

富国裕利债券型证券投资基金

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.....	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.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	15
§4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	18
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	23
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	23
§5 托管人报告	23
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	23
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.....	23
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	24
§6 审计报告	24
6.1 审计报告基本信息.....	24
6.2 审计报告的基本内容.....	24
§7 年度财务报告	27
7.1 资产负债表.....	27

7.2 利润表.....	28
7.3 净资产变动表.....	29
7.4 报表附注.....	31
§8 投资组合报告	67
8.1 期末基金资产组合情况.....	67
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	68
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	69
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	93
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	94
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	95
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.....	95
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.....	95
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	95
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	95
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	96
8.12 本报告期投资基金情况.....	96
8.13 投资组合报告附注.....	97
§9 基金份额持有人信息	106
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	106
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	107
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	107
§10 开放式基金份额变动	107
§11 重大事件揭示	107
11.1 基金份额持有人大会决议	107
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	108
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	108
11.4 基金投资策略的改变.....	108
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	108
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	108
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	108
11.8 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	109
11.9 其他重大事件.....	112
§12 影响投资者决策的其他重要信息	112
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	112

§13 备查文件目录 112

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国裕利债券型证券投资基金		
基金简称	富国裕利债券		
基金主代码	014671		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2022 年 02 月 23 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	5,479,616,477.20 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	富国裕利债券 A	富国裕利债券 C	富国裕利债券 E
下属分级基金的交易代码	014671	014672	018187
报告期末下属分级基金的份额总额 (单位: 份)	2,833,171,133.19 份	531,710,237.87 份	2,114,735,106.14 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保持资产流动性以及严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采取稳健灵活的投资策略,力求在有效控制风险的基础上,获得基金资产的稳定增值;同时根据对权益类市场的趋势研判适度参与股票资产投资,力求提高基金总体收益率。在资产配置方面,本基金采取自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在债券投资方面,本基金主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪,采用久期控制下的主动性投资策略。在股票投资方面,本基金将精选基本面良好、有长期投资价值的优质企业。在基金投资方面,本基金投资于全市场的股票型 ETF 及基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金。本基金的动态收益增强策略、存托凭证投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率 $\times$ 85%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算) $\times$ 5%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金。本基金投资港股通标的股票的,需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	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路222号外滩中心30楼
注册登记机构	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

§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) 富国裕利债券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 2 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	22,228,595.04	34,645,940.83	39,837,902.81
本期利润	100,680,085.72	11,628,334.23	24,066,827.76
加权平均基金份额本期利润	0.0465	0.0064	0.0179
本期加权平均净值利润率	4.39%	0.62%	1.77%
本期基金份额净值增长率	5.89%	2.72%	1.30%
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	180,602,821.63	101,059,889.82	13,254,772.78
期末可供分配基金份额利润	0.0637	0.0406	0.0130
期末基金资产净值	3,121,794,579.90	2,590,657,878.81	1,034,105,508.05
期末基金份额净值	1.1019	1.0406	1.0130
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	10.19%	4.06%	1.30%

(2) 富国裕利债券 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 2 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-409,076.44	5,428,657.28	2,280,820.33
本期利润	114,720.81	-2,635,780.81	1,627,013.57
加权平均基金份额本期利润	0.0009	-0.0076	0.0185
本期加权平均净值利润率	0.09%	-0.73%	1.84%
本期基金份额净值增长率	5.54%	2.32%	0.95%
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	27,524,745.55	6,422,816.18	711,127.42
期末可供分配基金份额利润	0.0518	0.0329	0.0095
期末基金资产净值	579,595,703.42	201,888,870.75	75,449,598.39
期末基金份额净值	1.0901	1.0329	1.0095
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	9.01%	3.29%	0.95%

(3) 富国裕利债券 E

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年 2 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	24,682,647.43	14,166,856.36	—
本期利润	74,037,212.95	-17,311,235.07	—
加权平均基金份额本期利润	0.0485	-0.0151	—
本期加权平均净值利润率	4.57%	-1.45%	—
本期基金份额净值增长率	5.86%	-0.21%	—
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	134,126,381.47	50,255,110.97	—
期末可供分配基金份额利润	0.0634	0.0404	—
期末基金资产净值	2,329,253,847.49	1,294,151,497.16	—
期末基金份额净值	1.1014	1.0404	—
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	5.64%	-0.21%	—

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) 富国裕利债券 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	2.01%	0.32%	1.66%	0.23%	0.35%	0.09%
过去六个月	4.43%	0.31%	4.37%	0.20%	0.06%	0.11%
过去一年	5.89%	0.28%	6.96%	0.17%	-1.07%	0.11%
自基金合同生效起至今	10.19%	0.21%	5.40%	0.18%	4.79%	0.03%

(2) 富国裕利债券 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	1.97%	0.32%	1.66%	0.23%	0.31%	0.09%
过去六个月	4.28%	0.31%	4.37%	0.20%	-0.09%	0.11%
过去一年	5.54%	0.28%	6.96%	0.17%	-1.42%	0.11%
自基金合同生效起至今	9.01%	0.21%	5.40%	0.18%	3.61%	0.03%

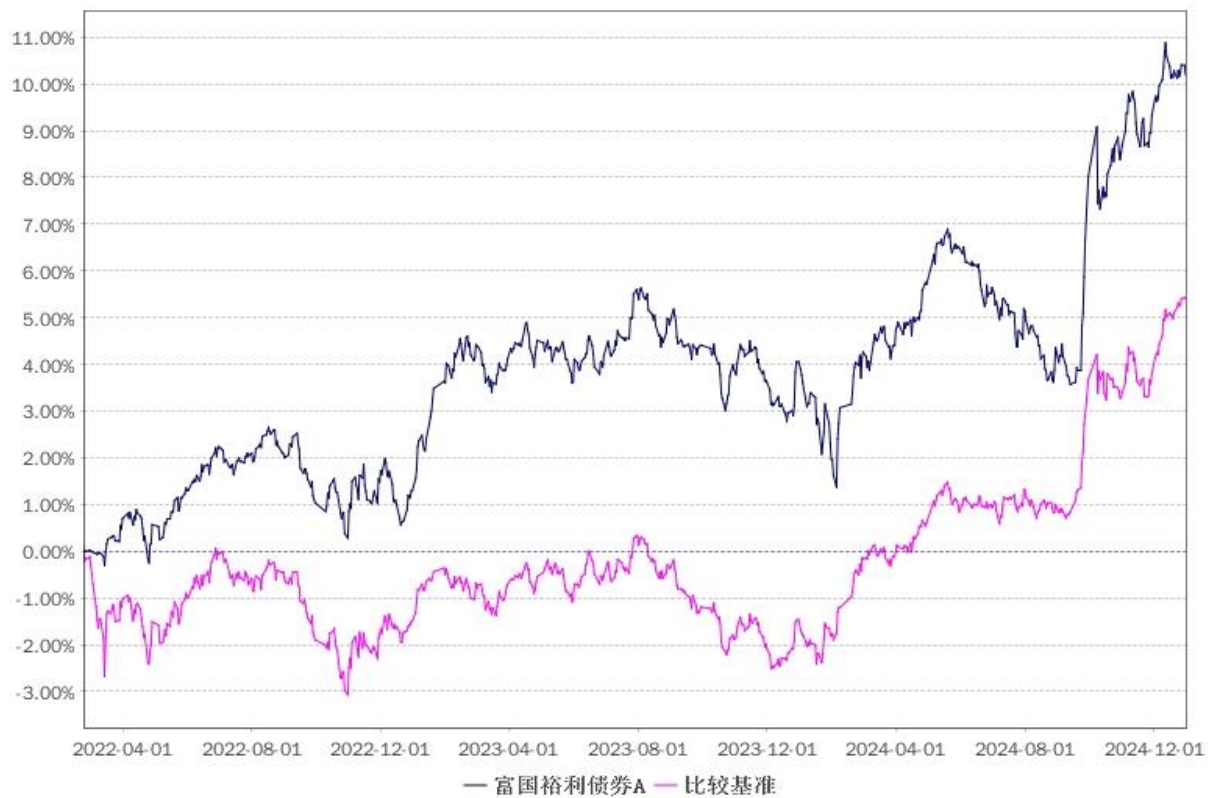
(3) 富国裕利债券 E

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	1.99%	0.32%	1.66%	0.23%	0.33%	0.09%
过去六个月	4.40%	0.31%	4.37%	0.20%	0.03%	0.11%
过去一年	5.86%	0.27%	6.96%	0.17%	-1.10%	0.10%
自基金分级生效日起至今	5.64%	0.24%	6.04%	0.16%	-0.40%	0.08%

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

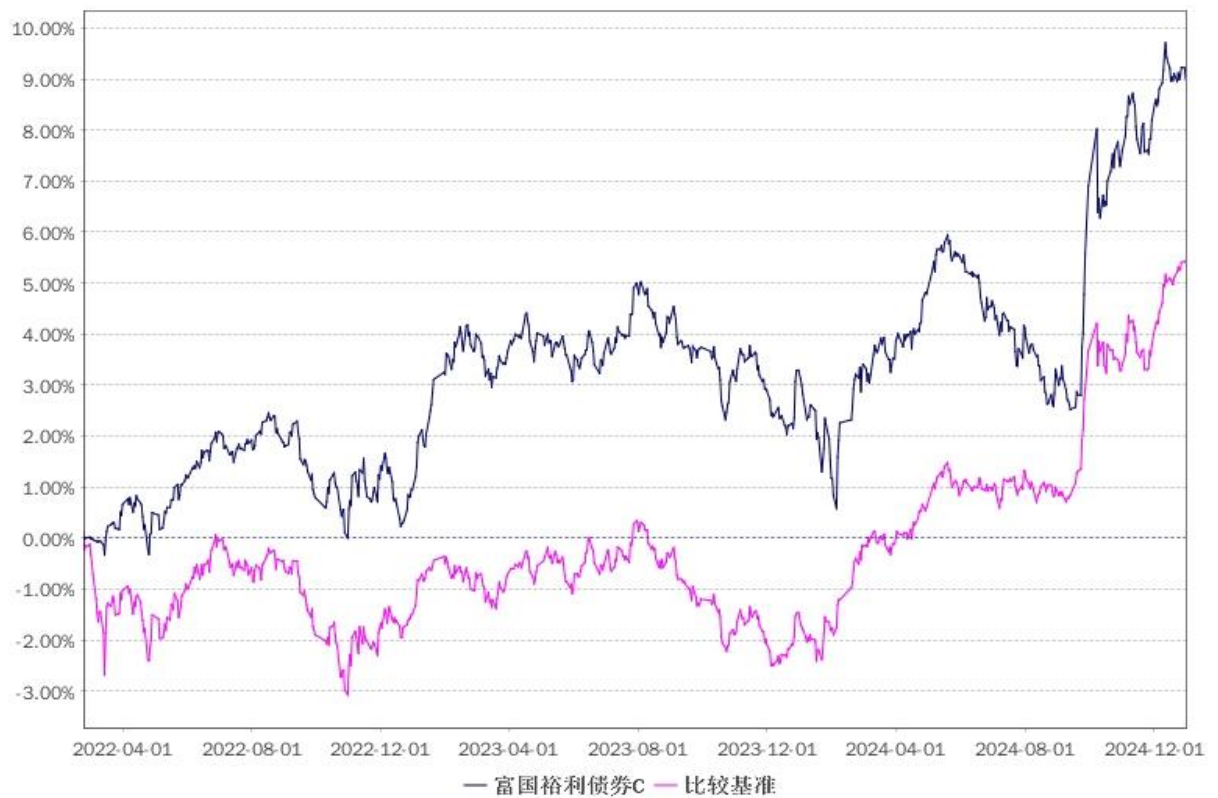
(1) 自基金合同生效以来富国裕利债券 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2024 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2022 年 2 月 23 日成立，建仓期 6 个月，从 2022 年 2 月 23 日起至 2022 年 8 月 22 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

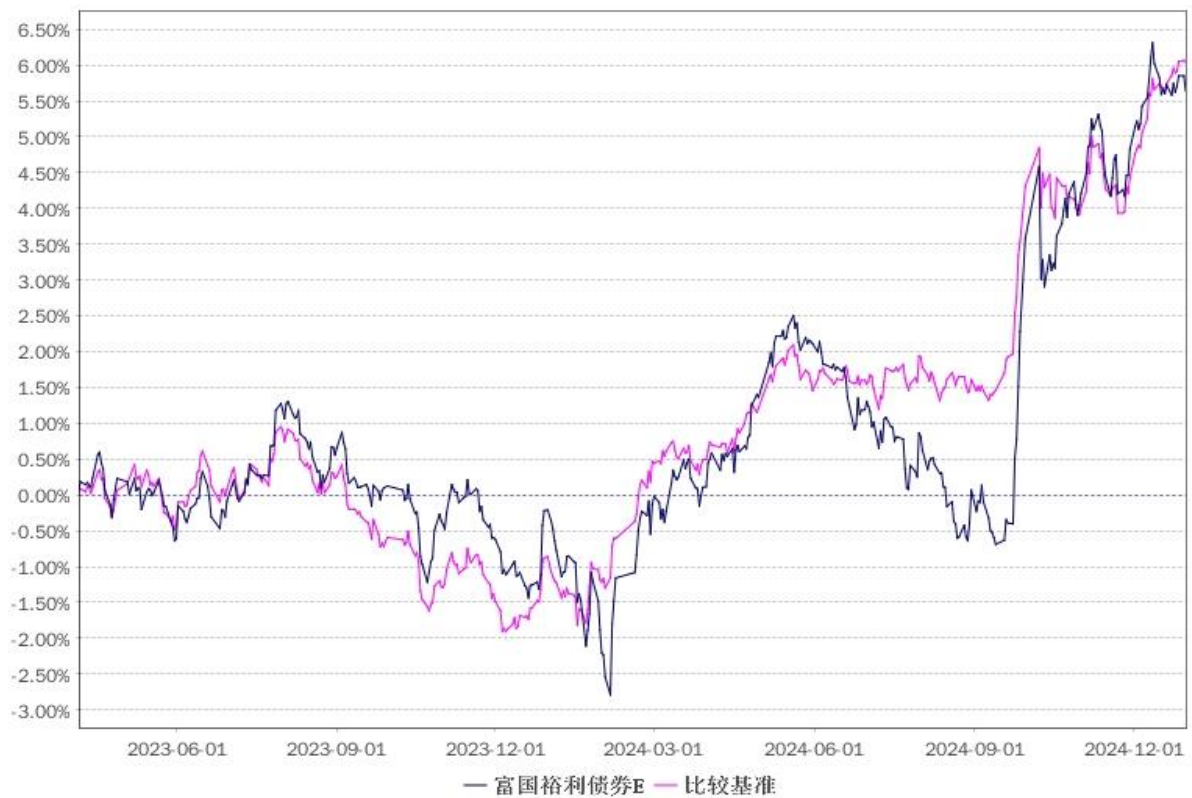
(2) 自基金合同生效以来富国裕利债券 C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2024 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2022 年 2 月 23 日成立，建仓期 6 个月，从 2022 年 2 月 23 日起至 2022 年 8 月 22 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）自基合同生效以来富国裕利债券 E 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

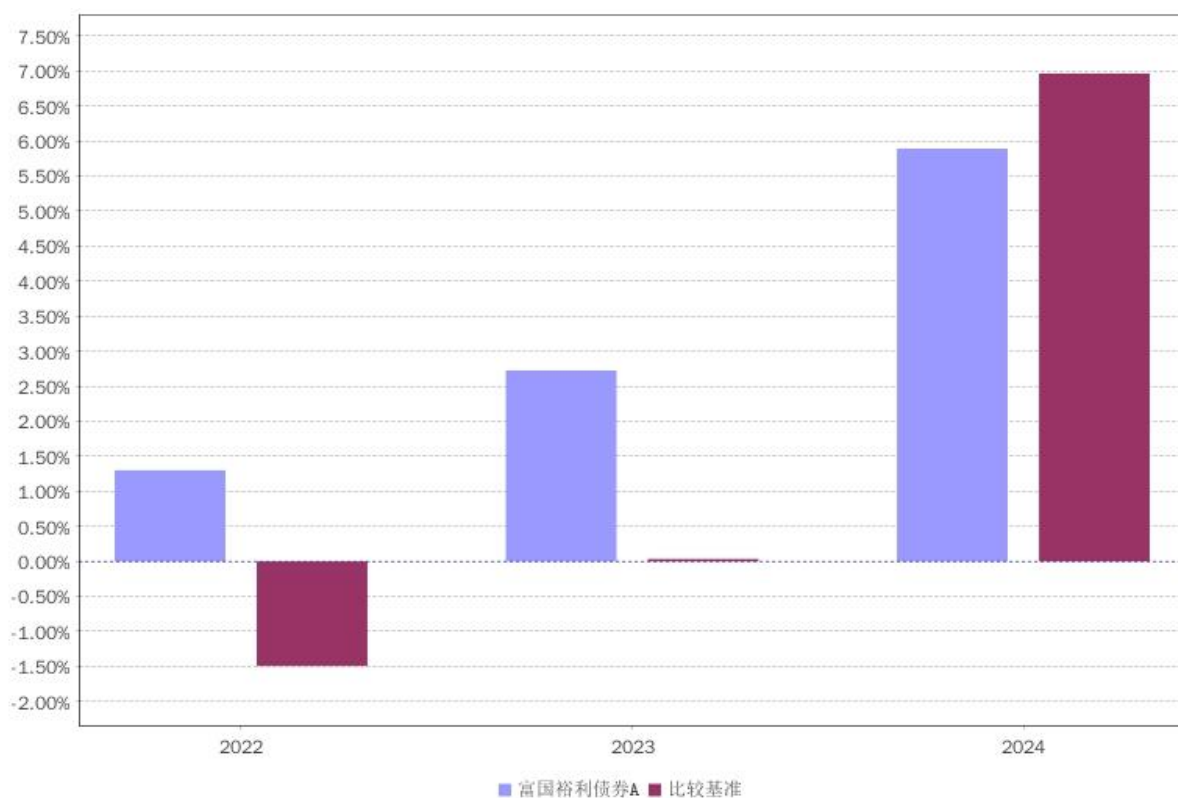


注：1、截止日期为 2024 年 12 月 31 日。

2、本基金自 2023 年 4 月 3 日起增加 E 类份额，相关数据按实际存续期计算。

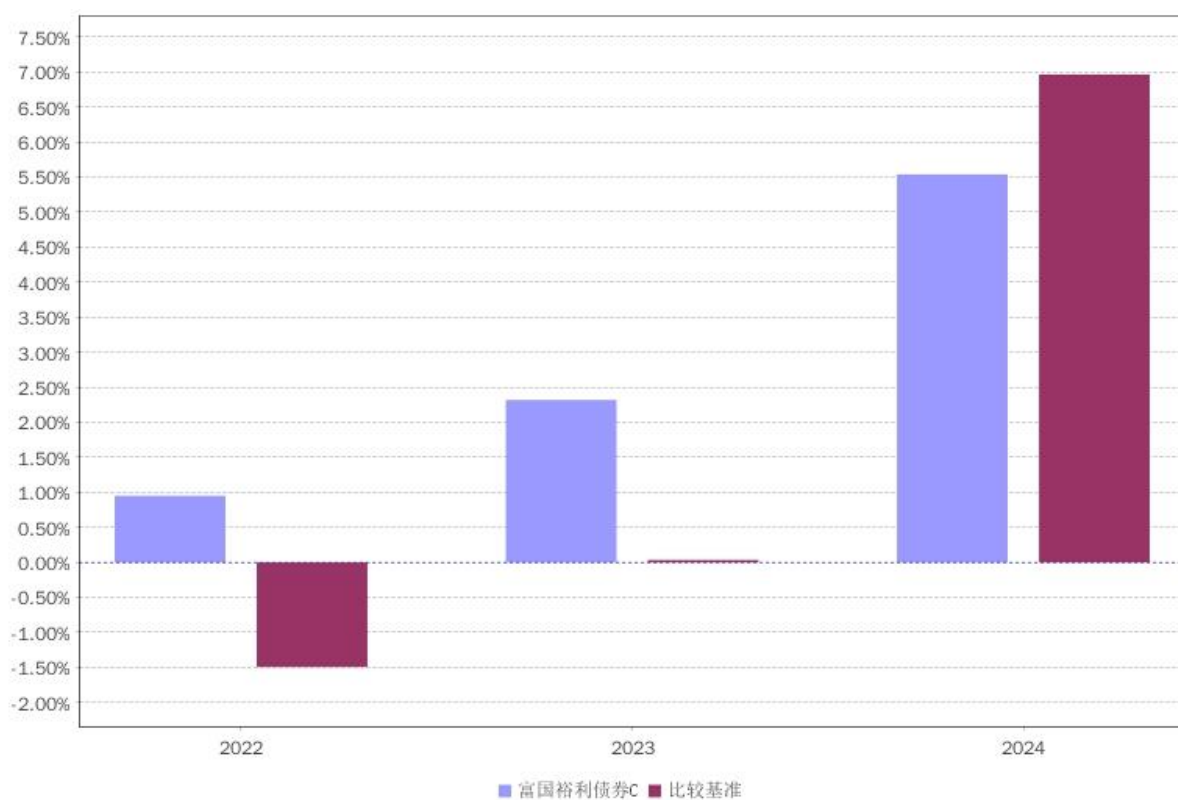
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 自基金合同生效以来富国裕利债券 A 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



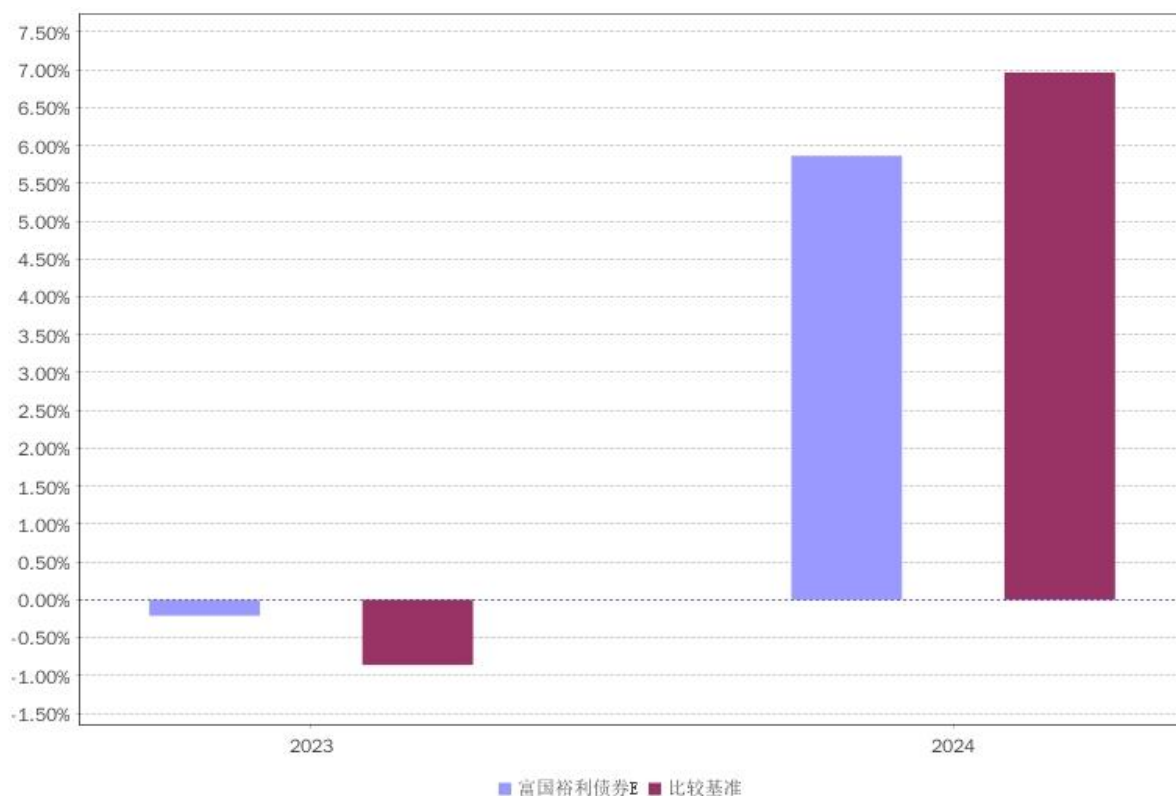
注：2022 年按实际存续期计算。

(2) 自基金合同生效以来富国裕利债券 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：2022 年按实际存续期计算。

(3) 自基金合同生效以来富国裕利债券 E 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：E 类份额自 2023 年 4 月 6 日起有基金份额。2023 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) 富国裕利债券 A

注：本基金 2022 年 2 月 23 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日未进行利润分配

(2) 富国裕利债券 C

注：本基金 2022 年 2 月 23 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日未进行利润分配

(3) 富国裕利债券 E

注：本基金 2022 年 2 月 23 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日未进行利润分配

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注

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

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省金融资产管理股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 期限	证券从业 年限	说明
----	----	-----------------	------------	----

		任职日期	离任日期		
黄纪亮	本基金现任基金经理	2022-02-23	—	17	硕士，曾任国泰君安证券股份有限公司助理研究员；自 2012 年 11 月加入富国基金管理有限公司，历任债券研究员、固定收益基金经理、固定收益投资部固定收益投资副总监、固定收益策略研究部总经理、高级固定收益基金经理；现任富国基金总经理助理，兼任富国基金固定收益投资部总经理、固定收益策略研究部总经理、高级固定收益基金经理。自 2013 年 02 月起任富国强回报定期开放债券型证券投资基金基金经理；自 2014 年 03 月起任富国汇利回报两年定期开放债券型证券投资基金(原富国汇利回报分级债券型证券投资基金)基金经理；自 2014 年 03 月起任富国天利增长债券投资基金基金经理；自 2014 年 06 月起任富国信用债债券型证券投资基金基金经理；自 2016 年 08 月起任富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理；自 2017 年 08 月起任富国祥利一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理；自 2022 年 02 月起任富国裕利债券型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
刘兴旺	本基金现任基金经理	2022-07-28	—	19	硕士，曾任申银万国证券股份有限公司固定收益研究员，华宝兴业基金管理有限公司基金经理助理兼债券研究员，泰信基金管理有限公司基金经理，国投瑞银基金管理有限公司基金经理，国联民生股份有限公司资产管理部副总经理，长安基金管理有限公司固定收益总监；自 2021 年 11 月加入富国基金管理有限公司，自 2022 年 5 月起历任固定收益投资经理；现任富国基金固定收益投资部固定收益基金经理。自 2022 年 07 月起任富国裕利债券型证券投资基金基金经理；自 2022 年 09 月起任富国双利增强债券型证券投资基金基金经理；自

					2022 年 12 月起任富国久利稳健配置混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 月起任富国优化增强债券型证券投资基金基金经理；自 2023 年 05 月起任富国稳健添利债券型证券投资基金基金经理；自 2023 年 07 月起任富国兴享回报 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；自 2024 年 12 月起任富国天利增长债券投资基金基金经理助理；具有基金从业资格。
王成林	本基金现任基金经理助理	2024-03-04	—	7	硕士，曾任华安基金管理有限公司研究员；自 2022 年 11 月加入富国基金管理有限公司，历任债券研究员、固定收益基金经理助理岗；现任富国基金固定收益策略研究部固定收益基金经理助理。自 2024 年 03 月起任富国裕利债券型证券投资基金基金经理助理；自 2024 年 06 月起任富国天利增长债券投资基金基金经理助理；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裕利债券型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》、《富国裕利债券型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 23 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 年国内经济克服内外部挑战，总体运行平稳，全年 GDP 同比达到 5%的增速目标。上半年国内需求略显不足，制造业 PMI 指数一季度短暂回升，二季度重新回落到 50 以下，CPI 同比维持低位。三季度开始，宏观政策的逆周期调节力度加大，央行于 7 月和 9 月下调公开市场 7 天逆回购利率合计 0.3 个百分点，推动存款利率市场化，引导 LPR、存量房贷利率等市场利率下行，财政较大规模增加债务额度，支持地方政府化解隐性债务。随着增量政策持续发力，四季度 GDP 同比回升到 5.4%，制造业 PMI、商品房销售等数据边际改善。海外环境依然复杂，美联储 9 月开始实施了三次降息，但四季度后，美国通胀回升，市场对美联储降息预期下降，美元指数和美债收益率走高。

2024 年债券收益率大幅下行，二季度经济预期转弱、三季度货币转松，债市基本面趋好，10 年期国债收益率从年初的 2.55%下行到三季度末的 2.05%左右。9 月底宏观政策加力，经济预期改善，债市出现短暂调整。四季度央行公开市场净买入国债，流动性维持充裕，政治局会议定调适度宽松的货币政策。市场对于宽松的预期升温，债券收益率快速下行，年末 10 年期国债收益率下破 1.70%。权益市场波动较大，2 月股市从前期低位反弹，但二季度末风险偏好再度回落，股市持续调整。9 月底增量政策的发布提振了市场预期，股市大幅反弹，到年底维持震荡上涨的走势。投资操作上，本基金注重大类资产配置，积极把握债市机会，适时调整久期和杠杆，优化权益持仓，报告期内净值有所增长。

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 1.1019 元，C 级为 1.0901 元，E 级为 1.1014 元；份额累计净值 A 级为 1.1019 元，C 级为 1.0901 元，E 级

为 1.1014 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为 5.89%，C 级为 5.54%，E 级为 5.86%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 6.96%，C 级为 6.96%，E 级为 6.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年内外部环境依然较为复杂，中央经济工作会议指出要充实完善政策工具箱，提高宏观调控的前瞻性、针对性、有效性，实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策。债市环境仍相对友好，流动性维持充裕、社会综合融资成本稳中有降，债券收益率或在偏低位置震荡。增量政策陆续出台，有助于支持股市的健康发展和预期改善，预计也会出现较好的投资机会。同时，要密切关注外部的不确定性，特朗普上任后，美国关税等政策可能对股、债、汇等市场都带来影响。本基金将继续侧重大类资产配置，根据市场情况优化持仓，灵活调整久期和杠杆，适当增加权益仓位，力争为持有人获得长期可持续的投资回报。

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”）在富国裕利债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金

资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(25)第 P00656 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	富国裕利债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国裕利债券型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，后附的富国裕利债券型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，公允反映了富国裕利债券型证券投资基金 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，我们独立于富国裕利债券型证券投资基金，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	富国裕利债券型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裕利债券型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裕利债券型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,就可能导致对富国裕利债券型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裕利债券型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	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	汪芳	冯适
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2025 年 03 月 27 日	

§ 7 年度财务报告

7.1 资产负债表

会计主体：富国裕利债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	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	53,406,587.56	12,081,247.37
结算备付金	19,498,642.23	49,219,207.21
存出保证金	198,407.89	242,515.67
交易性金融资产	5,682,343,402.52	5,135,326,310.44
其中：股票投资	487,312,225.72	284,264,350.30
基金投资	140,584,731.98	373,007,509.31
债券投资	5,024,103,648.88	4,447,610,797.70
资产支持证券投资	30,342,795.94	30,443,653.13
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	301,535,635.37	100,014,857.03
应收清算款	32,209,468.07	108,049,922.15
应收股利	—	—
应收申购款	8,950,349.27	141,001.63
递延所得税资产	—	—
其他资产	15,450.81	66,000.24
资产总计	6,098,157,943.72	5,405,141,061.74
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	41,229,395.28	970,049,852.90
应付清算款	2,707,098.86	47,915,856.20
应付赎回款	19,650,556.27	296,633,577.57
应付管理人报酬	2,951,895.04	2,795,069.73

应付托管费	511,541.29	487,648.11
应付销售服务费	131,304.85	139,025.12
应付投资顾问费	—	—
应交税费	64,293.06	87,357.86
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	267,728.26	334,427.53
负债合计	67,513,812.91	1,318,442,815.02
净资产：		
实收基金	5,479,616,477.20	3,928,960,429.75
其他综合收益	—	—
未分配利润	551,027,653.61	157,737,816.97
净资产合计	6,030,644,130.81	4,086,698,246.72
负债和净资产总计	6,098,157,943.72	5,405,141,061.74

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1006 元，基金份额总额 5,479,616,477.20 份。其中：富国裕利债券 A 份额净值 1.1019 元，份额总额 2,833,171,133.19 份；富国裕利债券 C 份额净值 1.0901 元，份额总额 531,710,237.87 份；富国裕利债券 E 份额净值 1.1014 元，份额总额 2,114,735,106.14 份。

7.2 利润表

会计主体：富国裕利债券型证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日)	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	212,619,714.28	26,178,825.76
1.利息收入	1,525,142.03	1,137,062.81
其中：存款利息收入	1,052,956.35	677,122.72
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	472,185.68	459,940.09
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	81,920,631.96	87,054,466.79
其中：股票投资收益	-19,913,339.15	-5,579,113.08
基金投资收益	-37,709,416.47	734,451.08
债券投资收益	124,488,639.05	86,286,955.28

资产支持证券投资收益	989,639.08	989,532.35
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	14,065,109.45	4,622,641.16
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）	128,329,853.45	-62,560,136.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	844,086.84	547,432.28
减：二、营业总支出	37,787,694.80	34,497,507.41
1. 管理人报酬	27,382,161.54	21,279,286.29
2. 托管费	4,784,818.69	3,691,501.33
3. 销售服务费	675,043.44	1,511,201.53
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	4,577,850.11	7,655,276.21
其中：卖出回购金融资产支出	4,577,850.11	7,655,276.21
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	88,392.67	87,056.07
8. 其他费用	279,428.35	273,185.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	174,832,019.48	-8,318,681.65
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	174,832,019.48	-8,318,681.65
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	174,832,019.48	-8,318,681.65

7.3 净资产变动表

会计主体：富国裕利债券型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2024年01月01日至2024年12月31日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,928,960,429.75	157,737,816.97	4,086,698,246.72
二、本期期初净资产	3,928,960,429.75	157,737,816.97	4,086,698,246.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,550,656,047.45	393,289,836.64	1,943,945,884.09
（一）、综合收益总额	—	174,832,019.48	174,832,019.48
（二）、本期基金份额交易产生的净资	1,550,656,047.45	218,457,817.16	1,769,113,864.61

产变动数（净资产减少以“-”号填列）	47.45	.16	64.61
其中：1. 基金申购款	6,310,873,264.03	469,781,725.26	6,780,654,989.29
2. 基金赎回款	-4,760,217,216.58	-251,323,908.10	-5,011,541,124.68
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—
四、本期期末净资产	5,479,616,477.20	551,027,653.61	6,030,644,130.81
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	1,095,589,206.24	13,965,900.20	1,109,555,106.44
二、本期期初净资产	1,095,589,206.24	13,965,900.20	1,109,555,106.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,833,371,223.51	143,771,916.77	2,977,143,140.28
（一）、综合收益总额	—	—8,318,681.65	—8,318,681.65
（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）	2,833,371,223.51	152,090,598.42	2,985,461,821.93
其中：1.基金申购款	6,229,395,967.94	276,798,793.59	6,506,194,761.53
2.基金赎回款	-3,396,024,744.43	-124,708,195.17	-3,520,732,939.60
（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	3,928,960,429.75	157,737,816.97	4,086,698,246.72

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

富国裕利债券型证券投资基金(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[2021]3968号《关于准予富国裕利债券型证券投资基金注册的批复》注册,由基金管理人富国基金管理有限公司自2022年1月26日至2022年2月18日止期间向社会公开发行募集,募集期结束经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具德师报(验)字(22)第00084号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2022年2月23日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币1,830,660,488.14元,募集资金在募集期间产生的利息为人民币483,714.35元,以上实收基金(本息)合计为人民币1,831,144,202.49元,折合1,831,144,202.49份基金份额,其中A类基金份额1,689,678,938.31份,C类基金份额141,465,264.18份。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。根据本基金管理人于2023年4月1日发布的《富国基金管理有限责任公司关于富国裕利债券型证券投资基金增加E类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》,从2023年4月3日起,本基金增设E类份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券)、政府支持债券、政府支持机构债券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、现金等货币市场工具、信用衍生品、国债期货、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(不包括QDII基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资公募基金的非基金中基金、货币市场基金)等,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，本基金对股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；本基金持有其他基金，其市值不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者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。其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：1、基金合同约定股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金；2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票及存托凭证资产占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率 $\times$ 85%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算） $\times$ 5%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 10%。

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) 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、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配；若基金合同生效不满 3 个月，本基金可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者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；

3、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任一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；

4、本基金同一类别内每一基金份额享有同等分配权，由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类和 E 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

5、法律法规或监管机关另有规定的，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	53,406,587.56	12,081,247.37
等于：本金	53,379,409.90	12,073,330.18
加：应计利息	27,177.66	7,917.19
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	53,406,587.56	12,081,247.37

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		504,878,341.89	—	487,312,225.72	— 17,566,116.17
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	2,038,605,053.93	16,166,027.80	2,094,368,694.91	39,597,613.18
	银行间市场	2,864,501,753.86	37,494,653.97	2,929,734,953.97	27,738,546.14
	合计	4,903,106,807.79	53,660,681.77	5,024,103,648.88	67,336,159.32
资产支持证券		29,838,000.00	352,795.94	30,342,795.94	152,000.00
基金		141,161,939.61	—	140,584,731.98	-577,207.63
其他		—	—	—	—
合计		5,578,985,089.29	54,013,477.71	5,682,343,402.52	49,344,835.52
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		324,704,255.37	—	284,264,350.30	— 40,439,905.07
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	2,559,126,339.80	25,025,732.84	2,575,810,213.76	— 8,341,858.88
	银行间市场	1,836,779,182.64	23,441,083.94	1,871,800,583.94	11,580,317.36
	合计	4,395,905,522.44	48,466,816.78	4,447,610,797.70	3,238,458.48
资产支持证券		29,942,000.00	353,653.13	30,443,653.13	148,000.00
基金		414,939,080.65	—	373,007,509.31	— 41,931,571.34
其他		—	—	—	—
合计		5,165,490,858.46	48,820,469.91	5,135,326,310.44	— 78,985,017.93

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

单位：人民币元

项目	本期末（2024 年 12 月 31 日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	241,530,793.24	—
银行间市场	60,004,842.13	—
合计	301,535,635.37	—
项目	上年度末（2023 年 12 月 31 日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	—	—
银行间市场	100,014,857.03	—
合计	100,014,857.03	—

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	15,450.81	66,000.24
待摊费用	—	—
合计	15,450.81	66,000.24

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	20,595.49	1,403.82
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	189,132.77	160,023.71
其中：交易所市场	177,652.73	144,464.50

银行间市场	11,480.04	15,559.21
应付利息	—	—
预提信息披露费	—	120,000.00
预提审计费	58,000.00	53,000.00
合计	267,728.26	334,427.53

7.4.7.7 实收基金

富国裕利债券 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	2,489,597,988.99	2,489,597,988.99
本期申购	2,570,919,166.11	2,570,919,166.11
本期赎回（以“-”号填列）	-2,227,346,021.91	-2,227,346,021.91
本期末	2,833,171,133.19	2,833,171,133.19

富国裕利债券 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	195,466,054.57	195,466,054.57
本期申购	606,268,313.08	606,268,313.08
本期赎回（以“-”号填列）	-270,024,129.78	-270,024,129.78
本期末	531,710,237.87	531,710,237.87

富国裕利债券 E:

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	1,243,896,386.19	1,243,896,386.19
本期申购	3,133,685,784.84	3,133,685,784.84
本期赎回（以“-”号填列）	-2,262,847,064.89	-2,262,847,064.89
本期末	2,114,735,106.14	2,114,735,106.14

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

富国裕利债券 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	127,734,326.93	-26,674,437.11	101,059,889.82
本期期初	127,734,326.93	-26,674,437.11	101,059,889.82
本期利润	22,228,595.04	78,451,490.68	100,680,085.72
本期基金份额交易产生的变动数	30,639,899.66	56,243,571.51	86,883,471.17
其中：基金申购款	141,669,917.50	58,863,958.25	200,533,875.75

基金赎回款	- 111,030,017.84	-2,620,386.74	-113,650,404.58
本期已分配利润	—	—	—
本期末	180,602,821.63	108,020,625.08	288,623,446.71

富国裕利债券 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	8,522,164.94	-2,099,348.76	6,422,816.18
本期期初	8,522,164.94	-2,099,348.76	6,422,816.18
本期利润	-409,076.44	523,797.25	114,720.81
本期基金份额交易产生的变动数	19,411,657.05	21,936,271.51	41,347,928.56
其中：基金申购款	30,262,676.44	22,494,034.20	52,756,710.64
基金赎回款	- 10,851,019.39	-557,762.69	-11,408,782.08
本期已分配利润	—	—	—
本期末	27,524,745.55	20,360,720.00	47,885,465.55

富国裕利债券 E:

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	63,553,775.09	- 13,298,664.12	50,255,110.97
本期期初	63,553,775.09	- 13,298,664.12	50,255,110.97
本期利润	24,682,647.43	49,354,565.52	74,037,212.95
本期基金份额交易产生的变动数	45,889,958.95	44,336,458.48	90,226,417.43
其中：基金申购款	158,896,847.55	57,594,291.32	216,491,138.87
基金赎回款	- 113,006,888.60	- 13,257,832.84	-126,264,721.44
本期已分配利润	—	—	—
本期末	134,126,381.47	80,392,359.88	214,518,741.35

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	422,827.85	191,363.84
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	497,120.45	331,480.75
其他	133,008.05	154,278.13
合计	1,052,956.35	677,122.72

7.4.7.10 股票投资收益

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）
卖出股票成交总额	966,382,321.82	667,193,780.25
减：卖出股票成本总额	984,312,050.14	670,815,867.94
减：交易费用	1,983,610.83	1,957,025.39
买卖股票差价收入	-19,913,339.15	-5,579,113.08

7.4.7.11 基金投资收益

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）
卖出/赎回基金成交总额	464,616,801.40	186,668,053.00
减：卖出/赎回基金成本总额	502,227,957.83	185,572,237.86
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	—	247,621.46
减：交易费用	98,260.04	113,742.60
基金投资收益	-37,709,416.47	734,451.08

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 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	96,112,364.54	77,023,128.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	28,376,274.51	9,263,826.78
合计	124,488,639.05	86,286,955.28

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（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	4,869,920,545.18	3,093,822,821.71

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,793,667,552.85	3,055,839,713.75
减：应计利息总额	47,729,075.48	28,602,506.56
减：交易费用	147,642.34	116,774.62
买卖债券差价收入	28,376,274.51	9,263,826.78

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证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）
资产支持证券投资收益——利息收入	989,639.08	989,532.35
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	—	—
合计	989,639.08	989,532.35

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

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）
卖出资产支持证券成交总额	104,000.00	58,000.00
减：卖出资产支持证券成本总额	104,000.00	58,000.00
减：应计利息总额	—	—
减：交易费用	—	—
资产支持证券投资收益	—	—

7.4.7.14 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。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 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。

7.4.7.15.2 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。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）
股票投资产生的股利收益	9,704,125.01	4,353,761.36
其中：证券出借权益补偿收入	—	—
基金投资产生的股利收益	4,360,984.44	268,879.80
合计	14,065,109.45	4,622,641.16

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）
1. 交易性金融资产	128,329,853.45	-62,560,136.12
股票投资	22,873,788.90	-30,938,951.41
债券投资	64,097,700.84	9,720,786.63
资产支持证券投资	4,000.00	212,000.00
基金投资	41,354,363.71	-41,553,971.34
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	128,329,853.45	-62,560,136.12

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）
基金赎回费收入	635,603.05	441,114.30
基金转换费收入	132,491.17	40,317.74
销售服务费返还	75,992.62	66,000.24
合计	844,086.84	547,432.28

7.4.7.19 持有基金产生的费用

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）
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	74,793.43	67,403.68
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,267,854.77	1,203,687.91
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	254,542.14	231,224.77

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出，不构成本基金的费用项目。

7.4.7.20 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。

7.4.7.21 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	58,000.00	53,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
银行费用	57,489.39	58,142.79
债券账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	7,938.96	6,043.19
合计	279,428.35	273,185.98

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、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
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

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

关联方名称	金额单位：人民币元			
	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	242,506,678.38	11.90	308,908,859.29	20.47
申万宏源	58,678,676.43	2.88	63,204,430.72	4.19

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

关联方名称	金额单位：人民币元			
	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	108,660,288.75	2.82	271,285,355.33	5.58
申万宏源	147,728,032.87	3.84	89,389,842.52	1.84

7.4.10.1.4 债券回购交易

关联方名称	金额单位：人民币元			
	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	占当期回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
海通证券	747,361,000.00	2.46	5,022,340,000.00	12.89
申万宏源	133,215,000.00	0.44	1,282,062,000.00	3.29

7.4.10.1.5 基金交易

关联方名称	金额单位：人民币元			
	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	占当期基金成交总额的比例（%）	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）
海通证券	24,071,000.00	5.51	72,174,429.40	12.22
申万宏源	—	—	709,786.20	0.12

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

关联方名称	金额单位：人民币元			
	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	117,366.84	9.90	9,569.08	5.39
申万宏源	36,418.21	3.07	8,319.15	4.68
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	153,097.38	14.97	26,394.35	18.27
申万宏源	45,811.80	4.48	10,529.24	7.29

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	27,382,161.54	21,279,286.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,648,492.56	3,133,907.36
应支付基金管理人的净管理费	24,733,668.98	18,145,378.93

注：本基金对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分不收取管理费。

本基金的管理费按前一日除基金管理人管理的基金外的基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.70\%\div \text{当年天数}$$

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减去持有基金管理人管理基金的基金资产净值
 基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，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	4,784,818.69	3,691,501.33

注：本基金对基金财产中持有的本基金托管人自身托管的基金部分不收取托管费。

本基金的托管费按前一日除基金托管人托管的基金外的基金资产净值的0.12%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.12\%\div \text{当年天数}$$

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减去持有基金托管人托管基金的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，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联方名称	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	富国裕利债券 A	富国裕利债券 C	富国裕利债券 E	合计
富国基金管理有限公司	—	3,126.61	109,610.54	112,737.15
海通证券股份有限公司	—	54.88	—	54.88
中国银行股份有限公司	—	248,070.69	—	248,070.69
合计	—	251,252.18	109,610.54	360,862.72

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			
	富国裕利债券 A	富国裕利债券 C	富国裕利债券 E	合计
富国基金管理有限公司	—	699,527.25	65,966.39	765,493.64
海通证券股份有限公司	—	348.52	—	348.52
中国银行股份有限公司	—	275,711.03	—	275,711.03
合计	—	975,586.80	65,966.39	1,041,553.19

注：自 2023 年 4 月 3 日起，本基金增加收取销售服务费的 E 类份额。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按前一日C类基金份额资产净值的0.40%年费率计提。E类基金份额的销售服务费按前一日E类基金份额资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E为该类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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）		
	富国裕利债券A	富国裕利债券C	富国裕利债券E	富国裕利债券A	富国裕利债券C	富国裕利债券E
基金合同生效日（2022年02月23日）持有的基金份额	—	—	—	—	—	—

期初持有的基金份额	—	—	959.14	—	—	—
期间申购/买入总份额	—	—	—	—	—	959.14
期间因拆分变动份额	—	—	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—	959.14	—	—	—
期末持有的基金份额	—	—	—	—	—	959.14
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	—	—	—	—	0.00%

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

富国裕利债券 E：

份额单位：份

关联方名称	本期末（2024 年 12 月 31 日）		上年度末（2023 年 12 月 31 日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
富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）	3,982,347.99	0.19	—	—

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	53,406,587.56	422,827.85	12,081,247.37	191,363.84

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均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

本期末，本基金持有基金管理人及其关联方管理的基金合计 115,754,381.28 元，占本基金资产净值的比例为 1.92%。上期末，本基金持有基金管理人及其关联方管理的基金合计 130,275,832.75 元，占本基金资产净值的比例为 3.19%。

7.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

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）
当期交易基金产生的申购费（元）	—	—
当期交易基金产生的赎回费（元）	80,783.77	90,127.67
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	74,793.43	67,403.68
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	884,925.09	611,231.50
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	173,859.14	111,088.75
当期交易基金产生的交易费	2,668.39	2,769.30

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用。其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

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：债券

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110098	南药转债	2024-12-25	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.00	90	9,000.00	9,000.28	—

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	10,400.00	77,872.00	72,384.00	—

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，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 41,229,395.28 元，于 2025 年 1 月 2 日、2025 年 5 月 6 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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	3,062,713,156.91	2,838,712,900.29
AAA 以下	1,045,870,509.58	932,566,627.42
未评级	184,834,641.65	387,435,156.99
合计	4,293,418,308.14	4,158,714,684.70

注：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

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	30,342,795.94	30,443,653.13
AAA 以下	—	—
未评级	—	—
合计	30,342,795.94	30,443,653.13

注：此表中资产支持证券的债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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	53,406,587.56	—	—	—	—	—	53,406,587.56
结算备付金	19,498,642.23	—	—	—	—	—	19,498,642.23
存出保证金	198,407.89	—	—	—	—	—	198,407.89
交易性金融资产	39,530,331.40	703,220,556.49	2,126,101,425.63	1,859,999,785.88	325,594,345.42	627,896,957.70	5,682,343,402.52
买入返售金融资产	301,535,635.37	—	—	—	—	—	301,535,635.37
应收清算款	—	—	—	—	—	32,209,468.07	32,209,468.07
其他资产	—	—	—	—	—	15,450.81	15,450.81
应收申购款	—	—	—	—	—	8,950,349.27	8,950,349.27
资产总计	414,169,604.45	703,220,556.49	2,126,101,425.63	1,859,999,785.88	325,594,345.42	669,072,225.85	6,098,157,943.72
负债							
卖出回购金融资产款	40,000,000.00	—	1,229,395.28	—	—	—	41,229,395.28
应付清算款	—	—	—	—	—	2,707,098.86	2,707,098.86
应付赎回款	—	—	—	—	—	19,650,556.27	19,650,556.27
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,951,895.04	2,951,895.04
应付托管费	—	—	—	—	—	511,541.29	511,541.29
应付销售服务费	—	—	—	—	—	131,304.85	131,304.85
应交税费	—	—	—	—	—	64,293.06	64,293.06
其他负债	—	—	—	—	—	267,728.26	267,728.26
负债总计	40,000,000.00	—	1,229,395.28	—	—	26,284,417.63	67,513,812.91
利率敏感度缺口	374,169,604.45	703,220,556.49	2,124,872,030.35	1,859,999,785.88	325,594,345.42	642,787,808.22	6,030,644,130.81

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	12,081,247.37	—	—	—	—	—	12,081,247.37
结算备付金	49,219,207.21	—	—	—	—	—	49,219,207.21
存出保证金	242,515.67	—	—	—	—	—	242,515.67
交易性金融资产	11,085,843.56	294,416,946.77	1,201,607,502.69	2,970,944,157.81	—	657,271,859.61	5,135,326,310.44
买入返售金融资产	100,014,857.03	—	—	—	—	—	100,014,857.03
应收清算款	—	—	—	—	—	108,049,922.15	108,049,922.15
其他资产	—	—	—	—	—	66,000.24	66,000.24
应收申购款	—	—	—	—	—	141,001.63	141,001.63
资产总计	172,643,670.84	294,416,946.77	1,201,607,502.69	2,970,944,157.81	—	765,528,783.63	5,405,141,061.74
负债							
卖出回购金融资产款	946,984,025.53	20,864,942.91	2,200,884.46	—	—	—	970,049,852.90
应付清算款	—	—	—	—	—	47,915,856.20	47,915,856.20
应付赎回款	—	—	—	—	—	296,633,577.57	296,633,577.57
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,795,069.73	2,795,069.73
应付托管费	—	—	—	—	—	487,648.11	487,648.11
应付销售服务费	—	—	—	—	—	139,025.12	139,025.12
应交税费	—	—	—	—	—	87,357.86	87,357.86
其他负债	—	—	—	—	—	334,427.53	334,427.53
负债总计	946,984,025.53	20,864,942.91	2,200,884.46	—	—	348,392,962.12	1,318,442,815.02
利率敏感度缺口	-774,340,354.69	273,552,003.86	1,199,406,618.23	2,970,944,157.81	—	417,135,821.51	4,086,698,246.72

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。

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%	-8,295,997.92	-8,250,465.30
	2. 基准点利率减少 0.1%	8,295,997.92	8,250,465.30

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	—	90,693,444.00	—	—	90,693,444.00
资产合计	—	90,693,444.00	—	—	90,693,444.00
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	—	90,693,444.00	—	—	90,693,444.00
项目	上年度末（2023 年 12 月 31 日）				
	美元	港币	欧元	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产					
交易性金融资产	—	94,412,144.00	—	—	94,412,144.00
资产合计	—	94,412,144.00	—	—	94,412,144.00
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	—	94,412,144.00	—	—	94,412,144.00

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%	-906,934.44	-944,121.44
	港币相对人民币升值 1%	906,934.44	944,121.44

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基金、股票和债券，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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债、

企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、政府支持债券、政府支持机构债券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、现金等货币市场工具、信用衍生品、国债期货、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（不包括 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资公募基金的非基金中基金、货币市场基金）等，以及法律法规或中国证监会允许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：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，本基金对股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；本基金持有其他基金，其市值不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者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。其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一： 1、基金合同约定股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金； 2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票及存托凭证资产占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金。 如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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	487,312,225.72	8.08	284,264,350.30	6.96
交易性金融资产—基金投资	140,584,731.98	2.33	373,007,509.31	9.13
交易性金融资产—债券投资	5,024,103,648.88	83.31	4,447,610,797.70	108.83
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—

衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	30,342,795.94	0.50	30,443,653.13	0.74
合计	5,682,343,402.52	94.22	5,135,326,310.44	125.66

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%	77,858,834.41	45,652,336.82
	2. 业绩比较基准减少 1%	-77,858,834.41	-45,652,336.82

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	上年度末
---------------	-----	------

	(2024 年 12 月 31 日)	(2023 年 12 月 31 日)
第一层次	1,628,533,560.04	1,458,907,250.48
第二层次	4,053,809,842.48	3,676,419,059.96
第三层次	—	—
合计	5,682,343,402.52	5,135,326,310.44

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。

7.4.14.3 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	487,312,225.72	7.99
	其中：股票	487,312,225.72	7.99
2	基金投资	140,584,731.98	2.31
3	固定收益投资	5,054,446,444.82	82.88
	其中：债券	5,024,103,648.88	82.39
	资产支持证券	30,342,795.94	0.50
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	301,535,635.37	4.94
	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	72,905,229.79	1.20
8	其他各项资产	41,373,676.04	0.68
9	合计	6,098,157,943.72	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 90,693,444.00 元，占资产净值比例为 1.50%。

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

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	329,454.00	0.01
B	采矿业	29,417,929.80	0.49
C	制造业	262,633,564.52	4.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,203,272.00	0.37
E	建筑业	2,451,262.00	0.04
F	批发和零售业	1,469,419.85	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	31,611,167.70	0.52
H	住宿和餐饮业	137,091.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,500,145.21	0.19
J	金融业	21,256,376.12	0.35
K	房地产业	4,150,177.00	0.07
L	租赁和商务服务业	3,847,370.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	4,228,188.10	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	330,254.42	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	282,333.00	0.00

R	文化、体育和娱乐业	665,780.00	0.01
S	综合	104,997.00	0.00
	合计	396,618,781.72	6.58

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（%）
非日常生活消费品	22,793,340.00	0.38
通信服务	15,446,400.00	0.26
医疗保健	14,106,377.00	0.23
原材料	11,466,125.00	0.19
能源	8,043,060.00	0.13
公用事业	6,992,000.00	0.12
工业	5,881,330.00	0.10
日常消费品	4,676,000.00	0.08
金融	1,288,812.00	0.02
合计	90,693,444.00	1.50

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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601233	桐昆股份	2,854,900	33,687,820.00	0.56
2	601006	大秦铁路	3,161,965	21,438,122.70	0.36
3	000589	贵州轮胎	3,108,458	15,635,543.74	0.26
4	00700	腾讯控股	40,000	15,446,400.00	0.26
5	600761	安徽合力	800,000	14,120,000.00	0.23
6	600426	华鲁恒升	502,400	10,856,864.00	0.18
7	002475	立讯精密	243,234	9,914,217.84	0.16
8	000400	许继电气	351,400	9,674,042.00	0.16
9	001286	陕西能源	1,007,700	9,351,456.00	0.16
10	603393	新天然气	300,300	9,090,081.00	0.15
11	01378	中国宏桥	812,500	8,848,125.00	0.15
12	002532	天山铝业	1,120,400	8,817,548.00	0.15
13	000923	河钢资源	601,200	8,356,680.00	0.14
14	09988	阿里巴巴—W	100,000	7,631,000.00	0.13
15	600079	人福医药	323,700	7,568,106.00	0.13
16	002011	盾安环境	700,000	7,567,000.00	0.13
17	600985	淮北矿业	526,300	7,405,041.00	0.12
18	600309	万华化学	101,100	7,213,485.00	0.12

19	600933	爱柯迪	440,000	7,172,000.00	0.12
20	00836	华润电力	400,000	6,992,000.00	0.12
21	000792	盐湖股份	403,500	6,641,610.00	0.11
22	02883	中海油田服务	1,000,000	6,520,000.00	0.11
22	601808	中海油服	3,100	47,275.00	0.00
23	603283	赛腾股份	90,000	6,224,400.00	0.10
24	603678	火炬电子	200,000	6,100,000.00	0.10
25	688097	博众精工	231,100	6,066,375.00	0.10
26	600004	白云机场	628,700	6,035,520.00	0.10
27	601636	旗滨集团	1,059,400	5,943,234.00	0.10
28	00175	吉利汽车	417,000	5,721,240.00	0.09
29	002322	理工能科	440,000	5,539,600.00	0.09
30	03759	康龙化成	408,450	5,334,357.00	0.09
30	300759	康龙化成	1,300	33,410.00	0.00
31	600587	新华医疗	301,000	5,011,650.00	0.08
32	600388	龙净环保	370,064	4,681,309.60	0.08
33	00291	华润啤酒	200,000	4,676,000.00	0.08
34	002601	龙佰集团	233,300	4,122,411.00	0.07
35	002947	恒铭达	123,500	4,116,255.00	0.07
36	603259	药明康德	71,800	3,951,872.00	0.07
37	000902	新洋丰	302,800	3,948,512.00	0.07
38	000612	焦作万方	600,000	3,852,000.00	0.06
39	01093	石药集团	856,000	3,792,080.00	0.06
40	003019	宸展光电	140,325	3,589,513.50	0.06
41	00598	中国外运	1,000,000	3,400,000.00	0.06
41	601598	中国外运	25,000	133,750.00	0.00
42	601939	建设银行	401,040	3,525,141.60	0.06
43	601717	郑煤机	264,400	3,431,912.00	0.06
44	02282	美高梅中国	362,000	3,330,400.00	0.06
45	688789	宏华数科	50,000	3,319,000.00	0.06
46	002271	东方雨虹	250,000	3,245,000.00	0.05
47	603277	银都股份	139,079	3,222,460.43	0.05
48	000513	丽珠集团	81,100	3,081,800.00	0.05
49	000552	甘肃能化	1,110,046	3,052,626.50	0.05
50	600546	山煤国际	257,800	3,049,774.00	0.05
51	688301	奕瑞科技	31,458	3,006,441.06	0.05
52	000858	五粮液	21,100	2,954,844.00	0.05
53	600861	北京人力	152,000	2,941,200.00	0.05
54	001914	招商积余	271,600	2,870,812.00	0.05
55	02899	紫金矿业	200,000	2,618,000.00	0.04

55	601899	紫金矿业	16,500	249,480.00	0.00
56	600131	国网信通	151,200	2,859,192.00	0.05
57	600809	山西汾酒	15,400	2,836,834.00	0.05
58	000975	山金国际	180,600	2,775,822.00	0.05
59	01548	金斯瑞生物科技	300,000	2,733,000.00	0.05
60	002080	中材科技	205,800	2,691,864.00	0.04
61	002372	伟星新材	200,000	2,526,000.00	0.04
62	02128	中国联塑	773,000	2,481,330.00	0.04
63	601878	浙商证券	200,008	2,448,097.92	0.04
64	002793	罗欣药业	632,300	2,415,386.00	0.04
65	02096	先声药业	342,000	2,246,940.00	0.04
66	06862	海底捞	150,000	2,208,000.00	0.04
67	02020	安踏体育	30,000	2,162,700.00	0.04
68	002353	杰瑞股份	51,000	1,886,490.00	0.03
69	002129	TCL 中环	212,500	1,884,875.00	0.03
70	02015	理想汽车—W	20,000	1,740,000.00	0.03
71	00883	中国海洋石油	86,000	1,523,060.00	0.03
71	600938	中国海油	2,700	79,677.00	0.00
72	03958	东方证券	274,800	1,288,812.00	0.02
72	600958	东方证券	8,500	89,760.00	0.00
73	601318	中国平安	17,600	926,640.00	0.02
74	600519	贵州茅台	600	914,400.00	0.02
75	601919	中远海控	45,700	708,350.00	0.01
76	601288	农业银行	113,200	604,488.00	0.01
77	600919	江苏银行	59,300	582,326.00	0.01
78	601169	北京银行	94,000	578,100.00	0.01
79	601818	光大银行	146,400	566,568.00	0.01
80	300750	宁德时代	2,100	558,600.00	0.01
81	601229	上海银行	57,600	527,040.00	0.01
82	601666	平煤股份	50,000	501,000.00	0.01
83	601009	南京银行	45,400	483,510.00	0.01
84	600015	华夏银行	59,300	474,993.00	0.01
85	601668	中国建筑	75,400	452,400.00	0.01
86	002128	电投能源	22,400	438,592.00	0.01
87	600177	雅戈尔	48,100	428,090.00	0.01
88	600585	海螺水泥	17,900	425,662.00	0.01
89	600900	长江电力	14,300	422,565.00	0.01
90	600350	山东高速	38,700	397,836.00	0.01

91	600036	招商银行	10,100	396,930.00	0.01
92	600153	建发股份	37,000	389,240.00	0.01
93	601998	中信银行	55,100	384,598.00	0.01
94	601398	工商银行	55,000	380,600.00	0.01
95	601166	兴业银行	19,400	371,704.00	0.01
96	600016	民生银行	88,700	366,331.00	0.01
97	300059	东方财富	14,100	364,062.00	0.01
98	600064	南京高科	46,700	362,859.00	0.01
99	601211	国泰君安	18,800	350,620.00	0.01
100	601555	东吴证券	44,700	348,660.00	0.01
101	601997	贵阳银行	57,300	343,800.00	0.01
102	601688	华泰证券	19,400	341,246.00	0.01
103	601601	中国太保	9,900	337,392.00	0.01
104	600642	申能股份	35,300	334,997.00	0.01
105	688256	寒武纪	500	329,000.00	0.01
106	000651	格力电器	6,900	313,605.00	0.01
107	000725	京东方A	71,200	312,568.00	0.01
108	000983	山西焦煤	37,600	309,824.00	0.01
109	600008	首创环保	93,500	306,680.00	0.01
110	600282	南钢股份	65,300	306,257.00	0.01
111	600352	浙江龙盛	29,500	303,555.00	0.01
112	601328	交通银行	38,900	302,253.00	0.01
113	601077	渝农商行	49,700	300,685.00	0.00
114	002001	新 和 成	13,300	292,201.00	0.00
115	601088	中国神华	6,700	291,316.00	0.00
116	600295	鄂尔多斯	29,800	290,848.00	0.00
117	600741	华域汽车	16,400	288,804.00	0.00
118	600019	宝钢股份	40,800	285,600.00	0.00
119	600901	江苏金租	54,300	283,446.00	0.00
120	000830	鲁西化工	24,000	280,560.00	0.00
121	600000	浦发银行	26,700	274,743.00	0.00
122	000598	兴蓉环境	35,000	265,650.00	0.00
123	601000	唐山港	56,300	265,173.00	0.00
124	000333	美的集团	3,500	263,270.00	0.00
125	601877	正泰电器	11,200	262,192.00	0.00
126	600887	伊利股份	8,500	256,530.00	0.00
127	002966	苏州银行	31,600	256,276.00	0.00
128	601857	中国石油	28,300	253,002.00	0.00
129	600820	隧道股份	35,100	252,369.00	0.00
130	601225	陕西煤业	10,400	241,904.00	0.00
131	600030	中信证券	8,200	239,194.00	0.00

132	601898	中煤能源	19,600	238,728.00	0.00
133	000783	长江证券	35,000	238,700.00	0.00
134	601825	沪农商行	27,500	234,025.00	0.00
135	601816	京沪高铁	37,600	231,616.00	0.00
136	601319	中国人保	30,200	230,124.00	0.00
137	601107	四川成渝	43,700	228,551.00	0.00
138	600968	海油发展	52,600	224,602.00	0.00
139	601658	邮储银行	39,000	221,520.00	0.00
140	600583	海油工程	40,400	220,988.00	0.00
141	601168	西部矿业	13,700	220,159.00	0.00
142	000883	湖北能源	43,900	218,622.00	0.00
143	000157	中联重科	30,200	218,346.00	0.00
144	688981	中芯国际	2,300	217,626.00	0.00
145	601179	中国西电	28,500	216,315.00	0.00
146	000776	广发证券	13,300	215,593.00	0.00
147	000623	吉林敖东	12,300	212,421.00	0.00
148	600219	南山铝业	53,700	209,967.00	0.00
149	000672	上峰水泥	27,000	206,550.00	0.00
150	002831	裕同科技	7,600	205,960.00	0.00
151	601628	中国人寿	4,900	205,408.00	0.00
152	600096	云天化	9,100	202,930.00	0.00
153	601108	财通证券	24,800	202,616.00	0.00
154	688041	海光信息	1,337	200,269.23	0.00
155	300433	蓝思科技	9,100	199,290.00	0.00
156	600018	上港集团	32,500	198,900.00	0.00
157	600377	宁沪高速	12,900	197,499.00	0.00
158	002546	新联电子	44,500	192,685.00	0.00
159	600028	中国石化	28,400	189,712.00	0.00
160	002273	水晶光电	8,500	188,870.00	0.00
161	601111	中国国航	23,400	185,094.00	0.00
162	300502	新易盛	1,600	184,928.00	0.00
163	000090	天健集团	44,800	184,128.00	0.00
164	601766	中国中车	21,600	181,008.00	0.00
165	600418	江淮汽车	4,800	180,000.00	0.00
166	601336	新华保险	3,600	178,920.00	0.00
167	002517	恺英网络	13,100	178,291.00	0.00
168	600029	南方航空	27,300	177,177.00	0.00
169	600196	复星医药	7,100	176,435.00	0.00
170	301236	软通动力	3,000	176,130.00	0.00
171	601618	中国中冶	53,300	175,890.00	0.00
172	600998	九州通	34,300	175,616.00	0.00

173	002233	塔牌集团	22,600	173,342.00	0.00
174	601669	中国电建	31,700	173,082.00	0.00
175	600170	上海建工	64,600	171,190.00	0.00
176	600398	海澜之家	22,700	170,250.00	0.00
177	688111	金山办公	594	170,115.66	0.00
178	002594	比亚迪	600	169,596.00	0.00
179	600879	航天电子	18,900	169,344.00	0.00
180	002550	千红制药	27,100	168,020.00	0.00
181	600755	厦门国贸	25,200	167,328.00	0.00
182	600012	皖通高速	9,400	165,910.00	0.00
183	600141	兴发集团	7,600	164,920.00	0.00
184	600663	陆家嘴	16,700	164,328.00	0.00
185	600109	国金证券	18,800	164,124.00	0.00
186	600582	天地科技	26,400	163,152.00	0.00
187	601198	东兴证券	14,800	162,948.00	0.00
188	600438	通威股份	7,300	161,403.00	0.00
189	600875	东方电气	10,100	160,489.00	0.00
190	601699	潞安环能	11,100	159,396.00	0.00
191	002384	东山精密	5,400	157,680.00	0.00
192	601298	青岛港	17,200	156,692.00	0.00
193	600299	安迪苏	12,300	154,365.00	0.00
194	688169	石头科技	700	153,503.00	0.00
195	600155	华创云信	20,300	150,220.00	0.00
196	300601	康泰生物	8,700	149,205.00	0.00
197	601012	隆基绿能	9,400	147,674.00	0.00
198	300866	安克创新	1,500	146,460.00	0.00
199	603158	腾龙股份	17,900	144,632.00	0.00
200	600517	国网英大	26,200	144,362.00	0.00
201	000932	华菱钢铁	34,300	143,374.00	0.00
202	002648	卫星化学	7,600	142,804.00	0.00
203	601390	中国中铁	22,200	141,858.00	0.00
204	002044	美年健康	30,800	141,372.00	0.00
205	002736	国信证券	12,600	141,120.00	0.00
206	600999	招商证券	7,300	139,868.00	0.00
207	600369	西南证券	29,900	139,633.00	0.00
208	601901	方正证券	16,600	138,278.00	0.00
209	601728	中国电信	19,100	137,902.00	0.00
210	600276	恒瑞医药	3,000	137,700.00	0.00
211	300002	神州泰岳	11,800	136,762.00	0.00
212	002867	周大生	9,400	136,582.00	0.00
213	000895	双汇发展	5,200	134,992.00	0.00

214	600023	浙能电力	23,800	134,708.00	0.00
215	603799	华友钴业	4,600	134,596.00	0.00
216	601128	常熟银行	17,680	133,837.60	0.00
217	600827	百联股份	12,200	133,346.00	0.00
218	603568	伟明环保	6,160	133,240.80	0.00
219	601928	凤凰传媒	11,500	132,710.00	0.00
220	000729	燕京啤酒	10,900	131,236.00	0.00
221	300474	景嘉微	1,400	130,886.00	0.00
222	600208	衢州发展	44,200	130,832.00	0.00
223	601098	中南传媒	8,700	130,587.00	0.00
224	002416	爱施德	8,000	130,160.00	0.00
225	600905	三峡能源	29,400	128,478.00	0.00
226	300308	中际旭创	1,020	125,980.20	0.00
227	600516	方大炭素	26,000	125,580.00	0.00
228	600971	恒源煤电	13,300	125,153.00	0.00
229	600020	中原高速	29,600	124,912.00	0.00
230	601216	君正集团	23,700	124,662.00	0.00
231	002156	通富微电	4,200	124,110.00	0.00
232	002938	鹏鼎控股	3,400	124,032.00	0.00
233	601577	长沙银行	13,900	123,571.00	0.00
234	603979	金诚信	3,400	123,420.00	0.00
235	603019	中科曙光	1,700	122,944.00	0.00
236	601916	浙商银行	42,100	122,511.00	0.00
237	600273	嘉化能源	15,300	121,941.00	0.00
238	600380	健康元	10,800	121,716.00	0.00
239	601311	骆驼股份	14,600	121,034.00	0.00
240	000728	国元证券	14,400	120,384.00	0.00
241	002939	长城证券	14,600	119,720.00	0.00
242	600057	厦门象屿	18,400	119,416.00	0.00
243	600050	中国联通	22,300	118,413.00	0.00
244	000876	新希望	13,100	117,638.00	0.00
245	002078	太阳纸业	7,900	117,473.00	0.00
246	002371	北方华创	300	117,300.00	0.00
247	601377	兴业证券	18,700	117,062.00	0.00
248	688188	柏楚电子	600	116,550.00	0.00
249	600995	南网储能	11,500	116,380.00	0.00
250	601138	工业富联	5,400	116,100.00	0.00
251	601611	中国核建	12,800	115,712.00	0.00
252	601966	玲珑轮胎	6,400	115,456.00	0.00
253	001289	龙源电力	7,300	114,683.00	0.00
254	600143	金发科技	13,200	114,048.00	0.00

255	002368	太极股份	4,800	113,664.00	0.00
256	000960	锡业股份	8,100	113,643.00	0.00
257	002508	老板电器	5,300	113,579.00	0.00
258	600362	江西铜业	5,500	113,520.00	0.00
259	601019	山东出版	10,000	113,500.00	0.00
260	002064	华峰化学	13,800	112,884.00	0.00
261	002318	久立特材	4,800	112,368.00	0.00
262	600536	中国软件	2,400	112,056.00	0.00
263	000425	徐工机械	14,100	111,813.00	0.00
264	600373	中文传媒	8,900	111,695.00	0.00
265	600699	均胜电子	7,100	111,257.00	0.00
266	000001	平安银行	9,500	111,150.00	0.00
267	002385	大北农	25,300	109,549.00	0.00
268	600021	上海电力	11,900	109,123.00	0.00
269	600637	东方明珠	14,000	108,640.00	0.00
270	000591	太阳能	22,700	108,052.00	0.00
271	600497	驰宏锌锗	19,300	107,501.00	0.00
272	002487	大金重工	5,200	106,548.00	0.00
273	600256	广汇能源	15,800	106,334.00	0.00
274	601838	成都银行	6,200	106,082.00	0.00
275	002432	九安医疗	2,600	106,028.00	0.00
276	603087	甘李药业	2,400	105,840.00	0.00
277	600729	重庆百货	3,600	105,300.00	0.00
278	000034	神州数码	3,000	105,150.00	0.00
279	600673	东阳光	9,300	104,997.00	0.00
280	601155	新城控股	8,700	104,052.00	0.00
281	002563	森马服饰	14,800	103,896.00	0.00
282	000683	远兴能源	18,500	103,415.00	0.00
283	601918	新集能源	14,400	103,392.00	0.00
284	300015	爱尔眼科	7,800	103,350.00	0.00
285	000429	粤高速A	7,000	102,900.00	0.00
286	601607	上海医药	4,900	102,900.00	0.00
287	603179	新泉股份	2,400	102,480.00	0.00
288	600528	中铁工业	12,700	102,362.00	0.00
289	002984	森麒麟	4,100	101,106.00	0.00
290	300274	阳光电源	1,360	100,408.80	0.00
291	000539	粤电力A	22,100	100,113.00	0.00
292	002414	高德红外	13,400	99,562.00	0.00
293	688235	百济神州	618	99,510.36	0.00
294	603893	瑞芯微	900	99,054.00	0.00
295	600848	上海临港	9,680	97,768.00	0.00

296	000060	中金岭南	20,600	96,614.00	0.00
297	000958	电投产融	15,500	96,565.00	0.00
298	603816	顾家家居	3,500	96,530.00	0.00
299	601609	金田股份	16,300	96,170.00	0.00
300	000066	中国长城	6,500	94,705.00	0.00
301	002028	思源电气	1,300	94,510.00	0.00
302	601800	中国交建	9,000	94,050.00	0.00
303	002340	格林美	14,400	94,032.00	0.00
304	300124	汇川技术	1,600	93,728.00	0.00
305	600325	华发股份	16,200	93,312.00	0.00
306	600970	中材国际	9,800	92,904.00	0.00
307	001872	招商港口	4,500	92,115.00	0.00
308	000544	中原环保	10,500	91,665.00	0.00
309	000967	盈峰环境	18,400	91,448.00	0.00
310	600674	川投能源	5,300	91,425.00	0.00
311	000582	北部湾港	11,600	91,408.00	0.00
312	601186	中国铁建	9,900	90,783.00	0.00
313	600392	盛和资源	8,800	90,464.00	0.00
314	002507	涪陵榨菜	6,400	90,432.00	0.00
315	000878	云南铜业	7,400	90,206.00	0.00
316	600688	上海石化	29,800	89,996.00	0.00
317	002299	圣农发展	6,200	89,776.00	0.00
318	600863	内蒙华电	20,700	89,631.00	0.00
319	002048	宁波华翔	7,100	89,602.00	0.00
320	600521	华海药业	5,000	89,350.00	0.00
321	300207	欣旺达	4,000	89,240.00	0.00
322	000063	中兴通讯	2,200	88,880.00	0.00
323	000100	TCL 科技	17,600	88,528.00	0.00
324	300677	英科医疗	3,500	88,480.00	0.00
325	600886	国投电力	5,300	88,086.00	0.00
326	603890	春秋电子	7,400	86,950.00	0.00
327	600378	昊华科技	3,000	86,730.00	0.00
328	000988	华工科技	2,000	86,600.00	0.00
329	000401	冀东水泥	16,500	86,295.00	0.00
330	601156	东航物流	5,100	86,037.00	0.00
331	600872	中炬高新	3,900	85,878.00	0.00
332	600123	兰花科创	10,000	85,600.00	0.00
333	600496	精工钢构	28,100	84,862.00	0.00
334	605117	德业股份	1,000	84,800.00	0.00
335	002352	顺丰控股	2,100	84,630.00	0.00
336	300014	亿纬锂能	1,800	84,132.00	0.00

337	600959	江苏有线	25,100	84,085.00	0.00
338	002206	海利得	19,600	84,084.00	0.00
339	603501	韦尔股份	800	83,528.00	0.00
340	002746	仙坛股份	13,100	83,054.00	0.00
341	600104	上汽集团	4,000	83,040.00	0.00
342	688213	思特威	1,060	82,383.20	0.00
343	002444	巨星科技	2,500	80,875.00	0.00
344	600258	首旅酒店	5,500	80,685.00	0.00
345	600312	平高电气	4,200	80,640.00	0.00
346	603596	伯特利	1,800	80,262.00	0.00
347	601127	赛力斯	600	80,034.00	0.00
348	601567	三星医疗	2,600	79,976.00	0.00
349	002429	兆驰股份	13,800	79,764.00	0.00
350	603558	健盛集团	7,300	78,548.00	0.00
351	603508	思维列控	3,300	78,474.00	0.00
352	600248	陕建股份	17,500	78,400.00	0.00
353	600570	恒生电子	2,800	78,372.00	0.00
354	603338	浙江鼎力	1,200	77,424.00	0.00
355	603299	苏盐井神	6,900	76,866.00	0.00
356	002236	大华股份	4,800	76,800.00	0.00
357	300760	迈瑞医疗	300	76,500.00	0.00
358	002019	亿帆医药	7,100	76,112.00	0.00
359	603167	渤海轮渡	8,500	75,140.00	0.00
360	000568	泸州老窖	600	75,120.00	0.00
361	688617	惠泰医疗	200	74,466.00	0.00
362	600874	创业环保	12,400	74,028.00	0.00
363	000537	中绿电	8,100	73,872.00	0.00
364	000997	新大陆	3,700	73,815.00	0.00
365	603606	东方电缆	1,400	73,570.00	0.00
366	603707	健友股份	5,500	72,985.00	0.00
367	002142	宁波银行	3,000	72,930.00	0.00
368	002266	浙富控股	23,300	72,696.00	0.00
369	002252	上海莱士	10,400	72,384.00	0.00
370	002061	浙江交科	17,400	70,992.00	0.00
371	600707	彩虹股份	8,500	69,870.00	0.00
372	000617	中油资本	10,100	69,589.00	0.00
373	000050	深天马A	7,700	69,531.00	0.00
374	000898	鞍钢股份	28,900	69,360.00	0.00
375	688772	珠海冠宇	4,300	69,144.00	0.00
376	600483	福能股份	6,900	68,793.00	0.00
377	600926	杭州银行	4,700	68,667.00	0.00

378	000404	长虹华意	9,200	68,080.00	0.00
379	600188	兖矿能源	4,790	67,874.30	0.00
380	688127	蓝特光学	2,500	67,750.00	0.00
381	000156	华数传媒	9,400	67,680.00	0.00
382	600061	国投资本	9,000	67,680.00	0.00
383	600031	三一重工	4,100	67,568.00	0.00
384	300803	指南针	700	67,165.00	0.00
385	688036	传音控股	700	66,500.00	0.00
386	601958	金钼股份	6,600	66,396.00	0.00
387	601158	重庆水务	13,500	66,150.00	0.00
388	600176	中国巨石	5,800	66,062.00	0.00
389	600764	中国海防	2,300	65,136.00	0.00
390	600511	国药股份	1,900	65,018.00	0.00
391	000951	中国重汽	3,800	64,524.00	0.00
392	000338	潍柴动力	4,700	64,390.00	0.00
393	600436	片仔癀	300	64,350.00	0.00
394	688777	中控技术	1,295	64,322.65	0.00
395	688072	拓荆科技	412	63,312.04	0.00
396	600694	大商股份	2,400	63,288.00	0.00
397	300724	捷佳伟创	1,000	63,210.00	0.00
398	600869	远东股份	13,300	63,175.00	0.00
399	002185	华天科技	5,400	62,694.00	0.00
400	600339	中油工程	17,300	61,934.00	0.00
401	601058	赛轮轮胎	4,300	61,619.00	0.00
402	002895	川恒股份	2,500	61,500.00	0.00
403	601117	中国化学	7,400	61,346.00	0.00
404	000048	京基智农	3,400	61,200.00	0.00
405	600566	济川药业	2,100	61,068.00	0.00
406	002003	伟星股份	4,300	60,931.00	0.00
407	000933	神火股份	3,600	60,840.00	0.00
408	600795	国电电力	13,200	60,456.00	0.00
409	601888	中国中免	900	60,309.00	0.00
410	688779	五矿新能	11,262	59,913.84	0.00
411	601965	中国汽研	3,400	59,908.00	0.00
412	002653	海思科	1,800	59,850.00	0.00
413	600612	老凤祥	1,100	59,697.00	0.00
414	603993	洛阳钼业	8,900	59,185.00	0.00
415	002533	金杯电工	6,000	59,040.00	0.00
416	300888	稳健医疗	1,400	58,912.00	0.00
417	002807	江阴银行	13,500	58,725.00	0.00
418	300999	金龙鱼	1,800	58,698.00	0.00

419	601456	国联民生	4,300	58,136.00	0.00
420	002557	洽洽食品	2,000	58,100.00	0.00
421	600801	华新水泥	4,800	58,080.00	0.00
422	002203	海亮股份	5,400	58,050.00	0.00
423	600066	宇通客车	2,200	58,036.00	0.00
424	002230	科大讯飞	1,200	57,984.00	0.00
425	600486	扬农化工	1,000	57,870.00	0.00
426	600967	内蒙一机	6,800	57,800.00	0.00
427	300498	温氏股份	3,500	57,785.00	0.00
428	001308	康冠科技	2,100	57,750.00	0.00
429	600150	中国船舶	1,600	57,536.00	0.00
430	000625	长安汽车	4,300	57,448.00	0.00
431	300114	中航电测	800	57,424.00	0.00
432	600782	新钢股份	17,000	56,780.00	0.00
433	603225	新凤鸣	5,100	56,763.00	0.00
434	600529	山东药玻	2,200	56,694.00	0.00
435	600600	青岛啤酒	700	56,644.00	0.00
436	000002	万科A	7,800	56,628.00	0.00
437	000630	铜陵有色	17,500	56,525.00	0.00
438	000423	东阿阿胶	900	56,448.00	0.00
439	600754	锦江酒店	2,100	56,406.00	0.00
440	603160	汇顶科技	700	56,378.00	0.00
441	600988	赤峰黄金	3,600	56,196.00	0.00
442	300682	朗新集团	4,600	56,120.00	0.00
443	603317	天味食品	4,200	56,028.00	0.00
444	600048	保利发展	6,300	55,818.00	0.00
445	600236	桂冠电力	8,200	55,760.00	0.00
446	000963	华东医药	1,600	55,360.00	0.00
447	601989	中国重工	11,500	55,315.00	0.00
448	600415	小商品城	4,100	54,981.00	0.00
449	300394	天孚通信	600	54,816.00	0.00
450	688716	中研股份	1,508	54,815.80	0.00
451	300577	开润股份	2,200	54,670.00	0.00
452	600027	华电国际	9,700	54,417.00	0.00
453	601600	中国铝业	7,400	54,390.00	0.00
454	601139	深圳燃气	7,700	54,362.00	0.00
455	002275	桂林三金	3,600	54,324.00	0.00
456	600885	宏发股份	1,700	54,094.00	0.00
457	600549	厦门钨业	2,800	53,956.00	0.00
458	300558	贝达药业	1,000	53,930.00	0.00
459	002020	京新药业	4,200	53,760.00	0.00

460	603379	三美股份	1,400	53,732.00	0.00
461	601101	昊华能源	6,500	53,495.00	0.00
462	601881	中国银河	3,500	53,305.00	0.00
463	002558	巨人网络	4,200	53,298.00	0.00
464	002572	索菲亚	3,100	53,258.00	0.00
465	600713	南京医药	10,700	53,072.00	0.00
466	600183	生益科技	2,200	52,910.00	0.00
467	600425	青松建化	13,400	52,528.00	0.00
468	688093	世华科技	2,600	52,494.00	0.00
469	601868	中国能建	22,900	52,441.00	0.00
470	002901	大博医疗	1,700	52,428.00	0.00
471	601827	三峰环境	6,100	52,338.00	0.00
472	002415	海康威视	1,700	52,190.00	0.00
473	002281	光迅科技	1,000	52,170.00	0.00
474	600873	梅花生物	5,200	52,156.00	0.00
475	000596	古井贡酒	300	51,990.00	0.00
476	605080	浙江自然	2,200	51,700.00	0.00
477	601238	广汽集团	5,500	51,370.00	0.00
478	600025	华能水电	5,400	51,354.00	0.00
479	002245	蔚蓝锂芯	4,800	51,312.00	0.00
480	600633	浙数文化	4,900	51,254.00	0.00
481	603995	甬金股份	2,800	51,212.00	0.00
482	000887	中鼎股份	3,900	51,168.00	0.00
483	002255	海陆重工	9,200	51,152.00	0.00
484	300383	光环新网	3,500	51,065.00	0.00
485	688425	铁建重工	11,604	51,057.60	0.00
486	688208	道通科技	1,300	50,908.00	0.00
487	003816	中国广核	12,300	50,799.00	0.00
488	601995	中金公司	1,500	50,535.00	0.00
489	002461	珠江啤酒	5,100	50,439.00	0.00
490	000998	隆平高科	4,500	50,265.00	0.00
491	002399	海普瑞	4,700	50,243.00	0.00
492	000636	风华高科	3,500	50,225.00	0.00
493	688778	厦钨新能	1,100	50,204.00	0.00
494	601236	红塔证券	5,900	50,091.00	0.00
495	002845	同兴达	3,300	50,028.00	0.00
496	601633	长城汽车	1,900	50,027.00	0.00
497	688385	复旦微电	1,300	49,907.00	0.00
498	603733	仙鹤股份	2,400	49,512.00	0.00
499	603786	科博达	800	49,440.00	0.00
500	603218	日月股份	4,100	49,405.00	0.00

501	000785	居然智家	13,700	48,909.00	0.00
502	600710	苏美达	5,245	48,778.50	0.00
503	300357	我武生物	2,400	48,768.00	0.00
504	603305	旭升集团	3,700	48,655.00	0.00
505	603301	振德医疗	2,200	48,378.00	0.00
506	605099	共创草坪	2,300	48,254.00	0.00
507	688248	南网科技	1,500	48,135.00	0.00
508	000825	太钢不锈	13,800	48,024.00	0.00
509	600803	新奥股份	2,200	47,696.00	0.00
510	001203	大中矿业	5,500	47,630.00	0.00
511	002970	锐明技术	1,000	47,630.00	0.00
512	603323	苏农银行	9,000	47,610.00	0.00
513	600526	菲达环保	10,600	47,594.00	0.00
514	689009	九号公司	1,000	47,500.00	0.00
515	000031	大悦城	15,600	47,424.00	0.00
516	000807	云铝股份	3,500	47,355.00	0.00
517	603056	德邦股份	3,300	47,289.00	0.00
518	600328	中盐化工	6,000	47,220.00	0.00
519	600489	中金黄金	3,900	46,917.00	0.00
520	002497	雅化集团	4,000	46,800.00	0.00
521	601137	博威合金	2,300	46,690.00	0.00
522	600487	亨通光电	2,700	46,494.00	0.00
523	002065	东华软件	6,400	46,464.00	0.00
524	002294	信立泰	1,500	46,395.00	0.00
525	600502	安徽建工	9,700	46,366.00	0.00
526	601066	中信建投	1,800	46,350.00	0.00
527	600038	中直股份	1,200	46,272.00	0.00
528	000685	中山公用	5,000	46,150.00	0.00
529	002768	国恩股份	2,000	46,140.00	0.00
530	000789	万年青	9,200	46,092.00	0.00
531	600060	海信视像	2,300	45,862.00	0.00
532	600690	海尔智家	1,600	45,552.00	0.00
533	600862	中航高科	1,800	45,468.00	0.00
534	002539	云图控股	5,800	45,356.00	0.00
535	600720	中交设计	5,100	45,186.00	0.00
536	002595	豪迈科技	900	45,171.00	0.00
537	002683	广东宏大	1,700	45,016.00	0.00
538	600908	无锡银行	7,600	44,916.00	0.00
539	300384	三联虹普	2,400	44,688.00	0.00
540	600271	航天信息	4,900	44,639.00	0.00
541	600216	浙江医药	2,800	44,408.00	0.00

542	688503	聚和材料	1,000	44,290.00	0.00
543	688588	凌志软件	3,200	44,160.00	0.00
544	002311	海大集团	900	44,145.00	0.00
545	002498	汉缆股份	13,000	44,070.00	0.00
546	001979	招商蛇口	4,300	44,032.00	0.00
547	600757	长江传媒	4,600	44,022.00	0.00
548	002484	江海股份	2,500	43,950.00	0.00
549	601528	瑞丰银行	7,800	43,914.00	0.00
550	002241	歌尔股份	1,700	43,877.00	0.00
551	002223	鱼跃医疗	1,200	43,788.00	0.00
552	600660	福耀玻璃	700	43,680.00	0.00
553	603303	得邦照明	3,700	43,549.00	0.00
554	601788	光大证券	2,400	43,464.00	0.00
555	603156	养元饮品	1,900	43,396.00	0.00
556	001965	招商公路	3,100	43,245.00	0.00
557	002690	美亚光电	2,900	42,978.00	0.00
558	603298	杭叉集团	2,400	42,936.00	0.00
559	601231	环旭电子	2,600	42,900.00	0.00
560	600406	国电南瑞	1,700	42,874.00	0.00
561	601187	厦门银行	7,600	42,864.00	0.00
562	002949	华阳国际	2,400	42,768.00	0.00
563	603866	桃李面包	6,468	42,688.80	0.00
564	688161	威高骨科	1,689	42,596.58	0.00
565	300251	光线传媒	4,500	42,480.00	0.00
566	003000	劲仔食品	3,100	42,470.00	0.00
567	603885	吉祥航空	3,100	42,470.00	0.00
568	605333	沪光股份	1,300	42,419.00	0.00
569	002050	三花智控	1,800	42,318.00	0.00
570	688349	三一重能	1,370	42,305.60	0.00
571	603193	润本股份	1,800	42,030.00	0.00
572	600316	洪都航空	1,300	41,756.00	0.00
573	601615	明阳智能	3,300	41,613.00	0.00
574	600893	航发动力	1,000	41,450.00	0.00
575	600346	恒力石化	2,700	41,445.00	0.00
576	600580	卧龙电驱	2,400	41,256.00	0.00
577	300529	健帆生物	1,400	41,076.00	0.00
578	600009	上海机场	1,200	40,980.00	0.00
579	000928	中钢国际	6,400	40,768.00	0.00
580	601985	中国核电	3,900	40,677.00	0.00
581	603855	华荣股份	2,000	40,580.00	0.00
582	002409	雅克科技	700	40,565.00	0.00

583	688150	莱特光电	1,800	40,536.00	0.00
584	000921	海信家电	1,400	40,460.00	0.00
585	603600	永艺股份	3,400	40,426.00	0.00
586	603103	横店影视	2,800	40,292.00	0.00
587	688297	中无人机	1,000	40,280.00	0.00
588	300360	炬华科技	2,400	40,248.00	0.00
589	601952	苏垦农发	4,100	40,139.00	0.00
590	605222	起帆电缆	2,600	40,040.00	0.00
591	000738	航发控制	1,800	40,032.00	0.00
592	688082	盛美上海	400	40,000.00	0.00
593	002534	西子洁能	3,600	39,996.00	0.00
594	688597	煜邦电力	4,100	39,893.00	0.00
595	603708	家家悦	3,500	39,865.00	0.00
596	600233	圆通速递	2,800	39,732.00	0.00
597	600298	安琪酵母	1,100	39,655.00	0.00
598	600062	华润双鹤	2,000	39,600.00	0.00
599	000768	中航西飞	1,400	39,536.00	0.00
600	000786	北新建材	1,300	39,403.00	0.00
601	600731	湖南海利	6,900	39,330.00	0.00
602	002179	中航光电	1,000	39,300.00	0.00
603	002430	杭氧股份	1,800	39,240.00	0.00
604	301498	乖宝宠物	500	39,160.00	0.00
605	000739	普洛药业	2,400	39,024.00	0.00
606	601222	林洋能源	5,500	38,885.00	0.00
607	600010	宝钢股份	20,900	38,874.00	0.00
608	600461	洪城环境	3,900	38,805.00	0.00
609	300628	亿联网络	1,000	38,600.00	0.00
610	688223	晶科能源	5,403	38,415.33	0.00
611	600126	杭钢股份	8,000	38,240.00	0.00
612	002493	荣盛石化	4,200	38,010.00	0.00
613	000030	富奥股份	7,400	37,962.00	0.00
614	688271	联影医疗	300	37,920.00	0.00
615	605368	蓝天燃气	3,300	37,719.00	0.00
616	600285	羚锐制药	1,700	37,672.00	0.00
617	000719	中原传媒	3,300	37,488.00	0.00
618	000920	沃顿科技	4,200	37,464.00	0.00
619	002641	公元股份	8,500	37,400.00	0.00
620	301179	泽宇智能	2,000	37,340.00	0.00
621	301262	海看股份	1,500	37,305.00	0.00
622	300765	新诺威	1,400	37,226.00	0.00
623	605166	聚合顺	3,100	37,107.00	0.00

624	688153	唯捷创芯	1,100	36,806.00	0.00
625	300777	中简科技	1,300	36,777.00	0.00
626	603871	嘉友国际	1,900	36,765.00	0.00
627	300054	鼎龙股份	1,400	36,428.00	0.00
628	002153	石基信息	5,100	36,414.00	0.00
629	000498	山东路桥	6,100	36,295.00	0.00
630	605338	巴比食品	2,100	36,267.00	0.00
631	600348	华阳股份	5,100	36,159.00	0.00
632	605599	菜百股份	3,183	36,127.05	0.00
633	300296	利亚德	5,600	36,064.00	0.00
634	600623	华谊集团	5,100	35,700.00	0.00
635	001322	箭牌家居	4,400	35,596.00	0.00
636	601038	一拖股份	2,400	35,472.00	0.00
637	600941	中国移动	300	35,448.00	0.00
638	600598	北大荒	2,400	35,400.00	0.00
639	000155	川能动力	3,300	35,244.00	0.00
640	603392	万泰生物	500	35,230.00	0.00
641	300674	宇信科技	1,800	35,136.00	0.00
642	603366	日出东方	3,000	35,130.00	0.00
643	300761	立华股份	1,800	35,028.00	0.00
644	300339	润和软件	700	35,021.00	0.00
645	600895	张江高科	1,300	34,840.00	0.00
646	688533	上声电子	1,000	34,820.00	0.00
647	605358	立昂微	1,400	34,678.00	0.00
648	300206	理邦仪器	3,100	34,658.00	0.00
649	688336	三生国健	1,609	34,464.78	0.00
650	688180	君实生物	1,259	34,408.47	0.00
651	301308	江波龙	400	34,400.00	0.00
652	600089	特变电工	2,700	34,398.00	0.00
653	600657	信达地产	8,200	34,112.00	0.00
654	688172	燕东微	1,700	34,085.00	0.00
655	688008	澜起科技	500	33,950.00	0.00
656	300470	中密控股	900	33,930.00	0.00
657	600315	上海家化	2,000	33,820.00	0.00
658	003025	思进智能	2,400	33,816.00	0.00
659	601512	中新集团	4,400	33,792.00	0.00
660	300476	胜宏科技	800	33,672.00	0.00
661	603889	新澳股份	4,800	33,648.00	0.00
662	688480	赛恩斯	1,233	33,463.62	0.00
663	003035	南网能源	8,000	33,440.00	0.00
664	603730	岱美股份	3,700	33,263.00	0.00

665	601886	江河集团	6,100	32,940.00	0.00
666	688209	英集芯	1,864	32,936.88	0.00
667	002884	凌霄泵业	1,800	32,886.00	0.00
668	600118	中国卫星	1,200	32,760.00	0.00
669	600416	湘电股份	2,900	32,741.00	0.00
670	603288	海天味业	700	32,130.00	0.00
671	688383	新益昌	715	32,082.05	0.00
672	300857	协创数据	300	32,067.00	0.00
673	603609	禾丰股份	3,700	31,894.00	0.00
674	600839	四川长虹	3,300	31,845.00	0.00
675	002801	微光股份	1,300	31,798.00	0.00
676	600547	山东黄金	1,400	31,682.00	0.00
677	601100	恒立液压	600	31,662.00	0.00
678	301015	百洋医药	1,300	31,473.00	0.00
679	301011	华立科技	1,218	31,290.42	0.00
680	603208	江山欧派	1,700	31,280.00	0.00
681	600548	深高速	2,300	31,004.00	0.00
682	688525	佰维存储	500	30,985.00	0.00
683	000708	中信特钢	2,700	30,807.00	0.00
684	603693	江苏新能	3,100	30,535.00	0.00
685	600760	中航沈飞	600	30,432.00	0.00
686	605555	德昌股份	1,400	30,296.00	0.00
687	600595	中孚实业	10,700	30,281.00	0.00
688	603057	紫燕食品	1,500	30,135.00	0.00
689	688009	中国通号	4,800	30,048.00	0.00
690	688122	西部超导	700	29,974.00	0.00
691	600845	宝信软件	1,020	29,845.20	0.00
692	301193	家联科技	1,800	29,754.00	0.00
693	002345	潮宏基	5,100	29,631.00	0.00
694	603351	威尔药业	1,200	29,472.00	0.00
695	002850	科达利	300	29,304.00	0.00
696	603699	纽威股份	1,300	28,821.00	0.00
697	603077	和邦生物	14,100	28,764.00	0.00
698	688187	时代电气	600	28,752.00	0.00
699	605183	确成股份	1,700	28,645.00	0.00
700	600217	中再资环	5,400	28,620.00	0.00
701	002606	大连电瓷	3,100	28,582.00	0.00
702	301267	华夏眼科	1,500	28,560.00	0.00
703	002053	云南能投	2,500	28,500.00	0.00
704	600332	白云山	1,000	28,420.00	0.00
705	600973	宝胜股份	4,500	28,350.00	0.00

706	688550	瑞联新材	900	28,161.00	0.00
707	605369	拱东医疗	1,000	28,080.00	0.00
708	300428	立中集团	1,700	27,710.00	0.00
709	688351	微电生理	1,450	27,608.00	0.00
710	688099	晶晨股份	400	27,472.00	0.00
711	000700	模塑科技	3,900	27,378.00	0.00
712	600662	外服控股	5,400	27,378.00	0.00
713	300973	立高食品	700	27,321.00	0.00
714	300285	国瓷材料	1,600	27,264.00	0.00
715	600395	盘江股份	5,300	26,977.00	0.00
716	688107	安路科技	909	26,888.22	0.00
717	688029	南微医学	391	26,427.69	0.00
718	603112	华翔股份	2,100	26,250.00	0.00
719	300837	浙矿股份	1,300	26,208.00	0.00
720	600859	王府井	1,700	26,197.00	0.00
721	003031	中瓷电子	500	26,195.00	0.00
722	002996	顺博合金	3,940	26,161.60	0.00
723	688267	中触媒	1,106	25,991.00	0.00
724	300783	三只松鼠	700	25,809.00	0.00
725	002765	蓝黛科技	3,000	25,800.00	0.00
726	601865	福莱特	1,300	25,597.00	0.00
727	001206	依依股份	1,532	25,323.96	0.00
728	002138	顺络电子	800	25,184.00	0.00
729	600882	妙可蓝多	1,400	25,060.00	0.00
730	603368	柳药集团	1,400	25,004.00	0.00
731	300755	华致酒行	1,400	24,976.00	0.00
732	600499	科达制造	3,200	24,960.00	0.00
733	688678	福立旺	1,675	24,873.75	0.00
734	605499	东鹏饮料	100	24,852.00	0.00
735	600894	广日股份	1,700	24,820.00	0.00
736	002459	晶澳科技	1,800	24,750.00	0.00
737	002140	东华科技	2,500	24,700.00	0.00
738	601333	广深铁路	7,200	24,696.00	0.00
739	300684	中石科技	1,100	24,673.00	0.00
740	000877	天山股份	4,300	24,338.00	0.00
741	601677	明泰铝业	2,000	24,060.00	0.00
742	000538	云南白药	400	23,980.00	0.00
743	688375	国博电子	482	23,791.52	0.00
744	002463	沪电股份	600	23,790.00	0.00
745	603638	艾迪精密	1,400	23,646.00	0.00
746	688087	英科再生	778	23,581.18	0.00

747	688388	嘉元科技	1,600	23,568.00	0.00
748	600737	中粮糖业	2,300	23,483.00	0.00
749	600814	杭州解百	2,800	23,212.00	0.00
750	601021	春秋航空	400	23,068.00	0.00
751	300673	佩蒂股份	1,300	23,049.00	0.00
752	605507	国邦医药	1,100	22,913.00	0.00
753	603883	老百姓	1,390	22,754.30	0.00
754	002797	第一创业	2,700	22,545.00	0.00
755	601698	中国卫通	1,100	22,440.00	0.00
756	688006	杭可科技	1,252	22,360.72	0.00
757	600073	光明肉业	3,200	22,208.00	0.00
758	603556	海兴电力	600	22,194.00	0.00
759	600026	中远海能	1,900	22,040.00	0.00
760	603681	永冠新材	1,700	21,913.00	0.00
761	600269	赣粤高速	3,900	21,879.00	0.00
762	603658	安图生物	500	21,820.00	0.00
763	600475	华光环能	2,400	21,624.00	0.00
764	603385	惠达卫浴	3,400	21,624.00	0.00
765	003038	鑫铂股份	1,300	21,554.00	0.00
766	002543	万和电气	2,100	21,504.00	0.00
767	600420	国药现代	1,800	21,492.00	0.00
768	002472	双环传动	700	21,434.00	0.00
769	603517	绝味食品	1,300	21,372.00	0.00
770	603337	杰克股份	700	21,322.00	0.00
771	000906	浙商中拓	3,200	21,120.00	0.00
772	600810	神马股份	2,600	21,034.00	0.00
773	600011	华能国际	3,100	20,987.00	0.00
774	300953	震裕科技	300	20,892.00	0.00
775	603529	爱玛科技	500	20,510.00	0.00
776	003012	东鹏控股	3,100	20,491.00	0.00
777	688510	航亚科技	1,175	20,468.50	0.00
778	000910	大亚圣象	2,600	20,462.00	0.00
779	603535	嘉诚国际	1,700	20,383.00	0.00
780	002158	汉钟精机	1,100	20,372.00	0.00
781	002170	芭田股份	2,300	20,079.00	0.00
782	002008	大族激光	800	20,000.00	0.00
783	600562	国睿科技	1,000	19,930.00	0.00
784	002978	安宁股份	700	19,894.00	0.00
785	603806	福斯特	1,340	19,832.00	0.00
786	688400	凌云光	900	19,728.00	0.00
787	002839	张家港行	4,500	19,665.00	0.00

788	603039	泛微网络	400	19,600.00	0.00
789	600007	中国国贸	800	19,568.00	0.00
790	688273	麦澜德	835	19,513.95	0.00
791	000021	深科技	1,000	19,060.00	0.00
792	002986	宇新股份	1,600	19,008.00	0.00
793	002790	瑞尔特	2,600	18,980.00	0.00
794	605339	南侨食品	1,100	18,722.00	0.00
795	600728	佳都科技	4,000	18,720.00	0.00
796	002152	广电运通	1,600	18,656.00	0.00
797	600989	宝丰能源	1,100	18,524.00	0.00
798	601339	百隆东方	3,400	18,496.00	0.00
799	603355	莱克电气	800	18,120.00	0.00
800	688376	美埃科技	540	18,030.60	0.00
801	300396	迪瑞医疗	1,100	17,974.00	0.00
802	300679	电连技术	300	17,910.00	0.00
803	603919	金徽酒	900	17,640.00	0.00
804	002701	奥瑞金	3,100	17,577.00	0.00
805	600586	金晶科技	3,100	17,422.00	0.00
806	600399	抚顺特钢	3,000	17,400.00	0.00
807	002961	瑞达期货	1,200	17,244.00	0.00
808	605128	上海沿浦	464	17,144.80	0.00
809	603165	荣晟环保	1,400	17,136.00	0.00
810	002262	恩华药业	700	17,045.00	0.00
811	300752	隆利科技	1,000	17,000.00	0.00
812	000403	派林生物	800	16,904.00	0.00
813	603939	益丰药房	700	16,891.00	0.00
814	600160	巨化股份	700	16,884.00	0.00
815	300232	洲明科技	2,400	16,488.00	0.00
816	000600	建投能源	2,900	16,414.00	0.00
817	300303	聚飞光电	2,400	16,368.00	0.00
818	002468	申通快递	1,600	16,208.00	0.00
819	603198	迎驾贡酒	300	16,182.00	0.00
820	002027	分众传媒	2,300	16,169.00	0.00
821	603173	福斯达	700	16,135.00	0.00
822	301349	信德新材	500	16,090.00	0.00
823	002032	苏泊尔	300	15,963.00	0.00
824	300979	华利集团	200	15,730.00	0.00
825	300418	昆仑万维	400	15,392.00	0.00
826	688244	永信至诚	600	15,360.00	0.00
827	002782	可立克	1,200	15,180.00	0.00
828	301371	敷尔佳	400	15,116.00	0.00

829	688475	萤石网络	500	15,095.00	0.00
830	300253	卫宁健康	2,100	15,036.00	0.00
831	300037	新宙邦	400	14,976.00	0.00
832	600167	联美控股	2,600	14,898.00	0.00
833	002841	视源股份	400	14,764.00	0.00
834	600482	中国动力	600	14,682.00	0.00
835	002025	航天电器	300	14,568.00	0.00
836	688690	纳微科技	824	14,502.40	0.00
837	300487	蓝晓科技	300	14,361.00	0.00
838	002749	国光股份	1,000	14,220.00	0.00
839	001287	中电港	700	14,217.00	0.00
840	688252	天德钰	593	14,202.35	0.00
841	688612	威迈斯	600	14,124.00	0.00
842	002925	盈趣科技	900	14,094.00	0.00
843	002180	纳思达	500	14,085.00	0.00
844	000550	江铃汽车	600	14,070.00	0.00
845	688105	诺唯赞	630	13,967.10	0.00
846	300707	威唐工业	900	13,833.00	0.00
847	603040	新坐标	600	13,752.00	0.00
848	002270	华明装备	800	13,512.00	0.00
849	601975	招商南油	4,300	13,459.00	0.00
850	300453	三鑫医疗	1,800	13,428.00	0.00
851	300702	天宇股份	800	13,328.00	0.00
852	300595	欧普康视	700	13,265.00	0.00
853	300791	仙乐健康	500	13,165.00	0.00
854	688290	景业智能	300	13,116.00	0.00
855	603927	中科软	600	13,020.00	0.00
856	300144	宋城演艺	1,400	13,006.00	0.00
857	688625	呈和科技	338	12,904.84	0.00
858	601702	华峰铝业	700	12,824.00	0.00
859	002054	德美化工	2,200	12,782.00	0.00
860	002283	天润工业	2,400	12,768.00	0.00
861	688606	奥泰生物	200	12,660.00	0.00
862	603690	至纯科技	500	12,555.00	0.00
863	000541	佛山照明	2,000	12,400.00	0.00
864	603171	税友股份	400	12,200.00	0.00
865	002422	科伦药业	400	11,972.00	0.00
866	600563	法拉电子	100	11,892.00	0.00
867	300257	开山股份	1,300	11,856.00	0.00
868	002773	康弘药业	600	11,760.00	0.00
869	600535	天士力	800	11,568.00	0.00

870	301004	嘉益股份	100	11,565.00	0.00
871	688658	悦康药业	800	11,528.00	0.00
872	688232	新点软件	385	11,161.15	0.00
873	603228	景旺电子	400	11,136.00	0.00
874	002155	湖南黄金	700	11,011.00	0.00
875	002891	中宠股份	300	10,710.00	0.00
876	605116	奥锐特	500	10,560.00	0.00
877	600601	方正科技	2,400	10,536.00	0.00
878	301031	中熔电气	100	10,402.00	0.00
879	301050	雷电微力	200	10,316.00	0.00
880	600161	天坛生物	500	10,250.00	0.00
881	600428	中远海特	1,400	10,220.00	0.00
882	600391	航发科技	500	9,925.00	0.00
883	002111	威海广泰	900	9,918.00	0.00
884	300388	节能国祯	1,300	9,815.00	0.00
885	688381	帝奥微	496	9,562.88	0.00
886	002955	鸿合科技	400	9,408.00	0.00
887	688401	路维光电	355	9,368.45	0.00
888	688468	科美诊断	1,348	9,233.80	0.00
889	603181	皇马科技	800	9,224.00	0.00
890	688553	汇宇制药	600	9,120.00	0.00
891	603989	艾华集团	600	9,048.00	0.00
892	603369	今世缘	200	9,046.00	0.00
893	300604	长川科技	200	8,826.00	0.00
894	688472	阿特斯	700	8,792.00	0.00
895	688516	奥特维	200	8,662.00	0.00
896	688314	康拓医疗	300	8,640.00	0.00
897	600718	东软集团	800	8,616.00	0.00
898	600597	光明乳业	1,000	8,540.00	0.00
899	002649	博彦科技	700	8,484.00	0.00
900	002304	洋河股份	100	8,353.00	0.00
901	603882	金域医学	300	8,259.00	0.00
902	002993	奥海科技	200	8,200.00	0.00
903	688517	金冠电气	600	8,136.00	0.00
904	688147	微导纳米	300	8,067.00	0.00
905	688295	中复神鹰	400	7,972.00	0.00
906	300525	博思软件	500	7,790.00	0.00
907	301327	华宝新能	100	7,671.00	0.00
908	003006	百亚股份	300	7,197.00	0.00
909	002615	哈尔斯	900	7,155.00	0.00
910	002738	中矿资源	200	7,100.00	0.00

911	002860	星帅尔	700	6,867.00	0.00
912	301002	崧盛股份	400	6,796.00	0.00
913	605068	明新旭腾	500	6,725.00	0.00
914	605377	华旺科技	500	6,675.00	0.00
915	300776	帝尔激光	100	6,358.00	0.00
916	688338	赛科希德	255	6,168.45	0.00
917	601033	永兴股份	400	5,784.00	0.00
918	000999	华润三九	130	5,764.20	0.00
919	603035	常熟汽饰	400	5,756.00	0.00
920	002284	亚太股份	600	4,644.00	0.00
921	688428	诺诚健华	337	4,138.36	0.00
922	002139	拓邦股份	300	4,083.00	0.00
923	688586	江航装备	410	3,923.70	0.00
924	000930	中粮科技	700	3,885.00	0.00
925	002536	飞龙股份	300	3,474.00	0.00
926	002511	中顺洁柔	500	3,405.00	0.00
927	300316	晶盛机电	100	3,190.00	0.00
928	000501	武商集团	300	3,138.00	0.00
929	603906	龙蟠科技	300	3,108.00	0.00
930	002034	旺能环境	200	3,100.00	0.00
931	300835	龙磁科技	100	3,092.00	0.00
932	600459	贵研铂业	200	2,746.00	0.00
933	300136	信维通信	100	2,544.00	0.00
934	301078	孩子王	200	2,276.00	0.00
935	301381	赛维时代	100	2,276.00	0.00
936	300130	新国都	100	2,166.00	0.00
937	603223	恒通股份	200	2,096.00	0.00
938	300113	顺网科技	100	1,681.00	0.00
939	002351	漫步者	100	1,650.00	0.00
940	603169	兰石重装	300	1,635.00	0.00
941	002127	南极电商	300	1,320.00	0.00
942	300463	迈克生物	100	1,320.00	0.00
943	300867	圣元环保	100	1,293.00	0.00
944	301296	新巨丰	100	1,015.00	0.00
945	300737	科顺股份	200	1,014.00	0.00
946	002154	报喜鸟	200	882.00	0.00
947	002219	新里程	300	792.00	0.00
948	002081	金螳螂	200	714.00	0.00
949	601933	永辉超市	100	634.00	0.00
950	600507	方大特钢	100	405.00	0.00
951	600575	淮河能源	100	397.00	0.00

注：300114 中航电测自 2025 年 2 月 17 日起证券代码变更为 302132，证券名称变更为中航成飞。

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	601233	桐昆股份	44,215,502.00	1.08
2	000589	贵州轮胎	28,929,849.58	0.71
3	000623	吉林敖东	27,949,972.55	0.68
4	600388	龙净环保	24,871,698.95	0.61
5	601006	大秦铁路	22,228,235.80	0.54
6	03968	招商银行	17,526,485.94	0.43
6	600036	招商银行	2,693,258.00	0.07
7	600761	安徽合力	14,851,325.00	0.36
8	600426	华鲁恒升	13,708,602.00	0.34
9	600079	人福医药	13,081,519.00	0.32
10	603393	新天然气	12,505,532.00	0.31
11	601878	浙商证券	12,072,604.00	0.30
12	300059	东方财富	11,489,337.96	0.28
13	002475	立讯精密	11,302,531.70	0.28
14	000400	许继电气	10,812,975.00	0.26
15	001286	陕西能源	10,710,249.00	0.26
16	001914	招商积余	9,484,386.00	0.23
17	000923	河钢资源	9,360,329.00	0.23
18	600985	淮北矿业	9,015,537.00	0.22
19	01339	中国人民保险集团	7,455,798.13	0.18
19	601319	中国人保	1,293,618.00	0.03
20	600309	万华化学	8,605,487.00	0.21

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	03968	招商银行	23,623,276.52	0.58
1	600036	招商银行	14,181,949.00	0.35

2	000623	吉林敖东	27,544,498.40	0.67
3	600388	龙净环保	21,094,891.50	0.52
4	03958	东方证券	15,905,668.68	0.39
4	600958	东方证券	322,722.68	0.01
5	00175	吉利汽车	14,514,457.61	0.36
6	000589	贵州轮胎	13,624,789.44	0.33
7	01378	中国宏桥	12,537,328.97	0.31
8	300059	东方财富	11,799,238.80	0.29
9	002653	海思科	11,688,141.00	0.29
10	300750	宁德时代	11,149,022.00	0.27
11	601233	桐昆股份	11,029,628.00	0.27
12	03900	绿城中国	10,759,773.65	0.26
13	001914	招商积余	10,438,643.00	0.26
14	002532	天山铝业	10,081,385.00	0.25
15	600519	贵州茅台	9,935,269.00	0.24
16	03908	中金公司	8,582,343.88	0.21
16	601995	中金公司	762,456.00	0.02
17	601816	京沪高铁	9,186,872.00	0.22
18	601878	浙商证券	9,069,627.20	0.22
19	00688	中国海外发展	8,830,833.98	0.22
20	01339	中国人民保险集团	7,557,996.25	0.18
20	601319	中国人保	1,174,409.00	0.03

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	1,164,486,136.66
卖出股票收入（成交）总额	966,382,321.82

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	306,031,386.60	5.07
2	央行票据	—	—
3	金融债券	3,234,231,936.60	53.63

	其中：政策性金融债	424,653,954.14	7.04
4	企业债券	184,496,300.82	3.06
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	298,626,038.24	4.95
7	可转债（可交换债）	1,000,717,986.62	16.59
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	5,024,103,648.88	83.31

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	2028003	20 平安银行永续 债 01	3,300,000	341,804,622.95	5.67
2	2028017	20 农业银行永续 债 01	2,500,000	257,137,027.40	4.26
3	240011	24 附息国债 11	1,650,000	174,012,327.35	2.89
4	2028023	20 招商银行永续 债 01	1,500,000	154,550,589.04	2.56
5	312400001	24 工行 TLAC 非资 本债 01A	1,300,000	133,418,109.59	2.21

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	180297	燕山湖 A	200,000	20,374,867.15	0.34
2	135099	22 金泰优	100,000	9,967,928.79	0.17

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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。

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 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资政策及风险说明

本基金采用定量分析和定性分析相结合的方式，一方面通过严格的量化规则筛选有潜在投资价值的标的纳入研究范围，另一方面结合所选基金的基金管理人的基本情况和投研文化等定性因素进行二次研判，双重维度力求筛选出中长期业绩稳定的优秀基金。本基金还将定期对投资组合进行回顾和动态调整，剔除不再符合筛选标准的标的基金，增加符合筛选标准的基金，以实现基金投资组合的优化。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，符合基金合同约定的投资政策，投资限制等要求。

8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	011830	富国天恒混合A	契约型开放式	24,281,185.81	27,656,270.64	0.46	是
2	001508	富国新动力灵活配置混合A	契约型开放式	8,819,416.34	25,100,058.90	0.42	是
3	019636	富国研究精选灵活配置混合D	契约型开放式	5,597,157.46	14,569,400.87	0.24	是
4	515790	光伏ETF	交易型开放式	18,000,000.00	13,626,000.00	0.23	否

5	000880	富国研究精选灵活配置混合A	契约型 开放式	3,978,894.05	10,368,997.89	0.17	是
6	008682	富国中证红利指数增强C	契约型 开放式	9,671,179.88	9,961,315.28	0.17	是
7	013291	富国沪深300指数增强C	契约型 开放式	6,321,112.52	9,867,256.64	0.16	是
8	159792	富国中证港股通互联网ETF	契约型，交易型 开放式	10,276,600.00	7,142,237.00	0.12	是
9	159629	富国中证1000ETF	契约型，交易型 开放式	2,537,522.00	6,145,878.28	0.10	是
10	510500	南方中证500ETF	交易型 开放式	1,000,000.00	5,811,000.00	0.10	否
11	512880	国泰中证全指证券公司ETF	交易型 开放式	4,500,000.00	5,265,000.00	0.09	否
12	011125	富国文体健康股票C	契约型 开放式	2,112,378.54	4,942,965.78	0.08	是
13	159928	消费ETF	交易型 开放式	157,100.00	128,350.70	—	否

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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，交通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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，平安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。

8.13.2 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。

8.13.3 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	198,407.89
2	应收清算款	32,209,468.07
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	8,950,349.27
6	其他应收款	15,450.81
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	41,373,676.04

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127089	晶澳转债	46,904,612.54	0.78
2	113064	东材转债	36,320,071.23	0.60
3	110062	烽火转债	35,828,749.83	0.59
4	110059	浦发转债	35,294,155.64	0.59
5	113048	晶科转债	32,672,331.58	0.54
6	123212	立中转债	29,781,852.25	0.49
7	118031	天 23 转债	29,754,834.25	0.49

8	128127	文科转债	25,231,976.71	0.42
9	113641	华友转债	23,927,187.12	0.40
10	118022	锂科转债	23,412,637.60	0.39
11	123236	家联转债	22,960,776.62	0.38
12	123119	康泰转 2	21,968,862.99	0.36
13	127078	优彩转债	21,756,046.84	0.36
14	110087	天业转债	20,786,780.49	0.34
15	118034	晶能转债	20,303,170.56	0.34
16	113685	升 24 转债	18,831,523.52	0.31
17	113545	金能转债	18,631,956.44	0.31
18	113654	永 02 转债	17,772,602.74	0.29
19	118040	宏微转债	16,644,494.79	0.28
20	113047	旗滨转债	16,145,813.64	0.27
21	113059	福莱转债	15,301,347.95	0.25
22	127073	天赐转债	15,007,964.72	0.25
23	127027	能化转债	14,651,442.52	0.24
24	128144	利民转债	13,976,645.89	0.23
25	127076	中宠转 2	13,505,687.34	0.22
26	111000	起帆转债	13,063,152.00	0.22
27	118000	嘉元转债	13,029,090.41	0.22
28	118005	天奈转债	12,387,989.59	0.21
29	127088	赫达转债	12,314,751.76	0.20
30	123214	东宝转债	12,302,091.94	0.20
31	111018	华康转债	11,582,613.70	0.19
32	123240	楚天转债	11,328,277.47	0.19
33	123162	东杰转债	11,142,426.49	0.18
34	113680	丽岛转债	10,621,120.55	0.18
35	113653	永 22 转债	10,531,039.79	0.17
36	128129	青农转债	10,320,374.70	0.17
37	127091	科数转债	10,064,284.93	0.17
38	127083	山路转债	9,704,646.12	0.16
39	118012	微芯转债	9,448,289.08	0.16

40	127086	恒邦转债	9,407,554.41	0.16
41	127031	洋丰转债	9,268,402.97	0.15
42	113636	甬金转债	9,178,654.34	0.15
43	118032	建龙转债	8,694,253.87	0.14
44	110093	神马转债	8,525,218.80	0.14
45	127070	大中转债	7,772,924.73	0.13
46	123172	漱玉转债	7,413,406.00	0.12
47	113623	凤 21 转债	7,361,166.54	0.12
48	113661	福 22 转债	7,225,813.94	0.12
49	123217	富仕转债	7,040,128.32	0.12
50	127061	美锦转债	6,993,407.73	0.12
51	127098	欧晶转债	6,687,849.12	0.11
52	123233	凯盛转债	6,587,935.89	0.11
53	127105	龙星转债	6,504,880.57	0.11
54	113640	苏利转债	6,497,950.68	0.11
55	123215	铭利转债	6,303,529.23	0.10
56	123076	强力转债	6,036,150.27	0.10
57	123169	正海转债	5,986,021.99	0.10
58	118023	广大转债	5,709,499.18	0.09
59	118038	金宏转债	5,457,378.09	0.09
60	127103	东南转债	5,189,754.23	0.09
61	123188	水羊转债	4,563,044.28	0.08
62	128117	道恩转债	4,413,669.06	0.07
63	123108	乐普转 2	4,313,627.40	0.07
64	118024	冠宇转债	4,308,568.13	0.07
65	123180	浙矿转债	4,244,075.62	0.07
66	123179	立高转债	4,102,487.63	0.07
67	113052	兴业转债	3,582,063.35	0.06
68	123211	阳谷转债	3,581,904.81	0.06
69	118009	华锐转债	3,327,348.15	0.06
70	113660	寿 22 转债	3,001,308.23	0.05
71	123196	正元转 02	2,903,457.39	0.05

72	123199	山河转债	2,883,643.02	0.05
73	110086	精工转债	2,746,891.23	0.05
74	118043	福立转债	2,658,775.34	0.04
75	111005	富春转债	2,365,428.21	0.04
76	127071	火箭转债	2,265,514.52	0.04
77	123071	天能转债	1,697,317.81	0.03
78	127087	星帅转 2	1,667,513.56	0.03
79	127060	湘佳转债	1,529,277.00	0.03
80	110090	爱迪转债	1,480,790.14	0.02
81	123120	隆华转债	1,393,409.18	0.02
82	118033	华特转债	1,227,558.72	0.02
83	113633	科沃转债	1,092,131.96	0.02
84	118042	奥维转债	1,086,762.47	0.02
85	127059	永东转 2	973,483.41	0.02
86	128121	宏川转债	967,525.15	0.02
87	113679	芯能转债	758,123.97	0.01
88	123165	回天转债	757,451.38	0.01
89	123113	仙乐转债	597,035.64	0.01
90	127040	国泰转债	511,023.79	0.01
91	128081	海亮转债	497,309.95	0.01
92	113609	永安转债	492,687.62	0.01
93	113068	金铜转债	469,917.49	0.01
94	113056	重银转债	436,461.12	0.01
95	113037	紫银转债	431,107.33	0.01
96	127018	本钢转债	415,612.26	0.01
97	113655	欧 22 转债	397,658.84	0.01
98	111019	宏柏转债	388,730.28	0.01
99	123197	光力转债	386,379.30	0.01
100	113542	好客转债	372,370.33	0.01
101	128097	奥佳转债	359,522.62	0.01
102	113530	大丰转债	320,020.51	0.01
103	127049	希望转 2	314,734.80	0.01

104	113054	绿动转债	280,442.04	0.00
105	113058	友发转债	272,752.90	0.00
106	128105	长集转债	269,216.09	0.00
107	113649	丰山转债	255,680.47	0.00
108	113532	海环转债	249,887.12	0.00
109	111001	山玻转债	240,486.82	0.00
110	127016	鲁泰转债	231,715.74	0.00
111	110084	贵燃转债	211,918.84	0.00
112	128131	崇达转 2	188,476.35	0.00
113	110064	建工转债	184,184.78	0.00
114	113042	上银转债	183,680.65	0.00
115	128066	亚泰转债	181,697.90	0.00
116	123155	中陆转债	181,619.59	0.00
117	123063	大禹转债	175,795.59	0.00
118	113044	大秦转债	174,713.29	0.00
119	127066	科利转债	166,106.98	0.00
120	128133	奇正转债	164,441.43	0.00
121	113608	威派转债	149,576.43	0.00
122	123150	九强转债	145,888.61	0.00
123	128125	华阳转债	143,878.71	0.00
124	123225	翔丰转债	141,533.58	0.00
125	127024	盈峰转债	140,840.47	0.00
126	113021	中信转债	115,033.52	0.00
127	123178	花园转债	114,640.97	0.00
128	123149	通裕转债	114,244.08	0.00
129	113065	齐鲁转债	112,523.62	0.00
130	128130	景兴转债	106,119.92	0.00
131	113030	东风转债	105,972.05	0.00
132	127020	中金转债	98,812.02	0.00
133	123107	温氏转债	96,960.22	0.00
134	127015	希望转债	96,842.69	0.00
135	113069	博 23 转债	94,948.67	0.00

136	123146	中环转 2	90,892.82	0.00
137	113657	再 22 转债	86,796.58	0.00
138	113051	节能转债	85,736.02	0.00
139	113667	春 23 转债	84,874.55	0.00
140	127102	浙建转债	78,922.30	0.00
141	127032	苏行转债	66,727.35	0.00
142	113681	镇洋转债	65,479.58	0.00
143	110063	鹰 19 转债	65,216.47	0.00
144	113046	金田转债	64,354.19	0.00
145	128141	旺能转债	63,885.76	0.00
146	110079	杭银转债	63,254.68	0.00
147	113050	南银转债	59,765.97	0.00
148	113625	江山转债	58,990.34	0.00
149	113584	家悦转债	58,574.25	0.00
150	113549	白电转债	58,280.17	0.00
151	123059	银信转债	57,874.57	0.00
152	128071	合兴转债	57,817.47	0.00
153	113628	晨丰转债	56,302.12	0.00
154	118013	道通转债	54,687.34	0.00
155	113055	成银转债	51,857.87	0.00
156	113651	松霖转债	51,664.66	0.00
157	113024	核建转债	50,501.01	0.00
158	110075	南航转债	50,214.58	0.00
159	127030	盛虹转债	49,646.41	0.00
160	123161	强联转债	46,599.89	0.00
161	111010	立昂转债	45,050.08	0.00
162	127085	韵达转债	44,272.93	0.00
163	123085	万顺转 2	44,157.14	0.00
164	128095	恩捷转债	41,320.95	0.00
165	118041	星球转债	40,164.80	0.00
166	113579	健友转债	39,304.13	0.00
167	123184	天阳转债	38,096.73	0.00

168	113627	太平转债	37,314.63	0.00
169	127052	西子转债	36,978.75	0.00
170	113652	伟 22 转债	34,174.74	0.00
171	110070	凌钢转债	33,999.86	0.00
172	127051	博杰转债	33,539.43	0.00
173	128072	翔鹭转债	31,201.10	0.00
174	128109	楚江转债	29,900.31	0.00
175	123147	中辰转债	29,232.31	0.00
176	127055	精装转债	28,502.33	0.00
177	113647	禾丰转债	27,951.68	0.00
178	128132	交建转债	27,881.94	0.00
179	123127	耐普转债	27,849.82	0.00
180	123224	宇邦转债	27,669.27	0.00
181	113062	常银转债	27,646.45	0.00
182	123039	开润转债	27,357.77	0.00
183	113668	鹿山转债	27,066.21	0.00
184	123112	万讯转债	25,823.46	0.00
185	123078	飞凯转债	25,808.60	0.00
186	113631	皖天转债	25,555.51	0.00
187	110067	华安转债	25,399.97	0.00
188	123166	蒙泰转债	25,389.56	0.00
189	127022	恒逸转债	25,069.33	0.00
190	123222	博俊转债	24,515.84	0.00
191	127026	超声转债	24,402.98	0.00
192	111015	东亚转债	24,017.06	0.00
193	123237	佳禾转债	23,847.79	0.00
194	113658	密卫转债	23,774.90	0.00
195	118003	华兴转债	23,582.51	0.00
196	123193	海能转债	23,366.33	0.00
197	127067	恒逸转 2	22,979.83	0.00
198	123121	帝尔转债	22,684.07	0.00
199	113534	鼎胜转债	22,492.87	0.00

200	123160	泰福转债	21,794.92	0.00
201	110085	通 22 转债	21,010.01	0.00
202	113574	华体转债	20,894.84	0.00
203	123204	金丹转债	20,563.33	0.00
204	123109	昌红转债	19,975.70	0.00
205	113039	嘉泽转债	19,736.46	0.00
206	127081	中旗转债	19,661.30	0.00
207	113669	景 23 转债	19,646.71	0.00
208	123087	明电转债	19,432.44	0.00
209	118004	博瑞转债	19,267.75	0.00
210	113673	岱美转债	19,021.28	0.00
211	128120	联诚转债	18,963.21	0.00
212	127082	亚科转债	18,764.49	0.00
213	128128	齐翔转 2	18,577.28	0.00
214	123130	设研转债	18,462.03	0.00
215	118028	会通转债	17,647.98	0.00
216	118015	芯海转债	16,567.70	0.00
217	123207	冠中转债	16,500.85	0.00
218	123218	宏昌转债	16,463.69	0.00
219	123235	亿田转债	16,426.49	0.00
220	123230	金钟转债	16,323.96	0.00
221	123124	晶瑞转 2	16,185.55	0.00
222	123122	富瀚转债	16,053.32	0.00
223	113033	利群转债	16,025.09	0.00
224	128070	智能转债	15,991.73	0.00
225	123227	雅创转债	15,888.00	0.00
226	118035	国力转债	15,726.55	0.00
227	123159	崧盛转债	15,618.46	0.00
228	128136	立讯转债	15,521.24	0.00
229	123090	三诺转债	15,042.74	0.00
230	123100	朗科转债	14,937.81	0.00
231	118011	银微转债	14,573.79	0.00

232	110052	贵广转债	14,560.28	0.00
233	127096	泰坦转债	13,530.48	0.00
234	113676	荣 23 转债	12,195.92	0.00
235	127075	百川转 2	12,072.74	0.00
236	110082	宏发转债	9,857.90	0.00
237	110076	华海转债	9,049.34	0.00
238	123234	中能转债	7,229.90	0.00
239	123133	佩蒂转债	6,135.14	0.00
240	113656	嘉诚转债	1,110.74	0.00

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

8.13.6 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(%)
富国裕利债券 A	4,667	607,064.74	1,827,116,795.78	64.49	1,006,054,337.41	35.51
富国裕利债券 C	1,943	273,654.27	20.89	0.00	531,710,216.98	100.00
富国裕利债券 E	114	18,550,307.95	2,093,636,439.63	99.00	21,098,666.51	1.00
合计	6,724	814,934.04	3,920,753,256.30	71.55	1,558,863,220.90	28.45

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	富国裕利债券 A	659,340.95	0.0233
	富国裕利债券 C	103.11	0.0000
	富国裕利债券 E	672,638.06	0.0318
	合计	1,332,082.12	0.0243

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	富国裕利债券 A	0
	富国裕利债券 C	0
	富国裕利债券 E	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	富国裕利债券 A	0
	富国裕利债券 C	0
	富国裕利债券 E	10~50
	合计	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国裕利债券 A	富国裕利债券 C	富国裕利债券 E
基金合同生效日(2022 年 02 月 23 日)基金份额总额	1,689,678,938.31	141,465,264.18	—
报告期期初基金份额总额	2,489,597,988.99	195,466,054.57	1,243,896,386.19
本报告期基金总申购份额	2,570,919,166.11	606,268,313.08	3,133,685,784.84
减：本报告期基金总赎回份额	2,227,346,021.91	270,024,129.78	2,262,847,064.89
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
报告期期末基金份额总额	2,833,171,133.19	531,710,237.87	2,114,735,106.14

§ 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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金本报告期所持有的基金未发生具有重大影响的事件。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 5.8 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 3 年。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7.1 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	公司已完成整改。

提出整改意见)	
其他	—

11.7.2 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。

11.8 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
渤海证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	3	148,799,341.24	7.30	84,284.53	7.11	—
诚通证券	2	—	—	—	—	—
东方证券	4	15,693,816.47	0.77	9,889.89	0.83	—
东吴证券	2	285,283,177.43	14.00	183,059.65	15.44	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	2	267,609,461.28	13.14	138,215.82	11.66	—
国盛证券	2	146,303,152.92	7.18	104,179.66	8.79	—
国泰君安	2	46,438,489.68	2.28	18,850.46	1.59	—
海通证券	2	242,506,678.38	11.90	117,366.84	9.90	—
华泰证券	2	196,885,236.29	9.66	123,316.66	10.40	—
华西证券	2	—	—	—	—	—
民生证券	3	479,217,697.19	23.52	297,505.56	25.10	—
申万宏源	2	58,678,676.43	2.88	36,418.21	3.07	—
太平洋证券	2	5,537,343.64	0.27	4,074.38	0.34	—
银河证券	2	21,835,045.96	1.07	14,625.88	1.23	—
浙商证券	2	16,272,089.51	0.80	6,604.21	0.56	—
中金公司	2	59,764,962.99	2.93	28,253.42	2.38	—
中信建投	2	24,051,340.34	1.18	9,653.50	0.81	—
中信证券	2	22,361,058.28	1.10	9,076.72	0.77	—

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。

11.8.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
渤海证券	—	—	—	—	—	—	—	—
长江证券	321,155,018.28	8.34	2,170,708,000.00	7.14	—	—	86,264,944.20	19.74
诚通证券	—	—	—	—	—	—	—	—
东方证券	46,466,641.83	1.21	75,495,000.00	0.25	—	—	20,696,529.25	4.74
东吴证券	359,213,244.86	9.33	3,924,139,000.00	12.90	—	—	17,998,000.00	4.12
方正证券	1,330,496.87	0.03	166,000,000.00	0.55	—	—	—	—
广发证券	321,335,943.94	8.35	2,144,507,000.00	7.05	—	—	50,752,223.30	11.62
国盛证券	372,751,907.75	9.68	3,326,565,000.00	10.94	—	—	4,720,000.00	1.08
国泰君安	36,824,511.86	0.96	7,868,000.00	0.03	—	—	29,135,817.45	6.67
海通证券	108,660,288.75	2.82	747,361,000.00	2.46	—	—	24,071,000.00	5.51
华泰证券	458,993,027.98	11.92	3,824,685,000.00	12.58	—	—	28,069,062.70	6.42
华西证券	—	—	—	—	—	—	—	—
民生证券	731,809,573.15	19.01	11,247,603,000.00	36.98	—	—	161,501,095.22	36.96

申万宏源	147,728,032.87	3.84	133,215,000.00	0.44	—	—	—	—
太平洋证券	5,582,785.06	0.14	—	—	—	—	—	—
银河证券	726,330,304.26	18.86	100,000,000.00	0.33	—	—	4,436,000.00	1.02
浙商证券	35,057,550.22	0.91	109,645,000.00	0.36	—	—	—	—
中金公司	71,581,036.33	1.86	1,370,598,000.00	4.51	—	—	—	—
中信建投	84,306,570.40	2.19	1,064,570,000.00	3.50	—	—	9,271,500.00	2.12
中信证券	21,425,945.99	0.56	—	—	—	—	—	—

11.9 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增聘富国裕利债券型证券投资基金基金经理助理的公告	规定披露媒介	2024年03月06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	2024-09-02 至 2024-10-27;2024-10-29 至 2024-11-12	208,796,842.89	766,565,099.43	166,268,238.92	809,093,703.40	14.77%
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裕利债券型证券投资基金的文件 2、富国裕利债券型证券投资基金基金合同 3、富国裕利债券型证券投资基金托管协议	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

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国裕利债券型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		cn。
---	--	-----