2.21
241	600764	中国海防	779,071.00	2.20
242	603156	养元饮品	776,276.00	2.20
243	688777	中控技术	775,800.69	2.19
244	000032	深桑达 A	773,722.00	2.19
245	601098	中南传媒	757,347.00	2.14
246	000551	创元科技	745,851.00	2.11
247	603558	健盛集团	740,619.00	2.09
248	600597	光明乳业	739,183.00	2.09
249	600258	首旅酒店	739,122.00	2.09
250	000987	越秀资本	738,499.00	2.09
251	300308	中际旭创	737,208.00	2.08
252	688307	中润光学	735,805.16	2.08
253	603318	水发燃气	732,704.00	2.07
254	002625	光启技术	731,332.00	2.07
255	600809	山西汾酒	728,167.00	2.06
256	000800	一汽解放	727,296.00	2.06

257	601668	中国建筑	720,953.00	2.04
258	300748	金力永磁	720,443.00	2.04
259	600125	铁龙物流	716,834.00	2.03
260	000823	超声电子	716,625.00	2.03
261	601518	吉林高速	715,722.00	2.02
262	002936	郑州银行	710,561.00	2.01
263	002345	潮宏基	709,307.00	2.01
264	600519	贵州茅台	708,972.00	2.00
265	601126	四方股份	708,640.00	2.00
266	603507	振江股份	707,764.00	2.00
267	300428	立中集团	707,712.00	2.00
268	600692	亚通股份	707,594.00	2.00

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

8.4.2 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	600885	宏发股份	3,854,957.00	10.90
2	002273	水晶光电	3,173,339.00	8.97
3	600549	厦门钨业	2,877,406.00	8.14
4	600141	兴发集团	2,876,771.00	8.13
5	600066	宇通客车	2,850,331.00	8.06
6	000933	神火股份	2,825,364.00	7.99
7	000997	新大陆	2,750,982.00	7.78
8	600079	人福医药	2,735,532.00	7.74
9	600598	北大荒	2,726,526.00	7.71
10	600582	天地科技	2,681,976.00	7.58
11	002138	顺络电子	2,652,264.00	7.50
12	600535	天士力	2,609,822.00	7.38

13	000709	河钢股份	2,593,713.00	7.33
14	601958	金钼股份	2,538,686.00	7.18
15	000060	中金岭南	2,494,869.00	7.06
16	600352	浙江龙盛	2,454,263.00	6.94
17	603160	汇顶科技	2,446,971.00	6.92
18	600482	中国动力	2,443,866.00	6.91
19	600177	雅戈尔	2,413,409.00	6.82
20	002128	电投能源	2,380,515.00	6.73
21	600096	云天化	2,378,599.00	6.73
22	601997	贵阳银行	2,354,085.00	6.66
23	002064	华峰化学	2,272,039.00	6.42
24	600873	梅花生物	2,261,063.00	6.39
25	000050	深天马 A	2,256,063.00	6.38
26	300296	利亚德	2,235,211.00	6.32
27	300383	光环新网	2,228,953.00	6.30
28	000598	兴蓉环境	2,216,771.00	6.27
29	000728	国元证券	2,202,930.10	6.23
30	000738	航发控制	2,201,135.00	6.22
31	600566	济川药业	2,181,799.00	6.17
32	000623	吉林敖东	2,176,474.00	6.15
33	002500	山西证券	2,128,540.00	6.02
34	000830	鲁西化工	2,124,325.00	6.01
35	002444	巨星科技	2,103,507.00	5.95
36	600998	九州通	2,098,039.00	5.93
37	688169	石头科技	2,097,929.52	5.93
38	600879	航天电子	2,090,563.00	5.91
39	600008	首创环保	2,065,471.00	5.84
40	000027	深圳能源	2,040,639.00	5.77
41	600928	西安银行	2,032,378.82	5.75
42	601233	桐昆股份	2,032,024.00	5.75
43	002463	沪电股份	2,029,413.00	5.74

44	002028	思源电气	2,024,078.00	5.72
45	600707	彩虹股份	2,000,888.00	5.66
46	600985	淮北矿业	1,984,669.00	5.61
47	601058	赛轮轮胎	1,968,767.00	5.57
48	000725	京东方 A	1,948,740.00	5.51
49	002152	广电运通	1,946,140.00	5.50
50	000651	格力电器	1,945,593.00	5.50
51	002558	巨人网络	1,945,264.00	5.50
52	601666	平煤股份	1,942,569.00	5.49
53	000887	中鼎股份	1,940,824.00	5.49
54	002223	鱼跃医疗	1,937,890.00	5.48
55	600637	东方明珠	1,934,298.00	5.47
56	600909	华安证券	1,922,634.00	5.44
57	002056	横店东磁	1,919,412.00	5.43
58	002340	格林美	1,908,948.00	5.40
59	002465	海格通信	1,908,071.00	5.40
60	603228	景旺电子	1,901,513.00	5.38
61	600170	上海建工	1,888,241.00	5.34
62	002958	青农商行	1,887,952.00	5.34
63	002797	第一创业	1,887,195.00	5.34
64	002422	科伦药业	1,885,082.00	5.33
65	600528	中铁工业	1,840,094.00	5.20
66	000513	丽珠集团	1,830,615.30	5.18
67	002532	天山铝业	1,795,828.00	5.08
68	600737	中粮糖业	1,790,670.00	5.06
69	600871	石化油服	1,789,737.00	5.06
70	600867	通化东宝	1,782,066.00	5.04
71	002449	国星光电	1,753,506.00	4.96
72	300394	天孚通信	1,750,669.00	4.95
73	600967	内蒙一机	1,748,314.00	4.94
74	002409	雅克科技	1,743,856.00	4.93

75	002600	领益智造	1,738,005.00	4.91
76	000039	中集集团	1,737,632.00	4.91
77	000778	新兴铸管	1,724,192.00	4.88
78	601216	君正集团	1,710,168.00	4.84
79	002595	豪迈科技	1,703,969.00	4.82
80	000559	万向钱潮	1,694,367.00	4.79
81	300003	乐普医疗	1,671,507.00	4.73
82	300009	安科生物	1,671,474.00	4.73
83	000878	云南铜业	1,665,265.00	4.71
84	600332	白云山	1,662,829.00	4.70
85	601077	渝农商行	1,660,342.00	4.70
86	601158	重庆水务	1,653,182.00	4.67
87	300502	新易盛	1,607,887.00	4.55
88	600398	海澜之家	1,605,404.00	4.54
89	600863	内蒙华电	1,599,586.00	4.52
90	000400	许继电气	1,584,808.00	4.48
91	603077	和邦生物	1,580,562.00	4.47
92	600500	中化国际	1,569,883.20	4.44
93	600755	厦门国贸	1,569,679.00	4.44
94	600390	五矿资本	1,564,762.00	4.42
95	002078	太阳纸业	1,560,562.00	4.41
96	600271	航天信息	1,557,402.00	4.40
97	600663	陆家嘴	1,548,352.00	4.38
98	601555	东吴证券	1,544,826.00	4.37
99	600820	隧道股份	1,543,551.00	4.36
100	600959	江苏有线	1,537,870.00	4.35
101	000156	华数传媒	1,528,817.00	4.32
102	000683	远兴能源	1,522,858.00	4.31
103	688213	思特威	1,507,137.06	4.26
104	600578	京能电力	1,475,265.00	4.17
105	600282	南钢股份	1,467,804.00	4.15

106	601989	中国重工	1,456,261.00	4.12
107	603858	步长制药	1,445,682.00	4.09
108	300253	卫宁健康	1,444,252.00	4.08
109	605208	永茂泰	1,434,222.00	4.06
110	002266	浙富控股	1,433,733.00	4.05
111	603893	瑞芯微	1,415,865.00	4.00
112	300207	欣旺达	1,406,424.00	3.98
113	600887	伊利股份	1,405,974.34	3.98
114	002384	东山精密	1,400,848.00	3.96
115	601000	唐山港	1,392,604.00	3.94
116	600161	天坛生物	1,392,216.00	3.94
117	000960	锡业股份	1,389,295.00	3.93
118	300144	宋城演艺	1,385,905.00	3.92
119	600098	广州发展	1,375,087.00	3.89
120	601228	广州港	1,371,644.00	3.88
121	000750	国海证券	1,362,698.00	3.85
122	000921	海信家电	1,362,430.00	3.85
123	601880	辽港股份	1,360,056.00	3.85
124	002032	苏泊尔	1,357,778.00	3.84
125	600517	国网英大	1,352,414.00	3.82
126	000937	冀中能源	1,348,454.40	3.81
127	600968	海油发展	1,346,025.00	3.81
128	002065	东华软件	1,334,780.00	3.77
129	600380	健康元	1,329,101.00	3.76
130	002294	信立泰	1,302,278.00	3.68
131	600276	恒瑞医药	1,295,452.00	3.66
132	002185	华天科技	1,293,927.00	3.66
133	002195	岩山科技	1,292,341.00	3.65
134	002202	金风科技	1,280,838.00	3.62
135	601615	明阳智能	1,280,414.00	3.62
136	002010	传化智联	1,259,048.00	3.56

137	600050	中国联通	1,244,883.00	3.52
138	002373	千方科技	1,236,065.00	3.50
139	000739	普洛药业	1,234,396.00	3.49
140	600309	万华化学	1,231,117.00	3.48
141	601608	中信重工	1,230,613.00	3.48
142	601992	金隅集团	1,221,849.00	3.46
143	688188	柏楚电子	1,218,689.72	3.45
144	000975	山金国际	1,216,335.00	3.44
145	601016	节能风电	1,215,697.00	3.44
146	601106	中国一重	1,204,611.00	3.41
147	000785	居然智家	1,189,697.00	3.36
148	600673	东阳光	1,174,376.00	3.32
149	600655	豫园股份	1,173,003.00	3.32
150	601636	旗滨集团	1,160,571.00	3.28
151	000423	东阿阿胶	1,158,504.00	3.28
152	002945	华林证券	1,158,198.00	3.28
153	600848	上海临港	1,156,645.00	3.27
154	601168	西部矿业	1,154,298.00	3.26
155	300146	汤臣倍健	1,141,029.00	3.23
156	601198	东兴证券	1,130,315.00	3.20
157	601098	中南传媒	1,116,268.00	3.16
158	300002	神州泰岳	1,110,475.00	3.14
159	601568	北元集团	1,109,895.00	3.14
160	603156	养元饮品	1,101,495.00	3.11
161	688122	西部超导	1,079,760.94	3.05
162	002008	大族激光	1,074,344.15	3.04
163	002517	恺英网络	1,072,121.00	3.03
164	603658	安图生物	1,069,684.00	3.02
165	002439	启明星辰	1,065,537.00	3.01
166	002936	郑州银行	1,064,824.00	3.01
167	688538	和辉光电	1,046,666.31	2.96

168	002025	航天电器	1,043,527.00	2.95
169	601717	郑煤机	1,041,233.00	2.94
170	601611	中国核建	1,018,361.00	2.88
171	601727	上海电气	1,014,957.00	2.87
172	600977	中国电影	1,012,134.00	2.86
173	002472	双环传动	1,008,777.00	2.85
174	600479	千金药业	1,005,575.00	2.84
175	600597	光明乳业	1,000,401.00	2.83
176	603826	坤彩科技	999,834.00	2.83
177	601399	国机重装	998,869.00	2.82
178	000967	盈峰环境	997,056.00	2.82
179	600536	中国软件	983,956.70	2.78
180	000100	TCL科技	978,401.00	2.77
181	002533	金杯电工	974,620.00	2.76
182	600583	海油工程	970,446.00	2.74
183	603589	口子窖	967,820.00	2.74
184	601728	中国电信	965,029.00	2.73
185	000563	陕国投 A	959,541.00	2.71
186	600699	均胜电子	944,223.00	2.67
187	300114	中航电测	941,817.00	2.66
188	000783	长江证券	939,837.00	2.66
189	002925	盈趣科技	936,854.00	2.65
190	603568	伟明环保	931,256.00	2.63
191	000650	仁和药业	929,163.00	2.63
192	000703	恒逸石化	920,440.00	2.60
193	601231	环旭电子	909,069.22	2.57
194	600862	中航高科	908,752.00	2.57
195	000930	中粮科技	906,602.00	2.56
196	600497	驰宏锌锗	902,662.00	2.55
197	002508	老板电器	902,006.00	2.55
198	600120	浙江东方	897,171.00	2.54

199	600126	杭钢股份	894,523.00	2.53
200	000932	华菱钢铁	883,846.00	2.50
201	600765	中航重机	879,798.00	2.49
202	002966	苏州银行	876,153.00	2.48
203	002027	分众传媒	870,612.00	2.46
204	600062	华润双鹤	870,532.00	2.46
205	688425	铁建重工	868,703.26	2.46
206	601766	中国中车	868,530.00	2.46
207	603786	科博达	865,854.00	2.45
208	300543	朗科智能	861,557.00	2.44
209	600104	上汽集团	856,503.00	2.42
210	002984	森麒麟	854,552.00	2.42
211	300724	捷佳伟创	852,597.00	2.41
212	601128	常熟银行	851,004.00	2.41
213	600704	物产中大	850,763.00	2.41
214	688234	天岳先进	842,523.11	2.38
215	601928	凤凰传媒	833,454.00	2.36
216	002557	洽洽食品	825,196.00	2.33
217	688050	爱博医疗	823,097.27	2.33
218	300765	新诺威	821,181.00	2.32
219	601126	四方股份	815,435.00	2.31
220	300308	中际旭创	814,629.00	2.30
221	600038	中直股份	814,606.13	2.30
222	601988	中国银行	813,289.00	2.30
223	600763	通策医疗	808,528.00	2.29
224	600208	衢州发展	804,489.00	2.27
225	300088	长信科技	801,514.00	2.27
226	000429	粤高速 A	800,256.00	2.26
227	600801	华新水泥	799,923.00	2.26
228	601138	工业富联	792,424.00	2.24
229	600580	卧龙电驱	792,271.00	2.24

230	600143	金发科技	790,398.00	2.24
231	002001	新 和 成	788,515.00	2.23
232	002826	易明医药	785,912.00	2.22
233	688728	格科微	785,702.36	2.22
234	688208	道通科技	779,766.36	2.21
235	301057	汇隆新材	779,478.00	2.20
236	601139	深圳燃气	778,165.00	2.20
237	300054	鼎龙股份	776,325.00	2.20
238	600764	中国海防	771,933.00	2.18
239	002608	江苏国信	771,900.00	2.18
240	000066	中国长城	768,852.00	2.17
241	688819	天能股份	766,821.43	2.17
242	600776	东方通信	764,775.00	2.16
243	002106	莱宝高科	763,773.00	2.16
244	002788	鹭燕医药	751,876.00	2.13
245	002347	泰尔股份	749,943.00	2.12
246	601518	吉林高速	748,678.00	2.12
247	601668	中国建筑	744,087.00	2.10
248	002004	华邦健康	737,821.00	2.09
249	688659	元琛科技	736,509.11	2.08
250	688331	荣昌生物	730,904.64	2.07
251	000800	一汽解放	728,353.00	2.06
252	002624	完美世界	727,248.00	2.06
253	600498	烽火通信	726,833.00	2.06
254	000032	深桑达 A	726,151.00	2.05
255	000036	华联控股	720,240.00	2.04
256	000425	徐工机械	718,051.00	2.03
257	603328	依顿电子	713,848.00	2.02
258	688387	信科移动	711,596.51	2.01
259	002448	中原内配	711,263.00	2.01
260	002601	龙佰集团	711,134.00	2.01

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。

8.4.3 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	491,629,433.71
卖出股票收入（成交）总额	477,497,103.91

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

8.12.3 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	27,289.88
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	28,488.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,778.54

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额	持	户均持有的	持有人结构
----	---	-------	-------

级别	有 人 户 数 (户)	基金份额	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
富安 达中 证500 指数 增强A	578	67,856.97	27,156,768.66	69.2 4%	12,064,558.42	30.76%
富安 达中 证500 指数 增强C	96	22,671.32	0.00	0.00%	2,176,447.15	100.00%
合计	674	61,421.03	27,156,768.66	65.6 0%	14,241,005.57	34.40%

注：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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 （份）	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	富安达中证500指 数增强A	194,454.63	0.50%
	富安达中证500指 数增强C	8,661.76	0.40%
	合计	203,116.39	0.49%

注：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）。

9.3 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	富安达中证500指数增强A	0~10
	富安达中证500指数增强C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	富安达中证500指数增强A	10~50
	富安达中证500指数增强C	-
	合计	10~50

- 1、基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为0至10万份（含）。
- 2、本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为10至50万份（含）。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	富安达中证500指数增强A	富安达中证500指数增强C
基金合同生效日(2019年11月19日)基金份额总额	297,167,480.72	-
本报告期期初基金份额总额	30,113,472.10	22,978.63
本报告期基金总申购份额	22,764,368.80	55,914,849.08
减：本报告期基金总赎回份额	13,656,513.82	53,761,380.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	39,221,327.08	2,176,447.15

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 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，本基金管理人聘任王胜为董事长，聘任金领千为总经理；蒋晓刚不再担任董事长，王胜不再担任总经理，沈伟青不再担任副总经理。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为31,500.00元人民币。

截至本报告期末，该事务所已提供审计服务的连续年限为2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
德邦	1	-	-	-	-	-

证券						
东方 证券	1	-	-	-	-	-
东海 证券	1	-	-	-	-	-
东兴 证券	1	57,735,225.00	5.96%	43,065.40	9.38%	-
方正 证券	1	-	-	-	-	-
光大 证券	1	-	-	-	-	-
国信 证券	1	-	-	-	-	-
国元 证券	1	-	-	-	-	-
海通 证券	1	-	-	-	-	-
华泰 证券	1	-	-	-	-	-
麦高 证券	1	6,478,737.70	0.67%	1,269.31	0.28%	-
申港 证券	1	70,729,138.40	7.30%	27,570.14	6.01%	-
五矿 证券	1	-	-	-	-	-
西南 证券	1	-	-	-	-	-
湘财 证券	1	-	-	-	-	-
新时 代证 券	1	-	-	-	-	-
信达	1	-	-	-	-	-

证券						
银河 证券	1	-	-	-	-	-
英大 证券	1	48,188,665.00	4.97%	35,945.03	7.83%	-
浙商 证券	1	41,537,063.49	4.29%	8,137.40	1.77%	-
中金 公司	1	-	-	-	-	-
中泰 证券	1	-	-	-	-	-
甬兴 证券	1	-	-	-	-	-
财通 证券	2	-	-	-	-	-
长江 证券	2	76,568,113.89	7.90%	14,999.67	3.27%	-
大同 证券	2	111,322,854.90	11.49%	34,133.61	7.44%	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-
东方 财富	2	-	-	-	-	-
东吴 证券	2	360,090.00	0.04%	268.58	0.06%	-
东亚 前海 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	2	695,449.00	0.07%	136.23	0.03%	-
国金 证券	2	-	-	-	-	-
国联	2	-	-	-	-	-

证券						
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国泰 君安	2	95,811,822.59	9.89%	32,058.88	6.99%	-
华安 证券	2	-	-	-	-	-
华宝 证券	2	-	-	-	-	-
华创 证券	2	7,531,372.75	0.78%	1,475.40	0.32%	-
华金 证券	2	47,817.00	0.00%	9.36	0.00%	-
华龙 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
华源 证券	2	-	-	-	-	-
开源 证券	2	-	-	-	-	-
民生 证券	2	-	-	-	-	-
南京 证券	2	-	-	-	-	-
山西 证券	2	145,795,381.21	15.04%	108,745.78	23.69%	-
申万 宏源	2	-	-	-	-	-
首创 证券	2	-	-	-	-	-
太平 洋证	2	68,393,455.13	7.06%	51,014.68	11.12%	-

券						
天风 证券	2	-	-	-	-	-
西部 证券	2	-	-	-	-	-
兴业 证券	2	95,529,723.10	9.86%	18,713.49	4.08%	-
中信 建投	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-
中银 国际 证券	2	-	-	-	-	-
中邮 证券	2	37,518,968.11	3.87%	7,350.43	1.60%	-
上海 证券	3	91,383,425.13	9.43%	63,995.54	13.94%	-
招商 证券	3	13,499,235.22	1.39%	10,069.01	2.19%	-

注：

1、交易单元的选择标准和程序：

我公司制定了选择券商的标准，即：

（1）财务状况良好，经营行为规范，具有完备的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（2）合规风控管理制度健全，具有良好的诚信合规记录,最近一年未因发生重大违规行为而受到证监会处罚；

（3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合基金证券交易的需要，最近一年未发生重大信息安全事故；

（4）能为公司提供高质量的研究服务；

基金管理人会对潜在签约券商进行必要的尽职调查，将相应的交易单元租用协议等作为附件，发起相应OA审批流程，经审批后用印。

2、在上述租用的券商交易单元中，(017888)麦高证券、(59075、017923)招商证券、(59740)德邦证券、(59593、396732)华源证券、(23217)华泰证券、(018325)国泰君安、(60021、

018452)中邮证券、(20181)湘财证券、(51424)华创证券、(55851)甬兴证券为本基金本期新增的交易单元。本基金本期剔除交易单元：(391893)东方证券、(39632)中信建投、(001461)国信证券、(53614)东亚前海证券、(52636)中银国际证券、(016338)五矿证券、(39181)方正证券。

3、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）的报告期为2024年7月1日至2024年12月31日，统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期未通过交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	规定媒介	2024-01-19
2	富安达中证500指数增强型证券投资基金2023年第4季度报告	规定媒介	2024-01-19
3	富安达基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定媒介	2024-01-30
4	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加乾道基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2024-02-06
5	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加众惠基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2024-03-13
6	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2024-03-28

7	富安达基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	规定媒介	2024-03-29
8	富安达中证500指数增强型证券投资基金2023年年度报告	规定媒介	2024-03-29
9	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	规定媒介	2024-04-18
10	富安达中证500指数增强型证券投资基金2024年第1季度报告	规定媒介	2024-04-18
11	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2024-05-09
12	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海大智慧基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2024-05-30
13	富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国信证券股份有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2024-06-05
14	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2024-06-13
15	富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加湘财证券股份有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2024-06-26
16	富安达中证500指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定媒介	2024-06-26
17	富安达基金管理有限公司关	规定媒介	2024-06-27

	于系统升级暂停服务的公告		
18	富安达基金管理有限公司关于变更直销柜台汇款交易业务银行账户的公告	规定媒介	2024-06-28
19	富安达基金管理有限公司关于终止直销网上交易平台、微信交易平台开户、认购、申购（含定期定额投资）、基金转换业务的公告	规定媒介	2024-07-06
20	富安达基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定媒介	2024-07-11
21	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	规定媒介	2024-07-18
22	富安达中证500指数增强型证券投资基金2024年第2季度报告	规定媒介	2024-07-18
23	富安达基金管理有限公司旗下全部基金中期报告提示性公告	规定媒介	2024-08-29
24	富安达中证500指数增强型证券投资基金2024年中期报告	规定媒介	2024-08-29
25	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2024-09-26
26	富安达基金管理有限公司关于旗下基金所持股票“国泰君安”（601211）估值调整的公告	规定媒介	2024-10-09
27	富安达中证500指数增强型证券投资基金基金产品资料	规定媒介	2024-10-12

	概要更新		
28	富安达中证500指数增强型证券投资基金招募说明书更新提示性公告	规定媒介	2024-10-12
29	富安达中证500指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（二〇二四年第一号）	规定媒介	2024-10-12
30	富安达基金管理有限公司董事长变更公告	规定媒介	2024-10-15
31	富安达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定媒介	2024-10-15
32	富安达中证500指数增强型证券投资基金2024年第3季度报告	规定媒介	2024-10-24
33	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	规定媒介	2024-10-24
34	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参加中信银行股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2024-11-06
35	富安达基金管理有限公司关于变更直销柜台汇款交易业务银行账户的公告	规定媒介	2024-11-12
36	富安达基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定媒介	2024-11-27
37	富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华泰证券股份有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2024-11-27

38	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2024-12-20
39	富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加民生证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2024-12-25

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20240910-20241231	3,381,196.43	9,420,404.38	0.00	12,801,600.81	30.92%
	2	20240101-20240902	16,312,550.05	0.00	9,900,000.00	6,412,550.05	15.49%
	3	20240410-20240827	0.00	20,499,066.22	20,499,066.22	0.00	0.00%
	4	20241008-20241031	0.00	20,499,066.22	20,499,066.22	0.00	0.00%
产品特有风险							
当持有基金份额比例达到或超过20%的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大的冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。							

注：

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予富安达中证500指数增强型证券投资基金注册的文件：《富安达中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》；

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

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

富安达基金管理有限公司
二〇二五年三月二十八日