富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）

二0二四年年度报告

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：　中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 7
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 8
3.1 主要会计数据和财务指标 8
3.2 基金净值表现 9
3.3 过去三年基金的利润分配情况 13
§4 管理人报告 13
4.1 基金管理人及基金经理情况 13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告 19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 21
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 21
§5 托管人报告 21
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 21
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 22
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 22
§6 审计报告 22
6.1 审计报告基本信息 22
6.2 审计报告的基本内容 22
§7 年度财务报告 25
7.1 资产负债表 25

7.2 利润表.....26
7.3 净资产变动表.....27
7.4 报表附注.....29
§8 投资组合报告.....65
8.1 期末基金资产组合情况.....65
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....65
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.....66
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....104
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....105
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.....106
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.....106
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.....106
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.....106
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....106
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....106
8.12 投资组合报告附注.....106
§9 基金份额持有人信息.....107
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....107
9.2 期末上市基金前十名持有人.....108
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....108
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.....108
§10 开放式基金份额变动.....109
§11 重大事件揭示.....109
11.1 基金份额持有人大会决议.....109
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.....109
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....109
11.4 基金投资策略的改变.....109
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....109
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.....109
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....110
11.8 其他重大事件.....113
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....113
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.....113
§13 备查文件目录.....114

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）	
基金简称	富国中证 1000 指数增强（LOF）	
基金主代码	161039	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 05 月 31 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,049,219,160.72 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	2018 年 6 月 20 日	
下属分级基金的基金简称	富国中证 1000 指数增强（LOF）A	富国中证 1000 指数增强（LOF）C
下属分级基金场内简称	1000 增强 LOF	-
下属分级基金的交易代码	161039	013331
报告期末下属分级基金的份额总额	512,742,248.91 份	536,476,911.81 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，主要策略为复制目标指数，即投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础，利用富国定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。本基金在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。本基金的股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略及参与转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%＋银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	任航
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		裴长江	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	富国基金管理有限公司　上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 中国农业银行股份有限公司　北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	A 类：中国证券登记结算有限责任公司；C 类：富国基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号；上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

（1） 富国中证 1000 指数增强（LOF）A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	-112,831,384.38	2,743,100.37	-188,859,048.11
本期利润	35,139,019.87	11,679,282.37	-367,054,510.74
加权平均基金份额本期利润	0.0430	0.0106	-0.3134
本期加权平均净值利润率	2.50%	0.55%	-16.33%
本期基金份额净值增长率	6.07%	-0.15%	-14.40%
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	287,801,788.37	657,307,562.98	728,380,062.65
期末可供分配基金份额利润	0.5613	0.6467	0.6594
期末基金资产净值	991,480,228.74	1,852,928,617.22	2,017,052,721.61
期末基金份额净值	1.9337	1.8231	1.8259
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	93.37%	82.31%	82.59%

（2） 富国中证 1000 指数增强（LOF）C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	-90,148,793.10	-17,120,430.66	-47,092,910.46
本期利润	-29,360,688.17	-46,335,431.11	-136,409,796.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0497	-0.0897	-0.4378
本期加权平均净值利润率	-2.90%	-4.72%	-22.78%
本期基金份额净值增长率	5.85%	-0.35%	-14.58%
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	294,667,138.41	510,673,263.40	247,866,030.86
期末可供分配基金份额利润	0.5493	0.6379	0.6543
期末基金资产净值	1,030,428,866.13	1,452,591,912.27	689,834,837.39
期末基金份额净值	1.9207	1.8145	1.8209
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	-6.81%	-11.96%	-11.65%

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

（1） 富国中证 1000 指数增强（LOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	2.65%	2.08%	4.23%	2.28%	-1.58%	-0.20%
过去六个月	18.15%	1.95%	20.68%	2.13%	-2.53%	-0.18%
过去一年	6.07%	1.90%	1.41%	2.01%	4.66%	-0.11%
过去三年	-9.35%	1.47%	-24.13%	1.54%	14.78%	-0.07%
过去五年	61.80%	1.43%	7.52%	1.49%	54.28%	-0.06%
自基金合同生效起至今	93.37%	1.40%	-3.16%	1.50%	96.53%	-0.10%

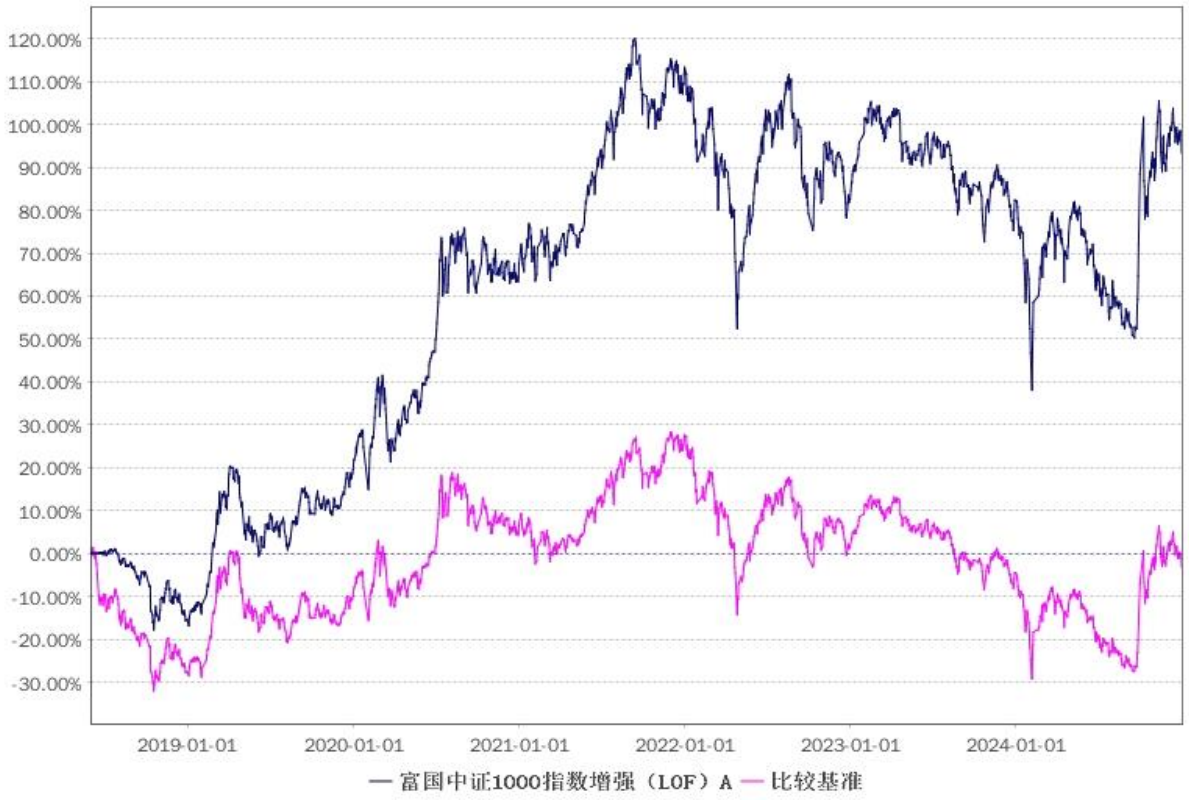
（2） 富国中证 1000 指数增强（LOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	2.60%	2.08%	4.23%	2.28%	-1.63%	-0.20%
过去六个月	18.04%	1.95%	20.68%	2.13%	-2.64%	-0.18%
过去一年	5.85%	1.90%	1.41%	2.01%	4.44%	-0.11%
过去三年	-9.89%	1.47%	-24.13%	1.54%	14.24%	-0.07%
自基金分级生效日起至今	-6.81%	1.43%	-18.88%	1.50%	12.07%	-0.07%

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

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

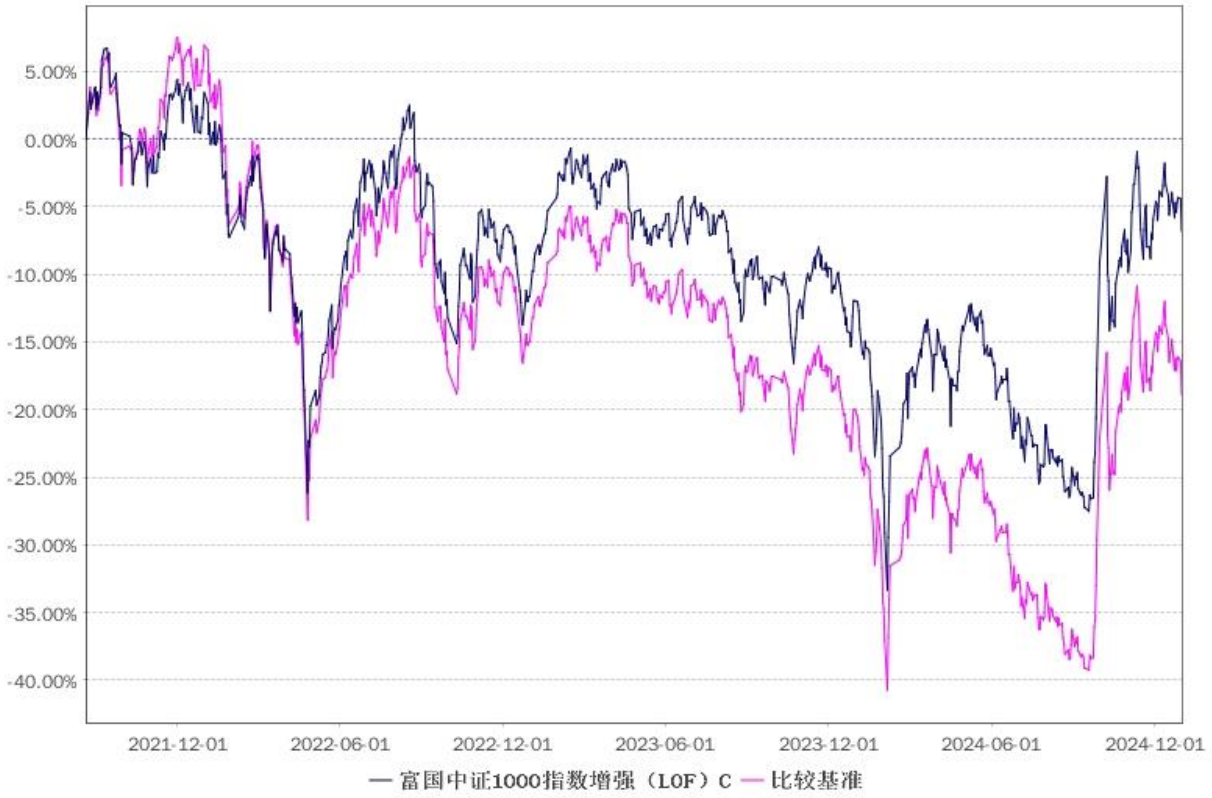
（1）自基金合同生效以来富国中证 1000 指数增强（LOF）A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2024 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2018 年 5 月 31 日成立，建仓期 6 个月，从 2018 年 5 月 31 日起至 2018 年 11 月 29 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

（2）自基金合同生效以来富国中证 1000 指数增强（LOF）C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

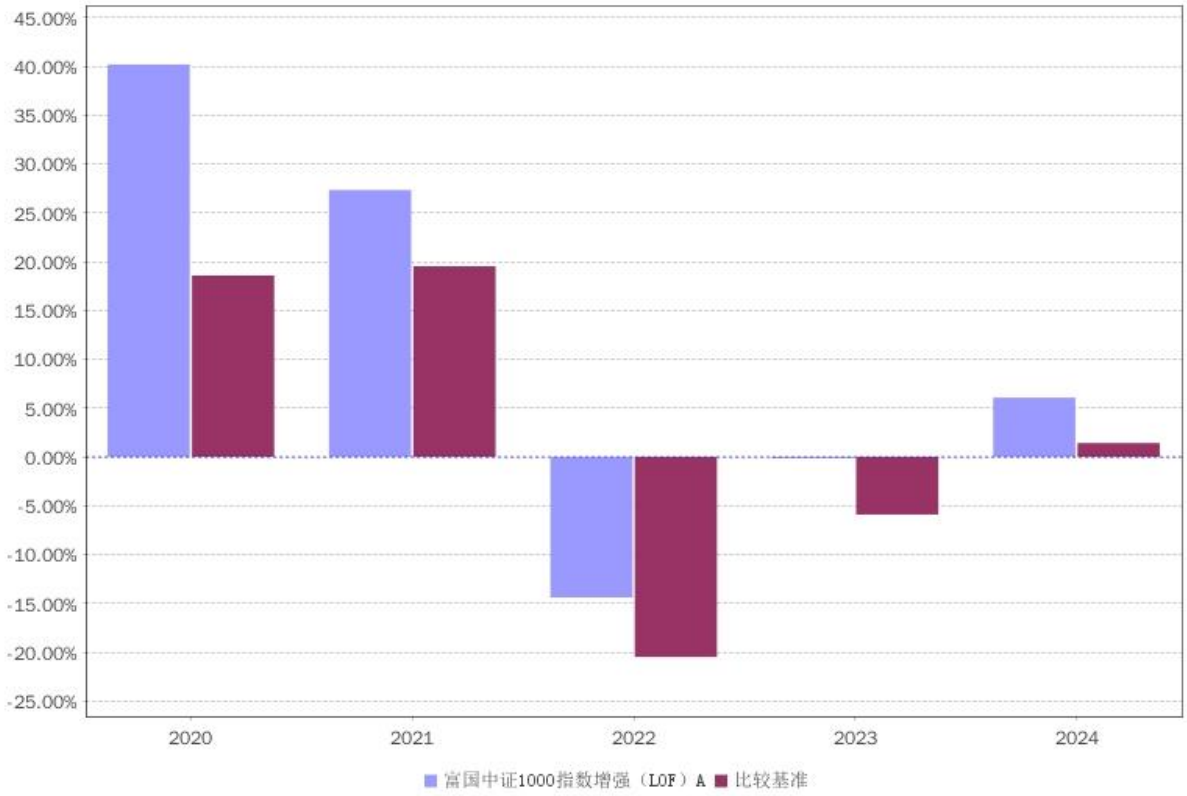


注：1、截止日期为 2024 年 12 月 31 日。

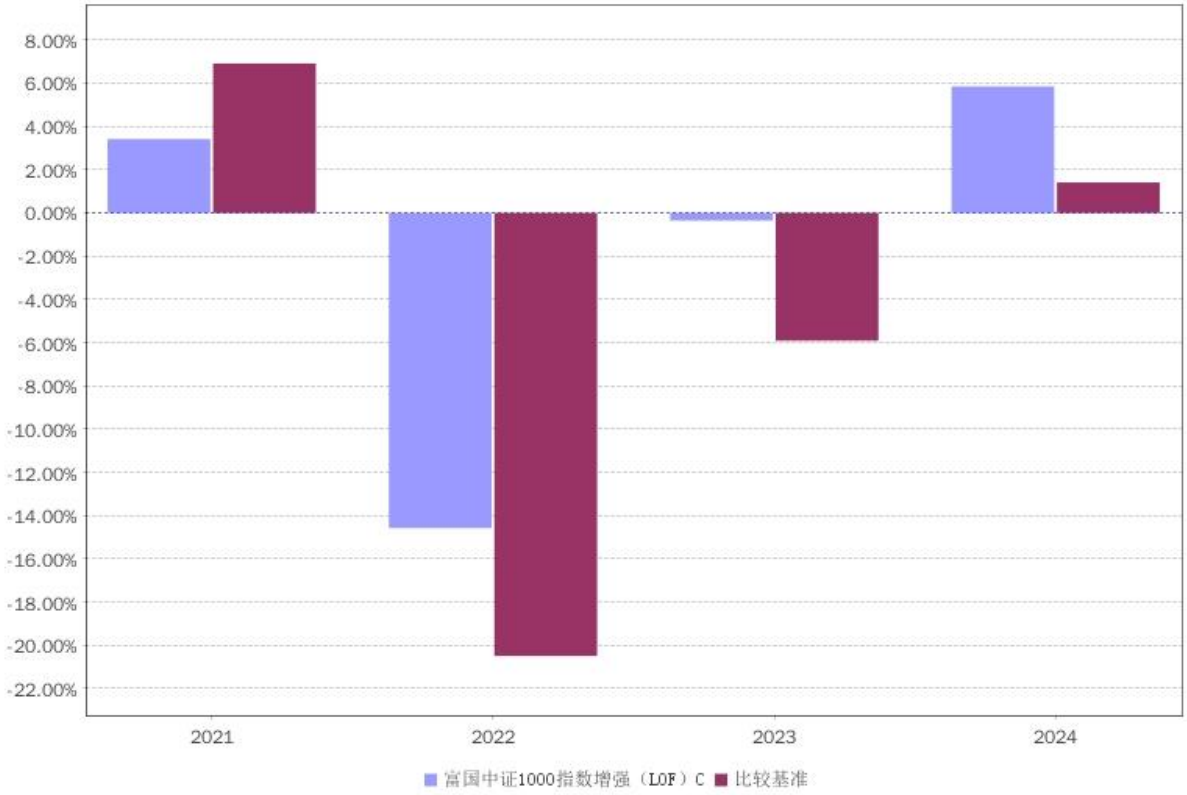
2、本基金自 2021 年 8 月 19 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

3.2.3 过去五年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

（1）过去五年以来富国中证 1000 指数增强（LOF）A 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



（2）过去五年以来富国中证 1000 指数增强（LOF）C 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：C 类份额自 2021 年 8 月 20 日起有基金份额。2021 年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

（1） 富国中证 1000 指数增强（LOF）A

注：过往三年本基金份额未进行利润分配。

（2） 富国中证 1000 指数增强（LOF）C

注：过往三年本基金份额未进行利润分配。

§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		
王保合	本基金现任基金经理	2022-10-27	—	19	博士，自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监、量化与海外投资部量化投资总监、量化投资部总经理；现任富国基金总经理助理，兼任富国基金量化投资部总经理、资深定量基金经理。自 2011 年 03 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2011 年 03 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2015 年 04 月起任富国中证国有企业改革指数型证券投资基金(原富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金)基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证全指证券公司指数型证券投资基金(原富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金)基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证银行指数型证券投资基金(原富国中证银行指数分级证券投资基金)基金经理；自 2020 年 09 月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2022 年 10 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；

					自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国创业板增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 09 月起任富国致弘量化选股股票型证券投资基金基金经理；自 2023 年 12 月起任富国致航量化选股股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
徐幼华	本基金现任基金经理	2018-05-31	—	20	硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资部经理助理；自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监，量化与海外投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部副总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。自 2011 年 05 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自 2011 年 10 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自 2018 年 05 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2018 年 07 月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理；自 2018 年 12 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自 2024 年 04 月起任富国 MSCI 中国 A50 互联互通增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
方旻	本基金现任基金经理	2018-05-31	—	15	硕士，自 2010 年 2 月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、高级定量基金经理、量化投资部量化投资副总监、量化投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼资深定量基金经理。自 2014 年 11 月起任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经

					理；自 2014 年 11 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2018 年 05 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2019 年 01 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自 2020 年 02 月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）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 指数增强型证券投资基金（LOF）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 31 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，我们坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极获取超额收益率。

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 A 级为 1.9337 元，C 级为 1.9207 元；份额累计净值 A 级为 1.9337 元，C 级为 1.9207 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为 6.07%,C 级为 5.85%,同期业绩比较基准收益率 A 级为 1.41%，C 级为 1.41%。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 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	安永华明（2025）审字第 70015656_B109 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 指数增强型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）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 指数增强型证券投资基金（LOF）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 指数增强型证券投资基金（LOF）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 指数增强型证券投资基金（LOF），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 指数增强型证券投资基金（LOF）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盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	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。 在编制财务报表时，管理层负责评估富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）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。 治理层负责监督富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的

	审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）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 指数增强型证券投资基金（LOF）不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得

	关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王珊珊	李倩妤
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
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 指数增强型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	191,863,038.74	183,593,140.66
结算备付金	13,635,322.87	18,671,402.26
存出保证金	23,804,595.06	202,439.33
交易性金融资产	1,682,069,598.02	3,066,626,126.62
其中：股票投资	1,682,069,598.02	3,057,404,834.23
基金投资	-	-
债券投资	-	9,221,292.39
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	529,535.56	152,859.71
应收股利	-	-
应收申购款	134,220,275.09	50,989,836.44
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	501.29
资产总计	2,046,122,365.34	3,320,236,306.31
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	3,949,015.18	—
应付赎回款	16,463,135.41	8,014,881.79
应付管理人报酬	1,607,985.95	2,809,097.88
应付托管费	241,197.90	421,364.71
应付销售服务费	147,782.02	243,499.57
应付投资顾问费	—	—
应交税费	503,820.34	114.66
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	1,300,333.67	3,226,818.21
负债合计	24,213,270.47	14,715,776.82
净资产：		
实收基金	1,049,219,160.72	1,816,900,462.56
其他综合收益	—	—
未分配利润	972,689,934.15	1,488,620,066.93
净资产合计	2,021,909,094.87	3,305,520,529.49
负债和净资产总计	2,046,122,365.34	3,320,236,306.31

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.9271 元，基金份额总额 1,049,219,160.72 份。其中：富国中证 1000 指数增强（LOF）A 份额净值 1.9337 元，份额总额 512,742,248.91 份；富国中证 1000 指数增强（LOF）C 份额净值 1.9207 元，份额总额 536,476,911.81 份。

7.2 利润表

会计主体：富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

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	36,394,316.82	3,632,941.47
1.利息收入	2,902,852.78	2,312,139.35
其中：存款利息收入	2,897,694.09	2,147,131.79

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	5,158.69	165,007.56
2.投资收益（损失以“-”填列）	-176,049,359.38	20,582,076.50
其中：股票投资收益	-258,645,316.27	-18,250,764.28
基金投资收益	-	-
债券投资收益	190,472.53	3,272,417.26
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	50,225,144.27	-
股利收益	32,180,340.09	35,560,423.52
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）	208,758,509.18	-20,278,818.45
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	782,314.24	1,017,544.07
减：二、营业总支出	30,615,985.12	38,289,090.21
1．管理人报酬	24,207,284.19	30,997,967.11
2．托管费	3,631,092.61	4,649,695.13
3．销售服务费	2,019,935.67	1,960,076.31
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	181,160.82	601.54
8．其他费用	576,511.83	680,750.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	5,778,331.70	-34,656,148.74
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	5,778,331.70	-34,656,148.74
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	5,778,331.70	-34,656,148.74

7.3 净资产变动表

会计主体：富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

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	1,816,900,462.56	1,488,620,066.93	3,305,520,529.49
二、本期期初净资产	1,816,900,462.56	1,488,620,066.93	3,305,520,529.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-767,681,301.84	-515,930,132.78	-1,283,611,434.62
（一）、综合收益总额	—	5,778,331.70	5,778,331.70
（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）	-767,681,301.84	-521,708,464.48	-1,289,389,766.32
其中：1.基金申购款	1,373,998,883.79	1,052,798,135.45	2,426,797,019.24
2.基金赎回款	-2,141,680,185.63	-1,574,506,599.93	-3,716,186,785.56
（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	1,049,219,160.72	972,689,934.15	2,021,909,094.87

项目	上年度可比期间 （2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,483,528,856.30	1,223,358,702.70	2,706,887,559.00
二、本期期初净资产	1,483,528,856.30	1,223,358,702.70	2,706,887,559.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	333,371,606.26	265,261,364.23	598,632,970.49
（一）、综合收益总额	—	-34,656,148.74	-34,656,148.74
（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）	333,371,606.26	299,917,512.97	633,289,119.23
其中：1.基金申购款	1,497,275,928.85	1,388,887,621.68	2,886,163,550.53
2.基金赎回款	-1,163,904,322.59	-1,088,970,108.71	-2,252,874,431.30
（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	1,816,900,462.56	1,488,620,066.93	3,305,520,529.49

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
————————	————————	————————
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]30 号文《关于准予富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）注册的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集。基金合同于 2018 年 5 月 31 日正式生效，首次设立募集规模为 512,114,043.76 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人于 2021 年 8 月 17 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自 2021 年 8 月 19 日起，本基金增加 C 类份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，A 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，C 类基金份额的注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 1000 指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与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：本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股的资产（均含存托凭证）不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%＋银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

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)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额的持有人可选择现金红利或将

现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(2)基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3)本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同；

(4)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、监管部门规定以及基金合同的约定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经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进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但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	191,863,038.74	183,593,140.66
等于：本金	191,800,279.54	183,545,449.23
加：应计利息	62,759.20	47,691.43
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	191,863,038.74	183,593,140.66

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		1,674,604,434.10	-	1,682,069,598.02	7,465,163.92
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,674,604,434.10	-	1,682,069,598.02	7,465,163.92
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		3,269,316,203.49	-	3,057,404,834.23	-211,911,369.26
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,049,156.00	170,112.39	9,221,292.39	2,024.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,049,156.00	170,112.39	9,221,292.39	2,024.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,278,365,359.49	170,112.39	3,066,626,126.62	-211,909,345.26

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	203,211,920.00	-	-	-
股指期货	203,211,920.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	203,211,920.00	-	-	-

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	137.00	163,188,920.00	-9,697,200.00
IM2503	IM2503	25.00	29,407,000.00	-918,800.00
合计				-10,616,000.00
减：可抵销期货暂收款				-10,616,000.00
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	-	501.29
合计	-	501.29

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	10,872.85	2,591.91
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,024,275.87	2,922,658.85
其中：交易所市场	1,024,275.87	2,922,658.85
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00

预提审计费	55,000.00	55,000.00
应付指数使用费	90,184.95	126,567.45
合计	1,300,333.67	3,226,818.21

7.4.7.7 实收基金

富国中证 1000 指数增强（LOF）A：

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	1,016,344,929.26	1,016,344,929.26
本期申购	304,803,533.88	304,803,533.88
本期赎回（以“-”号填列）	-808,406,214.23	-808,406,214.23
本期末	512,742,248.91	512,742,248.91

富国中证 1000 指数增强（LOF）C：

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	800,555,533.30	800,555,533.30
本期申购	1,069,195,349.91	1,069,195,349.91
本期赎回（以“-”号填列）	-1,333,273,971.40	-1,333,273,971.40
本期末	536,476,911.81	536,476,911.81

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

富国中证 1000 指数增强（LOF）A：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	657,307,562.98	179,276,124.98	836,583,687.96
本期期初	657,307,562.98	179,276,124.98	836,583,687.96
本期利润	-112,831,384.38	147,970,404.25	35,139,019.87
本期基金份额交易产生的变动数	-256,674,390.23	-136,310,337.77	-392,984,728.00
其中：基金申购款	133,499,348.75	100,365,308.09	233,864,656.84
基金赎回款	-390,173,738.98	-236,675,645.86	-626,849,384.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	287,801,788.37	190,936,191.46	478,737,979.83

富国中证 1000 指数增强（LOF）C：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	510,673,263.40	141,363,115.57	652,036,378.97
本期期初	510,673,263.40	141,363,115.57	652,036,378.97

本期利润	-90,148,793.10	60,788,104.93	-29,360,688.17
本期基金份额交易产生的变动数	-125,857,331.89	-2,866,404.59	-128,723,736.48
其中：基金申购款	496,709,081.24	322,224,397.37	818,933,478.61
基金赎回款	-622,566,413.13	-325,090,801.96	-947,657,215.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	294,667,138.41	199,284,815.91	493,951,954.32

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	2,421,690.75	1,672,325.93
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	410,731.22	317,409.52
其他	65,272.12	157,396.34
合计	2,897,694.09	2,147,131.79

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	-258,645,316.27	-18,250,764.28
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-258,645,316.27	-18,250,764.28

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	10,472,571,353.14	8,732,284,283.99
减：卖出股票成本总额	10,717,474,174.80	8,728,510,699.53
减：交易费用	13,742,494.61	22,024,348.74
买卖股票差价收入	-258,645,316.27	-18,250,764.28

7.4.7.10.3 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	6,893.58	115,922.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	183,578.95	3,156,494.61
合计	190,472.53	3,272,417.26

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	10,010,585.70	15,428,442.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,649,956.00	12,269,000.00
减：应计利息总额	177,009.40	2,330.89
减：交易费用	41.35	617.19
买卖债券差价收入	183,578.95	3,156,494.61

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)
股指期货投资收益	50,225,144.27	-

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	32,180,340.09	35,560,423.52
其中:证券出借权益补偿收入	-	19,127.75
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	32,180,340.09	35,560,423.52

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	219,374,509.18	-20,278,818.45
股票投资	219,376,533.18	-20,057,987.65
债券投资	-2,024.00	-220,830.80
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2.衍生工具	-10,616,000.00	-
权证投资	-	-
股指期货	-10,616,000.00	-
3.其他	-	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	208,758,509.18	-20,278,818.45

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	779,212.76	1,012,435.91
基金转换费收入	3,101.48	5,108.16
合计	782,314.24	1,017,544.07

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	55,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	14,094.79	9,756.77
指数使用费	387,316.72	495,967.48
其他	100.32	25.87
合计	576,511.83	680,750.12

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、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
申万宏源西部证券有限公司	基金管理人的股东控制的子公司、基金代销机构
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
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	基金管理人的股东控制的子公司
富国鑫汇养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金

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	2,428,340,032.16	12.39	1,957,121,895.05	10.86
申万宏源	1,830,464,697.35	9.34	1,566,678,497.62	8.69

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	15,704.40	1.52	1,156,528.00	4.77
申万宏源	72,636.05	7.03	609,625.51	2.52

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	752,733.87	10.38	152,598.17	14.90
申万宏源	567,141.21	7.82	139,207.42	13.59
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	1,424,117.78	10.89	593,455.09	20.31
申万宏源	1,140,861.09	8.73	477,267.96	16.33

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	24,207,284.19	30,997,967.11
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,472,802.70	5,760,669.63
应支付基金管理人的净管理费	18,734,481.49	25,237,297.48

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.0%的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×1.0%/当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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	3,631,092.61	4,649,695.13

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.15%/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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）

联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国中证 1000 指数增强（LOF）A	富国中证 1000 指数增强（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	-	1,229,307.60	1,229,307.60
海通证券股份有限公司	-	161.58	161.58
申万宏源证券有限公司	-	2,588.93	2,588.93
合计	-	1,232,058.11	1,232,058.11

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国中证 1000 指数增强（LOF）A	富国中证 1000 指数增强（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	-	1,198,300.70	1,198,300.70
海通证券股份有限公司	-	146.88	146.88
申万宏源西部证券有限公司	-	1.58	1.58
申万宏源证券有限公司	-	565.64	565.64
合计	-	1,199,014.80	1,199,014.80

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.20%年费率计提。销售服务费计算方法如下：

H＝E×0.20%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，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

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	交易金额	费率区间（%）	加权平均费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
海通证券	2,828,161.00	3.10～7.00	4.10	4,018.03	-	-

注:本基金本报告期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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）		上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）	
	富国中证 1000 指数增强（LOF）A	富国中证 1000 指数增强（LOF）C	富国中证 1000 指数增强（LOF）A	富国中证 1000 指数增强（LOF）C
基金合同生效日（2018 年 05 月 31 日）持有的基金份额	-	-	-	-
期初持有的基金份额	14,851,583.18	-	14,851,583.18	485.18
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-	-	485.18
期末持有的基金份额	14,851,583.18	-	14,851,583.18	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.90%	-	1.46%	-

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

富国中证 1000 指数增强（LOF）C：

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(%)
富国鑫汇养老目标日期2045五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	-	-	2,546,471.24	0.32
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	3,120,111.96	0.58	6,224,605.66	0.78

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
中国农业银行股份有限公司	191,863,038.74	2,421,690.75	183,593,140.66	1,672,325.93

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	证券名	发行方	基金在承销期内买入

	码	称	式	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
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	603193	润本股份	IPO网下申购	3,022	52,522.36
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

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
001391	国货航	2024-12-23	6 个月	新股限售	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
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	-
301606	绿联科技	2024-07-17	6 个月	新股限售	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
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	-
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
002252	上海莱士	2024 年 12 月 23 日	重大事项停牌	6.96	2025 年 01 月 07 日	6.93	103,300.00	769,777.00	718,968.00	-
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	17,084.00	550,326.14	601,356.80	-

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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得

超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

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	-	250,316.83
未评级	-	-
合计	-	250,316.83

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。

本基金本报告期末及上年度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	191,863,038.74	—	—	—	—	—	191,863,038.74
结算备付金	13,635,322.87	—	—	—	—	—	13,635,322.87
存出保证金	693,084.66	—	—	—	—	23,111,510.40	23,804,595.06
交易性金融资产	—	—	—	—	—	1,682,069,598.02	1,682,069,598.02
应收清算款	—	—	—	—	—	529,535.56	529,535.56
应收申购款	20,506.00	—	—	—	—	134,199,769.09	134,220,275.09
资产总计	206,211,952.27	—	—	—	—	1,839,910,413.07	2,046,122,365.34
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	3,949,015.18	3,949,015.18
应付赎回款	—	—	—	—	—	16,463,135.41	16,463,135.41
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,607,985.95	1,607,985.95
应付托管费	—	—	—	—	—	241,197.90	241,197.90
应付销售服务费	—	—	—	—	—	147,782.02	147,782.02
应交税费	—	—	—	—	—	503,820.34	503,820.34
其他负债	—	—	—	—	—	1,300,333.67	1,300,333.67
负债总计	—	—	—	—	—	24,213,270.47	24,213,270.47
利率敏感度缺口	206,211,952.27	—	—	—	—	1,815,697,142.60	2,021,909,094.87
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	183,593,140.66	—	—	—	—	—	183,593,140.66
结算备付金	18,671,402.26	—	—	—	—	—	18,671,402.26
存出保证金	202,439.33	—	—	—	—	—	202,439.33
交易性金融资产	8,970,975.56	—	250,316.83	—	—	3,057,404,834.23	3,066,626,126.62
应收清算款	—	—	—	—	—	152,859.71	152,859.71
其他资产	—	—	—	—	—	501.29	501.29
应收申购款	30,027,348.39	—	—	—	—	20,962,488.05	50,989,836.44
资产总计	241,465,306.20	—	250,316.83	—	—	3,078,520,683.28	3,320,236,306.31
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	8,014,881.79	8,014,881.79
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,809,097.88	2,809,097.88
应付托管费	—	—	—	—	—	421,364.71	421,364.71
应付销售服务费	—	—	—	—	—	243,499.57	243,499.57
应交税费	—	—	—	—	—	114.66	114.66
其他负债	—	—	—	—	—	3,226,818.21	3,226,818.21
负债总计	—	—	—	—	—	14,715,776.82	14,715,776.82
利率敏感度缺口	241,465,306.20	—	250,316.83	—	—	3,063,804,906.46	3,305,520,529.49

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。本基金本期末未持有债券资产（不含可转债），因此本期末市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。		
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.基准点利率增加 0.1%	—	-368.71
	2.基准点利率减少 0.1%	—	368.71

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证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 1000 指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换

债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2024 年 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	1,682,069,598.02	83.19	3,057,404,834.23	92.49
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	9,221,292.39	0.28
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,682,069,598.02	83.19	3,066,626,126.62	92.77

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。	
		对资产负债表日基金资产净值的

分析	相关风险变量的变动	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%	18,939,413.27	31,937,908.62
	2.业绩比较基准减少 1%	-18,939,413.27	-31,937,908.62

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	1,680,260,314.43	3,050,919,053.54
第二层次	1,348,061.30	12,267,112.46
第三层次	461,222.29	3,439,960.62
合计	1,682,069,598.02	3,066,626,126.62

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）		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	—	3,439,960.62	3,439,960.62
当期购买	—	337,718.57	337,718.57
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	2,989,912.38	2,989,912.38
当期利得或损失总额	—	-326,544.52	-326,544.52
其中：计入损益的利得或损失	—	-326,544.52	-326,544.52
期末余额	—	461,222.29	461,222.29
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	—	261,886.13	261,886.13
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	—	19,474,482.92	19,474,482.92
当期购买	—	22,842,205.50	22,842,205.50
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	37,319,954.95	37,319,954.95
当期利得或损失总额	—	-1,556,772.85	-1,556,772.85
其中：计入损益的利得或损失	—	-1,556,772.85	-1,556,772.85
期末余额	—	3,439,960.62	3,439,960.62

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	—	-506,814.17	-506,814.17

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	461,222.29	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	3,439,960.62	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	0.1462-2.1775	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	1,682,069,598.02	82.21
	其中：股票	1,682,069,598.02	82.21
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	205,498,361.61	10.04
8	其他各项资产	158,554,405.71	7.75
9	合计	2,046,122,365.34	100.00

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	4,768,075.66	0.24
B	采矿业	15,339,557.09	0.76
C	制造业	894,600,924.50	44.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,033,226.66	2.87
E	建筑业	16,583,693.95	0.82
F	批发和零售业	39,828,594.70	1.97
G	交通运输、仓储和邮政业	103,520,810.20	5.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	144,211,536.56	7.13
J	金融业	53,408,755.73	2.64
K	房地产业	10,459,431.00	0.52
L	租赁和商务服务业	16,161,222.52	0.80
M	科学研究和技术服务业	17,539,170.35	0.87

N	水利、环境和公共设施管理业	15,855,755.80	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,861,555.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	27,224,886.40	1.35
S	综合	-	-
	合计	1,419,397,196.12	70.20

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	493,334.00	0.02
B	采矿业	6,556,011.00	0.32
C	制造业	158,607,507.48	7.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,334,029.94	0.46
E	建筑业	4,092,964.00	0.20
F	批发和零售业	4,117,749.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	3,401,096.80	0.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,133,768.53	1.49
J	金融业	37,728,884.80	1.87
K	房地产业	1,944,549.00	0.10
L	租赁和商务服务业	1,014,943.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	2,433,418.35	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	1,192,140.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,770.00	0.00
Q	卫生和社会工作	684,990.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	932,246.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	262,672,401.90	12.99

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	1,506,100	18,043,078.00	0.89
2	002249	大洋电机	2,398,530	14,079,371.10	0.70
3	000902	新洋丰	999,500	13,033,480.00	0.64
4	000062	深圳华强	529,300	11,856,320.00	0.59

5	300627	华测导航	282,200	11,795,960.00	0.58
6	300045	华力创通	554,500	11,583,505.00	0.57
7	601222	林洋能源	1,606,400	11,357,248.00	0.56
8	000429	粤高速A	752,834	11,066,659.80	0.55
9	600328	中盐化工	1,405,040	11,057,664.80	0.55
10	002815	崇达技术	1,076,174	10,976,974.80	0.54
11	002967	广电计量	657,200	10,778,080.00	0.53
12	002745	木林森	1,233,600	10,756,992.00	0.53
13	600757	长江传媒	1,121,900	10,736,583.00	0.53
14	603299	苏盐井神	963,400	10,732,276.00	0.53
15	002461	珠江啤酒	1,004,014	9,929,698.46	0.49
16	002003	伟星股份	694,060	9,834,830.20	0.49
17	002020	京新药业	763,080	9,767,424.00	0.48
18	601369	陕鼓动力	1,116,502	9,713,567.40	0.48
19	600320	振华重工	2,452,120	9,612,310.40	0.48
20	300663	科蓝软件	546,200	9,482,032.00	0.47
21	000581	威孚高科	493,669	9,320,470.72	0.46
22	600033	福建高速	2,366,600	9,182,408.00	0.45
23	600531	豫光金铅	1,395,400	8,958,468.00	0.44
24	000685	中山公用	966,199	8,918,016.77	0.44
25	002267	陕天然气	1,052,366	8,892,492.70	0.44
26	002701	奥瑞金	1,503,300	8,523,711.00	0.42
27	300735	光弘科技	297,200	8,318,628.00	0.41
28	000951	中国重汽	477,200	8,102,856.00	0.40
29	601083	锦江航运	833,000	7,930,160.00	0.39
30	002550	千红制药	1,267,400	7,857,880.00	0.39
31	603323	苏农银行	1,485,195	7,856,681.55	0.39
32	600874	创业环保	1,305,100	7,791,447.00	0.39
33	000828	东莞控股	726,500	7,766,285.00	0.38
34	601811	新华文轩	483,700	7,666,645.00	0.38
35	600919	江苏银行	761,200	7,474,984.00	0.37
36	002139	拓邦股份	540,300	7,353,483.00	0.36
37	300303	聚飞光电	1,075,300	7,333,546.00	0.36
38	300674	宇信科技	372,799	7,277,036.48	0.36
39	600420	国药现代	607,200	7,249,968.00	0.36
40	600648	外高桥	602,600	7,176,966.00	0.35
41	600887	伊利股份	237,300	7,161,714.00	0.35
42	000848	承德露露	764,100	6,853,977.00	0.34
43	600073	光明肉业	979,422	6,797,188.68	0.34
44	600710	苏美达	711,801	6,619,749.30	0.33
45	301039	中集车辆	731,400	6,619,170.00	0.33

46	600717	天津港	1,328,800	6,471,256.00	0.32
47	002948	青岛银行	1,655,300	6,422,564.00	0.32
48	601311	骆驼股份	770,469	6,387,188.01	0.32
49	600267	海正药业	763,400	6,336,220.00	0.31
50	002204	大连重工	1,265,100	6,300,198.00	0.31
51	600323	瀚蓝环境	266,140	6,286,226.80	0.31
52	600550	保变电气	798,600	6,269,010.00	0.31
53	603301	振德医疗	283,100	6,225,369.00	0.31
54	000966	长源电力	1,309,100	6,218,225.00	0.31
55	688018	乐鑫科技	28,137	6,133,866.00	0.30
56	002004	华邦健康	1,348,100	6,093,412.00	0.30
57	002023	海特高新	596,200	6,051,430.00	0.30
58	002807	江阴银行	1,363,100	5,929,485.00	0.29
59	600269	赣粤高速	1,052,300	5,903,403.00	0.29
60	001213	中铁特货	1,409,300	5,876,781.00	0.29
61	601766	中国中车	697,500	5,845,050.00	0.29
62	601163	三角轮胎	387,400	5,838,118.00	0.29
63	002233	塔牌集团	758,700	5,819,229.00	0.29
64	600017	日照港	1,811,900	5,798,080.00	0.29
65	000990	诚志股份	747,000	5,789,250.00	0.29
66	603328	依顿电子	579,000	5,708,940.00	0.28
67	300598	诚迈科技	116,225	5,625,290.00	0.28
68	000538	云南白药	93,300	5,593,335.00	0.28
69	600100	同方股份	777,300	5,526,603.00	0.27
70	688235	百济神州	34,082	5,487,883.64	0.27
71	000503	国新健康	499,100	5,480,118.00	0.27
72	000725	京东方A	1,228,800	5,394,432.00	0.27
73	600718	东软集团	495,000	5,331,150.00	0.26
74	601326	秦港股份	1,579,500	5,291,325.00	0.26
75	600138	中青旅	518,200	5,254,548.00	0.26
76	000969	安泰科技	468,574	5,224,600.10	0.26
77	300232	洲明科技	748,000	5,138,760.00	0.25
78	002275	桂林三金	339,800	5,127,582.00	0.25
79	300180	华峰超纤	801,900	5,051,970.00	0.25
80	002839	张家港行	1,128,900	4,933,293.00	0.24
81	601988	中国银行	891,900	4,914,369.00	0.24
82	000528	柳工	404,225	4,874,953.50	0.24
83	600941	中国移动	41,100	4,856,376.00	0.24
84	601333	广深铁路	1,407,200	4,826,696.00	0.24
85	300079	数码视讯	891,200	4,821,392.00	0.24
86	002034	旺能环境	308,419	4,780,494.50	0.24

87	300455	航天智装	367,300	4,760,208.00	0.24
88	002635	安洁科技	296,200	4,715,504.00	0.23
89	002274	华昌化工	601,700	4,675,209.00	0.23
90	600125	铁龙物流	786,900	4,666,317.00	0.23
91	603075	热威股份	249,586	4,649,787.18	0.23
92	600900	长江电力	155,500	4,595,025.00	0.23
93	601528	瑞丰银行	815,600	4,591,828.00	0.23
94	002906	华阳集团	147,900	4,547,925.00	0.22
95	603985	恒润股份	386,306	4,512,054.08	0.22
96	688327	云从科技	367,872	4,451,251.20	0.22
97	002544	普天科技	206,700	4,429,581.00	0.22
98	600618	氯碱化工	448,300	4,420,238.00	0.22
99	600623	华谊集团	626,500	4,385,500.00	0.22
100	601921	浙版传媒	555,800	4,379,704.00	0.22
101	300638	广和通	216,400	4,360,460.00	0.22
102	601939	建设银行	490,600	4,312,374.00	0.21
103	600059	古越龙山	482,500	4,284,600.00	0.21
104	300181	佐力药业	275,600	4,233,216.00	0.21
105	002446	盛路通信	645,400	4,227,370.00	0.21
106	601088	中国神华	97,000	4,217,560.00	0.21
107	600908	无锡银行	706,634	4,176,206.94	0.21
108	000089	深圳机场	604,800	4,167,072.00	0.21
109	600621	华鑫股份	252,300	4,157,904.00	0.21
110	600926	杭州银行	284,000	4,149,240.00	0.21
111	600352	浙江龙盛	403,200	4,148,928.00	0.21
112	600728	佳都科技	885,200	4,142,736.00	0.20
113	601187	厦门银行	732,700	4,132,428.00	0.20
114	300623	捷捷微电	120,300	4,109,448.00	0.20
115	301050	雷电微力	79,100	4,079,978.00	0.20
116	001258	立新能源	511,600	4,072,336.00	0.20
117	300573	兴齐眼药	58,260	4,065,382.80	0.20
118	688019	安集科技	28,595	3,984,999.20	0.20
119	601137	博威合金	192,400	3,905,720.00	0.19
120	002063	远光软件	667,800	3,846,528.00	0.19
121	601728	中国电信	531,651	3,838,520.22	0.19
122	300346	南大光电	98,800	3,812,692.00	0.19
123	300077	国民技术	157,300	3,750,032.00	0.19
124	688088	虹软科技	96,871	3,735,345.76	0.18
125	002459	晶澳科技	271,600	3,734,500.00	0.18
126	600116	三峡水利	529,900	3,704,001.00	0.18
127	603005	晶方科技	130,900	3,697,925.00	0.18

128	002837	英维克	89,964	3,634,545.60	0.18
129	300083	创世纪	554,000	3,606,540.00	0.18
130	600305	恒顺醋业	450,500	3,594,990.00	0.18
131	300170	汉得信息	289,500	3,589,800.00	0.18
132	002891	中宠股份	98,850	3,528,945.00	0.17
133	600596	新安股份	395,900	3,476,002.00	0.17
134	300036	超图软件	201,000	3,412,980.00	0.17
135	000756	新华制药	213,800	3,358,798.00	0.17
136	600037	歌华有线	448,700	3,347,302.00	0.17
137	603281	江瀚新材	135,940	3,316,936.00	0.16
138	600820	隧道股份	459,500	3,303,805.00	0.16
139	300857	协创数据	30,800	3,292,212.00	0.16
140	300850	新强联	171,900	3,285,009.00	0.16
141	002237	恒邦股份	325,000	3,282,500.00	0.16
142	688321	微芯生物	175,711	3,264,710.38	0.16
143	600929	雪天盐业	578,641	3,234,603.19	0.16
144	300408	三环集团	83,900	3,230,989.00	0.16
145	688608	恒玄科技	9,820	3,195,133.40	0.16
146	603995	甬金股份	173,000	3,164,170.00	0.16
147	300457	赢合科技	165,175	3,161,449.50	0.16
148	002048	宁波华翔	249,300	3,146,166.00	0.16
149	002130	沃尔核材	124,300	3,138,575.00	0.16
150	688048	长光华芯	80,411	3,135,224.89	0.16
151	000061	农 产 品	445,800	3,125,058.00	0.15
152	002498	汉缆股份	909,461	3,083,072.79	0.15
153	600662	外服控股	605,400	3,069,378.00	0.15
154	002851	麦格米特	49,900	3,066,854.00	0.15
155	002928	华夏航空	395,200	3,066,752.00	0.15
156	000895	双汇发展	116,400	3,021,744.00	0.15
157	000681	视觉中国	144,900	3,016,818.00	0.15
158	601677	明泰铝业	250,600	3,014,718.00	0.15
159	300261	雅本化学	438,200	3,001,670.00	0.15
160	600597	光明乳业	349,900	2,988,146.00	0.15
161	300750	宁德时代	11,200	2,979,200.00	0.15
162	300123	亚光科技	511,774	2,968,289.20	0.15
163	688598	金博股份	139,146	2,930,414.76	0.14
164	600548	深高速	216,800	2,922,464.00	0.14
165	688766	普冉股份	28,701	2,906,263.26	0.14
166	300672	国科微	43,500	2,903,625.00	0.14
167	002091	江苏国泰	394,400	2,887,008.00	0.14
168	002215	诺 普 信	256,500	2,880,495.00	0.14

169	000543	皖能电力	363,200	2,872,912.00	0.14
170	000686	东北证券	361,000	2,866,340.00	0.14
171	688167	炬光科技	44,888	2,859,365.60	0.14
172	002097	山河智能	381,200	2,859,000.00	0.14
173	301316	慧博云通	111,800	2,858,726.00	0.14
174	688110	东芯股份	114,012	2,838,898.80	0.14
175	000597	东北制药	536,000	2,824,720.00	0.14
176	601126	四方股份	166,300	2,820,448.00	0.14
177	002668	TCL 智家	212,700	2,790,624.00	0.14
178	000088	盐 田 港	572,500	2,788,075.00	0.14
179	300773	拉卡拉	156,800	2,775,360.00	0.14
180	600133	东湖高新	295,900	2,766,665.00	0.14
181	600285	羚锐制药	124,402	2,756,748.32	0.14
182	002354	天娱数科	511,600	2,747,292.00	0.14
183	600562	国睿科技	137,540	2,741,172.20	0.14
184	603638	艾迪精密	161,900	2,734,491.00	0.14
185	002777	久远银海	158,000	2,720,760.00	0.13
186	600642	申能股份	285,806	2,712,298.94	0.13
187	601818	光大银行	691,500	2,676,105.00	0.13
188	002053	云南能投	234,600	2,674,440.00	0.13
189	002626	金达威	177,110	2,674,361.00	0.13
190	688798	艾为电子	37,869	2,644,013.58	0.13
191	605507	国邦医药	126,500	2,634,995.00	0.13
192	601398	工商银行	377,200	2,610,224.00	0.13
193	301339	通行宝	127,798	2,599,411.32	0.13
194	300130	新国都	119,400	2,586,204.00	0.13
195	601607	上海医药	122,900	2,580,900.00	0.13
196	000719	中原传媒	225,065	2,556,738.40	0.13
197	688556	高测股份	228,484	2,554,451.12	0.13
198	002396	星网锐捷	134,100	2,546,559.00	0.13
199	601022	宁波远洋	316,900	2,544,707.00	0.13
200	600019	宝钢股份	362,756	2,539,292.00	0.13
201	688066	航天宏图	124,023	2,530,069.20	0.13
202	000881	中广核技	344,500	2,525,185.00	0.12
203	300458	全志科技	64,700	2,507,772.00	0.12
204	300035	中科电气	166,000	2,481,700.00	0.12
205	000035	中国天楹	507,900	2,473,473.00	0.12
206	002970	锐明技术	51,800	2,467,234.00	0.12
207	600409	三友化工	456,100	2,462,940.00	0.12
208	605111	新洁能	72,200	2,448,302.00	0.12
209	002043	兔 宝 宝	205,900	2,446,092.00	0.12

210	000970	中科三环	235,300	2,440,061.00	0.12
211	600273	嘉化能源	304,400	2,426,068.00	0.12
212	688388	嘉元科技	163,178	2,403,611.94	0.12
213	688568	中科星图	47,043	2,400,604.29	0.12
214	601069	西部黄金	209,100	2,394,195.00	0.12
215	300624	万兴科技	37,865	2,391,174.75	0.12
216	603609	禾丰股份	276,900	2,386,878.00	0.12
217	600330	天通股份	334,401	2,374,247.10	0.12
218	002176	江特电机	319,400	2,366,754.00	0.12
219	300475	香农芯创	83,000	2,364,670.00	0.12
220	002651	利君股份	321,200	2,354,396.00	0.12
221	002226	江南化工	431,900	2,340,898.00	0.12
222	600456	宝钛股份	82,000	2,332,900.00	0.12
223	688183	生益电子	59,349	2,330,041.74	0.12
224	600572	康恩贝	499,770	2,328,928.20	0.12
225	300770	新媒股份	57,400	2,319,534.00	0.11
226	601816	京沪高铁	370,300	2,281,048.00	0.11
227	688439	振华风光	44,434	2,279,019.86	0.11
228	301180	万祥科技	147,300	2,278,731.00	0.11
229	300685	艾德生物	99,700	2,273,160.00	0.11
230	601200	上海环境	277,900	2,270,443.00	0.11
231	002913	奥士康	94,000	2,266,340.00	0.11
232	600183	生益科技	94,000	2,260,700.00	0.11
233	688408	中信博	31,227	2,248,344.00	0.11
234	002726	龙大美食	280,060	2,218,075.20	0.11
235	605090	九丰能源	77,600	2,213,928.00	0.11
236	603039	泛微网络	45,000	2,205,000.00	0.11
237	000650	仁和药业	375,100	2,160,576.00	0.11
238	688498	源杰科技	15,981	2,144,650.20	0.11
239	300777	中简科技	75,600	2,138,724.00	0.11
240	688578	艾力斯	35,263	2,112,253.70	0.10
241	300438	鹏辉能源	75,100	2,111,061.00	0.10
242	688007	光峰科技	140,798	2,082,402.42	0.10
243	603013	亚普股份	138,377	2,072,887.46	0.10
244	300113	顺网科技	123,252	2,071,866.12	0.10
245	603533	掌阅科技	102,000	2,071,620.00	0.10
246	300229	拓尔思	98,700	2,066,778.00	0.10
247	002895	川恒股份	83,800	2,061,480.00	0.10
248	000676	智度股份	242,800	2,054,088.00	0.10
249	002387	维信诺	199,700	2,052,916.00	0.10
250	603162	海通发展	223,048	2,052,041.60	0.10

251	603699	纽威股份	92,500	2,050,725.00	0.10
252	300327	中颖电子	83,700	2,048,139.00	0.10
253	000550	江铃汽车	87,100	2,042,495.00	0.10
254	603516	淳中科技	36,700	2,028,776.00	0.10
255	002061	浙江交科	496,400	2,025,312.00	0.10
256	603169	兰石重装	370,700	2,020,315.00	0.10
257	600888	新疆众和	284,482	2,019,822.20	0.10
258	600812	华北制药	390,100	2,016,817.00	0.10
259	002539	云图控股	251,900	1,969,858.00	0.10
260	000885	城发环境	150,000	1,966,500.00	0.10
261	600301	华锡有色	114,800	1,952,748.00	0.10
262	001287	中电港	96,120	1,952,197.20	0.10
263	300319	麦捷科技	156,400	1,951,872.00	0.10
264	002911	佛燃能源	153,836	1,944,487.04	0.10
265	001914	招商积余	182,400	1,927,968.00	0.10
266	688185	康希诺	31,258	1,908,300.90	0.09
267	600438	通威股份	86,300	1,908,093.00	0.09
268	002597	金禾实业	83,500	1,906,305.00	0.09
269	600064	南京高科	244,600	1,900,542.00	0.09
270	301171	易点天下	67,400	1,900,006.00	0.09
271	002468	申通快递	186,400	1,888,232.00	0.09
272	688270	臻镭科技	53,877	1,885,695.00	0.09
273	603881	数据港	83,030	1,880,629.50	0.09
274	000758	中色股份	377,462	1,864,662.28	0.09
275	300284	苏交科	183,100	1,858,465.00	0.09
276	000928	中钢国际	291,200	1,854,944.00	0.09
277	300433	蓝思科技	84,600	1,852,740.00	0.09
278	603893	瑞芯微	16,800	1,849,008.00	0.09
279	601838	成都银行	106,300	1,818,793.00	0.09
280	002773	康弘药业	91,300	1,789,480.00	0.09
281	688111	金山办公	6,247	1,789,078.33	0.09
282	603067	振华股份	141,392	1,785,780.96	0.09
283	601096	宏盛华源	409,300	1,780,455.00	0.09
284	688023	安恒信息	43,198	1,762,478.40	0.09
285	601127	赛力斯	12,900	1,720,731.00	0.09
286	300738	奥飞数据	118,280	1,715,060.00	0.08
287	002405	四维图新	175,900	1,695,676.00	0.08
288	601963	重庆银行	181,500	1,684,320.00	0.08
289	600563	法拉电子	14,100	1,676,772.00	0.08
290	600216	浙江医药	105,300	1,670,058.00	0.08
291	001309	德明利	18,900	1,648,080.00	0.08

292	002585	双星新材	307,800	1,643,652.00	0.08
293	300088	长信科技	250,300	1,636,962.00	0.08
294	000030	富奥股份	318,700	1,634,931.00	0.08
295	600487	亨通光电	94,800	1,632,456.00	0.08
296	688336	三生国健	75,806	1,623,764.52	0.08
297	603693	江苏新能	164,653	1,621,832.05	0.08
298	600428	中远海特	221,300	1,615,490.00	0.08
299	603025	大豪科技	105,720	1,612,230.00	0.08
300	002230	科大讯飞	33,200	1,604,224.00	0.08
301	300761	立华股份	82,400	1,603,504.00	0.08
302	603055	台华新材	144,500	1,601,060.00	0.08
303	688150	莱特光电	71,056	1,600,181.12	0.08
304	300677	英科医疗	63,280	1,599,718.40	0.08
305	688700	东威科技	54,271	1,598,823.66	0.08
306	300115	长盈精密	98,320	1,596,716.80	0.08
307	002245	蔚蓝锂芯	148,800	1,590,672.00	0.08
308	601886	江河集团	293,100	1,582,740.00	0.08
309	688596	正帆科技	44,369	1,577,317.95	0.08
310	603612	索通发展	116,300	1,571,213.00	0.08
311	603871	嘉友国际	80,788	1,563,247.80	0.08
312	688711	宏微科技	90,241	1,559,364.48	0.08
313	002428	云南锗业	82,400	1,557,360.00	0.08
314	300393	中来股份	249,080	1,556,750.00	0.08
315	001339	智微智能	42,200	1,544,098.00	0.08
316	002100	天康生物	235,500	1,542,525.00	0.08
317	000422	湖北宜化	121,900	1,538,378.00	0.08
318	002145	中核钛白	362,700	1,537,848.00	0.08
319	600961	株冶集团	195,100	1,535,437.00	0.08
320	605589	圣泉集团	65,100	1,535,058.00	0.08
321	000498	山东路桥	257,361	1,531,297.95	0.08
322	002212	天融信	237,300	1,530,585.00	0.08
323	003006	百亚股份	63,600	1,525,764.00	0.08
324	301559	中集环科	99,300	1,524,255.00	0.08
325	300418	昆仑万维	39,500	1,519,960.00	0.08
326	300726	宏达电子	48,800	1,517,680.00	0.08
327	605333	沪光股份	46,500	1,517,295.00	0.08
328	002654	万润科技	123,900	1,502,907.00	0.07
329	600641	万业企业	102,700	1,501,474.00	0.07
330	688352	颀中科技	123,399	1,496,829.87	0.07
331	300033	同花顺	5,200	1,495,000.00	0.07
332	002151	北斗星通	56,300	1,494,202.00	0.07

333	300075	数字政通	85,400	1,477,420.00	0.07
334	600502	安徽建工	307,700	1,470,806.00	0.07
335	300525	博思软件	94,400	1,470,752.00	0.07
336	002191	劲嘉股份	349,800	1,469,160.00	0.07
337	300257	开山股份	160,500	1,463,760.00	0.07
338	688123	聚辰股份	24,971	1,461,302.92	0.07
339	600020	中原高速	345,300	1,457,166.00	0.07
340	000019	深粮控股	220,580	1,449,210.60	0.07
341	000968	蓝焰控股	216,400	1,439,060.00	0.07
342	601375	中原证券	332,307	1,435,566.24	0.07
343	300039	上海凯宝	232,130	1,434,563.40	0.07
344	301511	德福科技	114,100	1,433,096.00	0.07
345	688315	诺禾致源	114,343	1,429,287.50	0.07
346	301327	华宝新能	18,600	1,426,806.00	0.07
347	688333	铂力特	36,057	1,421,727.51	0.07
348	605376	博迁新材	49,100	1,421,445.00	0.07
349	603477	巨星农牧	80,000	1,420,000.00	0.07
350	688107	安路科技	47,733	1,411,942.14	0.07
351	688266	泽璟制药	22,657	1,411,757.67	0.07
352	601869	长飞光纤	47,200	1,410,808.00	0.07
353	300618	寒锐钴业	41,640	1,406,182.80	0.07
354	605358	立昂微	56,040	1,388,110.80	0.07
355	002073	软控股份	166,900	1,378,594.00	0.07
356	301262	海看股份	55,400	1,377,798.00	0.07
357	600882	妙可蓝多	76,000	1,360,400.00	0.07
358	000736	中交地产	158,000	1,358,800.00	0.07
359	002206	海 利 得	314,700	1,350,063.00	0.07
360	605365	立达信	85,600	1,343,920.00	0.07
361	600163	中闽能源	219,900	1,339,191.00	0.07
362	603583	捷昌驱动	54,075	1,336,193.25	0.07
363	603530	神马电力	53,700	1,326,927.00	0.07
364	600217	中再资环	249,500	1,322,350.00	0.07
365	000404	长虹华意	178,500	1,320,900.00	0.07
366	301239	普瑞眼科	28,100	1,317,890.00	0.07
367	603733	仙鹤股份	63,700	1,314,131.00	0.06
368	000628	高新发展	20,900	1,301,861.00	0.06
369	603267	鸿远电子	35,900	1,300,657.00	0.06
370	601702	华峰铝业	70,800	1,297,056.00	0.06
371	300119	瑞普生物	70,400	1,293,248.00	0.06
372	002985	北摩高科	54,800	1,287,800.00	0.06
373	300641	正丹股份	51,600	1,281,744.00	0.06

374	600063	皖维高新	319,300	1,277,200.00	0.06
375	605020	永和股份	62,600	1,272,658.00	0.06
376	300031	宝通科技	69,400	1,271,408.00	0.06
377	600971	恒源煤电	134,900	1,269,409.00	0.06
378	000426	兴业银锡	113,600	1,263,232.00	0.06
379	001301	尚太科技	18,300	1,254,465.00	0.06
380	300821	东岳硅材	160,900	1,248,584.00	0.06
381	000729	燕京啤酒	102,700	1,236,508.00	0.06
382	300570	太辰光	17,000	1,235,900.00	0.06
383	002421	达实智能	358,300	1,228,969.00	0.06
384	600490	鹏欣资源	370,200	1,217,958.00	0.06
385	001236	弘业期货	126,000	1,214,640.00	0.06
386	601577	长沙银行	135,900	1,208,151.00	0.06
387	605305	中际联合	42,440	1,202,325.20	0.06
388	301217	铜冠铜箔	108,300	1,199,964.00	0.06
389	600850	电科数字	49,900	1,192,610.00	0.06
390	600864	哈投股份	162,200	1,192,170.00	0.06
391	300666	江丰电子	17,100	1,187,595.00	0.06
392	600012	皖通高速	66,800	1,179,020.00	0.06
393	600810	神马股份	145,300	1,175,477.00	0.06
394	000917	电广传媒	166,000	1,173,620.00	0.06
395	002483	润邦股份	224,600	1,170,166.00	0.06
396	601033	永兴股份	80,800	1,168,368.00	0.06
397	601009	南京银行	109,500	1,166,175.00	0.06
398	688522	纳睿雷达	20,694	1,165,899.96	0.06
399	300415	伊之密	58,100	1,165,486.00	0.06
400	688586	江航装备	121,013	1,158,094.41	0.06
401	002987	京北方	81,000	1,152,630.00	0.06
402	300182	捷成股份	195,200	1,145,824.00	0.06
403	002190	成飞集成	59,200	1,144,928.00	0.06
404	600645	中源协和	59,200	1,142,560.00	0.06
405	300134	大富科技	97,300	1,141,329.00	0.06
406	300783	三只松鼠	30,800	1,135,596.00	0.06
407	688372	伟测科技	19,383	1,134,293.16	0.06
408	600643	爱建集团	218,900	1,131,713.00	0.06
409	603983	丸美生物	35,000	1,129,100.00	0.06
410	688252	天德钰	47,080	1,127,566.00	0.06
411	688005	容百科技	35,620	1,123,811.00	0.06
412	601825	沪农商行	131,500	1,119,065.00	0.06
413	002991	甘源食品	11,900	1,112,888.00	0.06
414	600458	时代新材	86,500	1,108,065.00	0.05

415	605117	德业股份	13,000	1,102,400.00	0.05
416	300725	药石科技	32,800	1,102,080.00	0.05
417	002174	游族网络	117,500	1,098,625.00	0.05
418	002615	哈尔斯	138,000	1,097,100.00	0.05
419	688696	极米科技	11,188	1,096,647.76	0.05
420	688169	石头科技	4,967	1,089,213.43	0.05
421	601952	苏垦农发	110,800	1,084,732.00	0.05
422	301029	怡合达	43,700	1,080,264.00	0.05
423	300185	通裕重工	413,700	1,063,209.00	0.05
424	600894	广日股份	72,000	1,051,200.00	0.05
425	688095	福昕软件	15,629	1,049,643.64	0.05
426	001311	多利科技	40,652	1,048,415.08	0.05
427	600602	云赛智联	65,500	1,036,210.00	0.05
428	002099	海翔药业	200,800	1,036,128.00	0.05
429	002153	石基信息	144,300	1,030,302.00	0.05
430	688128	中国电研	48,994	1,029,363.94	0.05
431	301153	中科江南	36,720	1,025,956.80	0.05
432	002865	钧达股份	20,000	1,022,000.00	0.05
433	300757	罗博特科	4,520	1,018,446.40	0.05
434	002649	博彦科技	83,700	1,014,444.00	0.05
435	688009	中国通号	161,676	1,012,091.76	0.05
436	000034	神州数码	28,800	1,009,440.00	0.05
437	000582	北部湾港	128,000	1,008,640.00	0.05
438	300151	昌红科技	59,100	1,004,700.00	0.05
439	300360	炬华科技	59,600	999,492.00	0.05
440	000423	东阿阿胶	15,900	997,248.00	0.05
441	603083	剑桥科技	24,500	994,700.00	0.05
442	300776	帝尔激光	15,600	991,848.00	0.05
443	600151	航天机电	124,200	991,116.00	0.05
444	688213	思特威	12,747	990,696.84	0.05
445	601658	邮储银行	172,700	980,936.00	0.05
446	600395	盘江股份	192,200	978,298.00	0.05
447	300579	数字认证	31,000	974,020.00	0.05
448	600248	陕建股份	214,600	961,408.00	0.05
449	600366	宁波韵升	129,900	956,064.00	0.05
450	001270	铖昌科技	24,936	950,061.60	0.05
451	300679	电连技术	15,800	943,260.00	0.05
452	301205	联特科技	12,414	939,615.66	0.05
453	600575	淮河能源	235,300	934,141.00	0.05
454	300085	银之杰	24,400	933,300.00	0.05
455	002916	深南电路	7,400	925,000.00	0.05

456	000901	航天科技	84,300	924,771.00	0.05
457	300363	博腾股份	58,150	917,025.50	0.05
458	300001	特锐德	41,700	915,315.00	0.05
459	300590	移为通信	59,200	915,232.00	0.05
460	603408	建霖家居	72,700	910,931.00	0.05
461	301175	中科环保	167,800	906,120.00	0.04
462	688639	华恒生物	28,079	904,424.59	0.04
463	688776	国光电气	19,088	903,435.04	0.04
464	000766	通化金马	57,000	894,900.00	0.04
465	300747	锐科激光	46,520	891,323.20	0.04
466	600879	航天电子	99,400	890,624.00	0.04
467	301377	鼎泰高科	41,700	881,955.00	0.04
468	002222	福晶科技	27,170	880,308.00	0.04
469	300576	容大感光	19,400	876,492.00	0.04
470	603986	兆易创新	8,200	875,760.00	0.04
471	688232	新点软件	30,114	873,004.86	0.04
472	603565	中谷物流	89,000	872,200.00	0.04
473	688686	奥普特	11,532	871,934.52	0.04
474	601098	中南传媒	57,600	864,576.00	0.04
475	601319	中国人保	113,200	862,584.00	0.04
476	601068	中铝国际	194,900	859,509.00	0.04
477	601678	滨化股份	228,400	858,784.00	0.04
478	300443	金雷股份	43,100	858,552.00	0.04
479	600422	昆药集团	54,100	857,485.00	0.04
480	002968	新大正	92,800	854,688.00	0.04
481	002138	顺络电子	27,000	849,960.00	0.04
482	300682	朗新集团	69,600	849,120.00	0.04
483	300406	九强生物	63,400	847,024.00	0.04
484	000012	南　玻Ａ	159,825	843,876.00	0.04
485	600206	有研新材	53,500	838,345.00	0.04
486	300294	博雅生物	27,600	835,728.00	0.04
487	000048	京基智农	46,400	835,200.00	0.04
488	688233	神工股份	35,584	834,444.80	0.04
489	000935	四川双马	57,300	829,704.00	0.04
490	600997	开滦股份	122,100	825,396.00	0.04
491	688016	心脉医疗	7,477	821,348.45	0.04
492	002847	盐津铺子	13,110	820,686.00	0.04
493	300263	隆华科技	112,300	819,790.00	0.04
494	600869	远东股份	171,000	812,250.00	0.04
495	688127	蓝特光学	29,702	804,924.20	0.04
496	601231	环旭电子	48,600	801,900.00	0.04

497	600639	浦东金桥	72,200	801,420.00	0.04
498	603118	共进股份	89,660	797,974.00	0.04
499	300529	健帆生物	27,000	792,180.00	0.04
500	000837	秦川机床	88,300	792,051.00	0.04
501	002850	科达利	8,100	791,208.00	0.04
502	688261	东微半导	18,679	784,331.21	0.04
503	002125	湘潭电化	77,700	783,216.00	0.04
504	601515	东峰集团	196,500	782,070.00	0.04
505	002881	美格智能	26,100	781,956.00	0.04
506	002534	西子洁能	69,825	775,755.75	0.04
507	300379	东方通	51,200	772,608.00	0.04
508	600649	城投控股	172,600	768,070.00	0.04
509	600732	爱旭股份	69,100	761,482.00	0.04
510	600160	巨化股份	31,500	759,780.00	0.04
511	603439	贵州三力	58,300	757,900.00	0.04
512	301187	欧圣电气	22,200	757,020.00	0.04
513	600461	洪城环境	75,800	754,210.00	0.04
514	600383	金地集团	172,000	753,360.00	0.04
515	002389	航天彩虹	41,700	752,685.00	0.04
516	002085	万丰奥威	39,600	750,420.00	0.04
517	002312	川发龙蟒	51,800	749,546.00	0.04
518	300166	东方国信	79,600	748,240.00	0.04
519	600482	中国动力	30,400	743,888.00	0.04
520	000927	中国铁物	282,800	743,764.00	0.04
521	688208	道通科技	18,849	738,126.84	0.04
522	300080	易成新能	168,600	736,782.00	0.04
523	002202	金风科技	71,300	736,529.00	0.04
524	601860	紫金银行	258,200	735,870.00	0.04
525	300253	卫宁健康	102,600	734,616.00	0.04
526	300996	普联软件	40,500	733,860.00	0.04
527	688503	聚和材料	16,562	733,530.98	0.04
528	600075	新疆天业	168,605	733,431.75	0.04
529	600577	精达股份	100,100	729,729.00	0.04
530	002938	鹏鼎控股	19,800	722,304.00	0.04
531	000888	峨眉山A	54,400	719,712.00	0.04
532	002252	上海莱士	103,300	718,968.00	0.04
533	603218	日月股份	59,100	712,155.00	0.04
534	002014	永新股份	64,600	708,016.00	0.04
535	000735	罗 牛 山	105,601	703,302.66	0.03
536	603220	中贝通信	30,330	696,680.10	0.03
537	600315	上海家化	40,900	691,619.00	0.03

538	000680	山推股份	71,100	689,670.00	0.03
539	600120	浙江东方	146,800	684,088.00	0.03
540	600006	东风股份	91,900	677,303.00	0.03
541	600986	浙文互联	112,800	674,544.00	0.03
542	688253	英诺特	18,337	664,899.62	0.03
543	600266	城建发展	129,600	660,960.00	0.03
544	002171	楚江新材	80,600	660,920.00	0.03
545	688432	有研硅	58,157	657,174.10	0.03
546	600219	南山铝业	167,950	656,684.50	0.03
547	002194	武汉凡谷	58,200	653,004.00	0.03
548	002390	信邦制药	143,400	652,470.00	0.03
549	688348	昱能科技	13,358	651,870.40	0.03
550	600667	太极实业	94,100	651,172.00	0.03
551	300463	迈克生物	49,300	650,760.00	0.03
552	300432	富临精工	42,300	650,574.00	0.03
553	600660	福耀玻璃	10,400	648,960.00	0.03
554	600863	内蒙华电	149,000	645,170.00	0.03
555	000066	中国长城	44,000	641,080.00	0.03
556	002284	亚太股份	82,800	640,872.00	0.03
557	688347	华虹公司	13,773	640,031.31	0.03
558	002378	章源钨业	98,700	638,589.00	0.03
559	688322	奥比中光	13,730	638,445.00	0.03
560	300762	上海瀚讯	30,100	633,003.00	0.03
561	600459	贵研铂业	46,000	631,580.00	0.03
562	300207	欣旺达	28,300	631,373.00	0.03
563	688050	爱博医疗	6,919	629,836.57	0.03
564	688508	芯朋微	14,634	628,822.98	0.03
565	601908	京运通	206,100	628,605.00	0.03
566	600996	贵广网络	73,400	627,570.00	0.03
567	688380	中微半导	20,967	626,913.30	0.03
568	000636	风华高科	43,500	624,225.00	0.03
569	603033	三维股份	49,140	623,586.60	0.03
570	603123	翠微股份	77,232	621,717.60	0.03
571	300308	中际旭创	5,000	617,550.00	0.03
572	301348	蓝箭电子	24,066	616,570.92	0.03
573	300918	南山智尚	58,800	606,228.00	0.03
574	300002	神州泰岳	52,200	604,998.00	0.03
575	688037	芯源微	7,222	603,975.86	0.03
576	300602	飞荣达	31,300	601,586.00	0.03
577	688139	海尔生物	17,084	601,356.80	0.03
578	603416	信捷电气	14,300	599,885.00	0.03

579	002126	银轮股份	31,900	597,168.00	0.03
580	603129	春风动力	3,800	596,866.00	0.03
581	603678	火炬电子	19,500	594,750.00	0.03
582	603308	应流股份	41,700	587,970.00	0.03
583	600633	浙数文化	55,500	580,530.00	0.03
584	688472	阿特斯	46,164	579,819.84	0.03
585	600210	紫江企业	87,300	577,053.00	0.03
586	688141	杰华特	18,847	576,906.67	0.03
587	002101	广东鸿图	47,900	573,842.00	0.03
588	000988	华工科技	13,200	571,560.00	0.03
589	002978	安宁股份	20,100	571,242.00	0.03
590	601038	一拖股份	38,600	570,508.00	0.03
591	000541	佛山照明	91,830	569,346.00	0.03
592	603132	金徽股份	50,467	566,744.41	0.03
593	603105	芯能科技	62,600	564,026.00	0.03
594	688383	新益昌	12,477	559,842.99	0.03
595	301155	海力风电	10,500	559,755.00	0.03
596	600827	百联股份	51,000	557,430.00	0.03
597	002488	金固股份	53,300	556,452.00	0.03
598	300775	三角防务	22,200	553,446.00	0.03
599	300369	绿盟科技	76,500	550,035.00	0.03
600	600507	方大特钢	135,645	549,362.25	0.03
601	002545	东方铁塔	77,900	547,637.00	0.03
602	600480	凌云股份	50,500	545,905.00	0.03
603	300244	迪安诊断	47,900	543,665.00	0.03
604	601827	三峰环境	63,200	542,256.00	0.03
605	002318	久立特材	23,100	540,771.00	0.03
606	603236	移远通信	7,900	540,676.00	0.03
607	002038	双鹭药业	72,200	539,334.00	0.03
608	002472	双环传动	17,600	538,912.00	0.03
609	002961	瑞达期货	37,500	538,875.00	0.03
610	300476	胜宏科技	12,700	534,543.00	0.03
611	603229	奥翔药业	53,200	531,468.00	0.03
612	688031	星环科技	11,445	527,957.85	0.03
613	000913	钱江摩托	29,201	525,910.01	0.03
614	002617	露笑科技	68,700	525,555.00	0.03
615	301080	百普赛斯	11,900	525,266.00	0.03
616	600171	上海贝岭	13,200	523,776.00	0.03
617	300855	图南股份	23,800	521,696.00	0.03
618	603383	顶点软件	13,800	517,500.00	0.03
619	601101	昊华能源	62,720	516,185.60	0.03

620	600446	金证股份	29,900	515,476.00	0.03
621	688326	经纬恒润	6,088	512,000.80	0.03
622	688177	百奥泰	26,308	509,849.04	0.03
623	603496	恒为科技	18,700	508,266.00	0.03
624	688366	昊海生科	8,361	506,509.38	0.03
625	300446	航天智造	30,600	505,206.00	0.02
626	002273	水晶光电	22,700	504,394.00	0.02
627	002349	精华制药	65,800	503,370.00	0.02
628	688220	翱捷科技	9,266	501,197.94	0.02
629	300373	扬杰科技	11,500	500,480.00	0.02
630	601279	英利汽车	130,300	499,049.00	0.02
631	688550	瑞联新材	15,939	498,731.31	0.02
632	300026	红日药业	131,500	498,385.00	0.02
633	688484	南芯科技	13,749	495,513.96	0.02
634	300034	钢研高纳	31,700	494,520.00	0.02
635	300724	捷佳伟创	7,800	493,038.00	0.02
636	603799	华友钴业	16,800	491,568.00	0.02
637	002567	唐人神	95,600	487,560.00	0.02
638	688981	中芯国际	5,136	485,968.32	0.02
639	300502	新易盛	4,200	485,436.00	0.02
640	688161	威高骨科	19,240	485,232.80	0.02
641	300841	康华生物	8,900	485,228.00	0.02
642	688025	杰普特	10,177	483,407.50	0.02
643	600028	中国石化	72,000	480,960.00	0.02
644	001206	依依股份	28,900	477,717.00	0.02
645	300705	九典制药	26,600	477,470.00	0.02
646	688362	甬矽电子	14,151	476,605.68	0.02
647	002761	浙江建投	54,100	474,998.00	0.02
648	688403	汇成股份	52,407	469,566.72	0.02
649	301268	铭利达	28,200	467,556.00	0.02
650	600993	马应龙	17,600	459,536.00	0.02
651	603501	韦尔股份	4,400	459,404.00	0.02
652	688676	金盘科技	11,006	455,868.52	0.02
653	300772	运达股份	34,260	453,602.40	0.02
654	300856	科思股份	17,700	453,474.00	0.02
655	300015	爱尔眼科	34,200	453,150.00	0.02
656	601877	正泰电器	19,300	451,813.00	0.02
657	000090	天健集团	109,900	451,689.00	0.02
658	603160	汇顶科技	5,600	451,024.00	0.02
659	301087	可孚医疗	12,700	449,072.00	0.02
660	000887	中鼎股份	34,200	448,704.00	0.02

661	001380	华纬科技	20,400	446,760.00	0.02
662	002489	浙江永强	137,800	446,472.00	0.02
663	001965	招商公路	31,900	445,005.00	0.02
664	300049	福瑞股份	14,100	444,714.00	0.02
665	000603	盛达资源	36,700	440,033.00	0.02
666	600196	复星医药	17,700	439,845.00	0.02
667	002380	科远智慧	23,800	439,824.00	0.02
668	301510	固高科技	16,800	438,480.00	0.02
669	300413	芒果超媒	16,300	438,307.00	0.02
670	600522	中天科技	30,600	438,192.00	0.02
671	600557	康缘药业	32,100	437,202.00	0.02
672	300680	隆盛科技	18,200	436,072.00	0.02
673	688728	格科微	32,291	433,991.04	0.02
674	688126	沪硅产业	23,000	432,860.00	0.02
675	688049	炬芯科技	9,610	431,200.70	0.02
676	002371	北方华创	1,100	430,100.00	0.02
677	688131	皓元医药	11,961	427,007.70	0.02
678	002697	红旗连锁	72,200	426,702.00	0.02
679	000761	本钢板材	132,300	423,360.00	0.02
680	300223	北京君正	6,200	422,840.00	0.02
681	300708	聚灿光电	33,800	422,162.00	0.02
682	688209	英集芯	23,888	422,100.96	0.02
683	300274	阳光电源	5,700	420,831.00	0.02
684	301589	诺瓦星云	2,400	416,640.00	0.02
685	000950	重药控股	77,300	415,874.00	0.02
686	000049	德赛电池	17,660	415,186.60	0.02
687	300068	南都电源	25,700	414,798.00	0.02
688	002239	奥特佳	135,700	413,885.00	0.02
689	688041	海光信息	2,763	413,869.77	0.02
690	301216	万凯新材	40,350	411,570.00	0.02
691	000791	甘肃能源	68,100	410,643.00	0.02
692	300352	北信源	77,426	408,809.28	0.02
693	002156	通富微电	13,700	404,835.00	0.02
694	688286	敏芯股份	6,672	401,988.00	0.02
695	688080	映翰通	12,175	400,801.00	0.02
696	600901	江苏金租	76,740	400,582.80	0.02
697	001376	百通能源	27,300	399,126.00	0.02
698	300183	东软载波	20,600	398,610.00	0.02
699	688008	澜起科技	5,854	397,486.60	0.02
700	688521	芯原股份	7,498	393,120.14	0.02
701	688368	晶丰明源	4,399	391,511.00	0.02

702	301297	富乐德	9,200	391,000.00	0.02
703	688690	纳微科技	22,205	390,808.00	0.02
704	601609	金田股份	66,000	389,400.00	0.02
705	603018	华设集团	47,200	387,512.00	0.02
706	002081	金 螳 螂	108,400	386,988.00	0.02
707	688223	晶科能源	54,378	386,627.58	0.02
708	600587	新华医疗	23,160	385,614.00	0.02
709	002409	雅克科技	6,600	382,470.00	0.02
710	301090	华润材料	54,900	381,006.00	0.02
711	600773	西藏城投	35,300	380,534.00	0.02
712	002027	分众传媒	54,100	380,323.00	0.02
713	688105	诺唯赞	17,147	380,148.99	0.02
714	300620	光库科技	7,800	379,080.00	0.02
715	688658	悦康药业	26,248	378,233.68	0.02
716	300782	卓胜微	4,200	376,740.00	0.02
717	688390	固德威	9,187	375,748.30	0.02
718	603113	金能科技	66,600	374,958.00	0.02
719	600916	中国黄金	43,400	374,108.00	0.02
720	688739	成大生物	14,485	373,423.30	0.02
721	688100	威胜信息	10,290	372,498.00	0.02
722	600079	人福医药	15,800	369,404.00	0.02
723	688531	日联科技	7,732	368,275.16	0.02
724	600096	云天化	16,400	365,720.00	0.02
725	002185	华天科技	31,500	365,715.00	0.02
726	000810	创维数字	22,900	364,568.00	0.02
727	600195	中牧股份	54,000	362,340.00	0.02
728	688099	晶晨股份	5,263	361,462.84	0.02
729	300900	广联航空	16,400	360,800.00	0.02
730	688595	芯海科技	10,999	360,767.20	0.02
731	600745	闻泰科技	9,290	360,266.20	0.02
732	600460	士兰微	13,800	359,076.00	0.02
733	000682	东方电子	33,453	358,281.63	0.02
734	600114	东睦股份	22,100	357,357.00	0.02
735	600066	宇通客车	13,500	356,130.00	0.02
736	688396	华润微	7,512	354,491.28	0.02
737	600153	建发股份	33,600	353,472.00	0.02
738	300661	圣邦股份	4,300	351,654.00	0.02
739	688536	思瑞浦	3,773	349,002.50	0.02
740	002049	紫光国微	5,400	347,598.00	0.02
741	300101	振芯科技	16,000	346,560.00	0.02
742	000029	深深房A	23,000	346,380.00	0.02

743	688082	盛美上海	3,459	345,900.00	0.02
744	688234	天岳先进	6,747	345,446.40	0.02
745	603939	益丰药房	14,300	345,059.00	0.02
746	300888	稳健医疗	8,200	345,056.00	0.02
747	688559	海目星	10,000	344,000.00	0.02
748	000728	国元证券	40,800	341,088.00	0.02
749	301035	润丰股份	7,000	341,040.00	0.02
750	600478	科力远	82,400	340,312.00	0.02
751	300339	润和软件	6,800	340,204.00	0.02
752	300655	晶瑞电材	36,300	339,768.00	0.02
753	300842	帝科股份	8,200	336,364.00	0.02
754	600211	西藏药业	9,070	335,045.80	0.02
755	002588	史丹利	45,200	333,576.00	0.02
756	300869	康泰医学	23,900	333,166.00	0.02
757	603309	维力医疗	27,700	331,846.00	0.02
758	600331	宏达股份	43,500	331,470.00	0.02
759	300323	华灿光电	40,000	331,200.00	0.02
760	000100	TCL 科技	65,700	330,471.00	0.02
761	300979	华利集团	4,200	330,330.00	0.02
762	688256	寒武纪	502	330,316.00	0.02
763	688518	联赢激光	20,704	327,951.36	0.02
764	002706	良信股份	42,700	327,936.00	0.02
765	002033	丽江股份	36,900	327,303.00	0.02
766	600389	江山股份	22,600	326,570.00	0.02
767	603888	新华网	14,600	326,164.00	0.02
768	603317	天味食品	24,300	324,162.00	0.02
769	688629	华丰科技	9,670	323,848.30	0.02
770	603567	珍宝岛	27,900	323,640.00	0.02
771	002368	太极股份	13,600	322,048.00	0.02
772	603290	斯达半导	3,580	321,555.60	0.02
773	603508	思维列控	13,400	318,652.00	0.02
774	688409	富创精密	6,176	318,496.32	0.02
775	300349	金卡智能	23,200	317,144.00	0.02
776	002517	恺英网络	23,200	315,752.00	0.02
777	603358	华达科技	9,400	313,960.00	0.02
778	002123	梦网科技	28,800	311,328.00	0.02
779	603171	税友股份	10,200	311,100.00	0.02
780	688575	亚辉龙	19,654	310,533.20	0.02
781	601600	中国铝业	42,200	310,170.00	0.02
782	601998	中信银行	44,400	309,912.00	0.02
783	600372	中航机载	25,129	309,840.57	0.02

784	603890	春秋电子	26,300	309,025.00	0.02
785	688146	中船特气	10,624	308,520.96	0.02
786	600252	中恒集团	125,100	307,746.00	0.02
787	002068	黑猫股份	28,900	307,496.00	0.02
788	600559	老白干酒	14,600	306,454.00	0.02
789	300972	万辰集团	3,800	305,558.00	0.02
790	301219	腾远钴业	6,700	302,907.00	0.01
791	688599	天合光能	15,633	301,716.90	0.01
792	000099	中信海直	11,400	300,504.00	0.01
793	600123	兰花科创	35,000	299,600.00	0.01
794	300913	兆龙互连	5,200	299,052.00	0.01
795	600276	恒瑞医药	6,500	298,350.00	0.01
796	688076	诺泰生物	5,718	296,878.56	0.01
797	002416	爱施德	18,200	296,114.00	0.01
798	600477	杭萧钢构	114,900	295,293.00	0.01
799	600584	长电科技	7,200	294,192.00	0.01
800	000860	顺鑫农业	15,100	293,997.00	0.01
801	601801	皖新传媒	39,800	292,132.00	0.01
802	600298	安琪酵母	8,100	292,005.00	0.01
803	600399	抚顺特钢	50,200	291,160.00	0.01
804	002444	巨星科技	9,000	291,150.00	0.01
805	300741	华宝股份	16,700	290,413.00	0.01
806	000930	中粮科技	52,000	288,600.00	0.01
807	300188	国投智能	20,900	288,211.00	0.01
808	000739	普洛药业	17,600	286,176.00	0.01
809	600167	联美控股	49,700	284,781.00	0.01
810	688300	联瑞新材	4,415	284,326.00	0.01
811	600803	新奥股份	13,100	284,008.00	0.01
812	000811	冰轮环境	23,100	283,206.00	0.01
813	002078	太阳纸业	19,000	282,530.00	0.01
814	600664	哈药股份	67,900	280,427.00	0.01
815	300811	铂科新材	5,200	280,332.00	0.01
816	603989	艾华集团	18,585	280,261.80	0.01
817	300203	聚光科技	18,400	280,232.00	0.01
818	002270	华明装备	16,500	278,685.00	0.01
819	000738	航发控制	12,500	278,000.00	0.01
820	688526	科前生物	19,447	277,897.63	0.01
821	603379	三美股份	7,200	276,336.00	0.01
822	002595	豪迈科技	5,500	276,045.00	0.01
823	600675	中华企业	98,200	275,942.00	0.01
824	600057	厦门象屿	42,500	275,825.00	0.01

825	301500	飞南资源	15,316	275,688.00	0.01
826	000726	鲁　泰A	42,200	275,144.00	0.01
827	600403	大有能源	93,100	273,714.00	0.01
828	688278	特宝生物	3,729	273,596.73	0.01
829	605183	确成股份	16,200	272,970.00	0.01
830	601615	明阳智能	21,600	272,376.00	0.01
831	688515	裕太微	2,744	271,656.00	0.01
832	002088	鲁阳节能	21,000	268,590.00	0.01
833	300456	赛微电子	15,600	268,008.00	0.01
834	300459	汤姆猫	46,200	265,188.00	0.01
835	000829	天音控股	20,100	264,918.00	0.01
836	603566	普莱柯	20,700	264,132.00	0.01
837	600933	爱柯迪	16,200	264,060.00	0.01
838	000600	建投能源	46,600	263,756.00	0.01
839	600007	中国国贸	10,750	262,945.00	0.01
840	300027	华谊兄弟	100,300	262,786.00	0.01
841	600640	国脉文化	22,000	262,680.00	0.01
842	600780	通宝能源	46,300	260,669.00	0.01
843	300012	华测检测	20,900	259,787.00	0.01
844	002399	海普瑞	24,300	259,767.00	0.01
845	601015	陕西黑猫	77,400	258,516.00	0.01
846	002946	新乳业	17,700	256,827.00	0.01
847	300593	新雷能	22,900	256,480.00	0.01
848	688779	五矿新能	48,057	255,663.24	0.01
849	002594	比亚迪	900	254,394.00	0.01
850	600750	江中药业	11,200	254,240.00	0.01
851	688381	帝奥微	13,185	254,206.80	0.01
852	300470	中密控股	6,739	254,060.30	0.01
853	600452	涪陵电力	23,940	253,524.60	0.01
854	600775	南京熊猫	25,200	253,008.00	0.01
855	600115	中国东航	62,100	248,400.00	0.01
856	688147	微导纳米	9,225	248,060.25	0.01
857	000690	宝新能源	55,300	247,744.00	0.01
858	300628	亿联网络	6,400	247,040.00	0.01
859	603306	华懋科技	7,800	246,558.00	0.01
860	002051	中工国际	30,200	246,432.00	0.01
861	600886	国投电力	14,800	245,976.00	0.01
862	000875	吉电股份	46,650	245,379.00	0.01
863	600509	天富能源	37,900	245,213.00	0.01
864	603193	润本股份	10,500	245,175.00	0.01
865	600740	山西焦化	60,500	243,815.00	0.01

866	000420	吉林化纤	67,200	242,592.00	0.01
867	000915	华特达因	8,601	242,376.18	0.01
868	600475	华光环能	26,900	242,369.00	0.01
869	601077	渝农商行	39,700	240,185.00	0.01
870	300613	富瀚微	4,090	239,265.00	0.01
871	000156	华数传媒	33,200	239,040.00	0.01
872	002410	广联达	20,200	237,552.00	0.01
873	688389	普门科技	15,917	237,004.13	0.01
874	002960	青鸟消防	20,300	236,901.00	0.01
875	301371	敷尔佳	6,200	234,298.00	0.01
876	688523	航天环宇	11,711	234,220.00	0.01
877	688248	南网科技	7,295	234,096.55	0.01
878	300143	盈康生命	25,200	231,840.00	0.01
879	600055	万东医疗	15,100	228,010.00	0.01
880	002254	泰和新材	24,200	227,480.00	0.01
881	300213	佳讯飞鸿	29,400	226,086.00	0.01
882	002463	沪电股份	5,700	226,005.00	0.01
883	603337	杰克股份	7,400	225,404.00	0.01
884	688488	艾迪药业	28,316	222,563.76	0.01
885	600761	安徽合力	12,580	222,037.00	0.01
886	603327	福蓉科技	17,930	217,670.20	0.01
887	600036	招商银行	5,500	216,150.00	0.01
888	688510	航亚科技	12,405	216,095.10	0.01
889	301291	明阳电气	4,900	215,208.00	0.01
890	601718	际华集团	75,100	213,284.00	0.01
891	002315	焦点科技	5,100	212,568.00	0.01
892	300315	掌趣科技	38,500	211,750.00	0.01
893	300136	信维通信	8,300	211,152.00	0.01
894	002320	海峡股份	32,200	210,910.00	0.01
895	002859	洁美科技	10,100	209,575.00	0.01
896	601117	中国化学	25,200	208,908.00	0.01
897	300577	开润股份	8,400	208,740.00	0.01
898	600363	联创光电	4,300	205,884.00	0.01
899	300357	我武生物	10,100	205,232.00	0.01
900	300866	安克创新	2,100	205,044.00	0.01
901	605296	神农集团	7,400	204,980.00	0.01
902	002507	涪陵榨菜	14,500	204,885.00	0.01
903	600821	金开新能	37,800	204,120.00	0.01
904	000869	张　裕Ａ	8,800	204,072.00	0.01
905	000517	荣安地产	90,500	201,815.00	0.01
906	002340	格林美	30,900	201,777.00	0.01

907	603885	吉祥航空	14,700	201,390.00	0.01
908	600877	电科芯片	15,200	200,488.00	0.01
909	002929	润建股份	5,900	198,358.00	0.01
910	603259	药明康德	3,600	198,144.00	0.01
911	601226	华电科工	29,300	198,068.00	0.01
912	300236	上海新阳	5,300	198,061.00	0.01
913	600050	中国联通	37,100	197,001.00	0.01
914	603444	吉比特	900	196,956.00	0.01
915	002709	天赐材料	9,900	195,228.00	0.01
916	601916	浙商银行	66,900	194,679.00	0.01
917	300693	盛弘股份	7,190	193,842.40	0.01
918	002291	遥望科技	30,700	193,717.00	0.01
919	600058	五矿发展	27,100	192,952.00	0.01
920	603730	岱美股份	21,340	191,846.60	0.01
921	600601	方正科技	43,400	190,526.00	0.01
922	601186	中国铁建	20,700	189,819.00	0.01
923	601133	柏诚股份	16,900	189,618.00	0.01
924	600246	万通发展	25,400	189,230.00	0.01
925	603505	金石资源	7,920	188,020.80	0.01
926	000001	平安银行	16,000	187,200.00	0.01
927	688190	云路股份	2,034	187,128.00	0.01
928	600200	江苏吴中	19,900	185,468.00	0.01
929	688516	奥特维	4,266	184,760.46	0.01
930	300768	迪普科技	10,530	184,275.00	0.01
931	600651	飞乐音响	44,500	184,230.00	0.01
932	603209	兴通股份	11,500	183,770.00	0.01
933	600085	同仁堂	4,500	182,655.00	0.01
934	600859	王府井	11,800	181,838.00	0.01
935	003040	楚天龙	13,900	181,673.00	0.01
936	301376	致欧科技	9,500	181,640.00	0.01
937	300737	科顺股份	35,500	179,985.00	0.01
938	000776	广发证券	11,000	178,310.00	0.01
939	688063	派能科技	4,405	176,420.25	0.01
940	600966	博汇纸业	33,900	174,924.00	0.01
941	002683	广东宏大	6,600	174,768.00	0.01
942	600201	生物股份	25,376	174,079.36	0.01
943	300527	中船应急	21,400	172,698.00	0.01
944	601918	新集能源	24,000	172,320.00	0.01
945	688337	普源精电	4,409	171,951.00	0.01
946	600635	大众公用	38,600	171,770.00	0.01
947	002922	伊戈尔	9,600	171,072.00	0.01

948	688179	阿拉丁	12,388	170,954.40	0.01
949	601107	四川成渝	32,500	169,975.00	0.01
950	002214	大立科技	15,200	169,480.00	0.01
951	300389	艾比森	14,200	169,122.00	0.01
952	002563	森马服饰	23,839	167,349.78	0.01
953	600388	龙净环保	13,200	166,980.00	0.01
954	600989	宝丰能源	9,900	166,716.00	0.01
955	002966	苏州银行	20,400	165,444.00	0.01
956	002182	宝武镁业	14,580	164,462.40	0.01
957	600110	诺德股份	40,700	162,800.00	0.01
958	603866	桃李面包	24,600	162,360.00	0.01
959	002568	百润股份	5,700	159,657.00	0.01
960	603998	方盛制药	15,100	157,342.00	0.01
961	688046	药康生物	12,144	156,050.40	0.01
962	300887	谱尼测试	20,300	155,092.00	0.01
963	002326	永太科技	17,300	154,662.00	0.01
964	688506	百利天恒	800	153,384.00	0.01
965	002707	众信旅游	20,700	152,973.00	0.01
966	688303	大全能源	6,276	151,502.64	0.01
967	603661	恒林股份	4,900	150,136.00	0.01
968	603297	永新光学	1,600	150,112.00	0.01
969	688276	百克生物	5,905	148,274.55	0.01
970	300926	博俊科技	6,600	145,266.00	0.01
971	603199	九华旅游	4,300	145,125.00	0.01
972	600398	海澜之家	19,300	144,750.00	0.01
973	301332	德尔玛	14,400	144,288.00	0.01
974	688631	莱斯信息	1,650	143,698.50	0.01
975	300451	创业慧康	31,900	142,912.00	0.01
976	301015	百洋医药	5,900	142,839.00	0.01
977	603138	海量数据	9,900	142,263.00	0.01
978	002152	广电运通	11,800	137,588.00	0.01
979	601611	中国核建	15,000	135,600.00	0.01
980	300687	赛意信息	7,400	134,680.00	0.01
981	000488	ST 晨鸣	44,050	134,352.50	0.01
982	688301	奕瑞科技	1,402	133,989.14	0.01
983	688062	迈威生物	6,575	132,815.00	0.01
984	600975	新五丰	20,700	128,340.00	0.01
985	300226	上海钢联	5,600	128,072.00	0.01
986	688533	上声电子	3,658	127,371.56	0.01
987	600497	驰宏锌锗	22,700	126,439.00	0.01
988	600536	中国软件	2,700	126,063.00	0.01

989	603739	蔚蓝生物	10,500	125,895.00	0.01
990	603993	洛阳钼业	18,900	125,685.00	0.01
991	002035	华帝股份	17,100	125,514.00	0.01
992	002755	奥赛康	9,870	125,447.70	0.01
993	002281	光迅科技	2,400	125,208.00	0.01
994	300781	因赛集团	2,100	123,963.00	0.01
995	688401	路维光电	4,689	123,742.71	0.01
996	002001	新 和 成	5,600	123,032.00	0.01
997	688313	仕佳光子	7,390	121,122.10	0.01
998	000712	锦龙股份	7,900	119,448.00	0.01
999	002335	科华数据	4,100	118,572.00	0.01
1,000	301358	湖南裕能	2,600	117,832.00	0.01
1,001	603919	金徽酒	6,000	117,600.00	0.01
1,002	600419	天润乳业	12,600	117,306.00	0.01
1,003	000552	甘肃能化	42,300	116,325.00	0.01
1,004	600862	中航高科	4,600	116,196.00	0.01
1,005	000059	华锦股份	24,200	115,918.00	0.01
1,006	688551	科威尔	4,109	115,010.91	0.01
1,007	301095	广立微	2,200	114,554.00	0.01
1,008	001269	欧晶科技	4,000	113,960.00	0.01
1,009	688433	华曙高科	4,807	112,195.38	0.01
1,010	600963	岳阳林纸	22,000	111,760.00	0.01
1,011	002128	电投能源	5,700	111,606.00	0.01
1,012	688789	宏华数科	1,681	111,584.78	0.01
1,013	688400	凌云光	5,000	109,600.00	0.01
1,014	300986	志特新材	9,000	109,260.00	0.01
1,01	688563	航材股份	1,945	108,608.80	0.01

5					
1,016	600866	星湖科技	16,700	108,049.00	0.01
1,017	603690	至纯科技	4,300	107,973.00	0.01
1,018	688091	上海谊众	2,696	107,624.32	0.01
1,019	002036	联创电子	11,300	106,220.00	0.01
1,020	605080	浙江自然	4,500	105,750.00	0.01
1,021	300124	汇川技术	1,800	105,444.00	0.01
1,022	002434	万里扬	17,000	105,400.00	0.01
1,023	300409	道氏技术	7,700	104,797.00	0.01
1,024	600361	创新新材	25,200	97,272.00	0.00
1,025	300653	正海生物	4,500	95,850.00	0.00
1,026	603601	再升科技	28,500	95,760.00	0.00
1,027	301238	瑞泰新材	6,100	95,526.00	0.00
1,028	002332	仙琚制药	9,300	92,442.00	0.00
1,029	002438	江苏神通	7,500	91,500.00	0.00
1,030	300394	天孚通信	1,000	91,360.00	0.00
1,031	002008	大族激光	3,600	90,000.00	0.00
1,032	603801	志邦家居	7,000	89,670.00	0.00
1,033	300702	天宇股份	5,300	88,298.00	0.00
1,034	002990	盛视科技	3,800	88,046.00	0.00
1,035	601969	海南矿业	12,400	87,916.00	0.00
1,036	002129	TCL 中环	9,900	87,813.00	0.00

1,037	601777	千里科技	11,361	86,911.65	0.00
1,038	688206	概伦电子	4,554	86,116.14	0.00
1,039	300790	宇瞳光学	4,500	85,905.00	0.00
1,040	600282	南钢股份	18,000	84,420.00	0.00
1,041	600751	海航科技	31,900	83,897.00	0.00
1,042	002075	沙钢股份	13,300	83,258.00	0.00
1,043	002840	华统股份	6,600	83,226.00	0.00
1,044	601169	北京银行	13,500	83,025.00	0.00
1,045	600094	大名城	22,600	82,264.00	0.00
1,046	000801	四川九洲	5,500	78,705.00	0.00
1,047	688212	澳华内镜	1,926	77,386.68	0.00
1,048	600062	华润双鹤	3,900	77,220.00	0.00
1,049	300759	康龙化成	3,000	77,100.00	0.00
1,050	300453	三鑫医疗	10,200	76,092.00	0.00
1,051	300100	双林股份	2,700	74,628.00	0.00
1,052	300133	华策影视	10,300	74,366.00	0.00
1,053	601519	大智慧	8,000	74,000.00	0.00
1,054	688677	海泰新光	1,950	73,437.00	0.00
1,055	300596	利安隆	2,400	73,200.00	0.00
1,056	605368	蓝天燃气	6,400	73,152.00	0.00
1,057	000877	天山股份	12,900	73,014.00	0.00
1,05	600895	张江高科	2,700	72,360.00	0.00

8					
1,059	601500	通用股份	13,400	71,422.00	0.00
1,060	002079	苏州固锝	6,900	70,863.00	0.00
1,061	001389	广合科技	1,400	70,420.00	0.00
1,062	603093	南华期货	5,900	70,210.00	0.00
1,063	300296	利亚德	10,900	70,196.00	0.00
1,064	000401	冀东水泥	13,300	69,559.00	0.00
1,065	603173	福斯达	3,000	69,150.00	0.00
1,066	605007	五洲特纸	5,400	69,066.00	0.00
1,067	601108	财通证券	8,100	66,177.00	0.00
1,068	605577	龙版传媒	4,500	65,385.00	0.00
1,069	688027	国盾量子	218	65,042.48	0.00
1,070	600552	凯盛科技	5,700	65,037.00	0.00
1,071	605011	杭州热电	3,000	64,260.00	0.00
1,072	688299	长阳科技	4,302	63,239.40	0.00
1,073	601618	中国中冶	19,100	63,030.00	0.00
1,074	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.00
1,075	000977	浪潮信息	1,200	62,256.00	0.00
1,076	603063	禾望电气	3,100	61,876.00	0.00
1,077	600977	中国电影	5,300	61,533.00	0.00
1,078	300445	康斯特	3,700	60,199.00	0.00
1,079	300498	温氏股份	3,600	59,436.00	0.00

1,080	688012	中微公司	308	58,261.28	0.00
1,081	600595	中孚实业	20,300	57,449.00	0.00
1,082	605319	无锡振华	2,700	56,835.00	0.00
1,083	301325	曼恩斯特	1,040	56,357.60	0.00
1,084	600335	国机汽车	9,000	56,070.00	0.00
1,085	688236	春立医疗	4,348	55,654.40	0.00
1,086	300911	亿田智能	2,100	54,768.00	0.00
1,087	300347	泰格医药	1,000	54,620.00	0.00
1,088	688582	芯动联科	1,080	54,334.80	0.00
1,089	000767	晋控电力	20,900	52,877.00	0.00
1,090	300547	川环科技	1,800	49,572.00	0.00
1,091	603398	沐邦高科	2,100	48,321.00	0.00
1,092	301487	盟固利	2,200	46,794.00	0.00
1,093	688166	博瑞医药	1,514	45,722.80	0.00
1,094	001696	宗申动力	1,800	44,820.00	0.00
1,095	600313	农发种业	6,600	44,550.00	0.00
1,096	002265	建设工业	1,900	44,213.00	0.00
1,097	600733	北汽蓝谷	5,400	43,200.00	0.00
1,098	301031	中熔电气	400	41,608.00	0.00
1,099	688089	嘉必优	2,178	41,447.34	0.00
1,100	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
1,10	603288	海天味业	900	41,310.00	0.00

1					
1,102	600657	信达地产	9,900	41,184.00	0.00
1,103	600496	精工钢构	13,500	40,770.00	0.00
1,104	603719	良品铺子	2,800	39,788.00	0.00
1,105	002011	盾安环境	3,600	38,916.00	0.00
1,106	300416	苏试试验	3,300	38,808.00	0.00
1,107	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
1,108	603466	风语筑	4,000	37,280.00	0.00
1,109	002006	精工科技	2,200	36,300.00	0.00
1,110	688543	国科军工	708	35,484.96	0.00
1,111	600967	内蒙一机	4,100	34,850.00	0.00
1,112	002959	小熊电器	700	33,537.00	0.00
1,113	688106	金宏气体	1,909	32,472.09	0.00
1,114	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
1,115	300568	星源材质	3,300	32,076.00	0.00
1,116	001391	国货航	4,686	31,864.80	0.00
1,117	002727	一心堂	2,400	31,248.00	0.00
1,118	002675	东诚药业	2,500	30,550.00	0.00
1,119	301266	宇邦新材	900	30,150.00	0.00
1,120	688289	圣湘生物	1,328	30,145.60	0.00
1,121	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
1,122	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00

1,123	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
1,124	300657	弘信电子	1,100	24,926.00	0.00
1,125	301236	软通动力	400	23,484.00	0.00
1,126	600604	市北高新	4,800	22,848.00	0.00
1,127	002920	德赛西威	200	22,022.00	0.00
1,128	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
1,129	002941	新疆交建	1,600	17,872.00	0.00
1,130	000899	赣能股份	2,000	17,420.00	0.00
1,131	603737	三棵树	400	17,040.00	0.00
1,132	000063	中兴通讯	400	16,160.00	0.00
1,133	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
1,134	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
1,135	003009	中天火箭	400	15,600.00	0.00
1,136	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
1,137	605166	聚合顺	1,200	14,364.00	0.00
1,138	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
1,139	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
1,140	300482	万孚生物	600	13,446.00	0.00
1,141	603596	伯特利	300	13,377.00	0.00
1,142	688486	龙迅股份	171	13,344.84	0.00
1,143	002334	英威腾	1,700	12,784.00	0.00
1,14	688017	绿的谐波	116	12,534.96	0.00

4					
1,145	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
1,146	300496	中科创达	200	11,912.00	0.00
1,147	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
1,148	601028	玉龙股份	1,000	11,460.00	0.00
1,149	002324	普利特	1,200	11,436.00	0.00
1,150	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
1,151	301096	百诚医药	300	11,382.00	0.00
1,152	600764	中国海防	400	11,328.00	0.00
1,153	605128	上海沿浦	300	11,085.00	0.00
1,154	300870	欧陆通	100	10,678.00	0.00
1,155	002497	雅化集团	900	10,530.00	0.00
1,156	300699	光威复材	300	10,395.00	0.00
1,157	300442	润泽科技	200	10,392.00	0.00
1,158	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
1,159	600223	福瑞达	1,300	9,828.00	0.00
1,160	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
1,161	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
1,162	000938	紫光股份	300	8,349.00	0.00
1,163	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
1,164	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
1,165	300161	华中数控	300	7,902.00	0.00

1,166	603800	洪田股份	300	7,575.00	0.00
1,167	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
1,168	600158	中体产业	900	7,443.00	0.00
1,169	003021	兆威机电	100	7,391.00	0.00
1,170	002262	恩华药业	300	7,305.00	0.00
1,171	002142	宁波银行	300	7,293.00	0.00
1,172	301165	锐捷网络	100	7,220.00	0.00
1,173	002997	瑞鹄模具	200	6,930.00	0.00
1,174	603057	紫燕食品	300	6,027.00	0.00
1,175	600498	烽火通信	300	5,838.00	0.00
1,176	300595	欧普康视	300	5,685.00	0.00
1,177	605168	三人行	156	5,603.52	0.00
1,178	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
1,179	002949	华阳国际	300	5,346.00	0.00
1,180	000513	丽珠集团	140	5,320.00	0.00
1,181	301011	华立科技	200	5,138.00	0.00
1,182	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
1,183	300192	科德教育	300	4,770.00	0.00
1,184	002155	湖南黄金	300	4,719.00	0.00
1,185	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
1,186	000651	格力电器	100	4,545.00	0.00
1,18	601138	工业富联	200	4,300.00	0.00

7					
1,188	301328	维峰电子	100	4,227.00	0.00
1,189	000733	振华科技	100	4,217.00	0.00
1,190	300662	科锐国际	200	4,212.00	0.00
1,191	601628	中国人寿	100	4,192.00	0.00
1,192	002352	顺丰控股	100	4,030.00	0.00
1,193	300073	当升科技	100	4,028.00	0.00
1,194	688363	华熙生物	77	3,930.08	0.00
1,195	002179	中航光电	100	3,930.00	0.00
1,196	603009	北特科技	100	3,908.00	0.00
1,197	300673	佩蒂股份	200	3,546.00	0.00
1,198	600176	中国巨石	300	3,417.00	0.00
1,199	300994	久祺股份	300	3,384.00	0.00
1,200	601901	方正证券	400	3,332.00	0.00
1,201	002192	融捷股份	100	3,190.00	0.00
1,202	002294	信立泰	100	3,093.00	0.00
1,203	002979	雷赛智能	100	3,079.00	0.00
1,204	600938	中国海油	100	2,951.00	0.00
1,205	300633	开立医疗	100	2,939.00	0.00
1,206	002384	东山精密	100	2,920.00	0.00
1,207	300383	光环新网	200	2,918.00	0.00
1,208	600030	中信证券	100	2,917.00	0.00

1,209	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00
1,210	000768	中航西飞	100	2,824.00	0.00
1,211	001308	康冠科技	100	2,750.00	0.00
1,212	002831	裕同科技	100	2,710.00	0.00
1,213	603096	新经典	140	2,653.00	0.00
1,214	603324	盛剑科技	100	2,589.00	0.00
1,215	300298	三诺生物	100	2,581.00	0.00
1,216	002558	巨人网络	200	2,538.00	0.00
1,217	600406	国电南瑞	100	2,522.00	0.00
1,218	301177	迪阿股份	100	2,284.00	0.00
1,219	301381	赛维时代	100	2,276.00	0.00
1,220	601019	山东出版	200	2,270.00	0.00
1,221	603187	海容冷链	200	2,238.00	0.00
1,222	601669	中国电建	400	2,184.00	0.00
1,223	002508	老板电器	100	2,143.00	0.00
1,224	300286	安科瑞	100	2,055.00	0.00
1,225	002737	葵花药业	100	2,049.00	0.00
1,226	002637	赞宇科技	200	1,970.00	0.00
1,227	603712	七一二	100	1,947.00	0.00
1,228	600312	平高电气	100	1,920.00	0.00
1,229	000060	中金岭南	400	1,876.00	0.00
1,23	002747	埃斯顿	100	1,850.00	0.00

0					
1,231	603181	皇马科技	156	1,798.68	0.00
1,232	002541	鸿路钢构	100	1,793.00	0.00
1,233	002484	江海股份	100	1,758.00	0.00
1,234	600905	三峡能源	400	1,748.00	0.00
1,235	300723	一品红	100	1,706.00	0.00
1,236	002698	博实股份	100	1,700.00	0.00
1,237	002956	西麦食品	100	1,667.00	0.00
1,238	002612	朗姿股份	100	1,636.00	0.00
1,239	300491	通合科技	100	1,592.00	0.00
1,240	300398	飞凯材料	100	1,576.00	0.00
1,241	300997	欢乐家	100	1,546.00	0.00
1,242	000975	山金国际	100	1,537.00	0.00
1,243	600377	宁沪高速	100	1,531.00	0.00
1,244	601881	中国银河	100	1,523.00	0.00
1,245	603916	苏博特	200	1,492.00	0.00
1,246	002077	大港股份	100	1,467.00	0.00
1,247	301246	宏源药业	100	1,353.00	0.00
1,248	600029	南方航空	200	1,298.00	0.00
1,249	002739	万达电影	100	1,214.00	0.00
1,250	603027	千禾味业	100	1,211.00	0.00
1,251	601155	新城控股	100	1,196.00	0.00

1,252	301301	川宁生物	100	1,186.00	0.00
1,253	603915	国茂股份	100	1,172.00	0.00
1,254	603997	继峰股份	100	1,145.00	0.00
1,255	002930	宏川智慧	100	1,122.00	0.00
1,256	002041	登海种业	100	1,089.00	0.00
1,257	002581	未名医药	100	1,064.00	0.00
1,258	002624	完美世界	100	1,033.00	0.00
1,259	600483	福能股份	100	997.00	0.00
1,260	002533	金杯电工	100	984.00	0.00
1,261	000795	英洛华	100	973.00	0.00
1,262	600004	白云机场	100	960.00	0.00
1,263	002493	荣盛石化	100	905.00	0.00
1,264	000876	新 希 望	100	898.00	0.00
1,265	002243	力合科创	100	806.00	0.00
1,266	000058	深 赛 格	100	803.00	0.00
1,267	002400	省广集团	100	799.00	0.00
1,268	000737	北方铜业	100	780.00	0.00
1,269	601890	亚星锚链	100	779.00	0.00
1,270	600166	福田汽车	300	753.00	0.00
1,271	601006	大秦铁路	100	678.00	0.00
1,272	600256	广汇能源	100	673.00	0.00
1,27	002658	雪迪龙	100	640.00	0.00

3					
1,274	600556	天下秀	100	520.00	0.00
1,275	000557	西部创业	100	519.00	0.00
1,276	600998	九州通	100	512.00	0.00
1,277	000778	新兴铸管	100	384.00	0.00
1,278	000415	渤海租赁	100	377.00	0.00
1,279	002108	沧州明珠	100	359.00	0.00
1,280	600179	安通控股	100	283.00	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	002456	欧菲光	42,016,358.00	1.27
2	002249	大洋电机	37,613,443.10	1.14
3	002139	拓邦股份	36,044,330.00	1.09
4	603985	恒润股份	31,761,338.22	0.96
5	600420	国药现代	31,397,242.00	0.95
6	002745	木林森	30,936,616.00	0.94
7	000725	京东方 A	30,480,757.00	0.92
8	002053	云南能投	27,828,606.00	0.84
9	300379	东方通	27,527,487.00	0.83
10	000062	深圳华强	27,374,542.00	0.83
11	601766	中国中车	26,963,678.00	0.82
12	300624	万兴科技	26,556,360.84	0.80
13	002130	沃尔核材	26,426,734.00	0.80
14	600267	海正药业	26,270,878.00	0.79
15	000902	新洋丰	26,154,170.00	0.79
16	002152	广电运通	25,789,492.00	0.78
17	600623	华谊集团	25,074,512.00	0.76
18	000100	TCL 科技	24,802,787.00	0.75
19	601222	林洋能源	24,705,390.00	0.75
20	600285	羚锐制药	24,679,618.44	0.75

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	002130	沃尔核材	62,457,124.89	1.89
2	002085	万丰奥威	49,155,275.60	1.49
3	600312	平高电气	45,851,675.20	1.39
4	600572	康恩贝	42,064,223.00	1.27
5	603985	恒润股份	41,246,235.00	1.25
6	001696	宗申动力	38,322,093.60	1.16
7	300303	聚飞光电	38,161,609.00	1.15
8	600285	羚锐制药	37,624,443.64	1.14
9	600562	国睿科技	36,226,938.60	1.10
10	603328	依顿电子	35,961,686.00	1.09
11	002139	拓邦股份	35,668,057.00	1.08
12	000725	京东方 A	34,568,223.00	1.05
13	000650	仁和药业	33,741,408.00	1.02
14	300170	汉得信息	32,889,893.07	0.99
15	002456	欧菲光	32,840,931.00	0.99
16	600797	浙大网新	31,886,302.00	0.96
17	300166	东方国信	31,878,464.00	0.96
18	603920	世运电路	31,195,516.80	0.94
19	688158	优刻得	30,800,016.15	0.93
20	600489	中金黄金	30,625,926.00	0.93

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	9,122,762,405.41
卖出股票收入（成交）总额	10,472,571,353.14

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。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

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	23,804,595.06

2	应收清算款	529,535.56
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	134,220,275.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	158,554,405.71

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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
富国中证1000指数增强（LOF）A	64,158	7,991.87	49,041,594.19	9.56	463,700,654.72	90.44
富国中证1000指数增	44,404	12,081.72	401,786,653.02	74.89	134,690,258.79	25.11

强（LOF）C						
合计	108,562	9,664.70	450,828,247.21	42.97	598,390,913.51	57.03

9.2 期末上市基金前十名持有人

富国中证 1000 指数增强（LOF）A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	廖昌清	1,170,483.00	6.79
2	王铁柱	673,500.00	3.91
3	熊振国	573,600.00	3.33
4	付小珍	536,148.00	3.11
5	刘树航	481,890.00	2.80
6	陈实	403,094.00	2.34
7	来岚	345,100.00	2.00
8	宋金娥	315,000.00	1.83
9	宗爱云	277,983.00	1.61
10	李春	235,900.00	1.37

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	富国中证 1000 指数增强（LOF）A	394,372.22	0.0769
	富国中证 1000 指数增强（LOF）C	93,834.05	0.0175
	合计	488,206.27	0.0465

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	富国中证 1000 指数增强（LOF）A	0~10
	富国中证 1000 指数增强（LOF）C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	富国中证 1000 指数增强（LOF）A	10~50
	富国中证 1000 指数增强（LOF）C	0
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	富国中证1000指数增强（LOF）A	富国中证1000指数增强（LOF）C
基金合同生效日(2018年05月31日)基金份额总额	512,114,043.76	-
报告期期初基金份额总额	1,016,344,929.26	800,555,533.30
本报告期基金总申购份额	304,803,533.88	1,069,195,349.91
减：本报告期基金总赎回份额	808,406,214.23	1,333,273,971.40
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	512,742,248.91	536,476,911.81

§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。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为5.5万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为22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：报告期内，未发生托管人及其高级管理人员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（%）	
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	1,311,728.35	0.01	965.30	0.01	-
东方证券	4	635,361,771.18	3.24	467,559.83	6.45	-
广发证券	2	1,405,292,295.23	7.17	190,981.46	2.63	-
国海证券	2	2,065,626,610.28	10.54	1,520,081.23	20.97	-
国联民生	1	428,708,256.77	2.19	315,491.07	4.35	-
国泰君安	2	2,124,322,400.46	10.84	551,274.70	7.60	-
国投证券	2	120,161,098.00	0.61	88,425.23	1.22	-
国信证券	2	2,564,968,654.65	13.09	348,571.97	4.81	-
海通证券	1	2,428,340,032.16	12.39	752,733.87	10.38	-

华兴证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	258,254,595.21	1.32	190,051.54	2.62	-
申万宏源	3	1,830,464,697.35	9.34	567,141.21	7.82	-
兴业证券	2	353,538,833.09	1.80	260,182.58	3.59	-
浙商证券	1	152,769,244.07	0.78	112,422.48	1.55	-
中泰证券	1	1,449,602,938.37	7.40	402,391.16	5.55	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	3,773,345,385.25	19.26	1,481,349.71	20.43	-

注：1、我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金退租券商交易单元：开源证券（014691、54421），申万宏源（25939）。本报告期本基金新增券商交易单元：广发证券（397770、59969），国信证券（24420、392081）。

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（%）
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	6,721.32	0.65	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	247,453.33	23.94	-	-	-	-
海通证券	15,704.40	1.52	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-

开源证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	72,636.05	7.03	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	691,190.60	66.87	—	—	—	—

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旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2024年03月14日
2	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2024年06月14日
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07月31日
4	富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）溢价风险提示公告	规定披露媒介	2024年10月08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 2024-11-24	395,433,223.18	67,413,857.55	395,433,223.18	67,413,857.55	6.43%
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。							

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