

富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
二〇二四年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国银行股份有限公司

送出日期： 2025 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报告	21
7.1 资产负债表.....	21

7.2 利润表.....	22
7.3 净资产变动表.....	23
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告	59
8.1 期末基金资产组合情况.....	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60
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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	77
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	77
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.....	77
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.....	77
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	77
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	77
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	77
8.12 投资组合报告附注.....	78
§9 基金份额持有人信息	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
9.2 期末上市基金前十名持有人	79
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
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	80
§10 开放式基金份额变动	80
§11 重大事件揭示	80
11.1 基金份额持有人大会决议	80
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	81
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
11.4 基金投资策略的改变.....	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	81
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	81
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	82
11.8 其他重大事件	84
§12 影响投资者决策的其他重要信息	84
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	84
§13 备查文件目录	85

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
场内简称	AH500ETF
基金简称	富国中证沪港深 500ETF
基金主代码	517100
交易代码	517100
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 02 月 09 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	386,602,125.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 3 月 2 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的资产配置策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证沪港深 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证），具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金投资港股通标的股票的，将承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	许俊
	联系电话	021-20361818	010-66596688

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	-40,410,986.62	-22,645,034.43	-26,544,466.34
本期利润	49,424,509.87	-28,097,135.91	-71,150,338.73
加权平均基金份额本期利润	0.1199	-0.0604	-0.1378
本期加权平均净值利润率	16.71%	-8.14%	-18.08%

本期基金份额净值增长率	19.40%	-8.68%	-15.23%
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	-85,914,931.50	-141,913,323.36	-127,440,744.59
期末可供分配基金份额利润	-0.2222	-0.3221	-0.2577
期末基金资产净值	312,921,003.99	298,688,801.64	367,161,380.41
期末基金份额净值	0.8094	0.6779	0.7423
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	-19.06%	-32.21%	-25.77%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

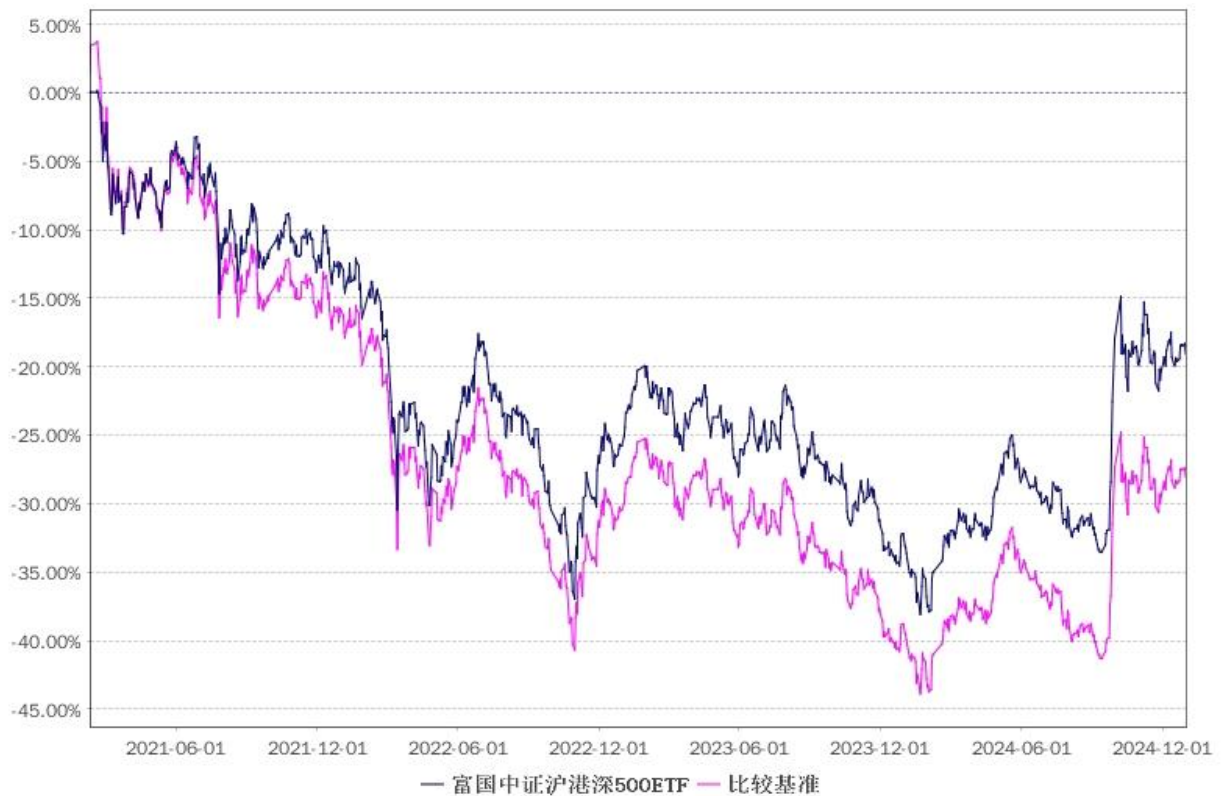
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.36%	1.44%	-0.93%	1.40%	-0.43%	0.04%
过去六个月	15.46%	1.39%	13.73%	1.38%	1.73%	0.01%
过去一年	19.40%	1.20%	17.56%	1.19%	1.84%	0.01%
过去三年	-7.57%	1.20%	-14.58%	1.18%	7.01%	0.02%
自基金合同生效起至今	-19.06%	1.18%	-28.05%	1.17%	8.99%	0.01%

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

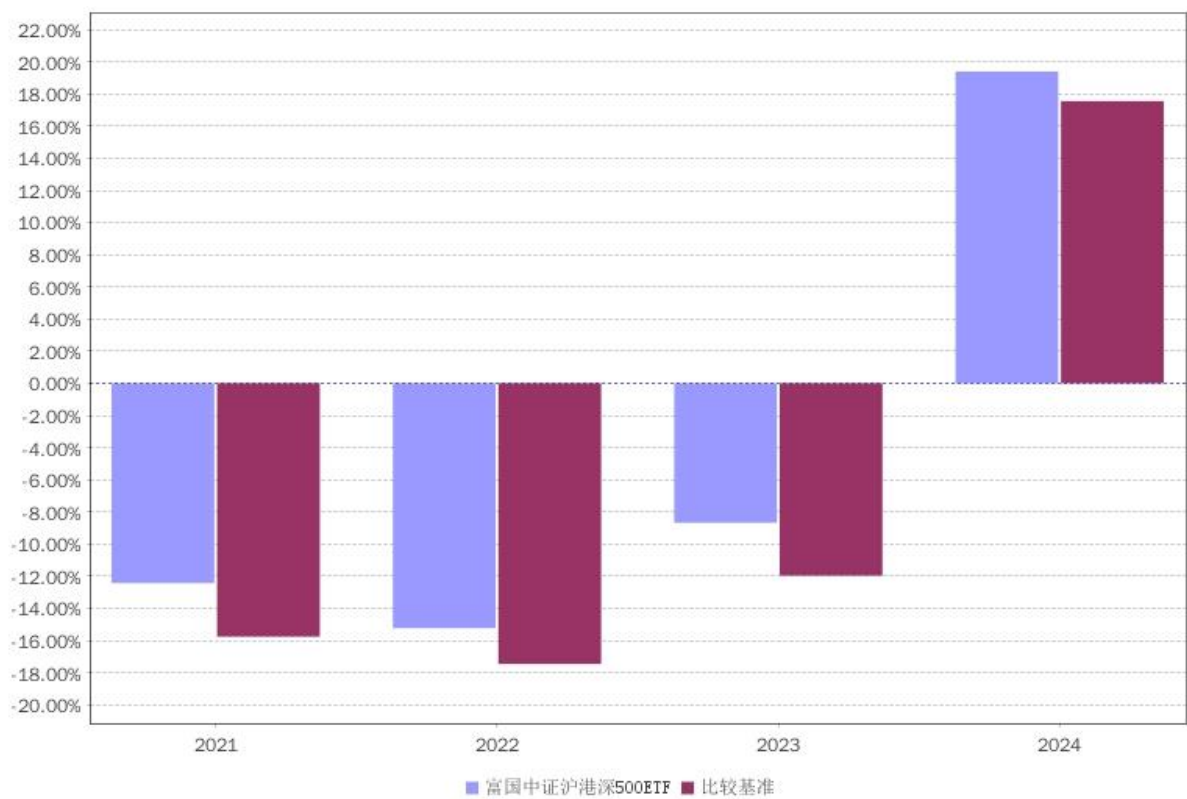
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2024年12月31日。

2、本基金于2021年2月9日成立，建仓期6个月，从2021年2月9日起至2021年8月8日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：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

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		
田希蒙	本基金现任基金经理	2023-03-03	—	8	硕士，自 2017 年 5 月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、定量研究员、定量投资经理；现任富国基金量化投资部定量基金经理。自 2023 年 01 月起任富国中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2023 年 01 月起任富

					国中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2023 年 04 月起任富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；自 2023 年 06 月起任富国恒生港股通医疗保健交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 09 月起任富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2023 年 10 月起任富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；自 2023 年 11 月起任富国标普石油天然气勘探及生产精选行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；自 2023 年 12 月起任富国恒生港股通医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2024 年 10 月起任富国大盘价值量化精选混合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合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分

析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现 3 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

在 2024 年，AH500ETF 的表现令人满意，取得了可观的涨幅。这一增长主要得益于宏观政策的显著改善。政府采取了一系列刺激措施，以促进经济复苏和市场信心的恢复。此外，当前市场的整体估值仍然处于历史低位，这为投资者提供了良好的入场机会。随着市场情绪的改善和资金的流入，AH500ETF 受益于这些积极变化，表现出色。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.8094 元；份额累计净值为 0.8094 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 19.40%，同期业绩比较基准收益率为 17.56%。

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，我们认为上市公司的业绩释放潜力依然巨大。随着宏观经济的复苏和政策的持续支持，许多大市值公司将受益于市场需求的回暖和自身业务的增长。特别是在新兴产业和科技领域，企业的创新和转型将进一步推动业绩的提升。我们预计，如果随着盈利能力的增强，这些公司的股票将继续为投资者带来可观的回报，推动 AH500ETF 的业绩增长。

从估值的角度来看，2025 年可能出现的一个重要机遇是中国资产的重新定价。随着美国新财政部长的上任以及第一季度美债高发行量的结束，市场可能迎来美元和美债利率的双双走弱。这种情况将为 A 股和港股市场创造良好的投资机

会。资金成本的降低和市场情绪的改善，可能促使投资者重新评估中国资产的价值，推动资金流入。我们相信，随着市场对中国经济前景的重新认识，投资者将对 A 股和港股的配置加大力度，进一步提升这些市场的吸引力。

在这样的市场环境中，AH500ETF 或将能够充分受益于即将到来的机会。我们将继续密切关注宏观经济动态和政策变化，灵活调整投资组合，以把握潜在的市场机会。我们相信，随着市场环境的改善和上市公司业绩的持续释放，投资 AH500ETF 将具备一定程度的潜力空间。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

（一）落细落实各项监管要求

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

（二）持续完善内控制度及流程建设

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

（三）进一步强化合规管理效能

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

（四）加强文化建设，持续提升员工合规意识

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

（五）立足于合规，不断拓展风险管理职能

公司持续推进旗下组合的投资合规风控阈值多维度排查梳理和日常投资合规监督工作的规范化管理，不断拓展优化投资监督提示内容，进一步提升投资监

督工作质量和效率。公司不断加强团队对新业务、新品种、新风险环境的学习研究，保持对各类风险的敏感度和识别响应能力。公司通过加强日常监测和定期回溯评估等方式，持续提升对于各类投资标的、投资行为的风险管理水平。

（六）信息化建设助力风控合规目标实现

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

（七）持续加强员工行为管理

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

（八）进一步提升反洗钱工作质效

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

（九）深入开展内部稽核审计

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70015656_B198 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	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	富国中证沪港深 500 交易型开放式指

	数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,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沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的

	财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价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沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与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：富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	1,131,540.02	3,227,165.60
结算备付金	18,836.48	44,615.56
存出保证金	10,948.93	10,740.65
交易性金融资产	311,948,602.21	295,373,383.14
其中：股票投资	311,948,602.21	295,373,383.14
基金投资	—	—
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	—	354,974.32
应收股利	33,667.59	16,520.38
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	2,274.08
资产总计	313,143,595.23	299,029,673.73
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	118.35	25.65
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	132,278.61	124,516.57
应付托管费	26,455.73	24,903.32
应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—

应交税费	—	225.26
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	63,738.55	191,201.29
负债合计	222,591.24	340,872.09
净资产：		
实收基金	386,602,125.00	440,602,125.00
其他综合收益	—	—
未分配利润	-73,681,121.01	-141,913,323.36
净资产合计	312,921,003.99	298,688,801.64
负债和净资产总计	313,143,595.23	299,029,673.73

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8094 元，基金份额总额 386,602,125.00 份。

7.2 利润表

会计主体：富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 12 月 31 日)
一、营业总收入	51,389,278.25	-25,827,973.21
1.利息收入	37,965.39	113,824.67
其中：存款利息收入	16,399.56	13,396.86
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	21,565.83	100,427.81
2.投资收益（损失以“-”填列）	-38,366,310.54	-20,413,745.76
其中：股票投资收益	-47,926,831.10	-29,440,224.80
基金投资收益	—	—
债券投资收益	2,142.44	24,366.20
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	9,558,378.12	9,002,112.84
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）	89,835,496.49	-5,452,101.48
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—

5.其他收入（损失以“-”号填列）	-117,873.09	-75,950.64
减：二、营业总支出	1,964,768.38	2,269,162.70
1. 管理人报酬	1,477,712.92	1,730,129.47
2. 托管费	295,542.49	346,026.01
3. 销售服务费	—	—
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	77.34	361.51
8. 其他费用	191,435.63	192,645.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	49,424,509.87	-28,097,135.91
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	49,424,509.87	-28,097,135.91
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	49,424,509.87	-28,097,135.91

7.3 净资产变动表

会计主体：富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、上期期末净资产	440,602,125.00	— 141,913,323.36	298,688,801.64
二、本期期初净资产	440,602,125.00	— 141,913,323.36	298,688,801.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	— 54,000,000.00	— 68,232,202.35	— 14,232,202.35
（一）、综合收益总额	—	49,424,509.87	49,424,509.87
（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）	— 54,000,000.00	— 18,807,692.48	— 35,192,307.52
其中：1. 基金申购款	139,500,000.00	— 41,215,326.67	98,284,673.33
2. 基金赎回款	—	— 60,023,019.	—

	193,500,000.00	15	133,476,980.85
(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	386,602,125.00	73,681,121.01	312,921,003.99
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	494,602,125.00	127,440,744.59	367,161,380.41
二、本期期初净资产	494,602,125.00	127,440,744.59	367,161,380.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	— 54,000,000.00	— 14,472,578.77	— 68,472,578.77
(一)、综合收益总额	—	28,097,135.91	28,097,135.91
(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）	— 54,000,000.00	13,624,557.14	— 40,375,442.86
其中：1.基金申购款	58,500,000.00	16,286,414.81	42,213,585.19
2.基金赎回款	112,500,000.00	29,910,971.95	82,589,028.05
(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	440,602,125.00	141,913,323.36	298,688,801.64

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
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可〔2020〕3527 号《关于准予富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于 2021 年 2 月 9 日正式生效,首次设立募集规模为 787,102,125.00 份基金份额。本基金为交易型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股(均含存托凭证)和其他股票。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票、港股通标的股票)、存托凭证、债券(国债、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、金融衍生工具(股指期货、国债期货)、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

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

本基金的业绩比较基准为中证沪港深 500 指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁

布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和中期报告》》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2024年12月31日的财务状况以及2024年1月1日至2024年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

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

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分

别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变

动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、每一基金份额享有同等分配权；

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

3、若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

4、本基金收益分配采用现金方式；

5、法律法规、监管机关、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。

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

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算

为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 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作为增值税纳税人；

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。

6 境外投资

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

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	1, 131, 540. 02	3, 227, 165. 60
等于：本金	1, 131, 416. 94	3, 226, 839. 34
加：应计利息	123. 08	326. 26
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	1, 131, 540. 02	3, 227, 165. 60

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	339, 681, 438. 96	—	311, 948, 602. 21	— 27, 732, 836. 75
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	339, 681, 438. 96	—	311, 948, 602. 21	— 27, 732, 836. 75
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		412,941,716.38	—	295,373,383.14	— 117,568,333.24
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		412,941,716.38	—	295,373,383.14	— 117,568,333.24

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

注：本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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	—	2,274.08
合计	—	2,274.08

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）
----	------------------	-------------------

	日)	31 日)
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	—	—
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	5,738.55	13,201.29
其中：交易所市场	5,738.55	13,201.29
银行间市场	—	—
应付利息	—	—
预提信息披露费	—	120,000.00
预提审计费	38,000.00	38,000.00
IOPV 计算发布费	20,000.00	20,000.00
合计	63,738.55	191,201.29

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	440,602,125.00	440,602,125.00
本期申购	139,500,000.00	139,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-193,500,000.00	-193,500,000.00
本期末	386,602,125.00	386,602,125.00

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-55,691,700.95	-86,221,622.41	— 141,913,323.36
本期期初	-55,691,700.95	-86,221,622.41	— 141,913,323.36
本期利润	-40,410,986.62	89,835,496.49	49,424,509.87
本期基金份额交易产生的变动数	10,187,756.07	8,619,936.41	18,807,692.48
其中：基金申购款	-23,738,743.25	-17,476,583.42	-41,215,326.67
基金赎回款	33,926,499.32	26,096,519.83	60,023,019.15
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-85,914,931.50	12,233,810.49	-73,681,121.01

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	9,819.97	10,298.89
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	6,107.30	2,946.81
其他	472.29	151.16
合计	16,399.56	13,396.86

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	-38,754,665.33	-23,006,118.48
股票投资收益——赎回差价收入	-9,172,165.77	-6,434,106.32
股票投资收益——申购差价收入	—	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—	—
合计	-47,926,831.10	-29,440,224.80

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	111,731,452.06	81,020,740.48
减：卖出股票成本总额	150,278,663.61	103,864,122.42
减：交易费用	207,453.78	162,736.54
买卖股票差价收入	-38,754,665.33	-23,006,118.48

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年12月31日）	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年12月31日）
赎回基金份额对价总额	133,476,980.85	82,589,028.05
减：现金支付赎回款总额	82,287,894.85	53,059,934.05
减：赎回股票成本总额	60,361,251.77	35,963,200.32
减：交易费用	—	—
赎回差价收入	-9,172,165.77	-6,434,106.32

7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益——申购差价收入。

7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年12月31日）	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年12月31日）
债券投资收益——利息收入	0.79	29.48
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,141.65	24,336.72
合计	2,142.44	24,366.20

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	9,342.82	141,074.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,200.00	116,700.00
减：应计利息总额	0.79	32.55
减：交易费用	0.38	5.64
买卖债券差价收入	2,141.65	24,336.72

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

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	9,558,378.12	9,002,112.84
其中：证券出借权益补偿收入	9,133.90	85,449.42
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	9,558,378.12	9,002,112.84

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	89,835,496.49	-5,452,101.48
股票投资	89,835,496.49	-5,448,735.78
债券投资	—	-3,365.70
资产支持证券投资	—	—
基金投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他	—	—
2. 衍生工具	—	—
权证投资	—	—

3. 其他	—	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—	—
合计	89,835,496.49	-5,452,101.48

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）
基金赎回费收入	—	—
替代损益	-117,873.09	-75,950.64
合计	-117,873.09	-75,950.64

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	38,000.00	38,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
银行费用	3,934.55	3,673.27
其他	29,501.08	30,972.44
合计	191,435.63	192,645.71

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

有人的合法权益。

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
申万宏源证券承销保荐有限责任公司（“申万宏源承销保荐”）	基金管理人的股东控制的子公司
富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
山东省金融资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
加拿大蒙特利尔银行	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）		上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	28,169,709.11	13.05	18,297,694.41	14.13
申万宏源	—	—	953,339.19	0.74

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	—	—	9,752.80	6.91

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

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	8,493.95	23.05	610.84	10.64
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	5,782.40	14.42	1,664.01	12.60
申万宏源	691.64	1.72	—	—

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	1,477,712.92	1,730,129.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,770.06	—
应支付基金管理人的净管理费	1,475,942.86	1,730,129.47

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）
当期发生的基金应支付的托管费	295,542.49	346,026.01

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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	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	207,754.00	119.17	—	—

注：本基金本报告期末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

本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 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	48,944.00	1.00	1.00	13.49	—	—
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	3,529,868.00	1.00～5.67	3.33	3,731.39	—	—
申万宏源	490,413.00	3.78	3.78	741.94	—	—

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

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

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末（2024 年 12 月 31 日）		上期末（2023 年 12 月 31 日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	114,694,300.00	29.67	113,440,900.00	25.75
海通证券股份有限公司	1,446,300.00	0.37	1,445,600.00	0.33

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）		上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	1,131,540.02	9,819.97	3,227,165.60	10,298.89

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

上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	301525	儒竞科技	IPO 网下申购	955	95,089.35
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	2,238	38,896.44

海通证券股份有限公司	688515	裕太微	IPO 网 下申购	1,853	171,328.38
海通证券股份有限公司	688531	日联科 技	IPO 网 下申购	1,269	193,370.22
海通证券股份有限公司	688548	广钢气 体	IPO 网 下申购	12,728	125,625.36
海通证券股份有限公司	688716	中研股 份	IPO 网 下申购	2,427	71,984.82
申万宏源证券 承销保荐有限 责任公司	601916	浙商银 行	配股	23,220	46,904.40

注：本基金本报告期末未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

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

为更紧密地跟踪标的指数，降低跟踪误差，经与基金托管人协商一致，本基金在报告期内根据基金合同约定的投资策略投资于基金管理人股东发行的股票海通证券（600837.SH）、基金管理人股东的母公司发行的股票申万宏源（000166.SZ）、基金托管人及其关联方发行的股票中国银行（601988.SH）、中国银行（3988.HK）、中银航空租赁（2588.HK）、中银香港（2388.HK）、中银证券（601696.SH）。

本报告期末，本基金持有海通证券 78,347 股，占基金资产净值比例 0.28%。上年度末，本基金持有海通证券 92,000 股，占基金资产净值比例 0.29%。

本报告期末，本基金持有申万宏源 73,100 股，占基金资产净值比例 0.12%。上年度末，本基金持有申万宏源 85,900 股，占基金资产净值比例 0.13%。

本报告期末，本基金持有中国银行（601988.SH）170,800 股，占基金资产净值比例 0.30%。上年度末，本基金持有中国银行（601988.SH）200,800 股，占基金资产净值比例 0.27%。

本报告期末，本基金持有中国银行（3988.HK）680,000 股，占基金资产净值比例 0.80%。上年度末，本基金持有中国银行（3988.HK）796,000 股，占基金资产净值比例 0.72%。

本报告期末，本基金持有中银航空租赁 1,600 股，占基金资产净值比例 0.03%。上年度末，本基金未持有中银航空租赁。

本报告期末，本基金持有中银香港 34,500 股，占基金资产净值比例 0.25%。上年度末，本基金持有中银香港 41,000 股，占基金资产净值比例 0.26%。

本报告期末，本基金持有中银证券 13,600 股，占基金资产净值比例 0.05%。上年度末，本基金持有中银证券 15,800 股，占基金资产净值比例 0.05%。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	221	4,490.72	6,216.73	—

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	7.22	2025 年 01 月 07 日	6.93	37,300.00	270,005.21	269,306.00	—
02007	碧桂园	2024 年 04 月 02 日	重大事项停牌	0.05	2025 年 01 月 21 日	0.50	124,000.00	598,033.51	6,200.00	—

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正

回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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%，但标的指数成分券不受此限。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的信用债。

7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在7.4.12中列示的

部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金本报告期末无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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

单位：人民币元

本期末（2024 年 12 月 31 日）	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,131,540.02	—	—	—	—	—	1,131,540.02
结算备付金	18,836.48	—	—	—	—	—	18,836.48
存出保证金	10,948.93	—	—	—	—	—	10,948.93
交易性金融资产	—	—	—	—	—	311,948,602.21	311,948,602.21
应收股利	—	—	—	—	—	33,667.59	33,667.59
资产总计	1,161,325.43	—	—	—	—	311,982,269.80	313,143,595.23
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	118.35	118.35
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	132,278.61	132,278.61
应付托管费	—	—	—	—	—	26,455.73	26,455.73
其他负债	—	—	—	—	—	63,738.55	63,738.55
负债总计	—	—	—	—	—	222,591.24	222,591.24
利率敏感度缺口	1,161,325.43	—	—	—	—	311,759,678.56	312,921,003.99
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	3,227,165.60	—	—	—	—	—	3,227,165.60
结算备付金	44,615.56	—	—	—	—	—	44,615.56
存出保证金	10,740.65	—	—	—	—	—	10,740.65
交易性金融资产	—	—	—	—	—	295,373,383.14	295,373,383.14

应收清算款	—	—	—	—	—	354,974.32	354,974.32
应收股利	—	—	—	—	—	16,520.38	16,520.38
其他资产	—	—	—	—	—	2,274.08	2,274.08
资产总计	3,282,521.81	—	—	—	—	295,747,151.92	299,029,673.73
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	25.65	25.65
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	124,516.57	124,516.57
应付托管费	—	—	—	—	—	24,903.32	24,903.32
应交税费	—	—	—	—	—	225.26	225.26
其他负债	—	—	—	—	—	191,201.29	191,201.29
负债总计	—	—	—	—	—	340,872.09	340,872.09
利率敏感度缺口	3,282,521.81	—	—	—	—	295,406,279.83	298,688,801.64

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末（2024 年 12 月 31 日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
交易性金融资产	—	132,744,352.00	—	—	132,744,352.00
应收股利	—	33,667.59	—	—	33,667.59
资产合计	—	132,778,019.59	—	—	132,778,019.59
以外币计价的负债					
—	—	—		—	—
负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	—	132,778,019.59	—	—	132,778,019.59
项目	上年度末（2023 年 12 月 31 日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
交易性金融资产	—	116,606,451.30	—	—	116,606,451.30
应收股利	—	16,520.38	—	—	16,520.38
资产合计	—	116,622,971.68	—	—	116,622,971.68
以外币计价的负债					
—	—	—		—	—
负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	—	116,622,971.68	—	—	116,622,971.68

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化 1%，其他变量不变； (2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动； (3) 计算外汇风险敏感性时，包含
----	---

	了远期外汇敞口。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币贬值 1%	-1, 327, 780. 20	-1, 166, 229. 72
	港币相对人民币升值 1%	1, 327, 780. 20	1, 166, 229. 72

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票、港股通标的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、金融衍生工具（股指期货、国债期货）、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含

存托凭证)的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如法律法规对该比例要求有变更的,在履行适当程序后,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

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	311,948,602.21	99.69	295,373,383.14	98.89
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	311,948,602.21	99.69	295,373,383.14	98.89

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	3,143,134.83	3,054,750.26

	2. 业绩比较基准减少 1%	-3, 143, 134. 83	-3, 054, 750. 26
--	----------------	------------------	------------------

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	311, 639, 142. 98	294, 798, 438. 28
第二层次	297, 042. 50	—
第三层次	12, 416. 73	574, 944. 86
合计	311, 948, 602. 21	295, 373, 383. 14

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	—	574,944.86	574,944.86
当期购买	—	18,687.72	18,687.72
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	54,560.00	54,560.00
转出第三层次	—	506,149.05	506,149.05
当期利得或损失总额	—	-129,626.80	-129,626.80
其中：计入损益的利得或损失	—	-129,626.80	-129,626.80
期末余额	—	12,416.73	12,416.73
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	—	1,726.01	1,726.01
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	—	814,206.00	814,206.00
当期购买	—	1,009,015.41	1,009,015.41
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	1,514,762.53	1,514,762.53
当期利得或损失总额	—	266,485.98	266,485.98
其中：计入损益的利得或损失	—	266,485.98	266,485.98
期末余额	—	574,944.86	574,944.86
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	—	99,378.35	99,378.35

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	6,216.73	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	1.5088	负相关
长期停牌的股票	6,200.00	经调整的净资产法	各项资产折扣率	20%-40%	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	574,944.86	平均价格 亚式期权 模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1855- 2.1752	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	权益投资	311,948,602.21	99.62
	其中：股票	311,948,602.21	99.62
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	1,150,376.50	0.37
8	其他各项资产	44,616.52	0.01
9	合计	313,143,595.23	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 132,744,352.00 元，占资产净值比例为 42.42%。

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	1,570,444.00	0.50
B	采矿业	8,836,336.40	2.82
C	制造业	96,045,189.31	30.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,670,331.00	2.13
E	建筑业	3,478,014.00	1.11
F	批发和零售业	587,036.43	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	6,125,805.00	1.96
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,336,657.51	2.66
J	金融业	42,630,528.76	13.62
K	房地产业	1,429,756.00	0.46
L	租赁和商务服务业	1,411,717.02	0.45
M	科学研究和技术服务业	1,547,035.30	0.49
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—

Q	卫生和社会工作	501,446.25	0.16
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	179,170,296.98	57.26

8.2.1.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	33,953.23	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	33,953.23	0.01

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
金融	41,516,292.00	13.27
非日常生活消费品	29,672,305.00	9.48
通信服务	26,730,913.00	8.54
信息技术	7,785,698.00	2.49
工业	5,704,112.50	1.82
能源	5,554,363.00	1.78
房地产	4,211,888.00	1.35
公用事业	4,069,132.50	1.30

日常消费品	3,423,072.00	1.09
医疗保健	3,177,051.00	1.02
原材料	899,525.00	0.29
合计	132,744,352.00	42.42

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	00700	腾讯控股	52,800	20,389,248.00	6.52
2	09988	阿里巴巴—W	155,200	11,843,312.00	3.78
3	00005	汇丰控股	146,400	10,275,816.00	3.28
4	600519	贵州茅台	5,100	7,772,400.00	2.48
5	601318	中国平安	87,200	4,591,080.00	1.47
5	02318	中国平安	61,000	2,601,040.00	0.83
6	03690	美团—W	49,500	6,953,760.00	2.22
7	00939	建设银行	978,000	5,868,000.00	1.88
7	601939	建设银行	54,700	480,813.00	0.15
8	300750	宁德时代	21,580	5,740,280.00	1.83
9	01398	工商银行	706,000	3,402,920.00	1.09
9	601398	工商银行	284,200	1,966,664.00	0.63
10	600036	招商银行	100,376	3,944,776.80	1.26
10	03968	招商银行	37,500	1,389,000.00	0.44
11	01299	友邦保险	88,000	4,588,320.00	1.47
12	01810	小米集团—W	142,200	4,543,290.00	1.45
13	00941	中国移动	50,500	3,581,965.00	1.14
13	600941	中国移动	7,400	874,384.00	0.28
14	01211	比亚迪股份	9,000	2,221,920.00	0.71
14	002594	比亚迪	7,400	2,091,684.00	0.67
15	03988	中国银行	680,000	2,502,400.00	0.80
15	601988	中国银行	170,800	941,108.00	0.30
16	000333	美的集团	39,700	2,986,234.00	0.95
16	00300	美的集团	4,900	342,804.00	0.11
17	00883	中国海洋石油	145,000	2,567,950.00	0.82
17	600938	中国海油	17,100	504,621.00	0.16
18	600900	长江电力	99,200	2,931,360.00	0.94
19	00388	香港交易所	10,300	2,811,900.00	0.90
20	688981	中芯国际	16,200	1,532,844.00	0.49

20	00981	中芯国际	39,000	1,148,550.00	0.37
21	601899	紫金矿业	133,600	2,020,032.00	0.65
21	02899	紫金矿业	50,000	654,500.00	0.21
22	300059	东方财富	102,402	2,644,019.64	0.84
23	600030	中信证券	79,035	2,305,450.95	0.74
23	06030	中信证券	17,000	336,090.00	0.11
24	601288	农业银行	258,700	1,381,458.00	0.44
24	01288	农业银行	250,000	1,025,000.00	0.33
25	601328	交通银行	188,500	1,464,645.00	0.47
25	03328	交通银行	143,000	846,560.00	0.27
26	601166	兴业银行	117,900	2,258,964.00	0.72
27	000858	五 粮 液	15,800	2,212,632.00	0.71
28	601088	中国神华	26,900	1,169,612.00	0.37
28	01088	中国神华	27,500	855,525.00	0.27
29	00857	中国石油股份	172,000	973,520.00	0.31
29	601857	中国石油	92,000	822,480.00	0.26
30	02888	渣打集团	19,800	1,751,904.00	0.56
31	002475	立讯精密	40,900	1,667,084.00	0.53
32	600276	恒瑞医药	36,120	1,657,908.00	0.53
33	000651	格力电器	36,200	1,645,290.00	0.53
34	00386	中国石油化工股份	198,000	815,760.00	0.26
34	600028	中国石化	118,200	789,576.00	0.25
35	600887	伊利股份	51,700	1,560,306.00	0.50
36	601601	中国太保	27,900	950,832.00	0.30
36	02601	中国太保	22,600	527,484.00	0.17
37	600690	海尔智家	30,600	871,182.00	0.28
37	06690	海尔智家	23,400	595,998.00	0.19
38	601816	京沪高铁	236,600	1,457,456.00	0.47
39	601728	中国电信	126,000	909,720.00	0.29
39	00728	中国电信	114,000	514,140.00	0.16
40	00669	创科实业	15,000	1,423,800.00	0.46
41	02628	中国人寿	61,000	828,990.00	0.26
41	601628	中国人寿	13,600	570,112.00	0.18
42	000725	京东方 A	299,500	1,314,805.00	0.42
43	300760	迈瑞医疗	4,972	1,267,860.00	0.41
44	600919	江苏银行	119,000	1,168,580.00	0.37
45	688041	海光信息	7,625	1,142,148.75	0.36
46	603259	药明康德	20,420	1,123,916.80	0.36
47	688256	寒武纪	1,700	1,118,600.00	0.36

48	600309	万华化学	15,400	1,098,790.00	0.35
49	09987	百胜中国	3,100	1,074,212.00	0.34
50	000063	中兴通讯	26,300	1,062,520.00	0.34
51	02015	理想汽车—W	12,100	1,052,700.00	0.34
52	06160	百济神州	10,300	1,041,536.00	0.33
53	300124	汇川技术	17,550	1,028,079.00	0.33
54	601668	中国建筑	168,600	1,011,600.00	0.32
55	00002	中电控股	16,500	997,755.00	0.32
56	600000	浦发银行	95,200	979,608.00	0.31
57	002371	北方华创	2,500	977,500.00	0.31
58	01024	快手—W	24,600	941,934.00	0.30
59	000001	平安银行	78,600	919,620.00	0.29
60	002415	海康威视	29,800	914,860.00	0.29
61	300308	中际旭创	7,300	901,623.00	0.29
62	300274	阳光电源	11,880	877,100.40	0.28
63	600837	海通证券	78,347	871,218.64	0.28
64	603019	中科曙光	11,900	860,608.00	0.28
65	002714	牧原股份	22,300	857,212.00	0.27
66	601658	邮储银行	90,100	511,768.00	0.16
66	01658	邮储银行	81,000	343,440.00	0.11
67	00001	长和	22,000	845,460.00	0.27
68	02020	安踏体育	11,600	836,244.00	0.27
69	600016	民生银行	201,900	833,847.00	0.27
70	00016	新鸿基地产	12,000	829,560.00	0.27
71	601766	中国中车	98,600	826,268.00	0.26
72	600406	国电南瑞	32,758	826,156.76	0.26
73	600660	福耀玻璃	13,100	817,440.00	0.26
74	601919	中远海控	51,840	803,520.00	0.26
75	601985	中国核电	76,600	798,938.00	0.26
76	02388	中银香港	34,500	796,950.00	0.25
77	600031	三一重工	48,000	791,040.00	0.25
78	002352	顺丰控股	19,500	785,850.00	0.25
79	600104	上汽集团	37,600	780,576.00	0.25
80	601012	隆基绿能	49,116	771,612.36	0.25
81	000100	TCL 科技	152,220	765,666.60	0.24
82	601127	赛力斯	5,700	760,323.00	0.24
83	000568	泸州老窖	6,000	751,200.00	0.24
84	601229	上海银行	80,957	740,756.55	0.24
85	600809	山西汾酒	4,020	740,524.20	0.24
86	601169	北京银行	120,100	738,615.00	0.24

87	601225	陕西煤业	31,600	735,016.00	0.23
88	601688	华泰证券	41,700	733,503.00	0.23
89	002230	科大讯飞	15,100	729,632.00	0.23
90	603501	韦尔股份	6,965	727,215.65	0.23
91	300498	温氏股份	43,200	713,232.00	0.23
92	601138	工业富联	32,400	696,600.00	0.22
93	601211	国泰君安	36,600	682,590.00	0.22
94	600050	中国联通	127,000	674,370.00	0.22
95	00027	银河娱乐	22,000	672,320.00	0.21
96	00175	吉利汽车	49,000	672,280.00	0.21
97	300502	新易盛	5,800	670,364.00	0.21
98	02328	中国财险	58,000	658,300.00	0.21
99	600150	中国船舶	18,200	654,472.00	0.21
100	002142	宁波银行	26,790	651,264.90	0.21
101	09868	小鹏汽车— W	15,000	648,000.00	0.21
102	603288	海天味业	13,605	624,469.50	0.20
103	688012	中微公司	3,300	624,228.00	0.20
104	688008	澜起科技	9,100	617,890.00	0.20
105	00267	中信股份	71,000	605,630.00	0.19
106	01109	华润置地	29,000	605,520.00	0.19
107	00006	电能实业	12,000	602,280.00	0.19
108	00998	中信银行	85,000	422,450.00	0.14
108	601998	中信银行	25,734	179,623.32	0.06
109	000338	潍柴动力	43,900	601,430.00	0.19
110	002625	光启技术	12,300	587,940.00	0.19
111	601818	光大银行	150,600	582,822.00	0.19
112	00992	联想集团	62,000	578,460.00	0.18
113	603986	兆易创新	5,400	576,720.00	0.18
114	600999	招商证券	30,100	576,716.00	0.18
115	002027	分众传媒	82,000	576,460.00	0.18
116	688111	金山办公	2,000	572,780.00	0.18
117	02057	中通快递— W	3,950	553,434.50	0.18
118	00168	青岛啤酒股 份	6,000	315,600.00	0.10
118	600600	青岛啤酒	2,900	234,668.00	0.07
119	02269	药明生物	33,500	544,710.00	0.17
120	000625	长安汽车	40,428	540,118.08	0.17
121	00011	恒生银行	6,100	539,728.00	0.17
122	600436	片仔癀	2,500	536,250.00	0.17

123	601888	中国中免	8,002	536,214.02	0.17
124	601390	中国中铁	83,200	531,648.00	0.17
125	00003	香港中华煤气	91,250	524,687.50	0.17
126	600089	特变电工	41,180	524,633.20	0.17
127	000938	紫光股份	18,700	520,421.00	0.17
128	300033	同花顺	1,800	517,500.00	0.17
129	600048	保利发展	58,200	515,652.00	0.16
130	09633	农夫山泉	16,400	515,616.00	0.16
131	002241	歌尔股份	19,800	511,038.00	0.16
132	600905	三峡能源	116,100	507,357.00	0.16
133	01113	长实集团	17,000	502,180.00	0.16
134	300015	爱尔眼科	37,845	501,446.25	0.16
135	601006	大秦铁路	73,700	499,686.00	0.16
136	600019	宝钢股份	71,300	499,100.00	0.16
137	09992	泡泡玛特	6,000	498,120.00	0.16
138	600418	江淮汽车	13,200	495,000.00	0.16
139	000792	盐湖股份	29,800	490,508.00	0.16
140	600438	通威股份	22,000	486,420.00	0.16
141	600584	长电科技	11,700	478,062.00	0.15
142	000425	徐工机械	59,800	474,214.00	0.15
143	601600	中国铝业	64,400	473,340.00	0.15
144	300014	亿纬锂能	10,000	467,400.00	0.15
145	600585	海螺水泥	19,600	466,088.00	0.15
146	601009	南京银行	43,300	461,145.00	0.15
147	01801	信达生物	13,500	457,515.00	0.15
148	600760	中航沈飞	9,012	457,088.64	0.15
149	600893	航发动力	10,900	451,805.00	0.14
150	600958	东方证券	42,436	448,124.16	0.14
151	601989	中国重工	92,400	444,444.00	0.14
152	600111	北方稀土	20,600	437,132.00	0.14
153	000977	浪潮信息	8,400	435,792.00	0.14
154	000538	云南白药	7,240	434,038.00	0.14
155	01171	兖矿能源	27,200	225,488.00	0.07
155	600188	兖矿能源	14,620	207,165.40	0.07
156	002050	三花智控	18,300	430,233.00	0.14
157	688271	联影医疗	3,395	429,128.00	0.14
158	002463	沪电股份	10,800	428,220.00	0.14
159	600926	杭州银行	29,300	428,073.00	0.14
160	02313	申洲国际	7,400	424,834.00	0.14
161	300408	三环集团	11,000	423,610.00	0.14

162	02319	蒙牛乳业	26,000	422,760.00	0.14
163	600015	华夏银行	51,700	414,117.00	0.13
164	605499	东鹏饮料	1,660	412,543.20	0.13
165	00788	中国铁塔 (新)	396,000	411,840.00	0.13
166	002304	洋河股份	4,900	409,297.00	0.13
167	00688	中国海外发 展	35,500	407,540.00	0.13
168	002179	中航光电	10,368	407,462.40	0.13
169	00288	万洲国际	73,000	406,610.00	0.13
170	600886	国投电力	24,300	403,866.00	0.13
171	02382	舜宇光学科 技	6,300	401,688.00	0.13
172	000002	万 科 A	55,300	401,478.00	0.13
173	000166	申万宏源	73,100	391,085.00	0.12
174	000776	广发证券	24,100	390,661.00	0.12
175	00066	港铁公司	15,500	389,050.00	0.12
176	603993	洛阳钼业	57,400	381,710.00	0.12
177	601669	中国电建	69,800	381,108.00	0.12
178	01928	金沙中国有 限公司	19,600	379,260.00	0.12
179	002028	思源电气	5,100	370,770.00	0.12
180	688036	传音控股	3,780	359,100.00	0.11
181	300433	蓝思科技	16,300	356,970.00	0.11
182	601916	浙商银行	122,320	355,951.20	0.11
183	002049	紫光国微	5,520	355,322.40	0.11
184	601377	兴业证券	56,130	351,373.80	0.11
185	600009	上海机场	10,200	348,330.00	0.11
186	01038	长江基建集 团	6,500	347,620.00	0.11
187	600570	恒生电子	12,408	347,299.92	0.11
188	601186	中国铁建	37,500	343,875.00	0.11
189	600010	包钢股份	184,100	342,426.00	0.11
190	00762	中国联通	50,000	342,000.00	0.11
191	601825	沪农商行	39,800	338,698.00	0.11
192	601336	新华保险	6,800	337,960.00	0.11
193	02688	新奥能源	6,500	336,180.00	0.11
194	601901	方正证券	40,200	334,866.00	0.11
195	002311	海大集团	6,800	333,540.00	0.11
196	601727	上海电气	41,100	333,321.00	0.11
197	600547	山东黄金	14,700	332,661.00	0.11

198	601838	成都银行	19,400	331,934.00	0.11
199	600795	国电电力	72,300	331,134.00	0.11
200	01519	极兔速递— W	57,800	328,304.00	0.10
201	603799	华友钴业	11,080	324,200.80	0.10
202	002460	赣锋锂业	9,240	323,492.40	0.10
203	000768	中航西飞	11,400	321,936.00	0.10
204	002384	东山精密	11,000	321,200.00	0.10
205	02331	李宁	21,000	320,040.00	0.10
206	600522	中天科技	22,300	319,336.00	0.10
207	00291	华润啤酒	13,500	315,630.00	0.10
208	00836	华润电力	18,000	314,640.00	0.10
209	601995	中金公司	9,300	313,317.00	0.10
210	09626	哔哩哔哩— W	2,380	312,970.00	0.10
211	601058	赛轮轮胎	21,300	305,229.00	0.10
212	601077	渝农商行	50,100	303,105.00	0.10
213	601800	中国交建	29,000	303,050.00	0.10
214	001979	招商蛇口	29,500	302,080.00	0.10
215	600989	宝丰能源	17,800	299,752.00	0.10
216	600415	小商品城	22,300	299,043.00	0.10
217	601360	三六零	28,500	294,975.00	0.09
218	01093	石药集团	66,000	292,380.00	0.09
219	00285	比亚迪电子	7,500	292,050.00	0.09
220	000157	中联重科	40,300	291,369.00	0.09
221	601788	光大证券	15,900	287,949.00	0.09
222	002422	科伦药业	9,600	287,328.00	0.09
223	300442	润泽科技	5,500	285,780.00	0.09
224	600489	中金黄金	23,700	285,111.00	0.09
225	600029	南方航空	43,600	282,964.00	0.09
226	300782	卓胜微	3,140	281,658.00	0.09
227	09926	康方生物	5,000	281,050.00	0.09
228	00135	昆仑能源	36,000	280,080.00	0.09
229	06862	海底捞	19,000	279,680.00	0.09
230	600115	中国东航	69,400	277,600.00	0.09
231	002466	天齐锂业	8,400	277,200.00	0.09
232	01997	九龙仓置业	15,000	275,850.00	0.09
233	600745	闻泰科技	7,100	275,338.00	0.09
234	00020	商汤—W	199,000	274,620.00	0.09
235	600674	川投能源	15,900	274,275.00	0.09
236	601066	中信建投	10,600	272,950.00	0.09

237	01177	中国生物制药	92,000	272,320.00	0.09
238	06618	京东健康	10,450	271,909.00	0.09
239	002340	格林美	41,600	271,648.00	0.09
240	002001	新 和 成	12,328	270,846.16	0.09
241	601689	拓普集团	5,525	270,725.00	0.09
242	601881	中国银河	17,700	269,571.00	0.09
243	300418	昆仑万维	7,000	269,360.00	0.09
244	002252	上海莱士	37,300	269,306.00	0.09
245	601633	长城汽车	10,200	268,566.00	0.09
246	000661	长春高新	2,700	268,488.00	0.09
247	01821	ESR	24,200	267,652.00	0.09
248	600160	巨化股份	11,000	265,320.00	0.08
249	600346	恒力石化	17,200	264,020.00	0.08
250	600066	宇通客车	10,000	263,800.00	0.08
251	003816	中国广核	63,800	263,494.00	0.08
252	002736	国信证券	23,500	263,200.00	0.08
253	600426	华鲁恒升	12,170	262,993.70	0.08
254	00012	恒基地产	12,000	262,200.00	0.08
255	00083	信和置业	36,000	261,720.00	0.08
256	002648	卫星化学	13,785	259,020.15	0.08
257	600196	复星医药	10,400	258,440.00	0.08
258	300122	智飞生物	9,800	257,740.00	0.08
259	002236	大华股份	16,100	257,600.00	0.08
260	300394	天孚通信	2,800	255,808.00	0.08
261	601878	浙商证券	20,800	254,592.00	0.08
262	688126	沪硅产业	13,500	254,070.00	0.08
263	002920	德赛西威	2,300	253,253.00	0.08
264	601555	东吴证券	32,390	252,642.00	0.08
265	000786	北新建材	8,300	251,573.00	0.08
266	600256	广汇能源	37,300	251,029.00	0.08
267	000963	华东医药	7,200	249,120.00	0.08
268	601117	中国化学	29,900	247,871.00	0.08
269	688169	石头科技	1,130	247,797.70	0.08
270	01378	中国宏桥	22,500	245,025.00	0.08
271	688777	中控技术	4,925	244,624.75	0.08
272	600372	中航机载	19,760	243,640.80	0.08
273	000596	古井贡酒	1,400	242,620.00	0.08
274	600011	华能国际	35,700	241,689.00	0.08
275	601111	中国国航	30,500	241,255.00	0.08
276	601868	中国能建	105,200	240,908.00	0.08

277	002601	龙佰集团	13,600	240,312.00	0.08
278	603369	今世缘	5,300	239,719.00	0.08
279	600183	生益科技	9,900	238,095.00	0.08
280	300896	爱美客	1,300	237,250.00	0.08
281	00268	金蝶国际	30,000	237,000.00	0.08
282	03888	金山软件	7,600	236,816.00	0.08
283	300347	泰格医药	4,300	234,866.00	0.08
284	600096	云天化	10,500	234,150.00	0.07
285	002129	TCL 中环	26,350	233,724.50	0.07
286	001965	招商公路	16,700	232,965.00	0.07
287	002202	金风科技	22,500	232,425.00	0.07
288	601100	恒立液压	4,400	232,188.00	0.07
289	688223	晶科能源	32,641	232,077.51	0.07
290	601021	春秋航空	4,000	230,680.00	0.07
291	000066	中国长城	15,800	230,206.00	0.07
292	000807	云铝股份	17,000	230,010.00	0.07
293	002180	纳思达	8,100	228,177.00	0.07
294	300661	圣邦股份	2,785	227,757.30	0.07
295	600085	同仁堂	5,600	227,304.00	0.07
296	600741	华域汽车	12,900	227,169.00	0.07
297	600482	中国动力	9,200	225,124.00	0.07
298	002493	荣盛石化	24,800	224,440.00	0.07
299	002459	晶澳科技	16,232	223,190.00	0.07
300	600176	中国巨石	19,590	223,130.10	0.07
301	06186	中国飞鹤	44,000	222,200.00	0.07
302	603392	万泰生物	3,148	221,808.08	0.07
303	600219	南山铝业	56,600	221,306.00	0.07
304	000895	双汇发展	8,500	220,660.00	0.07
305	301269	华大九天	1,800	217,980.00	0.07
306	01193	华润燃气	7,600	216,448.00	0.07
307	600885	宏发股份	6,800	216,376.00	0.07
308	601108	财通证券	26,480	216,341.60	0.07
309	600460	士兰微	8,200	213,364.00	0.07
310	000423	东阿阿胶	3,400	213,248.00	0.07
311	002916	深南电路	1,700	212,500.00	0.07
312	01308	海丰国际	11,000	210,870.00	0.07
313	600515	海南机场	55,700	210,546.00	0.07
314	000975	山金国际	13,600	209,032.00	0.07
315	00960	龙湖集团	22,500	208,350.00	0.07
316	002938	鹏鼎控股	5,700	207,936.00	0.07
317	600845	宝信软件	7,058	206,517.08	0.07

318	002271	东方雨虹	15,900	206,382.00	0.07
319	601877	正泰电器	8,800	206,008.00	0.07
320	03311	中国建筑国际	18,000	204,300.00	0.07
321	601168	西部矿业	12,600	202,482.00	0.06
322	00004	九龙仓集团	10,000	202,300.00	0.06
323	000933	神火股份	11,900	201,110.00	0.06
324	000630	铜陵有色	62,200	200,906.00	0.06
325	600233	圆通速递	14,100	200,079.00	0.06
326	600161	天坛生物	9,700	198,850.00	0.06
327	002555	三七互娱	12,700	198,628.00	0.06
328	601319	中国人保	25,900	197,358.00	0.06
329	06969	思摩尔国际	16,000	197,120.00	0.06
330	00019	太古股份公司A	3,000	195,720.00	0.06
331	002709	天赐材料	9,900	195,228.00	0.06
332	688396	华润微	4,100	193,479.00	0.06
333	02618	京东物流	16,200	191,970.00	0.06
334	300832	新产业	2,700	191,295.00	0.06
335	601607	上海医药	9,100	191,100.00	0.06
336	601618	中国中冶	57,900	191,070.00	0.06
337	300223	北京君正	2,800	190,960.00	0.06
338	000983	山西焦煤	23,100	190,344.00	0.06
339	002078	太阳纸业	12,700	188,849.00	0.06
340	300759	康龙化成	7,325	188,252.50	0.06
341	00322	康师傅控股	20,000	187,400.00	0.06
342	002074	国轩高科	8,800	186,736.00	0.06
343	600023	浙能电力	32,800	185,648.00	0.06
344	000999	华润三九	4,160	184,454.40	0.06
345	000783	长江证券	26,900	183,458.00	0.06
346	09896	名创优品	4,200	182,994.00	0.06
347	03800	协鑫科技	182,000	182,000.00	0.06
348	688072	拓荆科技	1,184	181,945.28	0.06
349	002600	领益智造	22,700	181,600.00	0.06
350	601898	中煤能源	14,900	181,482.00	0.06
351	605117	德业股份	2,140	181,472.00	0.06
352	600298	安琪酵母	5,000	180,250.00	0.06
353	300450	先导智能	8,960	179,379.20	0.06
354	600588	用友网络	16,700	179,191.00	0.06
355	603606	东方电缆	3,400	178,670.00	0.06
356	000408	藏格矿业	6,400	177,472.00	0.06

357	000301	东方盛虹	21,500	176,515.00	0.06
358	02367	巨子生物	3,800	175,598.00	0.06
359	600362	江西铜业	8,500	175,440.00	0.06
360	600765	中航重机	8,500	173,995.00	0.06
361	00270	粤海投资	28,000	173,880.00	0.06
362	688599	天合光能	8,922	172,194.60	0.06
363	601872	招商轮船	26,400	169,224.00	0.05
364	300316	晶盛机电	5,300	169,070.00	0.05
365	601238	广汽集团	18,100	169,054.00	0.05
366	00384	中国燃气	26,600	166,782.00	0.05
367	002128	电投能源	8,500	166,430.00	0.05
368	000876	新希望	18,500	166,130.00	0.05
369	600803	新奥股份	7,600	164,768.00	0.05
370	300413	芒果超媒	6,100	164,029.00	0.05
371	688122	西部超导	3,820	163,572.40	0.05
372	603296	华勤技术	2,300	163,185.00	0.05
373	601567	三星医疗	5,300	163,028.00	0.05
374	601233	桐昆股份	13,800	162,840.00	0.05
375	600332	白云山	5,700	161,994.00	0.05
376	603260	合盛硅业	2,900	161,124.00	0.05
377	00868	信义玻璃	22,000	160,820.00	0.05
378	03692	翰森制药	10,000	160,000.00	0.05
379	300999	金龙鱼	4,900	159,789.00	0.05
380	00241	阿里健康	52,000	159,640.00	0.05
381	300037	新宙邦	4,200	157,248.00	0.05
382	600061	国投资本	20,900	157,168.00	0.05
383	300628	亿联网络	4,020	155,172.00	0.05
384	600039	四川路桥	21,300	155,064.00	0.05
385	688047	龙芯中科	1,167	154,370.76	0.05
386	00144	招商局港口	12,000	153,840.00	0.05
387	601799	星宇股份	1,152	153,768.96	0.05
388	600027	华电国际	27,400	153,714.00	0.05
389	002821	凯莱英	2,020	153,701.80	0.05
390	002812	恩捷股份	4,800	153,552.00	0.05
391	688506	百利天恒	800	153,384.00	0.05
392	601696	中银证券	13,600	151,776.00	0.05
393	002007	华兰生物	9,000	151,650.00	0.05
394	01209	华润万象生活	5,600	149,856.00	0.05
395	600918	中泰证券	22,700	149,139.00	0.05
396	00881	中升控股	11,500	148,695.00	0.05

397	03808	中国重汽	7,000	147,770.00	0.05
398	600875	东方电气	9,100	144,599.00	0.05
399	01585	雅迪控股	12,000	143,760.00	0.05
400	601216	君正集团	27,200	143,072.00	0.05
401	000617	中油资本	20,600	141,934.00	0.05
402	000932	华菱钢铁	33,800	141,284.00	0.05
403	601699	潞安环能	9,800	140,728.00	0.04
404	688472	阿特斯	11,200	140,672.00	0.04
405	01972	太古地产	9,600	140,640.00	0.04
406	603605	珀莱雅	1,660	140,602.00	0.04
407	600642	申能股份	14,800	140,452.00	0.04
408	600025	华能水电	14,700	139,797.00	0.04
409	600018	上港集团	22,800	139,536.00	0.04
410	603659	璞泰来	8,714	138,639.74	0.04
411	300919	中伟股份	3,800	137,256.00	0.04
412	01044	恒安国际	6,500	135,135.00	0.04
413	000733	振华科技	3,200	134,944.00	0.04
414	002064	华峰化学	16,200	132,516.00	0.04
415	600026	中远海能	11,400	132,240.00	0.04
416	688009	中国通号	21,085	131,992.10	0.04
417	03998	波司登	36,000	129,240.00	0.04
418	00968	信义光能	44,000	128,040.00	0.04
419	01548	金斯瑞生物科技	14,000	127,540.00	0.04
420	600132	重庆啤酒	2,000	126,040.00	0.04
421	603806	福斯特	8,491	125,666.80	0.04
422	300751	迈为股份	1,180	124,077.00	0.04
423	601018	宁波港	31,700	122,045.00	0.04
424	688303	大全能源	5,000	120,700.00	0.04
425	601865	福莱特	6,100	120,109.00	0.04
426	603939	益丰药房	4,911	118,502.43	0.04
427	601059	信达证券	7,900	118,342.00	0.04
428	688188	柏楚电子	600	116,550.00	0.04
429	03668	兖煤澳大利亚	4,000	116,120.00	0.04
430	600985	淮北矿业	8,100	113,967.00	0.04
431	603195	公牛集团	1,585	111,330.40	0.04
432	603816	顾家家居	3,990	110,044.20	0.04
433	002603	以岭药业	6,800	108,868.00	0.03
434	02380	中国电力	37,000	108,780.00	0.03
435	000629	钒钛股份	37,700	108,576.00	0.03

436	603198	迎驾贡酒	2,000	107,880.00	0.03
437	002939	长城证券	13,000	106,600.00	0.03
438	00316	东方海外国 际	1,000	106,590.00	0.03
439	601698	中国卫通	5,200	106,080.00	0.03
440	688187	时代电气	2,200	105,424.00	0.03
441	601966	玲珑轮胎	5,800	104,632.00	0.03
442	002414	高德红外	13,931	103,507.33	0.03
443	603833	欧派家居	1,500	103,410.00	0.03
444	300979	华利集团	1,300	102,245.00	0.03
445	01929	周大福	16,400	102,172.00	0.03
446	601136	首创证券	4,500	99,000.00	0.03
447	01876	百威亚太	14,100	97,854.00	0.03
448	00293	国泰航空	11,000	97,130.00	0.03
449	000708	中信特钢	8,200	93,562.00	0.03
450	00101	恒隆地产	16,000	92,320.00	0.03
451	603899	晨光股份	3,000	90,750.00	0.03
452	02588	中银航空租 赁	1,600	89,424.00	0.03
453	000987	越秀资本	12,310	86,416.20	0.03
454	300765	新诺威	3,200	85,088.00	0.03
455	601231	环旭电子	5,100	84,150.00	0.03
456	688728	格科微	6,129	82,373.76	0.03
457	688363	华熙生物	1,600	81,664.00	0.03
458	02282	美高梅中国	8,800	80,960.00	0.03
459	600606	绿地控股	34,200	71,820.00	0.02
460	688082	盛美上海	700	70,000.00	0.02
461	002032	苏 泊 尔	1,300	69,173.00	0.02
462	06110	滔搏	25,000	69,000.00	0.02
463	601808	中海油服	4,400	67,100.00	0.02
464	600968	海油发展	15,400	65,758.00	0.02
465	000877	天山股份	11,600	65,656.00	0.02
466	600377	宁沪高速	4,100	62,771.00	0.02
467	000800	一汽解放	7,400	60,680.00	0.02
468	600236	桂冠电力	8,900	60,520.00	0.02
469	001286	陕西能源	5,700	52,896.00	0.02
470	600350	山东高速	5,100	52,428.00	0.02
471	601298	青岛港	5,300	48,283.00	0.02
472	001872	招商港口	1,900	38,893.00	0.01
473	002945	华林证券	2,200	33,726.00	0.01
474	601061	中信金属	3,900	28,314.00	0.01

475	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.01
476	001289	龙源电力	1,300	20,423.00	0.01
477	603194	中力股份	221	6,216.73	0.00
478	02007	碧桂园	124,000	6,200.00	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	09988	阿里巴巴-W	12,614,534.74	4.22
2	00700	腾讯控股	6,738,662.99	2.26
3	00005	汇丰控股	3,683,345.98	1.23
4	02888	渣打集团	2,667,670.86	0.89
5	03690	美团-W	2,062,374.09	0.69
6	300750	宁德时代	2,005,731.00	0.67
7	01299	友邦保险	1,983,928.43	0.66
8	00939	建设银行	1,895,241.50	0.63
8	601939	建设银行	14,156.00	0.00
9	00941	中国移动	1,714,908.24	0.57
9	600941	中国移动	62,450.00	0.02
10	000333	美的集团	1,119,654.00	0.37
10	00300	美的集团	346,816.36	0.12
11	600519	贵州茅台	1,356,171.00	0.45
12	01398	工商银行	1,119,721.74	0.37
12	601398	工商银行	110,680.00	0.04
13	300760	迈瑞医疗	1,174,327.00	0.39
14	300502	新易盛	1,062,669.00	0.36
15	02318	中国平安	737,614.76	0.25
15	601318	中国平安	254,249.00	0.09
16	000858	五粮液	991,076.00	0.33
17	02057	中通快递-W	972,039.69	0.33
18	00883	中国海洋石油	929,913.63	0.31
18	600938	中国海油	37,759.00	0.01
19	002594	比亚迪	734,184.00	0.25
19	01211	比亚迪股份	191,935.49	0.06
20	03988	中国银行	859,003.20	0.29
20	601988	中国银行	55,994.00	0.02

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	00700	腾讯控股	10,023,484.51	3.36
2	00005	汇丰控股	6,060,650.54	2.03
3	00941	中国移动	3,591,112.35	1.20
3	600941	中国移动	32,482.00	0.01
4	03690	美团-W	3,086,573.60	1.03
5	01299	友邦保险	2,954,898.25	0.99
6	00939	建设银行	2,697,209.35	0.90
6	601939	建设银行	6,688.00	0.00
7	300750	宁德时代	2,641,401.00	0.88
8	02888	渣打集团	2,541,017.06	0.85
9	01398	工商银行	1,592,693.69	0.53
9	601398	工商银行	96,664.00	0.03
10	002594	比亚迪	1,052,763.51	0.35
10	01211	比亚迪股份	634,891.66	0.21
11	000333	美的集团	1,541,212.00	0.52
12	00883	中国海洋石油	1,337,832.27	0.45
12	600938	中国海油	19,047.00	0.01
13	000858	五粮液	1,320,609.00	0.44
14	300760	迈瑞医疗	1,318,566.00	0.44
15	01810	小米集团-W	1,304,429.30	0.44
16	00388	香港交易所	1,287,588.84	0.43
17	02318	中国平安	1,003,885.81	0.34
17	601318	中国平安	281,525.00	0.09
18	03988	中国银行	1,198,327.06	0.40
18	601988	中国银行	49,433.00	0.02
19	09633	农夫山泉	1,143,687.68	0.38
20	300059	东方财富	845,741.00	0.28

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	104,364,798.84
卖出股票收入（成交）总额	111,731,452.06

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

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，在风险可控的基础上，以套期保值为目的，参与国债期货的投资，以降低跟踪误差。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	10,948.93
2	应收清算款	—
3	应收股利	33,667.59
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	44,616.52

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603072	C 天和	24,956.70	0.01	新股认购
1	603072	C 天和	2,779.80	0.00	新股限售
2	603194	中力股份	6,216.73	0.00	新股限售
3	02007	碧桂园	6,200.00	0.00	筹划重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
5,461	70,793.28	150,112,096.00	38.83	236,490,029.00	61.17	114,694,300.00	29.67

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	BARCLAYS BANK PLC	13,857,618.00	3.58
2	中信证券股份有限公司	7,070,138.00	1.83

3	徐亚英	3,500,000.00	0.91
4	薛宏飞	3,500,000.00	0.91
5	中信建投证券股份有限公司	3,343,440.00	0.86
6	欧小清	3,058,900.00	0.79
7	北京中洲禾源投资咨询有限公司	3,000,000.00	0.78
8	王贤华	2,130,000.00	0.55
9	庞彪	2,140,000.00	0.55
10	马磊	2,100,000.00	0.54
11	富国中证沪港深 500 交易型 开放式指数证券投资基金联接基金	114,694,300.00	29.67

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年02月09日)基金份额总额	787,102,125.00
报告期期初基金份额总额	440,602,125.00
本报告期基金总申购份额	139,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	193,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	386,602,125.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

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

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 3.8 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：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
渤海证券	1	10,799,493.65	5.00	1,046.81	2.84	—
长江证券	3	4,936,096.03	2.29	3,632.36	9.86	—
诚通证券	2	—	—	—	—	—
东方证券	4	1,083,764.04	0.50	797.55	2.16	—
东吴证券	2	3,344,589.34	1.55	2,461.17	6.68	—
方正证券	1	487,453.09	0.23	9.58	0.03	—
广发证券	2	33,890,654.58	15.70	5,757.12	15.62	—
国盛证券	2	7,454,342.49	3.45	5,485.83	14.89	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—
海通证券	2	28,169,709.11	13.05	8,493.95	23.05	—
华泰证券	2	3,884,460.13	1.80	1,534.57	4.16	—
华西证券	2	—	—	—	—	—
民生证券	3	2,509,319.13	1.16	1,846.55	5.01	—
申港证券	1	105,429,036.92	48.84	3,782.81	10.27	—
申万宏源	2	—	—	—	—	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	2	148,789.00	0.07	109.49	0.30	—
浙商证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	13,794.64	0.01	10.17	0.03	—
中信建投	2	782,841.07	0.36	122.97	0.33	—
中信证券	2	12,947,869.93	6.00	1,759.68	4.78	—

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：申港证券（012072、50378）。本报告期本基金新增券商交易单元：渤海证券（005839），东方证券（007913、28883），国泰

君安（018520、60244）。

2、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《富国基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元						
券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）
渤海证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
诚通证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	9,342.82	100.00	—	—	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
华西证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
申港证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—

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部分基金 2024 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	规定披露媒介	2024 年 01 月 02 日
2	富国基金管理有限公司关于旗下部分上海证券交易所 ETF 暂停申购、赎回业务的公告	规定披露媒介	2024 年 09 月 06 日
3	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年 12 月 24 日因港股通非交易日暂停申购、赎回等业务的公告	规定披露媒介	2024 年 12 月 20 日
4	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年 12 月 31 日因港股通非交易日暂停申购、赎回等业务的公告	规定披露媒介	2024 年 12 月 26 日
5	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金 2025 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	规定披露媒介	2024 年 12 月 31 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
富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券	1	2024-01-01 至 2024-12-31	113,440,900.00	12,283,800.00	11,030,400.00	114,694,300.00	29.67%

投资基金 联接基金							
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沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的文件 2、富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同 3、富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	中国(上海)自由贸易试验区 世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网 址： http://www.fullgoal.com.cn 。