

富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
二〇二四年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2025 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国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。

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

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

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、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.....	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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.....	18
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	18
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报告	21
7.1 资产负债表.....	21

7.2 利润表.....	23
7.3 净资产变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告.....	61
8.1 期末基金资产组合情况.....	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	62
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	89
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	90
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.....	90
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.....	90
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.....	91
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.....	91
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	91
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	91
8.12 投资组合报告附注.....	91
§9 基金份额持有人信息.....	92
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	92
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	93
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	93
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	93
§10 开放式基金份额变动.....	94
§11 重大事件揭示.....	94
11.1 基金份额持有人大会决议.....	94
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.....	94
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	94
11.4 基金投资策略的改变.....	94
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	94
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.....	94
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	95
11.8 其他重大事件.....	98
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	98
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.....	98
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	99

§13 备查文件目录 99

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
场内简称	1000ETF
基金简称	富国中证 1000ETF
基金主代码	159629
交易代码	159629
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 07 月 27 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,691,252,663.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2022 年 8 月 3 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金的资产配置策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券（含分离交易可转债）及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为中证 1000 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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份股及备选成份股，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		富国基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	许俊

	联系电话	021-20361818	010-66596688
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95566
传真		021-20361616	010-66594942
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		裴长江	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路222号外滩中心30楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 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7月27日 (基金合同生效日) 至2022年12月 31日
本期已实现收益	617,734,028.36	-186,278,169.91	-246,715,497.02

本期利润	1,629,262,538.42	-177,302,628.79	-592,079,628.76
加权平均基金份额本期利润	0.4948	-0.0722	-0.1101
本期加权平均净值利润率	22.80%	-3.16%	-9.62%
本期基金份额净值增长率	2.25%	-5.49%	-11.84%
3.1.2 期末数据和指标	2024年12月31日	2023年12月31日	2022年12月31日
期末可供分配利润	-1,551,708,114.30	-1,036,043,412.04	-796,688,578.72
期末可供分配基金份额利润	-0.4204	-0.4737	-0.2529
期末基金资产净值	8,932,416,236.74	5,176,327,021.91	5,932,855,276.06
期末基金份额净值	2.4199	2.3666	1.8832
3.1.3 累计期末指标	2024年12月31日	2023年12月31日	2022年12月31日
基金份额累计净值增长率	-14.80%	-16.68%	-11.84%

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

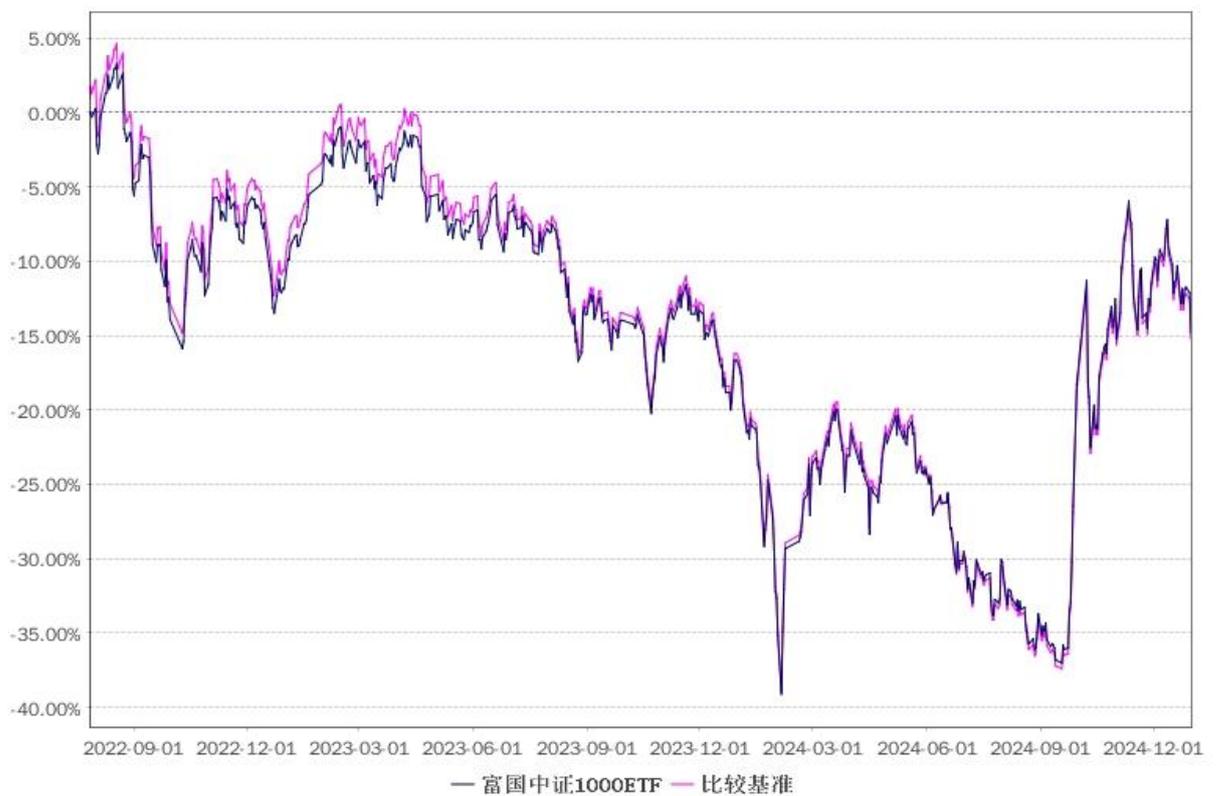
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.27%	2.39%	4.36%	2.40%	-0.09%	-0.01%
过去六个月	21.94%	2.24%	21.69%	2.24%	0.25%	0.00%
过去一年	2.25%	2.11%	1.20%	2.12%	1.05%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-14.80%	1.57%	-15.22%	1.58%	0.42%	-0.01%

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

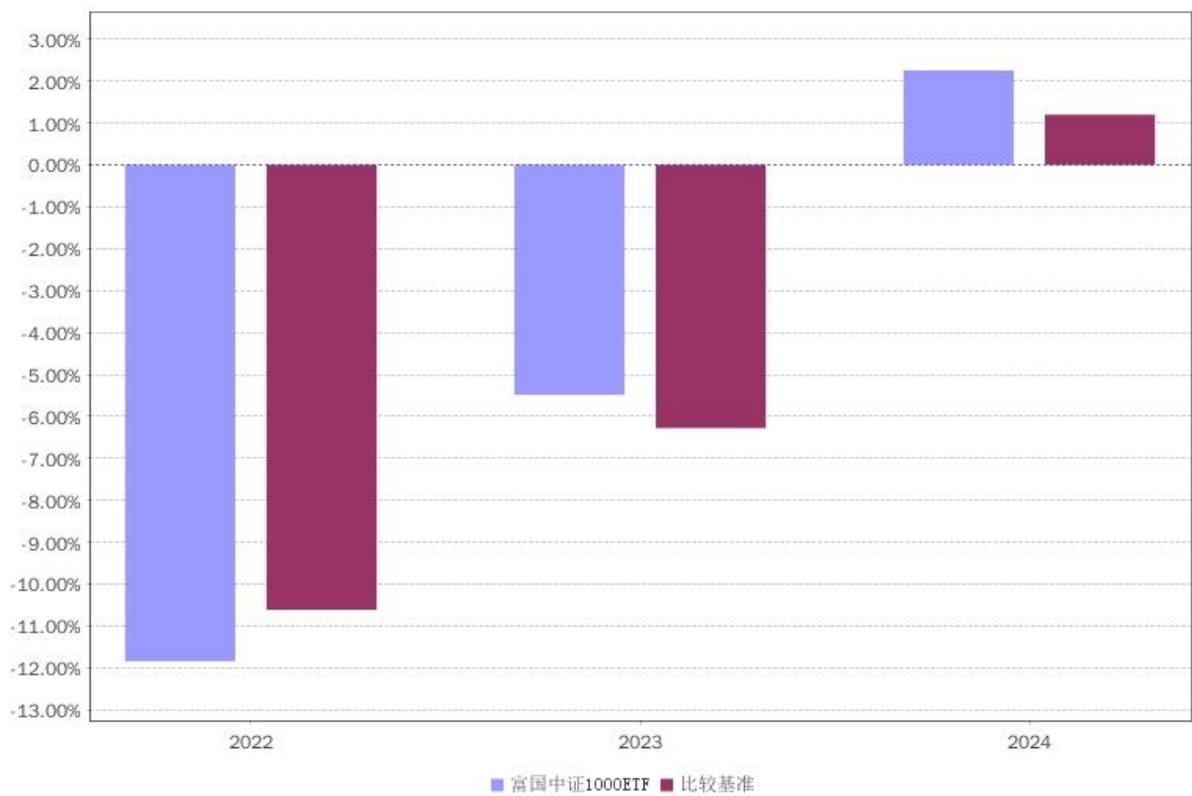
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2024年12月31日。

2、本基金于2022年7月27日成立，建仓期6个月，从2022年7月27日起至2023年1月26日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来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：2022 年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金 2022 年 7 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日未进行利润分配

§ 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

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

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、

申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省金融资产管理股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安（以下简称“存续公司”）承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持本公司股权亦归属于存续公司，即存续公司成为本公司的主要股东。公司将根据中国证监会批复和相关法律法规的要求办理主要股东变更相关事宜，并及时履行信息披露义务，维护基金份额持有人的合法权益。

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 363 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
金泽宇	本基金现任基金经理	2022-07-27	—	7	博士，自 2018 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、初级定量研究员、定量研究员；现任富国基金量化投资部定量基金经理。自 2022 年 07 月起任富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2022 年

					11月起任富国中证1000交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自2023年09月起任富国中证2000交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自2023年12月起任富国创业板中盘200交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自2024年02月起任富国创业板中盘200交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自2024年05月起任富国沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自2024年05月起任富国中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自2024年07月起任富国中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自2024年09月起任富国沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自2024年10月起任富国中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自2024年11月起任富国中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；具有基金从业资格。
苏华清	本基金现任基金经理	2023-10-19	—	7	硕士，曾任中证指数有限公司研究员；自2022年6月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员；现任富国基金量化投资部定量基金经理。自2023年10月起任富国中证1000交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自2023年10月起任富国中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自2023年11月起任富国深证50交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自2024年01月起任富国深证50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自2024年03月起任富国中证A50交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自2024年04月起

					任富国中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2024 年 06 月起任富国中证通信设备主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 08 月起任富国中证通信设备主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2024 年 09 月起任富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 11 月起任富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易

系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现33次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年开年以来，国内悲观预期加速释放，海外修正抢跑的降息预期，资金和情绪的负反馈导致市场调整加速。2 月，随着国内经济与政策预期得到重新修正，风险偏好改善驱动市场快速反弹。在海外 AI 技术迎来突破等信息刺激下，A 股迎来大幅反弹，月末沪指成功站上 3000 点。4 月末，美国降息预期推后下非美货币普遍贬值，而人民币汇率抗跌走出独立行情，中国资产在全球的配置性价比和逻辑开始凸显，引发外资回流。业绩期进入尾声后，内资风险偏好抬升，合力推动沪指突破 3100 点。6 月进入验证期，国内经济复苏再度放缓，PMI 回落枯荣线以下、信用扩张疲软、经济“供强需弱”特征延续。接连落空的预期验证放大悲观情绪，沪指连续调整至 3000 点以下。下半年，进入 7 月，市场提前交易美国大选风险，海外科技大盘股、金属商品等前期表现较好资产出现下跌，压制全球市场风险偏好。9 月 18 日美联储以 50bp 开启降息周期，为国内宽松打开空间。9 月 24 日国内宽松即刻跟进，9 月 26 日中央政治局会议罕见在 9 月讨论经济问题，全面聚焦增长，加力推出增量政策、实施有力度的降息、促进房地产市场止跌回稳、提振资本市场等积极表述超出市场预期，明确释放了政策全力聚焦稳增长，且后续仍有增量政策加力的积极信号，市场迎来大幅上涨。10 月国庆假期回归后，市场对后续政策力度和微观流动性的预期回归理性，短期超涨后经历大波动。11 月，美国大选等重要大事集中落地，海外扰动与内部积极因素交织，市场区间震荡。进入 12 月，随着两大重磅会议定调落地，市场风格迎来切换，前期高位股、小微盘股开始回落，市场风格逐步向大盘、红利倾斜，前期极致的风格分化持续收敛。

总体来看，2024 年全年上证综指上涨 12.67%，沪深 300 上涨 14.68%，创业板指上涨 13.23%，中证 500 指数上涨 5.46%。

在投资管理上，本基金采用量化和人工管理相结合的方法，处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件，合理安排仓位及头寸，将跟踪误差控制在合理水平，努力为投资者提供更合格的投资工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 2.4199 元；份额累计净值为 0.852 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 2.25%，同期业绩比较基准收益

率为 1.20%。

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 2025 年，在更加积极有为的宏观政策基调下，国内基本面有望逐步修复，预计市场呈现出螺旋式震荡上行的特征。从政策面看，如财政政策能够持续加码，有效提振内需，将改善企业盈利。从资金面看个人投资者和长期机构将有望成为增量资金主要来源。过去几年国内居民储蓄存款持续积累，随着市场投资环境逐步修复，可能使国内居民和全球资金对 A 股配置需求有更积极的边际变化。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

（一）落细落实各项监管要求

报告期内，公司从新规解读、制度建立、合同模板更新、系统更新、流程改造、事后检查等方面持续推进各项法律法规及监管要求的落实工作。

（二）持续完善内控制度及流程建设

报告期内，公司持续完善内控制度建设，以检视重点业务内控制度体系、规范各业务部门内部管理为重点，新增、修订多项内控制度。同时，公司细化优化多项业务流程，确保各项内控要求有效执行。

（三）进一步强化合规管理效能

报告期内，公司持续完善合规考核机制，通过合规考核引导全员主动合规。公司在投研条线设立专职合规人员，在其余业务条线设立兼职合规人员，通过定期专兼职合规管理人员会议等机制，推动第一道防线的充分履职，使合规管理深入各业务部门。

（四）加强文化建设，持续提升员工合规意识

为持续提高员工合规意识及应知应会水平，公司紧跟新规要求、监管动态、行业热点，通过“线上+线下”的模式开展不同形式的合规培训、合规提示和宣导，结合合规谈话及合规考试，多管齐下全面提升员工的合规意识。公司积极支持行业各项文化建设活动，积极参与“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化建设。

（五）立足于合规，不断拓展风险管理职能

公司持续推进旗下组合的投资合规风控阈值多维度排查梳理和日常投资合

规监督工作的规范化管理，不断拓展优化投资监督提示内容，进一步提升投资监督工作质量和效率。公司不断加强团队对新业务、新品种、新风险环境的学习研究，保持对各类风险的敏感度和识别响应能力。公司通过加强日常监测和定期回溯评估等方式，持续提升对于各类投资标的、投资行为的风险管理水平。

（六）信息化建设助力风控合规目标实现

报告期内，公司进一步深入开展风控合规信息化建设工作。公司持续对各类风险管理工具的功能和成果进行梳理整合，通过对投资过程中事前、事中、事后的风险管理系统工具建设，助力有效监测、识别、防范投资组合运作过程中的各类风险，促进投资组合稳定、健康运作。在合规管理方面，公司积极探索金融科技在员工行为管理等领域的应用，借助科技力量提升合规监测工作成效。

（七）持续加强员工行为管理

为规范公司员工的执业行为，防范利益冲突和道德风险，公司建立并持续完善通信管理机制，对投资管理业务相关人员的通讯设备、通讯软件等进行统一管控。公司定期开展事后监测，检查评估相关要求的执行情况。

（八）进一步提升反洗钱工作质效

公司认真贯彻落实反洗钱监管要求。除在客户尽职调查、可疑交易报告、客户资料和交易记录保存等反洗钱核心义务方面积极履职外，还深入学习新《反洗钱法》修订内容，通过重点专项工作等方式有序推动反洗钱工作深入开展。报告期内，公司开展的主要重点专项工作包括持续推动数据治理和系统建设、开展洗钱风险评估、完善名单监控及可疑监测模型、开展多维度文化宣贯等。

（九）深入开展内部稽核审计

公司持续坚持问题导向、风险导向，围绕各条线各部门制度框架体系建立情况、法规要求及监管重点开展专项审计。通过基础风险点例行检查与重点内容专项排查相结合的方式，检视内控不足、推动制度流程完善，切实起到第三道防线自查自纠、防范风险、保驾护航的作用。报告期内，公司针对投资研究、销售管理、信息技术、运营管理等各主要业务流程及人员管理等开展多项专项审计工作。就审计中发现的问题牵头各部门追根溯源，以查促改，实现审计项目的有效闭环，持续提高内部控制的有效性和风险防控能力。

本基金管理人将持续坚持基金份额持有人利益优先的原则，勤勉尽责地开展各项监察稽核工作，切实保障基金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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.9 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

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务

会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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	德师报(审)字(25)第 P00642 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	富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表,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,后附的富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 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,我们独立于富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金,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	富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则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。</p> <p>在编制财务报表时,管理层负责评估富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资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,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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。</p> <p>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:</p> <p>(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</p>

	<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(3)评价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。</p> <p>(4)对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,就可能对富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资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富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(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。</p> <p>我们与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。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	汪芳 冯适
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2025 年 03 月 27 日

§ 7 年度财务报告

7.1 资产负债表

会计主体:富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2024 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	本期末	上年度末
----	-----	------

	2024年12月 31日	2023年12月31 日
资产：		
货币资金	63,246,025.57	28,091,960.01
结算备付金	97,120,033.57	10,526,310.20
存出保证金	21,916,567.94	214,658.09
交易性金融资产	8,753,556,231.94	5,146,419,993.37
其中：股票投资	8,753,556,231.94	5,145,765,346.02
基金投资	—	—
债券投资	—	654,647.35
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	1,097.80	13,671,327.75
应收股利	—	1,740.00
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	313,905.58
资产总计	8,935,839,956.82	5,199,239,895.00
负债和净资产	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	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	538,699.81	18,968,940.32
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	1,201,966.30	2,149,490.42
应付托管费	400,655.43	429,898.09
应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—
应交税费	168,559.15	45,589.48
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	1,113,839.39	1,318,954.78
负债合计	3,423,720.08	22,912,873.09

净资产：		
实收基金	10,484,124,351.04	6,212,370,433.95
其他综合收益	—	—
未分配利润	1,551,708,114.30	-1,036,043,412.04
净资产合计	8,932,416,236.74	5,176,327,021.91
负债和净资产总计	8,935,839,956.82	5,199,239,895.00

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.4199 元，基金份额总额 3,691,252,663.00 份。

7.2 利润表

会计主体：富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

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)	上年度可比期间 (2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 12 月 31 日)
一、营业总收入	1,668,614,103.05	-142,919,642.90
1.利息收入	5,521,484.62	19,909,230.93
其中：存款利息收入	727,758.91	367,029.63
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	4,793,725.71	19,542,201.30
2.投资收益（损失以“-”填列）	669,793,318.17	-192,119,128.65
其中：股票投资收益	550,056,739.45	-248,268,999.73
基金投资收益	—	—
债券投资收益	734,875.95	4,014,058.66
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	28,233,680.03	—
股利收益	90,768,022.74	52,135,812.42
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）	1,011,528,510.06	8,975,541.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-18,229,209.80	20,314,713.70

减：二、营业总支出	39,351,564.63	34,382,985.89
1. 管理人报酬	32,163,579.52	28,273,905.15
2. 托管费	6,654,452.57	5,654,781.00
3. 销售服务费	—	—
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	119,061.16	70,383.74
8. 其他费用	414,471.38	383,916.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,629,262,538.42	-177,302,628.79
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,629,262,538.42	-177,302,628.79
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	1,629,262,538.42	-177,302,628.79

7.3 净资产变动表

会计主体：富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

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	6,212,370,433.95	— 1,036,043,412.04	5,176,327,021.91
二、本期期初净资产	6,212,370,433.95	— 1,036,043,412.04	5,176,327,021.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,271,753,917.09	— 515,664,702.26	3,756,089,214.83
（一）、综合收益总额	—	1,629,262,538.42	1,629,262,538.42
（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）	4,271,753,917.09	— 2,144,927,240.68	2,126,826,676.41
其中：1. 基金申购款	23,315,710,044.14	— 6,270,796,105.05	17,044,913,939.09
2. 基金赎回款	— 19,043,956,	4,125,868,864.37	— 14,918,087,

	127.05		262.68
(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	10,484,124,351.04	1,551,708,114.30	8,932,416,236.74
	上年度可比期间 (2023年01月01日至2023年12月31日)		
项目	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	6,729,543,854.78	796,688,578.72	5,932,855,276.06
二、本期期初净资产	6,729,543,854.78	796,688,578.72	5,932,855,276.06
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	517,173,420.83	239,354,833.32	756,528,254.15
(一)、综合收益总额	—	177,302,628.79	177,302,628.79
(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)	517,173,420.83	62,052,204.53	579,225,625.36
其中：1.基金申购款	23,112,177,080.20	2,121,612,014.58	20,990,565,065.62
2.基金赎回款	23,629,350,501.03	2,059,559,810.05	21,569,790,690.98
(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	6,212,370,433.95	1,036,043,412.04	5,176,327,021.91

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：

陈戈

林志松

徐慧

算结果的公告》，富国基金管理有限公司对本基金实施份额折算与变更登记。权益登记日为 2023 年 6 月 8 日。折算方式为基金份额折算后本基金基金份额净值与 2023 年 6 月 1 日中证 1000 指数收盘点位的万分之四基本一致。根据上述折算方式计算的基金份额折算比例为 0.752078692。本基金折算前，基金份额总额为 2,688,867,297.00 份，基金份额净值为 1.9404 元；本基金折算后，基金份额总额为 2,022,252,663.00 份，基金份额净值为 2.5800 元。基金份额持有人持有的折算产生的小数点后基金份额将按照“上进位”的原则进行取整，即小数点后基金份额均进位为 1 份，折算后的基金份额以登记结算机构最终确认的数据为准。进位处理所需资金由本基金管理人弥补，并于份额折算日计入基金资产。折算后的基金份额净值采用四舍五入法保留到小数点后 4 位。

本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股(均含存托凭证)。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(包含主板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票)、存托凭证、债券(国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具(股指期货、股票期权等)、货币市场工具以及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)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股(均含存托凭证)的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率。

7.4.2 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、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2号《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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2024年12月31日的财务状况以及2024年1月1日至2024年12月31日止期间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

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2024年1月1日至2024年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须

付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；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，应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，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应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，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金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确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计

提；

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

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入。出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入计入投资收益；

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。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，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、基金每年收益分配次数没有限制，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

3、若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

4、本基金收益分配采用现金方式；

5、法律法规、监管机关、登记机构、深圳证券交易所另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，并应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

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

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1 印花税

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

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

2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内

全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基

金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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。

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	63,246,025.57	28,091,960.01
等于：本金	63,241,409.89	28,089,344.54
加：应计利息	4,615.68	2,615.47
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	63,246,025.57	28,091,960.01

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

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	8,069,385.73 8.99	—	8,753,556.23 1.94	684,170,492. 95
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	8,069,385.73 8.99	—	8,753,556.23 1.94	684,170,492. 95
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	5,482,153.93 6.64	—	5,145,765.34 6.02	— 336,388,590. 62
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	654,600.00	47.35	654,647.35
	银行间市场	—	—	—
	合计	654,600.00	47.35	654,647.35
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—

合计	5,482,808,536.64	47.35	5,146,419,993.37	336,388,590.62
----	------------------	-------	------------------	----------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

金额单位：人民币元

项目	本期末（2024年12月31日）			
	名义金额	公允价值		备注(成本)
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	184,221,133.51	—	—	—
股指期货	184,221,133.51	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	184,221,133.51	—	—	—

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

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2501	IM2501	74.00	88,145,840.00	-6,423,853.51
IM2503	IM2503	74.00	87,044,720.00	-2,606,720.00
合计				-9,030,573.51
减：可抵销期货暂收款				-9,030,573.51
净额				—

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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

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）
应收利息	—	—
其他应收款	—	—
待摊费用	—	—
转融通证券出借利息	—	313,905.58
合计	—	313,905.58

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

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	—	—
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	1,002,565.42	1,107,680.81
其中：交易所市场	1,002,565.42	1,107,680.81
银行间市场	—	—
应付利息	—	—
预提信息披露费	—	120,000.00
预提审计费	63,000.00	63,000.00
IOPV 计算发布费	48,273.97	28,273.97
合计	1,113,839.39	1,318,954.78

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,187,252,663.00	6,212,370,433.95
本期申购	8,209,000,000.00	23,315,710,044.14
本期赎回（以“-”号填列）	-6,705,000,000.00	-19,043,956,127.05
本期末	3,691,252,663.00	10,484,124,351.04

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	-328,636,085.49	-707,407,326.55	- 1,036,043,412.04
本期期初	-328,636,085.49	-707,407,326.55	- 1,036,043,412.04
本期利润	617,734,028.36	1,011,528,510.06	1,629,262,538.42
本期基金份额 交易产生的变 动数	-576,828,613.04	- 1,568,098,627.64	- 2,144,927,240.68
其中：基金申购 款	- 2,363,912,215.97	- 3,906,883,889.08	- 6,270,796,105.05
基金赎回 款	1,787,083,602.93	2,338,785,261.44	4,125,868,864.37
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	-287,730,670.17	- 1,263,977,444.13	- 1,551,708,114.30

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	176,656.15	112,329.18
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	541,084.07	240,548.12
其他	10,018.69	14,152.33
合计	727,758.91	367,029.63

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

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）
股票投资收益——买卖股票差价收入	196,146,977.45	-204,622,203.52
股票投资收益——赎回差价收入	353,909,762.00	-43,646,796.21
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	550,056,739.45	-248,268,999.73

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（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	9,281,770,283.07	10,249,817,065.19
减：卖出股票成本总额	9,076,130,654.91	10,441,384,033.41
减：交易费用	9,492,650.71	13,055,235.30
买卖股票差价收入	196,146,977.45	-204,622,203.52

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

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）
赎回基金份额对价总额	14,918,087,262.68	21,569,790,690.98
减：现金支付赎回款总额	6,652,242,816.68	9,153,923,978.98
减：赎回股票成本总额	7,911,934,684.00	12,459,513,508.21
减：交易费用	—	—
赎回差价收入	353,909,762.00	-43,646,796.21

7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益——申购差价收入。

7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

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）
债券投资收益——利息收入	551.87	2,613.43
债券投资收益——买卖债券（债转	734,324.08	4,011,445.23

股及债券到期兑付) 差价收入		
合计	734,875.95	4,014,058.66

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（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）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,849,173.86	20,349,694.13
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,114,000.00	16,334,500.00
减：应计利息总额	615.83	2,934.99
减：交易费用	233.95	813.91
买卖债券差价收入	734,324.08	4,011,445.23

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖贵金属交易。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日	上年度可比期间（2023年01
----	----------------	-----------------

	至 2024 年 12 月 31 日)	月 01 日至 2023 年 12 月 31 日)
股指期货投资收益	28,233,680.03	—

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 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	90,768,022.74	52,135,812.42
其中：证券出借权益补偿收入	4,865,456.79	7,693,535.93
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	90,768,022.74	52,135,812.42

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 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	1,020,559,083.57	8,975,541.12
股票投资	1,020,559,083.57	9,116,510.22
债券投资	—	-140,969.10
资产支持证券投资	—	—
基金投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他	—	—
2. 衍生工具	-9,030,573.51	—
权证投资	—	—
股指期货	-9,030,573.51	—
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	1,011,528,510.06	8,975,541.12

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 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	—	—
替代损益	-18,229,209.80	20,281,525.70
其他	—	33,188.00
合计	-18,229,209.80	20,314,713.70

7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年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	63,000.00	63,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
银行费用	61,471.38	30,916.00
其他	170,000.00	170,000.00
合计	414,471.38	383,916.00

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

经中国证监会于2025年1月17日批复核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自本次吸收合并交割日（即2025年3月14日）起，合并后的国泰君安（以下简称“存续公司”）承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持本公司股权亦归属于存续公司，即存续公司成为本公司的主要股东。公司将根据中国证监会批复和相关法律法规的要求办理主要股东变更相关事宜，并及时履行信息披露义务，维护基金份额持有人的合法权益。

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
富国中证1000交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
山东省金融资产管理股份有限公司	基金管理人的股东

加拿大蒙特利尔银行

基金管理人的股东

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。

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（%）
海通证券	794,566,689.76	3.92	102,591,639.39	0.50
申万宏源	31,668,404.72	0.16	24,347,615.84	0.12

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
海通证券	453,508.06	7.75	1,737,970.91	8.54
申万宏源	—	—	430,680.35	2.12

7.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

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 (%)
海通证券	123,435.93	3.48	104,486.01	10.42
申万宏源	10,131.99	0.29	2,984.13	0.30
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 (%)
海通证券	74,805.54	2.26	27,494.64	2.48
申万宏源	17,709.07	0.54	3,543.81	0.32

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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。相关佣金协议已根据此规定完成了更新。

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	32,163,579.52	28,273,905.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	387,635.73	954,958.64
应支付基金管理人的净管理费	31,775,943.79	27,318,946.51

注：2024年11月19日前，基金管理费按前一日的基金资产净值的0.50%的年费率计提。自2024年11月19日起，基金管理费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

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	6,654,452.57	5,654,781.00

注：2024年11月19日前，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。自2024年11月19日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.05%的年费率计提。

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

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

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

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

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

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

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

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自有资金投资本基金的情况

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

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

份额单位：份

关联方名称	本期末（2024年12月31日）		上期末（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（%）
富国中证1000交易型开放式指数证券投资基金联接基金	37,937,815.00	1.03	17,482,228.00	0.80
海通证券股份有限公司	652,160.00	0.02	242,390.00	0.01
申万宏源证券有限公司	368,162.00	0.01	110,450,875.00	5.05

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
中国银行股份有限公司	63,246,025.57	176,656.15	28,091,960.01	112,329.18

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2024年01月01日至2024年12月31日）

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	301565	中仑新材	IPO 网下申购	7,103	84,383.64
海通证券股份有限公司	603344	星德胜	IPO 网下申购	1,813	34,773.34
海通证券股份有限公司	688721	龙图光罩	IPO 网下申购	2,786	51,541.00

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2023年01月01日至2023年12月31日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	301525	儒竞科技	IPO 网下申购	2,660	264,856.20
海通证券股份有限公司	301568	思泰克	IPO 网下申购	2,456	57,052.88
海通证券股份有限公司	688347	华虹公司	IPO 网下申购	82,606	4,295,512.00
海通证券股份有限公司	688469	芯联集成	IPO 网下申购	137,994	785,185.86
海通证券股份有限公司	688507	索辰科技	IPO 网下申购	1,495	367,112.20
海通证券股份有限公司	688515	裕太微	IPO 网下申购	4,183	386,760.18
海通证券股份有限公司	688531	日联科技	IPO 网下申购	3,460	527,234.80
海通证券股份有限公司	688548	广钢气体	IPO 网下申购	40,476	399,498.12
海通证券股份有限公司	688716	中研股份	IPO 网下申购	2,668	79,132.88

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301522	上大股份	2024-10-09	6个月	新股限售	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	—
301551	无线传媒	2024-09-19	6个月	新股限售	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	—
301552	科力装备	2024-07-15	6个月	新股限售	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	—
301556	托普云农	2024-10-10	6个月	新股限售	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	—
301571	国科天成	2024-08-14	6个月	新股限售	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	—
301585	蓝宇股份	2024-12-10	6个月	新股限售	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	—
301586	佳力奇	2024-08-21	6个月	新股限售	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	—
301603	乔锋智能	2024-07-03	6个月	新股限售	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	—
301607	富特科技	2024-08-28	6个月	新股限售	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	—
301608	博实结	2024-07-25	6个月	新股限售	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	—
301611	珂玛科技	2024-08-07	6个月	新股限售	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	—
301613	新铝时代	2024-10-18	6个月	新股限售	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	—
301617	博苑股份	2024-12-03	6个月	新股限售	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	—
301622	英思特	2024-11-26	6个月	新股限售	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	—
301626	苏州天脉	2024-10-17	6个月	新股限售	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	—
603072	天和磁材	2024-12-24	1个月内 (含)	新股认购	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	—
603072	天和磁材	2024-12-24	6个月	新股限售	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	—
603194	中力股份	2024-12-17	6个月	新股限售	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	—
603207	小方制药	2024-08-19	6个月	新股限售	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	—
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	新股限售	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	—
603310	巍华新材	2024-08-07	6个月	新股限售	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	—
603395	红四方	2024-11-19	6个月	新股限售	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	—
688449	联芸科技	2024-11-20	6个月	新股限售	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	—
688708	佳驰科技	2024-11-27	6个月	新股限售	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	—
688721	龙图光罩	2024-07-30	6个月	新股限售	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	—
688726	拉普拉斯	2024-10-22	6个月	新股限售	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	—
688750	金天钛业	2024-11-12	6个月	新股限售	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	—

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688139	海尔生物	2024年12月23日	重大事项停牌	35.20	2025年01月07日	30.60	255,335.00	8,605,364.27	8,987,792.00	—

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

注：截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
AAA	—	—
AAA 以下	—	654,647.35
未评级	—	—
合计	—	654,647.35

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的信用债。本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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

单位：人民币元

本期末（2024年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	63,246,025.57	—	—	—	—	—	63,246,025.57
结算备付金	97,120,033.57	—	—	—	—	—	97,120,033.57
存出保证金	893,700.74	—	—	—	—	21,022,867.20	21,916,567.94
交易性金融资产	—	—	—	—	—	8,753,556,231.94	8,753,556,231.94
应收清算款	—	—	—	—	—	1,097.80	1,097.80
资产总计	161,259,759.88	—	—	—	—	8,774,580,196.94	8,935,839,956.82
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	538,699.81	538,699.81
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,201,966.30	1,201,966.30
应付托管费	—	—	—	—	—	400,655.43	400,655.43
应交税费	—	—	—	—	—	168,559.15	168,559.15
其他负债	—	—	—	—	—	1,113,839.39	1,113,839.39
负债总计	—	—	—	—	—	3,423,720.08	3,423,720.08
利率敏感度缺口	161,259,759.88	—	—	—	—	8,771,156,476.86	8,932,416,236.74
上年度末（2023年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	28,091,960.01	—	—	—	—	—	28,091,960.01
结算备付金	10,526,310.20	—	—	—	—	—	10,526,310.20
存出保证金	214,658.09	—	—	—	—	—	214,658.09

交易性金融资产	—	—	654,647.35	—	—	5,145,765,346.02	5,146,419,993.37
应收清算款	—	—	—	—	—	13,671,327.75	13,671,327.75
应收股利	—	—	—	—	—	1,740.00	1,740.00
其他资产	—	—	—	—	—	313,905.58	313,905.58
资产总计	38,832,928.30	—	654,647.35	—	—	5,159,752,319.35	5,199,239,895.00
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	18,968,940.32	18,968,940.32
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,149,490.42	2,149,490.42
应付托管费	—	—	—	—	—	429,898.09	429,898.09
应交税费	—	—	—	—	—	45,589.48	45,589.48
其他负债	—	—	—	—	—	1,318,954.78	1,318,954.78
负债总计	—	—	—	—	—	22,912,873.09	22,912,873.09
利率敏感度缺口	38,832,928.30	—	654,647.35	—	—	5,136,839,446.26	5,176,327,021.91

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）。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（包含主板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、股票期权等）、货币市场工具以及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）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为

准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（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	8,753,556,231.94	98.00	5,145,765,346.02	99.41
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	654,647.35	0.01
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	8,753,556,231.94	98.00	5,146,419,993.37	99.42

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年12月31日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	88,922,248.15	51,463,377.17
2. 业绩比较基准减少 1%	-88,922,248.15	-51,463,377.17	

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。

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	8,744,080,691.59	5,131,276,634.40
第二层次	9,015,528.50	11,806,174.15
第三层次	460,011.85	3,337,184.82
合计	8,753,556,231.94	5,146,419,993.37

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

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）		合计
	交易性金融资产		
	债券投资	股票投资	

期初余额	—	3,337,184.82	3,337,184.82
当期购买	—	340,887.09	340,887.09
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	2,911,903.73	2,911,903.73
当期利得或损失总额	—	-306,156.33	-306,156.33
其中：计入损益的利得或损失	—	-306,156.33	-306,156.33
期末余额	—	460,011.85	460,011.85
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	—	273,420.65	273,420.65
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	—	1,496,345.97	1,496,345.97
当期购买	—	5,191,444.96	5,191,444.96
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	3,251,919.52	3,251,919.52
当期利得或损失总额	—	-98,686.59	-98,686.59
其中：计入损益的利得或损失	—	-98,686.59	-98,686.59
期末余额	—	3,337,184.82	3,337,184.82
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	—	-503,291.36	-503,291.36

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	460,011.85	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.3423-4.9648	负相关

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	3,337,184.82	平均价格 亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1855- 2.1752	负相关

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	8,753,556,231.94	97.96
	其中：股票	8,753,556,231.94	97.96
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	160,366,059.14	1.79
8	其他各项资产	21,917,665.74	0.25
9	合计	8,935,839,956.82	100.00

注：上表中的股票投资金额含可退替代款估值增值

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

8.2.1.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	57,443,292.02	0.64
B	采矿业	214,620,041.10	2.40
C	制造业	5,678,900,581.49	63.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	243,227,244.02	2.72
E	建筑业	150,134,320.25	1.68
F	批发和零售业	271,829,336.85	3.04
G	交通运输、仓储和邮政业	282,259,316.32	3.16
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,029,416,737.24	11.52
J	金融业	246,190,368.40	2.76
K	房地产业	141,834,263.08	1.59
L	租赁和商务服务业	168,019,905.23	1.88
M	科学研究和技术服务业	68,970,264.06	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	67,833,242.67	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	28,317,015.60	0.32
R	文化、体育和娱乐业	104,072,512.26	1.17
S	综合	—	—
	合计	8,753,068,440.59	97.99

8.2.1.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—

B	采矿业	—	—
C	制造业	402,403.40	0.00
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	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	85,344.95	0.00
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
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	487,748.35	0.01

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	002456	欧菲光	4,518,695	54,133,966.10	0.61
2	002851	麦格米特	600,494	36,906,361.24	0.41
3	002130	沃尔核材	1,386,000	34,996,500.00	0.39
4	300757	罗博特科	148,340	33,423,968.80	0.37
5	688608	恒玄科技	97,920	31,860,230.40	0.36
6	002405	四维图新	3,243,500	31,267,340.00	0.35
7	600171	上海贝岭	774,500	30,732,160.00	0.34
8	300346	南大光电	788,470	30,427,057.30	0.34
9	000528	柳工	2,167,345	26,138,180.70	0.29
10	688027	国盾量子	87,171	26,008,339.56	0.29
11	688235	百济神州	156,394	25,182,561.88	0.28
12	603005	晶方科技	890,595	25,159,308.75	0.28
13	002837	英维克	607,307	24,535,202.80	0.27
14	600363	联创光电	497,300	23,810,724.00	0.27
15	300458	全志科技	607,310	23,539,335.60	0.26
16	001696	宗申动力	938,700	23,373,630.00	0.26
17	002139	拓邦股份	1,707,900	23,244,519.00	0.26
18	002402	和而泰	1,264,100	22,892,851.00	0.26

19	600100	同方股份	3,210,700	22,828,077.00	0.26
20	300623	捷捷微电	666,148	22,755,615.68	0.25
21	002312	川发龙蟒	1,548,875	22,412,221.25	0.25
22	000415	渤海租赁	5,928,600	22,350,822.00	0.25
23	300085	银之杰	580,900	22,219,425.00	0.25
24	300459	汤姆猫	3,842,900	22,058,246.00	0.25
25	300088	长信科技	3,360,200	21,975,708.00	0.25
26	605589	圣泉集团	927,322	21,866,252.76	0.24
27	300857	协创数据	201,000	21,484,890.00	0.24
28	002126	银轮股份	1,139,600	21,333,312.00	0.24
29	002583	海能达	1,493,000	21,215,530.00	0.24
30	600559	老白干酒	1,002,400	21,040,376.00	0.24
31	300679	电连技术	348,500	20,805,450.00	0.23
32	000766	通化金马	1,324,801	20,799,375.70	0.23
33	688347	华虹公司	445,481	20,701,502.07	0.23
34	300315	掌趣科技	3,741,700	20,579,350.00	0.23
35	601677	明泰铝业	1,703,335	20,491,120.05	0.23
36	688018	乐鑫科技	91,163	19,873,534.00	0.22
37	000099	中信海直	741,900	19,556,484.00	0.22
38	300068	南都电源	1,192,500	19,246,950.00	0.22
39	002400	省广集团	2,385,949	19,063,732.51	0.21
40	300077	国民技术	797,900	19,021,936.00	0.21
41	688568	中科星图	371,856	18,975,811.68	0.21
42	601777	千里科技	2,478,100	18,957,465.00	0.21
43	300627	华测导航	450,500	18,830,900.00	0.21
44	002497	雅化集团	1,577,900	18,461,430.00	0.21
45	300779	惠城环保	188,220	18,370,272.00	0.21
46	688037	芯源微	218,436	18,267,802.68	0.20
47	688116	天奈科技	469,400	18,217,414.00	0.20
48	300762	上海瀚讯	860,620	18,098,838.60	0.20
49	300115	长盈精密	1,112,000	18,058,880.00	0.20
50	300296	利亚德	2,773,600	17,861,984.00	0.20
51	300568	星源材质	1,834,900	17,835,228.00	0.20
52	300666	江丰电子	254,555	17,678,844.75	0.20
53	300229	拓尔思	838,156	17,550,986.64	0.20
54	002176	江特电机	2,335,200	17,303,832.00	0.19
55	603236	移远通信	251,239	17,194,797.16	0.19
56	300253	卫宁健康	2,396,000	17,155,360.00	0.19
57	002389	航天彩虹	950,300	17,152,915.00	0.19
58	300182	捷成股份	2,918,100	17,129,247.00	0.19
59	600072	中船科技	1,218,461	17,119,377.05	0.19

60	688019	安集科技	122,825	17,116,892.00	0.19
61	002506	协鑫集成	6,406,200	17,104,554.00	0.19
62	002245	蔚蓝锂芯	1,578,030	16,869,140.70	0.19
63	600577	精达股份	2,311,800	16,853,022.00	0.19
64	688343	云天励飞	337,438	16,736,924.80	0.19
65	002222	福晶科技	515,781	16,711,304.40	0.19
66	300170	汉得信息	1,347,400	16,707,760.00	0.19
67	601975	招商南油	5,301,400	16,593,382.00	0.19
68	002416	爱施德	1,017,900	16,561,233.00	0.19
69	688050	爱博医疗	181,194	16,494,089.82	0.18
70	601375	中原证券	3,776,000	16,312,320.00	0.18
71	002617	露笑科技	2,114,000	16,172,100.00	0.18
72	601333	广深铁路	4,631,100	15,884,673.00	0.18
73	600323	瀚蓝环境	670,400	15,834,848.00	0.18
74	300570	太辰光	217,600	15,819,520.00	0.18
75	688266	泽璟制药	253,330	15,784,992.30	0.18
76	002151	北斗星通	593,534	15,752,392.36	0.18
77	002145	中核钛白	3,705,050	15,709,412.00	0.18
78	000875	吉电股份	2,979,100	15,670,066.00	0.18
79	002003	伟星股份	1,103,756	15,640,222.52	0.18
80	600446	金证股份	907,200	15,640,128.00	0.18
81	300432	富临精工	1,004,600	15,450,748.00	0.17
82	605111	新洁能	454,843	15,423,726.13	0.17
83	600388	龙净环保	1,217,900	15,406,435.00	0.17
84	300738	奥飞数据	1,056,440	15,318,380.00	0.17
85	000686	东北证券	1,921,300	15,255,122.00	0.17
86	300045	华力创通	724,400	15,132,716.00	0.17
87	600601	方正科技	3,437,800	15,091,942.00	0.17
88	300674	宇信科技	772,240	15,074,124.80	0.17
89	002075	沙钢股份	2,406,600	15,065,316.00	0.17
90	600761	安徽合力	851,400	15,027,210.00	0.17
91	000628	高新发展	240,600	14,986,974.00	0.17
92	000581	威孚高科	789,875	14,912,840.00	0.17
93	601528	瑞丰银行	2,646,680	14,900,808.40	0.17
94	603083	剑桥科技	367,000	14,900,200.00	0.17
95	300083	创世纪	2,279,700	14,840,847.00	0.17
96	600331	宏达股份	1,945,700	14,826,234.00	0.17
97	300181	佐力药业	960,000	14,745,600.00	0.17
98	300735	光弘科技	526,700	14,742,333.00	0.17
99	002807	江阴银行	3,363,020	14,629,137.00	0.16
100	600216	浙江医药	919,250	14,579,305.00	0.16

101	688208	道通科技	371,832	14,560,941.12	0.16
102	600718	东软集团	1,338,600	14,416,722.00	0.16
103	002484	江海股份	815,000	14,327,700.00	0.16
104	600908	无锡银行	2,407,600	14,228,916.00	0.16
105	002698	博实股份	836,100	14,213,700.00	0.16
106	002936	郑州银行	6,767,901	14,212,592.10	0.16
107	300035	中科电气	939,300	14,042,535.00	0.16
108	600186	莲花控股	2,461,200	14,028,840.00	0.16
109	000681	视觉中国	672,100	13,993,122.00	0.16
110	600602	云赛智联	883,650	13,979,343.00	0.16
111	002701	奥瑞金	2,459,700	13,946,499.00	0.16
112	601222	林洋能源	1,971,500	13,938,505.00	0.16
113	600667	太极实业	2,013,300	13,932,036.00	0.16
114	300672	国科微	208,588	13,923,249.00	0.16
115	000860	顺鑫农业	711,230	13,847,648.10	0.16
116	000970	中科三环	1,332,090	13,813,773.30	0.15
117	002036	联创电子	1,465,200	13,772,880.00	0.15
118	688327	云从科技	1,137,248	13,760,700.80	0.15
119	600285	羚锐制药	620,900	13,759,144.00	0.15
120	000917	电广传媒	1,944,300	13,746,201.00	0.15
121	600728	佳都科技	2,926,700	13,696,956.00	0.15
122	600133	东湖高新	1,459,100	13,642,585.00	0.15
123	002249	大洋电机	2,323,100	13,636,597.00	0.15
124	000951	中国重汽	802,917	13,633,530.66	0.15
125	300777	中简科技	481,900	13,632,951.00	0.15
126	300438	鹏辉能源	483,750	13,598,212.50	0.15
127	600562	国睿科技	681,000	13,572,330.00	0.15
128	002428	云南锗业	717,000	13,551,300.00	0.15
129	300773	拉卡拉	765,100	13,542,270.00	0.15
130	300101	振芯科技	622,500	13,483,350.00	0.15
131	600850	电科数字	561,550	13,421,045.00	0.15
132	688183	生益电子	341,314	13,399,987.64	0.15
133	600452	涪陵电力	1,264,744	13,393,638.96	0.15
134	300624	万兴科技	211,764	13,372,896.60	0.15
135	000690	宝新能源	2,982,303	13,360,717.44	0.15
136	600338	西藏珠峰	1,250,200	13,339,634.00	0.15
137	002747	埃斯顿	713,900	13,207,150.00	0.15
138	300133	华策影视	1,821,900	13,154,118.00	0.15
139	300775	三角防务	526,300	13,120,659.00	0.15
140	000422	湖北宜化	1,038,200	13,102,084.00	0.15
141	601137	博威合金	642,800	13,048,840.00	0.15

142	600120	浙江东方	2,798,300	13,040,078.00	0.15
143	600641	万业企业	889,600	13,005,952.00	0.15
144	300827	上能电气	295,703	12,981,361.70	0.15
145	688676	金盘科技	313,309	12,977,258.78	0.15
146	300303	聚飞光电	1,902,480	12,974,913.60	0.15
147	000829	天音控股	983,764	12,966,009.52	0.15
148	688408	中信博	179,355	12,913,560.00	0.14
149	300525	博思软件	828,020	12,900,551.60	0.14
150	600064	南京高科	1,660,000	12,898,200.00	0.14
151	603871	嘉友国际	664,532	12,858,694.20	0.14
152	002335	科华数据	443,600	12,828,912.00	0.14
153	600877	电科芯片	971,800	12,818,042.00	0.14
154	603766	隆鑫通用	1,407,100	12,804,610.00	0.14
155	688088	虹软科技	330,272	12,735,288.32	0.14
156	688318	财富趋势	74,471	12,734,541.00	0.14
157	600206	有研新材	811,100	12,709,937.00	0.14
158	300348	长亮科技	885,400	12,661,220.00	0.14
159	300638	广和通	627,662	12,647,389.30	0.14
160	600771	广誉远	670,016	12,636,501.76	0.14
161	000627	天茂集团	2,703,407	12,624,910.69	0.14
162	000810	创维数字	789,400	12,567,248.00	0.14
163	300294	博雅生物	414,800	12,560,144.00	0.14
164	605090	九丰能源	440,200	12,558,906.00	0.14
165	600864	哈投股份	1,704,700	12,529,545.00	0.14
166	600399	抚顺特钢	2,159,100	12,522,780.00	0.14
167	688322	奥比中光	268,945	12,505,942.50	0.14
168	603300	海南华铁	2,156,400	12,463,992.00	0.14
169	300811	铂科新材	231,003	12,453,371.73	0.14
170	603662	柯力传感	192,700	12,448,420.00	0.14
171	002270	华明装备	736,000	12,431,040.00	0.14
172	002745	木林森	1,423,373	12,411,812.56	0.14
173	000620	新华联	5,638,471	12,348,251.49	0.14
174	688484	南芯科技	341,255	12,298,830.20	0.14
175	000762	西藏矿业	572,000	12,298,000.00	0.14
176	002221	东华能源	1,293,800	12,278,162.00	0.14
177	000543	皖能电力	1,551,700	12,273,947.00	0.14
178	688166	博瑞医药	405,513	12,246,492.60	0.14
179	001301	尚太科技	178,500	12,236,175.00	0.14
180	002396	星网锐捷	644,200	12,233,358.00	0.14
181	600986	浙文互联	2,038,500	12,190,230.00	0.14
182	300180	华峰超纤	1,931,100	12,165,930.00	0.14

183	300783	三只松鼠	329,800	12,159,726.00	0.14
184	300657	弘信电子	536,000	12,145,760.00	0.14
185	002354	天娱数科	2,261,200	12,142,644.00	0.14
186	600246	万通发展	1,624,900	12,105,505.00	0.14
187	301050	雷电微力	234,432	12,092,002.56	0.14
188	000801	四川九洲	841,500	12,041,865.00	0.13
189	300456	赛微电子	700,900	12,041,462.00	0.13
190	600330	天通股份	1,693,416	12,023,253.60	0.13
191	603063	禾望电气	602,150	12,018,914.00	0.13
192	002063	远光软件	2,086,600	12,018,816.00	0.13
193	002544	普天科技	560,800	12,017,944.00	0.13
194	600827	百联股份	1,098,000	12,001,140.00	0.13
195	000680	山推股份	1,235,700	11,986,290.00	0.13
196	300298	三诺生物	463,200	11,955,192.00	0.13
197	600621	华鑫股份	725,400	11,954,592.00	0.13
198	300409	道氏技术	877,300	11,940,053.00	0.13
199	002123	梦网科技	1,098,700	11,876,947.00	0.13
200	300319	麦捷科技	951,100	11,869,728.00	0.13
201	002127	南极电商	2,690,600	11,838,640.00	0.13
202	300075	数字政通	682,780	11,812,094.00	0.13
203	600635	大众公用	2,653,900	11,809,855.00	0.13
204	600552	凯盛科技	1,035,000	11,809,350.00	0.13
205	000682	东方电子	1,101,400	11,795,994.00	0.13
206	600821	金开新能	2,183,800	11,792,520.00	0.13
207	000503	国新健康	1,073,300	11,784,834.00	0.13
208	600750	江中药业	518,400	11,767,680.00	0.13
209	000676	智度股份	1,384,991	11,717,023.86	0.13
210	300166	东方国信	1,246,040	11,712,776.00	0.13
211	002839	张家港行	2,676,800	11,697,616.00	0.13
212	301078	孩子王	1,026,417	11,680,625.46	0.13
213	000035	中国天楹	2,397,400	11,675,338.00	0.13
214	601126	四方股份	685,900	11,632,864.00	0.13
215	002174	游族网络	1,243,900	11,630,465.00	0.13
216	300130	新国都	535,600	11,601,096.00	0.13
217	603920	世运电路	392,968	11,553,259.20	0.13
218	300049	福瑞股份	365,400	11,524,716.00	0.13
219	300379	东方通	763,400	11,519,706.00	0.13
220	300598	诚迈科技	237,962	11,517,360.80	0.13
221	688333	铂力特	291,563	11,496,329.09	0.13
222	603678	火炬电子	376,617	11,486,818.50	0.13
223	300036	超图软件	676,411	11,485,458.78	0.13

224	600422	昆药集团	724,400	11,481,740.00	0.13
225	600179	安通控股	4,049,756	11,460,809.48	0.13
226	600572	康恩贝	2,456,700	11,448,222.00	0.13
227	300776	帝尔激光	179,899	11,437,978.42	0.13
228	601860	紫金银行	4,013,000	11,437,050.00	0.13
229	300327	中颖电子	466,710	11,420,393.70	0.13
230	603283	赛腾股份	165,100	11,418,316.00	0.13
231	600596	新安股份	1,296,300	11,381,514.00	0.13
232	002317	众生药业	932,736	11,332,742.40	0.13
233	601020	华钰矿业	897,900	11,331,498.00	0.13
234	603306	华懋科技	358,296	11,325,736.56	0.13
235	688200	华峰测控	108,200	11,306,900.00	0.13
236	002654	万润科技	928,700	11,265,131.00	0.13
237	688596	正帆科技	316,838	11,263,590.90	0.13
238	603565	中谷物流	1,147,100	11,241,580.00	0.13
239	300236	上海新阳	300,653	11,235,402.61	0.13
240	000969	安泰科技	1,006,800	11,225,820.00	0.13
241	688141	杰华特	366,548	11,220,034.28	0.13
242	000685	中山公用	1,213,800	11,203,374.00	0.13
243	000902	新洋丰	859,000	11,201,360.00	0.13
244	002948	青岛银行	2,885,900	11,197,292.00	0.13
245	300113	顺网科技	665,600	11,188,736.00	0.13
246	002183	怡亚通	2,489,900	11,179,651.00	0.13
247	600456	宝钛股份	392,200	11,158,090.00	0.12
248	603881	数据港	490,471	11,109,168.15	0.12
249	600185	格力地产	1,544,400	11,104,236.00	0.12
250	002675	东诚药业	906,194	11,073,690.68	0.12
251	600587	新华医疗	664,931	11,071,101.15	0.12
252	601778	晶科科技	3,916,700	11,045,094.00	0.12
253	688016	心脉医疗	100,401	11,029,049.85	0.12
254	688582	芯动联科	218,822	11,008,934.82	0.12
255	600420	国药现代	921,500	11,002,710.00	0.12
256	300185	通裕重工	4,274,100	10,984,437.00	0.12
257	600210	紫江企业	1,660,000	10,972,600.00	0.12
258	002239	奥特佳	3,597,100	10,971,155.00	0.12
259	600151	航天机电	1,373,500	10,960,530.00	0.12
260	688498	源杰科技	81,555	10,944,681.00	0.12
261	300576	容大感光	241,976	10,932,475.68	0.12
262	002906	华阳集团	355,300	10,925,475.00	0.12
263	301171	易点天下	387,500	10,923,625.00	0.12
264	600633	浙数文化	1,043,500	10,915,010.00	0.12

265	300026	红日药业	2,878,850	10,910,841.50	0.12
266	600595	中孚实业	3,852,300	10,902,009.00	0.12
267	300663	科蓝软件	626,500	10,876,040.00	0.12
268	688289	圣湘生物	478,831	10,869,463.70	0.12
269	002315	焦点科技	260,000	10,836,800.00	0.12
270	002215	诺普信	964,400	10,830,212.00	0.12
271	600269	赣粤高速	1,926,000	10,804,860.00	0.12
272	002681	奋达科技	1,730,800	10,800,192.00	0.12
273	002332	仙琚制药	1,084,317	10,778,110.98	0.12
274	688409	富创精密	208,848	10,770,291.36	0.12
275	600993	马应龙	412,000	10,757,320.00	0.12
276	600428	中远海特	1,473,600	10,757,280.00	0.12
277	300087	荃银高科	910,230	10,740,714.00	0.12
278	002182	宝武镁业	951,180	10,729,310.40	0.12
279	300475	香农芯创	375,300	10,692,297.00	0.12
280	002597	金禾实业	468,000	10,684,440.00	0.12
281	600320	振华重工	2,724,300	10,679,256.00	0.12
282	601678	滨化股份	2,828,700	10,635,912.00	0.12
283	603323	苏农银行	2,009,700	10,631,313.00	0.12
284	300109	新开源	665,303	10,611,582.85	0.12
285	600273	嘉化能源	1,330,986	10,607,958.42	0.12
286	002020	京新药业	828,322	10,602,521.60	0.12
287	300079	数码视讯	1,954,300	10,572,763.00	0.12
288	688110	东芯股份	424,045	10,558,720.50	0.12
289	603393	新天然气	348,600	10,552,122.00	0.12
290	002292	奥飞娱乐	1,219,000	10,544,350.00	0.12
291	300284	苏交科	1,038,076	10,536,471.40	0.12
292	600201	生物股份	1,535,909	10,536,335.74	0.12
293	000429	粤高速A	714,100	10,497,270.00	0.12
294	600114	东睦股份	648,800	10,491,096.00	0.12
295	603108	润达医疗	655,905	10,448,566.65	0.12
296	600123	兰花科创	1,219,960	10,442,857.60	0.12
297	002171	楚江新材	1,273,200	10,440,240.00	0.12
298	002212	天融信	1,617,600	10,433,520.00	0.12
299	002015	协鑫能科	1,333,842	10,350,613.92	0.12
300	000727	冠捷科技	3,721,000	10,344,380.00	0.12
301	300678	中科信息	283,600	10,314,532.00	0.12
302	600759	洲际油气	4,540,600	10,307,162.00	0.12
303	600461	洪城环境	1,035,000	10,298,250.00	0.12
304	601187	厦门银行	1,813,900	10,230,396.00	0.11
305	688503	聚和材料	230,808	10,222,486.32	0.11

306	300457	赢合科技	533,850	10,217,889.00	0.11
307	601718	际华集团	3,596,000	10,212,640.00	0.11
308	002541	鸿路钢构	568,530	10,193,742.90	0.11
309	601519	大智慧	1,096,323	10,140,987.75	0.11
310	688029	南微医学	149,909	10,132,349.31	0.11
311	002351	漫步者	610,500	10,073,250.00	0.11
312	300618	寒锐钴业	297,400	10,043,198.00	0.11
313	002832	比音勒芬	468,275	10,025,767.75	0.11
314	002567	唐人神	1,958,700	9,989,370.00	0.11
315	002421	达实智能	2,907,900	9,974,097.00	0.11
316	300685	艾德生物	436,967	9,962,847.60	0.11
317	600916	中国黄金	1,155,100	9,956,962.00	0.11
318	688279	峰岬科技	63,117	9,953,550.90	0.11
319	600037	歌华有线	1,334,220	9,953,281.20	0.11
320	002488	金固股份	952,800	9,947,232.00	0.11
321	300027	华谊兄弟	3,793,673	9,939,423.26	0.11
322	603997	继峰股份	868,000	9,938,600.00	0.11
323	000012	南玻A	1,881,000	9,931,680.00	0.11
324	300034	钢研高纳	635,960	9,920,976.00	0.11
325	600057	厦门象屿	1,524,927	9,896,776.23	0.11
326	600550	保变电气	1,260,500	9,894,925.00	0.11
327	600645	中源协和	512,500	9,891,250.00	0.11
328	002265	建设工业	424,200	9,871,134.00	0.11
329	603505	金石资源	415,204	9,856,942.96	0.11
330	002773	康弘药业	502,500	9,849,000.00	0.11
331	002091	江苏国泰	1,340,530	9,812,679.60	0.11
332	002004	华邦健康	2,166,334	9,791,829.68	0.11
333	002100	天康生物	1,492,100	9,773,255.00	0.11
334	000420	吉林化纤	2,696,800	9,735,448.00	0.11
335	300188	国投智能	705,747	9,732,251.13	0.11
336	002649	博彦科技	801,447	9,713,537.64	0.11
337	600717	天津港	1,982,585	9,655,188.95	0.11
338	000062	深圳华强	430,800	9,649,920.00	0.11
339	601963	重庆银行	1,035,800	9,612,224.00	0.11
340	600267	海正药业	1,154,600	9,583,180.00	0.11
341	603220	中贝通信	416,390	9,564,478.30	0.11
342	300910	瑞丰新材	200,636	9,548,267.24	0.11
343	600967	内蒙一机	1,122,300	9,539,550.00	0.11
344	600328	中盐化工	1,209,694	9,520,291.78	0.11
345	002011	盾安环境	878,700	9,498,747.00	0.11
346	301297	富乐德	223,400	9,494,500.00	0.11

347	300655	晶瑞电材	1,013,032	9,481,979.52	0.11
348	000758	中色股份	1,918,500	9,477,390.00	0.11
349	688362	甬矽电子	280,566	9,449,462.88	0.11
350	688063	派能科技	235,891	9,447,434.55	0.11
351	002706	良信股份	1,230,000	9,446,400.00	0.11
352	603398	沐邦高科	409,162	9,414,817.62	0.11
353	002847	盐津铺子	149,810	9,378,106.00	0.10
354	002276	万马股份	1,107,800	9,371,988.00	0.10
355	002668	TCL 智家	714,000	9,367,680.00	0.10
356	603690	至纯科技	371,220	9,321,334.20	0.10
357	000712	锦龙股份	615,700	9,309,384.00	0.10
358	000089	深圳机场	1,349,000	9,294,610.00	0.10
359	603699	纽威股份	417,400	9,253,758.00	0.10
360	600248	陕建股份	2,064,900	9,250,752.00	0.10
361	300613	富瀚微	157,915	9,238,027.50	0.10
362	600252	中恒集团	3,752,800	9,231,888.00	0.10
363	300323	华灿光电	1,114,400	9,227,232.00	0.10
364	603308	应流股份	654,200	9,224,220.00	0.10
365	600409	三友化工	1,701,400	9,187,560.00	0.10
366	300693	盛弘股份	340,375	9,176,510.00	0.10
367	688702	盛科通信	109,200	9,172,800.00	0.10
368	600116	三峡水利	1,312,261	9,172,704.39	0.10
369	688076	诺泰生物	176,667	9,172,550.64	0.10
370	002643	万润股份	764,000	9,168,000.00	0.10
371	002895	川恒股份	371,400	9,136,440.00	0.10
372	002079	苏州固锝	887,460	9,114,214.20	0.10
373	300398	飞凯材料	577,900	9,107,704.00	0.10
374	002192	融捷股份	285,300	9,101,070.00	0.10
375	000795	英洛华	933,300	9,081,009.00	0.10
376	002539	云图控股	1,160,600	9,075,892.00	0.10
377	603599	广信股份	747,736	9,010,218.80	0.10
378	000811	冰轮环境	734,500	9,004,970.00	0.10
379	301039	中集车辆	995,000	9,004,750.00	0.10
380	300415	伊之密	448,760	9,002,125.60	0.10
381	600556	天下秀	1,730,100	8,996,520.00	0.10
382	688139	海尔生物	255,335	8,987,792.00	0.10
383	000555	神州信息	800,300	8,963,360.00	0.10
384	300482	万孚生物	397,034	8,897,531.94	0.10
385	688262	国芯科技	321,144	8,895,688.80	0.10
386	000650	仁和药业	1,542,200	8,883,072.00	0.10
387	300747	锐科激光	463,621	8,882,978.36	0.10

388	688798	艾为电子	126,947	8,863,439.54	0.10
389	600729	重庆百货	302,500	8,848,125.00	0.10
390	002716	湖南白银	2,600,700	8,816,373.00	0.10
391	300761	立华股份	452,587	8,807,343.02	0.10
392	688123	聚辰股份	150,260	8,793,215.20	0.10
393	000657	中钨高新	953,860	8,785,050.60	0.10
394	000156	华数传媒	1,220,000	8,784,000.00	0.10
395	001309	德明利	100,620	8,774,064.00	0.10
396	000927	中国铁物	3,331,200	8,761,056.00	0.10
397	002324	普利特	918,100	8,749,493.00	0.10
398	688548	广钢气体	868,700	8,747,809.00	0.10
399	002458	益生股份	908,400	8,729,724.00	0.10
400	600158	中体产业	1,055,300	8,727,331.00	0.10
401	603039	泛微网络	178,100	8,726,900.00	0.10
402	600933	爱柯迪	535,300	8,725,390.00	0.10
403	603588	高能环境	1,665,135	8,725,307.40	0.10
404	002061	浙江交科	2,138,540	8,725,243.20	0.10
405	300682	朗新集团	715,000	8,723,000.00	0.10
406	300633	开立医疗	296,600	8,717,074.00	0.10
407	300641	正丹股份	350,600	8,708,904.00	0.10
408	000923	河钢资源	626,400	8,706,960.00	0.10
409	600055	万东医疗	576,600	8,706,660.00	0.10
410	600266	城建发展	1,707,072	8,706,067.20	0.10
411	600782	新钢股份	2,585,100	8,634,234.00	0.10
412	002010	传化智联	1,905,700	8,632,821.00	0.10
413	600459	贵研铂业	626,820	8,606,238.60	0.10
414	300470	中密控股	228,000	8,595,600.00	0.10
415	600575	淮河能源	2,164,600	8,593,462.00	0.10
416	688332	中科蓝讯	65,761	8,581,810.50	0.10
417	688766	普冉股份	84,400	8,546,344.00	0.10
418	600509	天富能源	1,317,100	8,521,637.00	0.10
419	603027	千禾味业	702,187	8,503,484.57	0.10
420	000821	京山轻机	682,600	8,498,370.00	0.10
421	600012	皖通高速	480,800	8,486,120.00	0.10
422	002468	申通快递	836,700	8,475,771.00	0.09
423	688083	中望软件	98,942	8,466,466.94	0.09
424	603279	景津装备	472,100	8,441,148.00	0.09
425	000735	罗牛山	1,267,000	8,438,220.00	0.09
426	002048	宁波华翔	667,400	8,422,588.00	0.09
427	300357	我武生物	414,400	8,420,608.00	0.09
428	600894	广日股份	576,000	8,409,600.00	0.09

429	000901	航天科技	763,300	8,373,401.00	0.09
430	300352	北信源	1,585,600	8,371,968.00	0.09
431	300031	宝通科技	456,600	8,364,912.00	0.09
432	600480	凌云股份	771,600	8,340,996.00	0.09
433	301293	三博脑科	192,620	8,336,593.60	0.09
434	300620	光库科技	171,180	8,319,348.00	0.09
435	300593	新雷能	740,267	8,290,990.40	0.09
436	300224	正海磁材	672,500	8,278,475.00	0.09
437	601369	陕鼓动力	949,675	8,262,172.50	0.09
438	301029	怡合达	333,888	8,253,711.36	0.09
439	603619	中曼石油	425,650	8,240,584.00	0.09
440	002006	精工科技	499,293	8,238,334.50	0.09
441	300232	洲明科技	1,198,300	8,232,321.00	0.09
442	002446	盛路通信	1,256,700	8,231,385.00	0.09
443	002737	葵花药业	401,600	8,228,784.00	0.09
444	002023	海特高新	809,800	8,219,470.00	0.09
445	600664	哈药股份	1,990,000	8,218,700.00	0.09
446	002726	龙大美食	1,035,529	8,201,389.68	0.09
447	600211	西藏药业	221,490	8,181,840.60	0.09
448	603218	日月股份	678,400	8,174,720.00	0.09
449	002043	兔宝宝	686,300	8,153,244.00	0.09
450	300123	亚光科技	1,403,600	8,140,880.00	0.09
451	688789	宏华数科	122,567	8,135,997.46	0.09
452	300634	彩讯股份	371,800	8,105,240.00	0.09
453	600006	东风股份	1,099,000	8,099,630.00	0.09
454	688629	华丰科技	241,600	8,091,184.00	0.09
455	600138	中青旅	796,700	8,078,538.00	0.09
456	600888	新疆众和	1,135,900	8,064,890.00	0.09
457	600017	日照港	2,519,400	8,062,080.00	0.09
458	600597	光明乳业	943,200	8,054,928.00	0.09
459	603358	华达科技	241,000	8,049,400.00	0.09
460	600063	皖维高新	2,010,900	8,043,600.00	0.09
461	603267	鸿远电子	221,837	8,037,154.51	0.09
462	002099	海翔药业	1,556,500	8,031,540.00	0.09
463	603496	恒为科技	294,600	8,007,228.00	0.09
464	601311	骆驼股份	964,100	7,992,389.00	0.09
465	600757	长江传媒	832,700	7,968,939.00	0.09
466	002237	恒邦股份	788,593	7,964,789.30	0.09
467	000552	甘肃能化	2,890,800	7,949,700.00	0.09
468	600835	上海机电	440,300	7,890,176.00	0.09
469	605507	国邦医药	378,686	7,888,029.38	0.09

470	600502	安徽建工	1,649,800	7,886,044.00	0.09
471	002226	江南化工	1,447,020	7,842,848.40	0.09
472	002254	泰和新材	830,800	7,809,520.00	0.09
473	002761	浙江建投	889,400	7,808,932.00	0.09
474	300244	迪安诊断	688,000	7,808,800.00	0.09
475	000913	钱江摩托	432,700	7,792,927.00	0.09
476	000848	承德露露	868,406	7,789,601.82	0.09
477	002081	金螳螂	2,181,500	7,787,955.00	0.09
478	600366	宁波韵升	1,057,700	7,784,672.00	0.09
479	600059	古越龙山	876,000	7,778,880.00	0.09
480	300463	迈克生物	588,320	7,765,824.00	0.09
481	000028	国药一致	265,190	7,756,807.50	0.09
482	002097	山河智能	1,033,800	7,753,500.00	0.09
483	301071	力量钻石	213,800	7,750,250.00	0.09
484	603337	杰克股份	253,400	7,718,564.00	0.09
485	600971	恒源煤电	819,300	7,709,613.00	0.09
486	600649	城投控股	1,730,185	7,699,323.25	0.09
487	600259	广晟有色	276,800	7,697,808.00	0.09
488	688352	颀中科技	633,900	7,689,207.00	0.09
489	600507	方大特钢	1,895,300	7,675,965.00	0.09
490	600586	金晶科技	1,365,591	7,674,621.42	0.09
491	603197	保隆科技	203,300	7,674,575.00	0.09
492	300602	飞荣达	397,975	7,649,079.50	0.09
493	002993	奥海科技	186,540	7,648,140.00	0.09
494	300772	运达股份	577,140	7,641,333.60	0.09
495	600094	大名城	2,098,600	7,638,904.00	0.09
496	300451	创业慧康	1,704,700	7,637,056.00	0.09
497	600110	诺德股份	1,906,800	7,627,200.00	0.09
498	600787	中储股份	1,194,500	7,620,910.00	0.09
499	002326	永太科技	852,300	7,619,562.00	0.09
500	300770	新媒股份	188,200	7,605,162.00	0.09
501	002163	海南发展	813,300	7,604,355.00	0.09
502	000737	北方铜业	973,500	7,593,300.00	0.09
503	603100	川仪股份	351,760	7,580,428.00	0.08
504	002605	姚记科技	283,800	7,566,108.00	0.08
505	601200	上海环境	925,156	7,558,524.52	0.08
506	300446	航天智造	457,300	7,550,023.00	0.08
507	300260	新莱应材	278,600	7,547,274.00	0.08
508	600478	科力远	1,826,960	7,545,344.80	0.08
509	002815	崇达技术	739,500	7,542,900.00	0.08
510	000928	中钢国际	1,182,700	7,533,799.00	0.08

511	301035	润丰股份	154,331	7,519,006.32	0.08
512	601702	华峰铝业	410,100	7,513,032.00	0.08
513	002233	塔牌集团	979,100	7,509,697.00	0.08
514	600395	盘江股份	1,473,656	7,500,909.04	0.08
515	603281	江瀚新材	306,748	7,484,651.20	0.08
516	300151	昌红科技	439,592	7,473,064.00	0.08
517	600315	上海家化	441,700	7,469,147.00	0.08
518	688127	蓝特光学	275,537	7,467,052.70	0.08
519	000049	德赛电池	316,440	7,439,504.40	0.08
520	300393	中来股份	1,189,300	7,433,125.00	0.08
521	600125	铁龙物流	1,250,600	7,416,058.00	0.08
522	002219	新里程	2,807,300	7,411,272.00	0.08
523	601952	苏垦农发	757,001	7,411,039.79	0.08
524	000837	秦川机床	825,900	7,408,323.00	0.08
525	601028	玉龙股份	644,800	7,389,408.00	0.08
526	000582	北部湾港	936,700	7,381,196.00	0.08
527	688575	亚辉龙	466,780	7,375,124.00	0.08
528	301291	明阳电气	167,900	7,374,168.00	0.08
529	000090	天健集团	1,793,500	7,371,285.00	0.08
530	002038	双鹭药业	985,450	7,361,311.50	0.08
531	300725	药石科技	218,896	7,354,905.60	0.08
532	688739	成大生物	285,203	7,352,533.34	0.08
533	002214	大立科技	659,195	7,350,024.25	0.08
534	600776	东方通信	654,000	7,318,260.00	0.08
535	301219	腾远钴业	161,774	7,313,802.54	0.08
536	600305	恒顺醋业	915,400	7,304,892.00	0.08
537	003021	兆威机电	98,460	7,277,178.60	0.08
538	600458	时代新材	567,500	7,269,675.00	0.08
539	600033	福建高速	1,873,100	7,267,628.00	0.08
540	600623	华谊集团	1,038,100	7,266,700.00	0.08
541	002390	信邦制药	1,595,400	7,259,070.00	0.08
542	688321	微芯生物	390,500	7,255,490.00	0.08
543	000915	华特达因	257,000	7,242,260.00	0.08
544	688403	汇成股份	808,280	7,242,188.80	0.08
545	688100	威胜信息	199,925	7,237,285.00	0.08
546	600869	远东股份	1,520,900	7,224,275.00	0.08
547	002891	中宠股份	202,303	7,222,217.10	0.08
548	300705	九典制药	402,120	7,218,054.00	0.08
549	603866	桃李面包	1,092,294	7,209,140.40	0.08
550	601890	亚星锚链	923,600	7,194,844.00	0.08
551	002635	安洁科技	451,100	7,181,512.00	0.08

552	300687	赛意信息	393,560	7,162,792.00	0.08
553	603033	三维股份	564,427	7,162,578.63	0.08
554	301095	广立微	137,400	7,154,418.00	0.08
555	601900	南方传媒	471,300	7,121,343.00	0.08
556	688270	臻镭科技	203,053	7,106,855.00	0.08
557	600996	贵广网络	831,200	7,106,760.00	0.08
558	300363	博腾股份	449,900	7,094,923.00	0.08
559	600866	星湖科技	1,094,500	7,081,415.00	0.08
560	300119	瑞普生物	384,300	7,059,591.00	0.08
561	600740	山西焦化	1,750,100	7,052,903.00	0.08
562	600773	西藏城投	654,133	7,051,553.74	0.08
563	002077	大港股份	480,200	7,044,534.00	0.08
564	300726	宏达电子	225,800	7,022,380.00	0.08
565	300841	康华生物	128,769	7,020,485.88	0.08
566	600313	农发种业	1,040,000	7,020,000.00	0.08
567	600976	健民集团	168,200	7,010,576.00	0.08
568	600675	中华企业	2,494,200	7,008,702.00	0.08
569	300226	上海钢联	305,743	6,992,342.41	0.08
570	301316	慧博云通	273,359	6,989,789.63	0.08
571	688559	海目星	202,984	6,982,649.60	0.08
572	600490	鹏欣资源	2,117,300	6,965,917.00	0.08
573	300171	东富龙	524,200	6,961,376.00	0.08
574	688192	迪哲医药	167,381	6,941,290.07	0.08
575	603128	华贸物流	1,075,100	6,912,893.00	0.08
576	688326	经纬恒润	82,071	6,902,171.10	0.08
577	002518	科士达	306,200	6,898,686.00	0.08
578	688388	嘉元科技	467,237	6,882,401.01	0.08
579	600169	太原重工	2,752,300	6,853,227.00	0.08
580	688400	凌云光	312,263	6,844,804.96	0.08
581	603713	密尔克卫	133,200	6,819,840.00	0.08
582	000966	长源电力	1,435,700	6,819,575.00	0.08
583	603368	柳药集团	381,687	6,816,929.82	0.08
584	002928	华夏航空	877,400	6,808,624.00	0.08
585	603026	石大胜华	194,400	6,804,000.00	0.08
586	000930	中粮科技	1,223,800	6,792,090.00	0.08
587	000603	盛达资源	565,300	6,777,947.00	0.08
588	002777	久远银海	393,470	6,775,553.40	0.08
589	688779	五矿新能	1,270,800	6,760,656.00	0.08
590	688106	金宏气体	397,057	6,753,939.57	0.08
591	603328	依顿电子	684,700	6,751,142.00	0.08
592	600710	苏美达	724,900	6,741,570.00	0.08

593	000065	北方国际	688,320	6,731,769.60	0.08
594	300596	利安隆	220,475	6,724,487.50	0.08
595	688556	高测股份	601,368	6,723,294.24	0.08
596	600531	豫光金铅	1,046,400	6,717,888.00	0.08
597	000550	江铃汽车	286,400	6,716,080.00	0.08
598	002705	新宝股份	447,100	6,706,500.00	0.08
599	600197	伊力特	388,678	6,704,695.50	0.08
600	002243	力合科创	831,341	6,700,608.46	0.08
601	601500	通用股份	1,256,300	6,696,079.00	0.07
602	300660	江苏雷利	175,000	6,688,500.00	0.07
603	300820	英杰电气	120,850	6,676,962.50	0.07
604	002925	盈趣科技	425,700	6,666,462.00	0.07
605	601619	嘉泽新能	1,999,100	6,637,012.00	0.07
606	601163	三角轮胎	439,800	6,627,786.00	0.07
607	688091	上海谊众	165,681	6,613,985.52	0.07
608	688062	迈威生物	327,383	6,613,136.60	0.07
609	000048	京基智农	366,400	6,595,200.00	0.07
610	002697	红旗连锁	1,112,970	6,577,652.70	0.07
611	600389	江山股份	455,115	6,576,411.75	0.07
612	002108	沧州明珠	1,830,483	6,571,433.97	0.07
613	688696	极米科技	66,912	6,558,714.24	0.07
614	002967	广电计量	399,900	6,558,360.00	0.07
615	002550	千红制药	1,057,500	6,556,500.00	0.07
616	688639	华恒生物	203,197	6,544,975.37	0.07
617	000061	农产品	933,500	6,543,835.00	0.07
618	603583	捷昌驱动	264,400	6,533,324.00	0.07
619	601326	秦港股份	1,948,800	6,528,480.00	0.07
620	600557	康缘药业	478,800	6,521,256.00	0.07
621	601208	东材科技	863,030	6,507,246.20	0.07
622	688612	威迈斯	276,300	6,504,102.00	0.07
623	688522	纳睿雷达	115,400	6,501,636.00	0.07
624	688007	光峰科技	439,594	6,501,595.26	0.07
625	002929	润建股份	193,160	6,494,039.20	0.07
626	688300	联瑞新材	100,820	6,492,808.00	0.07
627	601101	昊华能源	788,800	6,491,824.00	0.07
628	603612	索通发展	479,410	6,476,829.10	0.07
629	002537	海联金汇	1,124,600	6,466,450.00	0.07
630	600775	南京熊猫	643,700	6,462,748.00	0.07
631	600751	海航科技	2,457,200	6,462,436.00	0.07
632	002068	黑猫股份	607,200	6,460,608.00	0.07
633	603305	旭升集团	491,200	6,459,280.00	0.07

634	000990	诚志股份	831,700	6,445,675.00	0.07
635	002291	遥望科技	1,019,200	6,431,152.00	0.07
636	002985	北摩高科	272,631	6,406,828.50	0.07
637	000719	中原传媒	562,600	6,391,136.00	0.07
638	301155	海力风电	119,839	6,388,617.09	0.07
639	000950	重药控股	1,186,734	6,384,628.92	0.07
640	002727	一心堂	489,700	6,375,894.00	0.07
641	688366	昊海生科	105,241	6,375,499.78	0.07
642	300455	航天智装	491,900	6,375,024.00	0.07
643	688372	伟测科技	108,907	6,373,237.64	0.07
644	600163	中闽能源	1,045,501	6,367,101.09	0.07
645	300129	泰胜风能	902,300	6,361,215.00	0.07
646	001287	中电港	312,286	6,342,528.66	0.07
647	600682	南京新百	926,000	6,333,840.00	0.07
648	603888	新华网	283,500	6,333,390.00	0.07
649	300261	雅本化学	923,700	6,327,345.00	0.07
650	002626	金达威	419,000	6,326,900.00	0.07
651	000059	华锦股份	1,320,840	6,326,823.60	0.07
652	603383	顶点软件	168,280	6,310,500.00	0.07
653	300821	东岳硅材	813,100	6,309,656.00	0.07
654	688167	炬光科技	99,017	6,307,382.90	0.07
655	002194	武汉凡谷	559,400	6,276,468.00	0.07
656	000756	新华制药	399,400	6,274,574.00	0.07
657	600882	妙可蓝多	350,200	6,268,580.00	0.07
658	605376	博迁新材	216,200	6,258,990.00	0.07
659	000557	西部创业	1,204,600	6,251,874.00	0.07
660	600073	光明肉业	900,700	6,250,858.00	0.07
661	300366	创意信息	671,000	6,240,300.00	0.07
662	688630	芯碁微装	107,937	6,230,123.64	0.07
663	300039	上海凯宝	1,007,580	6,226,844.40	0.07
664	603477	巨星农牧	350,800	6,226,700.00	0.07
665	002498	汉缆股份	1,834,000	6,217,260.00	0.07
666	688146	中船特气	213,877	6,210,988.08	0.07
667	300134	大富科技	528,600	6,200,478.00	0.07
668	002154	报喜鸟	1,404,800	6,195,168.00	0.07
669	001914	招商积余	584,600	6,179,222.00	0.07
670	002859	洁美科技	296,600	6,154,450.00	0.07
671	300443	金雷股份	308,800	6,151,296.00	0.07
672	600963	岳阳林纸	1,210,200	6,147,816.00	0.07
673	603533	掌阅科技	302,100	6,135,651.00	0.07
674	300183	东软载波	315,700	6,108,795.00	0.07

675	002274	华昌化工	786,013	6,107,321.01	0.07
676	600075	新疆天业	1,403,860	6,106,791.00	0.07
677	000828	东莞控股	570,700	6,100,783.00	0.07
678	600812	华北制药	1,177,800	6,089,226.00	0.07
679	601595	上海电影	246,500	6,088,550.00	0.07
680	603008	喜临门	363,100	6,085,556.00	0.07
681	600648	外高桥	510,600	6,081,246.00	0.07
682	688131	皓元医药	170,177	6,075,318.90	0.07
683	002987	京北方	426,860	6,074,217.80	0.07
684	002511	中顺洁柔	891,400	6,070,434.00	0.07
685	601908	京运通	1,986,300	6,058,215.00	0.07
686	002320	海峡股份	924,600	6,056,130.00	0.07
687	002461	珠江啤酒	609,000	6,023,010.00	0.07
688	300580	贝斯特	261,700	6,006,015.00	0.07
689	603567	珍宝岛	517,500	6,003,000.00	0.07
690	002545	东方铁塔	853,400	5,999,402.00	0.07
691	600217	中再资环	1,131,000	5,994,300.00	0.07
692	603733	仙鹤股份	290,500	5,993,015.00	0.07
693	600861	北京人力	309,510	5,989,018.50	0.07
694	601609	金田股份	1,015,000	5,988,500.00	0.07
695	002960	青鸟消防	511,806	5,972,776.02	0.07
696	688190	云路股份	64,851	5,966,292.00	0.07
697	300855	图南股份	272,160	5,965,747.20	0.07
698	688700	东威科技	202,486	5,965,237.56	0.07
699	002349	精华制药	777,900	5,950,935.00	0.07
700	601969	海南矿业	837,800	5,940,002.00	0.07
701	600449	宁夏建材	395,200	5,935,904.00	0.07
702	600997	开滦股份	876,700	5,926,492.00	0.07
703	688598	金博股份	280,849	5,914,679.94	0.07
704	601801	皖新传媒	800,500	5,875,670.00	0.07
705	002191	劲嘉股份	1,397,729	5,870,461.80	0.07
706	605333	沪光股份	179,500	5,857,085.00	0.07
707	300913	兆龙互连	101,700	5,848,767.00	0.07
708	688066	航天宏图	286,665	5,847,966.00	0.07
709	603638	艾迪精密	345,800	5,840,562.00	0.07
710	601606	长城军工	496,000	5,832,960.00	0.07
711	600477	杭萧钢构	2,265,800	5,823,106.00	0.07
712	300579	数字认证	185,300	5,822,126.00	0.07
713	688502	茂莱光学	28,872	5,814,820.80	0.07
714	600301	华锡有色	341,400	5,807,214.00	0.07
715	002216	三全食品	483,500	5,802,000.00	0.06

716	300416	苏试试验	491,700	5,782,392.00	0.06
717	600961	株冶集团	734,100	5,777,367.00	0.06
718	000488	ST晨鸣	1,889,300	5,762,365.00	0.06
719	603118	共进股份	646,200	5,751,180.00	0.06
720	000881	中广核技	780,100	5,718,133.00	0.06
721	600651	飞乐音响	1,380,500	5,715,270.00	0.06
722	688432	有研硅	504,700	5,703,110.00	0.06
723	603229	奥翔药业	569,808	5,692,381.92	0.06
724	688631	莱斯信息	65,300	5,686,977.00	0.06
725	688006	杭可科技	317,600	5,672,336.00	0.06
726	002060	广东建工	1,549,500	5,671,170.00	0.06
727	601827	三峰环境	660,100	5,663,658.00	0.06
728	000600	建投能源	1,000,600	5,663,396.00	0.06
729	600966	博汇纸业	1,097,400	5,662,584.00	0.06
730	601949	中国出版	788,400	5,660,712.00	0.06
731	300850	新强联	295,000	5,637,450.00	0.06
732	003006	百亚股份	234,900	5,635,251.00	0.06
733	300428	立中集团	345,700	5,634,910.00	0.06
734	600643	爱建集团	1,088,001	5,624,965.17	0.06
735	603317	天味食品	421,600	5,624,144.00	0.06
736	301031	中熔电气	53,904	5,607,094.08	0.06
737	002588	史丹利	759,100	5,602,158.00	0.06
738	301510	固高科技	214,600	5,601,060.00	0.06
739	688439	振华风光	109,070	5,594,200.30	0.06
740	002434	万里扬	901,600	5,589,920.00	0.06
741	002051	中工国际	682,200	5,566,752.00	0.06
742	000029	深深房A	367,400	5,533,044.00	0.06
743	000688	国城矿业	460,400	5,474,156.00	0.06
744	000567	海德股份	801,163	5,471,943.29	0.06
745	001270	铖昌科技	143,406	5,463,768.60	0.06
746	603919	金徽酒	278,540	5,459,384.00	0.06
747	002101	广东鸿图	455,300	5,454,494.00	0.06
748	301363	美好医疗	168,200	5,453,044.00	0.06
749	002258	利尔化学	658,300	5,444,141.00	0.06
750	603876	鼎胜新材	614,440	5,437,794.00	0.06
751	301175	中科环保	1,006,800	5,436,720.00	0.06
752	300406	九强生物	405,300	5,414,808.00	0.06
753	002158	汉钟精机	291,900	5,405,988.00	0.06
754	688515	裕太微	54,590	5,404,410.00	0.06
755	603995	甬金股份	294,670	5,389,514.30	0.06
756	301205	联特科技	71,000	5,373,990.00	0.06

757	002840	华统股份	426,000	5,371,860.00	0.06
758	300527	中船应急	661,310	5,336,771.70	0.06
759	605368	蓝天燃气	466,700	5,334,381.00	0.06
760	000767	晋控电力	2,106,800	5,330,204.00	0.06
761	301325	曼恩斯特	98,260	5,324,709.40	0.06
762	002204	大连重工	1,068,400	5,320,632.00	0.06
763	301511	德福科技	419,840	5,273,190.40	0.06
764	002399	海普瑞	492,400	5,263,756.00	0.06
765	600508	上海能源	397,800	5,262,894.00	0.06
766	002041	登海种业	482,100	5,250,069.00	0.06
767	600223	福瑞达	694,100	5,247,396.00	0.06
768	000088	盐田港	1,075,447	5,237,426.89	0.06
769	002125	湘潭电化	518,100	5,222,448.00	0.06
770	688389	普门科技	350,519	5,219,227.91	0.06
771	603043	广州酒家	313,700	5,216,831.00	0.06
772	301487	盟固利	245,200	5,215,404.00	0.06
773	301015	百洋医药	215,244	5,211,057.24	0.06
774	600783	鲁信创投	409,600	5,189,632.00	0.06
775	605168	三人行	144,191	5,179,340.72	0.06
776	000597	东北制药	982,400	5,177,248.00	0.06
777	002267	陕天然气	611,300	5,165,485.00	0.06
778	688232	新点软件	178,099	5,163,090.01	0.06
779	600639	浦东金桥	464,900	5,160,390.00	0.06
780	603171	税友股份	168,700	5,145,350.00	0.06
781	000498	山东路桥	858,800	5,109,860.00	0.06
782	001213	中铁特货	1,224,500	5,106,165.00	0.06
783	600335	国机汽车	819,000	5,102,370.00	0.06
784	002516	旷达科技	1,006,200	5,101,434.00	0.06
785	600548	深高速	377,800	5,092,744.00	0.06
786	002585	双星新材	953,200	5,090,088.00	0.06
787	000672	上峰水泥	664,900	5,086,485.00	0.06
788	600929	雪天盐业	907,300	5,071,807.00	0.06
789	301087	可孚医疗	143,312	5,067,512.32	0.06
790	600874	创业环保	842,800	5,031,516.00	0.06
791	603636	南威软件	478,500	5,024,250.00	0.06
792	600640	国脉文化	419,900	5,013,606.00	0.06
793	601515	东峰集团	1,258,300	5,008,034.00	0.06
794	300861	美畅股份	250,400	4,995,480.00	0.06
795	601869	长飞光纤	167,100	4,994,619.00	0.06
796	600020	中原高速	1,183,400	4,993,948.00	0.06
797	688147	微导纳米	185,400	4,985,406.00	0.06

798	688549	中巨芯	584,300	4,978,236.00	0.06
799	300257	开山股份	544,900	4,969,488.00	0.06
800	002612	朗姿股份	303,000	4,957,080.00	0.06
801	688380	中微半导	165,180	4,938,882.00	0.06
802	603169	兰石重装	903,900	4,926,255.00	0.06
803	002941	新疆交建	440,700	4,922,619.00	0.06
804	600657	信达地产	1,180,100	4,909,216.00	0.05
805	000718	苏宁环球	2,078,600	4,905,496.00	0.05
806	688707	振华新材	446,200	4,885,890.00	0.05
807	002327	富安娜	552,600	4,884,984.00	0.05
808	688690	纳微科技	276,784	4,871,398.40	0.05
809	002581	未名医药	455,400	4,845,456.00	0.05
810	605599	菜百股份	426,800	4,844,180.00	0.05
811	002991	甘源食品	51,600	4,825,632.00	0.05
812	000791	甘肃能源	800,000	4,824,000.00	0.05
813	001337	四川黄金	230,800	4,819,104.00	0.05
814	603299	苏盐井神	431,594	4,807,957.16	0.05
815	688443	智翔金泰	191,400	4,802,226.00	0.05
816	002489	浙江永强	1,481,800	4,801,032.00	0.05
817	300856	科思股份	187,300	4,798,626.00	0.05
818	601096	宏盛华源	1,102,300	4,795,005.00	0.05
819	601921	浙版传媒	605,500	4,771,340.00	0.05
820	600662	外服控股	941,000	4,770,870.00	0.05
821	301239	普瑞眼科	101,500	4,760,350.00	0.05
822	688298	东方生物	162,298	4,760,200.34	0.05
823	688097	博众精工	180,880	4,748,100.00	0.05
824	002190	成飞集成	245,000	4,738,300.00	0.05
825	688150	莱特光电	210,400	4,738,208.00	0.05
826	601882	海天精工	215,900	4,734,687.00	0.05
827	600475	华光环能	523,097	4,713,103.97	0.05
828	301238	瑞泰新材	300,798	4,710,496.68	0.05
829	688048	长光华芯	120,563	4,700,751.37	0.05
830	601107	四川成渝	898,300	4,698,109.00	0.05
831	600195	中牧股份	699,500	4,693,645.00	0.05
832	002833	弘亚数控	278,500	4,687,155.00	0.05
833	300768	迪普科技	266,950	4,671,625.00	0.05
834	600987	航民股份	671,860	4,662,708.40	0.05
835	002755	奥赛康	366,703	4,660,795.13	0.05
836	000813	德展健康	1,487,300	4,655,249.00	0.05
837	603025	大豪科技	304,620	4,645,455.00	0.05
838	300737	科顺股份	915,640	4,642,294.80	0.05

839	000885	城发环境	353,800	4,638,318.00	0.05
840	600604	市北高新	973,300	4,632,908.00	0.05
841	688107	安路科技	156,200	4,620,396.00	0.05
842	603801	志邦家居	358,060	4,586,748.60	0.05
843	603466	风语筑	491,200	4,577,984.00	0.05
844	000935	四川双马	314,680	4,556,566.40	0.05
845	002302	西部建设	690,000	4,540,200.00	0.05
846	300973	立高食品	115,994	4,527,245.82	0.05
847	002034	旺能环境	291,301	4,515,165.50	0.05
848	300080	易成新能	1,027,800	4,491,486.00	0.05
849	000025	特力A	271,600	4,486,832.00	0.05
850	301536	星辰科技	56,100	4,482,390.00	0.05
851	600810	神马股份	553,000	4,473,770.00	0.05
852	000736	中交地产	517,029	4,446,449.40	0.05
853	601038	一拖股份	300,600	4,442,868.00	0.05
854	000968	蓝焰控股	668,000	4,442,200.00	0.05
855	600780	通宝能源	787,700	4,434,751.00	0.05
856	688658	悦康药业	306,922	4,422,746.02	0.05
857	603123	翠微股份	548,900	4,418,645.00	0.05
858	688531	日联科技	92,621	4,411,538.23	0.05
859	000869	张裕A	190,100	4,408,419.00	0.05
860	603609	禾丰股份	507,796	4,377,201.52	0.05
861	605123	派克新材	81,345	4,373,107.20	0.05
862	002242	九阳股份	420,100	4,352,236.00	0.05
863	301216	万凯新材	425,128	4,336,305.60	0.05
864	603297	永新光学	46,200	4,334,484.00	0.05
865	002053	云南能投	379,700	4,328,580.00	0.05
866	601069	西部黄金	376,030	4,305,543.50	0.05
867	002378	章源钨业	662,990	4,289,545.30	0.05
868	003012	东鹏控股	646,400	4,272,704.00	0.05
869	301589	诺瓦星云	24,600	4,270,560.00	0.05
870	603915	国茂股份	363,700	4,262,564.00	0.05
871	301207	华兰疫苗	243,400	4,261,934.00	0.05
872	603566	普莱柯	332,600	4,243,976.00	0.05
873	605020	永和股份	207,880	4,226,200.40	0.05
874	688261	东微半导	100,279	4,210,715.21	0.05
875	300723	一品红	246,453	4,204,488.18	0.05
876	001323	慕思股份	110,978	4,196,078.18	0.05
877	688337	普源精电	107,152	4,178,928.00	0.05
878	688586	江航装备	435,733	4,169,964.81	0.05
879	600058	五矿发展	583,500	4,154,520.00	0.05

880	301047	义翘神州	67,043	4,146,609.55	0.05
881	003040	楚天龙	316,400	4,135,348.00	0.05
882	301348	蓝箭电子	160,100	4,101,762.00	0.05
883	002959	小熊电器	85,600	4,101,096.00	0.05
884	688209	英集芯	231,859	4,096,948.53	0.05
885	300492	华图山鼎	56,100	4,084,080.00	0.05
886	603730	岱美股份	453,080	4,073,189.20	0.05
887	002096	易普力	342,800	4,072,464.00	0.05
888	688348	昱能科技	83,300	4,065,040.00	0.05
889	603055	台华新材	366,700	4,063,036.00	0.05
890	603348	文灿股份	170,904	4,043,588.64	0.05
891	301153	中科江南	144,272	4,030,959.68	0.05
892	603301	振德医疗	181,600	3,993,384.00	0.04
893	301327	华宝新能	51,750	3,969,742.50	0.04
894	688185	康希诺	63,065	3,850,118.25	0.04
895	301526	国际复材	1,030,000	3,811,000.00	0.04
896	601015	陕西黑猫	1,134,770	3,790,131.80	0.04
897	301217	铜冠铜箔	342,000	3,789,360.00	0.04
898	688686	奥普特	49,604	3,750,558.44	0.04
899	603327	福蓉科技	307,640	3,734,749.60	0.04
900	002275	桂林三金	244,100	3,683,469.00	0.04
901	600903	贵州燃气	470,300	3,668,340.00	0.04
902	688105	诺唯赞	165,291	3,664,501.47	0.04
903	688351	微电生理	192,049	3,656,612.96	0.04
904	301268	铭利达	220,200	3,650,916.00	0.04
905	603439	贵州三力	280,599	3,647,787.00	0.04
906	601033	永兴股份	248,093	3,587,424.78	0.04
907	000030	富奥股份	697,400	3,577,662.00	0.04
908	688336	三生国健	165,730	3,549,936.60	0.04
909	002314	南山控股	1,487,800	3,540,964.00	0.04
910	603985	恒润股份	301,950	3,526,776.00	0.04
911	300926	博俊科技	159,600	3,512,796.00	0.04
912	002088	鲁阳节能	274,585	3,511,942.15	0.04
913	603983	丸美生物	108,600	3,503,436.00	0.04
914	301339	通行宝	171,400	3,486,276.00	0.04
915	603162	海通发展	377,579	3,473,726.80	0.04
916	002901	大博医疗	110,900	3,420,156.00	0.04
917	603355	莱克电气	150,800	3,415,620.00	0.04
918	002946	新乳业	234,400	3,401,144.00	0.04
919	301069	凯盛新材	229,177	3,396,403.14	0.04
920	605116	奥锐特	160,300	3,385,536.00	0.04

921	601083	锦江航运	354,000	3,370,080.00	0.04
922	002534	西子洁能	302,900	3,365,219.00	0.04
923	000899	赣能股份	385,900	3,361,189.00	0.04
924	601886	江河集团	617,600	3,335,040.00	0.04
925	605009	豪悦护理	83,345	3,330,466.20	0.04
926	603989	艾华集团	220,354	3,322,938.32	0.04
927	688206	概伦电子	175,326	3,315,414.66	0.04
928	688001	华兴源创	122,328	3,315,088.80	0.04
929	000058	深赛格	410,500	3,296,315.00	0.04
930	000761	本钢板材	1,019,700	3,263,040.00	0.04
931	003009	中天火箭	83,400	3,252,600.00	0.04
932	688177	百奥泰	166,900	3,234,522.00	0.04
933	688392	骄成超声	78,355	3,196,884.00	0.04
934	300702	天宇股份	191,400	3,188,724.00	0.04
935	002913	奥士康	131,100	3,160,821.00	0.04
936	002651	利君股份	429,000	3,144,570.00	0.04
937	002911	佛燃能源	248,698	3,143,542.72	0.04
938	603013	亚普股份	209,400	3,136,812.00	0.04
939	603719	良品铺子	220,690	3,136,004.90	0.04
940	301367	怡和嘉业	49,320	3,107,160.00	0.03
941	301376	致欧科技	162,400	3,105,088.00	0.03
942	001308	康冠科技	112,360	3,089,900.00	0.03
943	002978	安宁股份	108,300	3,077,886.00	0.03
944	300755	华致酒行	172,200	3,072,048.00	0.03
945	300894	火星人	224,197	3,071,498.90	0.03
946	300869	康泰医学	218,700	3,048,678.00	0.03
947	001258	立新能源	382,300	3,043,108.00	0.03
948	600618	氯碱化工	306,800	3,025,048.00	0.03
949	688268	华特气体	65,603	3,012,489.76	0.03
950	300741	华宝股份	172,200	2,994,558.00	0.03
951	301246	宏源药业	221,100	2,991,483.00	0.03
952	001236	弘业期货	309,600	2,984,544.00	0.03
953	603093	南华期货	250,000	2,975,000.00	0.03
954	000019	深粮控股	452,700	2,974,239.00	0.03
955	000517	荣安地产	1,327,300	2,959,879.00	0.03
956	603530	神马电力	118,307	2,923,365.97	0.03
957	603877	太平鸟	197,378	2,921,194.40	0.03
958	601022	宁波远洋	361,200	2,900,436.00	0.03
959	688315	诺禾致源	228,247	2,853,087.50	0.03
960	301558	三态股份	322,200	2,822,472.00	0.03
961	688776	国光电气	59,295	2,806,432.35	0.03

962	301371	敷尔佳	73,500	2,777,565.00	0.03
963	605222	起帆电缆	174,700	2,690,380.00	0.03
964	605296	神农集团	95,860	2,655,322.00	0.03
965	601811	新华文轩	164,400	2,605,740.00	0.03
966	688526	科前生物	182,337	2,605,595.73	0.03
967	688433	华曙高科	111,595	2,604,627.30	0.03
968	001389	广合科技	51,000	2,565,300.00	0.03
969	605577	龙版传媒	175,600	2,551,468.00	0.03
970	688383	新益昌	55,675	2,498,137.25	0.03
971	301381	赛维时代	108,900	2,478,564.00	0.03
972	001311	多利科技	95,344	2,458,921.76	0.03
973	002990	盛视科技	104,000	2,409,680.00	0.03
974	603693	江苏新能	243,000	2,393,550.00	0.03
975	688128	中国电研	112,399	2,361,502.99	0.03
976	605011	杭州热电	109,300	2,341,206.00	0.03
977	603057	紫燕食品	115,100	2,312,359.00	0.03
978	001269	欧晶科技	81,080	2,309,969.20	0.03
979	003039	顺控发展	171,100	2,237,988.00	0.03
980	603489	八方股份	93,633	2,230,338.06	0.02
981	688523	航天环宇	108,400	2,168,000.00	0.02
982	605365	立达信	137,100	2,152,470.00	0.02
983	301090	华润材料	307,019	2,130,711.86	0.02
984	603219	富佳股份	147,600	2,091,492.00	0.02
985	001322	箭牌家居	253,700	2,052,433.00	0.02
986	301508	中机认检	60,200	2,046,800.00	0.02
987	301500	飞南资源	110,100	1,981,800.00	0.02
988	600403	大有能源	653,600	1,921,584.00	0.02
989	601068	中铝国际	426,200	1,879,542.00	0.02
990	301559	中集环科	116,015	1,780,830.25	0.02
991	301606	绿联科技	44,200	1,670,760.00	0.02
992	603132	金徽股份	146,600	1,646,318.00	0.02
993	601279	英利汽车	428,500	1,641,155.00	0.02
994	301565	中仑新材	76,687	1,641,101.80	0.02
995	603103	横店影视	104,900	1,509,511.00	0.02
996	301262	海看股份	58,500	1,454,895.00	0.02
997	301177	迪阿股份	61,592	1,406,761.28	0.02
998	301180	万祥科技	72,400	1,120,028.00	0.01
999	603075	热威股份	57,000	1,061,910.00	0.01
1,000	001376	百通能源	62,400	912,288.00	0.01
1,000	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.00

1					
1,00 2	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
1,00 3	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
1,00 4	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
1,00 5	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
1,00 6	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
1,00 7	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
1,00 8	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
1,00 9	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
1,01 0	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
1,01 1	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
1,01 2	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
1,01 3	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
1,01 4	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
1,01 5	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
1,01 6	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
1,01 7	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
1,01 8	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
1,01 9	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
1,02 0	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
1,02 1	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
1,02 2	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00

1,023	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
1,024	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
1,025	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
1,026	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00

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	601099	太平洋	74,201,620.50	1.43
2	603129	春风动力	53,584,318.00	1.04
3	688235	百济神州	51,757,938.02	1.00
4	688050	爱博医疗	51,691,531.31	1.00
5	688333	铂力特	48,361,118.34	0.93
6	688278	特宝生物	48,171,317.13	0.93
7	601677	明泰铝业	47,657,198.95	0.92
8	600559	老白干酒	46,910,974.75	0.91
9	688266	泽璟制药	44,349,628.11	0.86
10	600100	同方股份	43,041,299.64	0.83
11	688037	芯源微	41,624,408.32	0.80
12	603005	晶方科技	41,566,134.92	0.80
13	605589	圣泉集团	41,511,136.29	0.80
14	600312	平高电气	40,654,608.12	0.79
15	688408	中信博	39,822,810.91	0.77
16	688076	诺泰生物	39,756,824.80	0.77
17	601975	招商南油	39,679,269.00	0.77
18	688578	艾力斯	39,183,985.35	0.76
19	601001	晋控煤业	38,915,158.00	0.75
20	600761	安徽合力	37,960,938.16	0.73

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

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	601099	太平洋	110,909,112.68	2.14
2	300339	润和软件	70,720,945.76	1.37
3	603129	春风动力	66,314,034.50	1.28
4	688278	特宝生物	59,572,929.57	1.15
5	600312	平高电气	53,752,840.39	1.04
6	688578	艾力斯	53,470,806.26	1.03
7	601001	晋控煤业	49,757,412.81	0.96
8	688050	爱博医疗	48,365,495.41	0.93
9	601918	新集能源	48,257,398.54	0.93
10	601567	三星医疗	47,931,632.39	0.93
11	688235	百济神州	45,143,521.39	0.87
12	600685	中船防务	42,342,915.67	0.82
13	600559	老白干酒	41,811,063.13	0.81
14	688333	铂力特	41,413,869.17	0.80
15	600100	同方股份	40,349,907.40	0.78
16	603979	金诚信	39,887,102.20	0.77
17	688266	泽璟制药	39,491,621.68	0.76
18	300476	胜宏科技	39,262,750.00	0.76
19	002085	万丰奥威	39,075,911.00	0.75
20	603005	晶方科技	38,840,947.97	0.75

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

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	11,005,990,591.05
卖出股票收入（成交）总额	9,281,770,283.07

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

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	21,916,567.94
2	应收清算款	1,097.80
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

9	合计	21,917,665.74
---	----	---------------

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301626	苏州天脉	62,951.46	0.00	新股限售
2	301611	珂玛科技	45,104.40	0.00	新股限售
3	688449	联芸科技	41,392.64	0.00	新股限售
4	688708	佳驰科技	38,181.00	0.00	新股限售
5	688726	拉普拉斯	32,365.74	0.00	新股限售

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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

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		富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额	持有份额	占总份额	持有份额	占总份额

			比例 (%)		比例 (%)		比例 (%)
23,428	157,557.31	3,345,620,393.00	90.64	345,632,270.00	9.36	37,937,815.00	1.03

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“富国中证1000交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中央汇金资产管理有限责任公司	1,461,247,600.00	39.59
2	中央汇金投资有限责任公司	1,313,005,255.00	35.57
3	中国人寿保险股份有限公司	168,208,181.00	4.56
4	香港中央结算有限公司	41,272,290.00	1.12
5	中国平安人寿保险股份有限公司—寿险传统低—自主	39,984,000.00	1.08
6	华夏人寿保险股份有限公司—万能保险产品	34,794,598.00	0.94
7	招商证券股份有限公司	29,245,924.00	0.79
8	中国移动通信集团有限公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	19,905,325.00	0.54
9	中国国际金融股份有限公司	13,440,671.00	0.36
10	东方证券股份有限公司	12,295,853.00	0.33
11	富国中证1000交易型开放式指数证券投资基金联接基金	37,937,815.00	1.03

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	—	—

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年07月27日)基金份额总额	7,949,570,836.00
报告期期初基金份额总额	2,187,252,663.00
本报告期基金总申购份额	8,209,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	6,705,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	3,691,252,663.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有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

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为6.3万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为3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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	富国基金管理有限公司

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

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 本期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 (%)	
渤海证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	3	584,747,732.12	2.88	145,741.04	4.11	—
诚通证券	2	—	—	—	—	—
东方证券	4	5,143,782.06	0.03	3,785.23	0.11	—
东吴证券	2	359,805,324.86	1.77	264,775.56	7.46	—
方正证券	1	51,172,789.17	0.25	6,954.38	0.20	—
广发证券	2	1,339,925,654.88	6.61	421,432.74	11.87	—
国盛证券	2	711,871,404.51	3.51	523,857.99	14.76	—
国泰君安	2	11,660.00	0.00	1.59	0.00	—
海通证券	2	794,566,689.76	3.92	123,435.93	3.48	—

华泰证券	2	1,075,596,751.54	5.30	455,553.91	12.83	—
华西证券	2	13,534,139,848.84	66.72	1,203,698.56	33.90	—
民生证券	3	168,156,628.96	0.83	123,746.88	3.49	—
申万宏源	2	31,668,404.72	0.16	10,131.99	0.29	—
太平洋证券	2	889,650.00	0.00	654.75	0.02	—
银河证券	2	17,664,489.77	0.09	12,999.18	0.37	—
浙商证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	16,383,176.51	0.08	12,057.20	0.34	—
中信建投	2	164,254,713.17	0.81	47,258.64	1.33	—
中信证券	2	1,428,465,266.89	7.04	194,136.12	5.47	—

注：1、我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金退租券商交易单元：申港证券（012072、50378）。本报告期本基金新增券商交易单元：渤海证券（005839），东方证券（007913、28883），国泰君安（018520、60244）。

2、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《富国基金管理有限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》的报告期为2024年7月1日至2024年12月31日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）
渤海证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
诚通证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	1,054,999.06	18.04	—	—	—	—
国盛证券	1,646,638.11	28.15	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
海通证券	453,508.06	7.75	—	—	—	—

华泰证券	853,817.88	14.60	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	1,840,210.75	31.46	-	-	-	-

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	富国基金管理有限公司关于调整富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金最小申购、赎回单位的公告	规定披露媒介	2024年02月19日
2	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2024年03月14日
3	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2024年06月14日
4	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2024年07月31日
5	富国基金管理有限公司关于富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金管理费率、托管费率并修订基金合同及托管协议的公告	规定披露媒介	2024年11月16日

§ 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	2024-01-01 至 2024-02-07; 2024-03-07	766,683,714.00	558,248,347.00	1,276,291,664.00	48,640,397.00	1.32%

	2	2024-01-26 至 2024-02-05	236,47 0,039. 00	490,455 ,215.00	558,71 7,073. 00	168,208,181 .00	4.56%
	3	2024-02-07 至 2024-12-31	—	1,313,0 05,255. 00	—	1,313,005,2 55.00	35.57%
	4	2024-07-18 至 2024-12-31	—	1,461,2 47,600. 00	—	1,461,247,6 00.00	39.59%

产品特有风险

本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20% 的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，基金管理人决定自 2024 年 2 月 19 日起，将本基金最小申购、赎回单位由 100 万份调整为 200 万份。具体可参见基金管理人于 2024 年 2 月 19 日发布的《富国基金管理有限公司关于调整富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金最小申购、赎回单位的公告》及修改后的招募说明书等法律文件。

二、本报告期内，根据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定自 2024 年 11 月 19 日起，调低本基金的管理费率、托管费率，并对本基金的基金合同及托管协议的相应条款进行修订。具体可参见基金管理人于 2024 年 11 月 16 日发布的《富国基金管理有限公司关于调低富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金管理费率、托管费率并修订基金合同及托管协议的公告》及修订后的基金合同、托管协议。

§ 13 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
--------	----------	----------

<p>1、中国证监会批准设立富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的文件</p> <p>2、富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同</p> <p>3、富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议</p> <p>4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件</p> <p>5、富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注</p> <p>6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告</p>	<p>中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层</p>	<p>投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司 网 址： http://www.fullgoal.com.cn。</p>
---	---	---