

上证综指交易型开放式指数证券投资基金

二〇二五年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国工商银行股份有限公司

送出日期： 2025 年 08 月 30 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。本中期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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§ 2	基金简介	6
2.1	基金基本情况.....	6
2.2	基金产品说明.....	6
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	7
2.5	其他相关资料.....	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标.....	8
3.2	基金净值表现.....	8
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8	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.....	15
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§ 6	中期财务报告（未经审计）	17
6.1	资产负债表.....	17
6.2	利润表.....	18
6.3	净资产变动表.....	19
6.4	报表附注.....	20
§ 7	投资组合报告	45

7.1	期末基金资产组合情况.....	45
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	46
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
7.6	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.....	58
7.7	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..	58
7.8	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..	58
7.9	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.....	58
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	58
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12	投资组合报告附注.....	59
§ 8	基金份额持有人信息	61
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	61
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	62
§ 9	开放式基金份额变动	63
§ 10	重大事件揭示.....	64
10.1	基金份额持有人大会决议.....	64
10.2	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.....	64
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4	基金投资策略的改变.....	64
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	64
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8	其他重大事件.....	66
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	67
11.1	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	67
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§ 12	备查文件目录.....	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证综指交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	上证综指 ETF
场内简称	上证指数 ETF
基金主代码	510210
交易代码	510210
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2011 年 01 月 30 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,046,192,565.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 3 月 25 日

注：根据 2020 年 7 月 10 日发布的《富国基金管理有限公司关于上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金变更基金扩位简称的公告》，本基金场内简称进行了调整。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的标的指数为上证综合指数。
投资策略	本基金采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标的指数的紧密跟踪。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的最优化目标组合的构建、存托凭证的投资策略、其他金融工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	上证综合指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金，跟踪上证综合指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	郭明
	联系电话	021-20361818	010-66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	95105686、4008880688	95588
传真	021-20361616	010—66105798
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 55 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 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	裴长江	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 55 号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	354,374,168.13
本期利润	288,674,520.99
加权平均基金份额本期利润	0.0458
本期加权平均净值利润率	5.66%
本期基金份额净值增长率	5.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	1,111,609,252.81
期末可供分配基金份额利润	0.2747
期末基金资产净值	3,476,201,771.94
期末基金份额净值	0.859
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	81.13%

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

3.2 基金净值表现

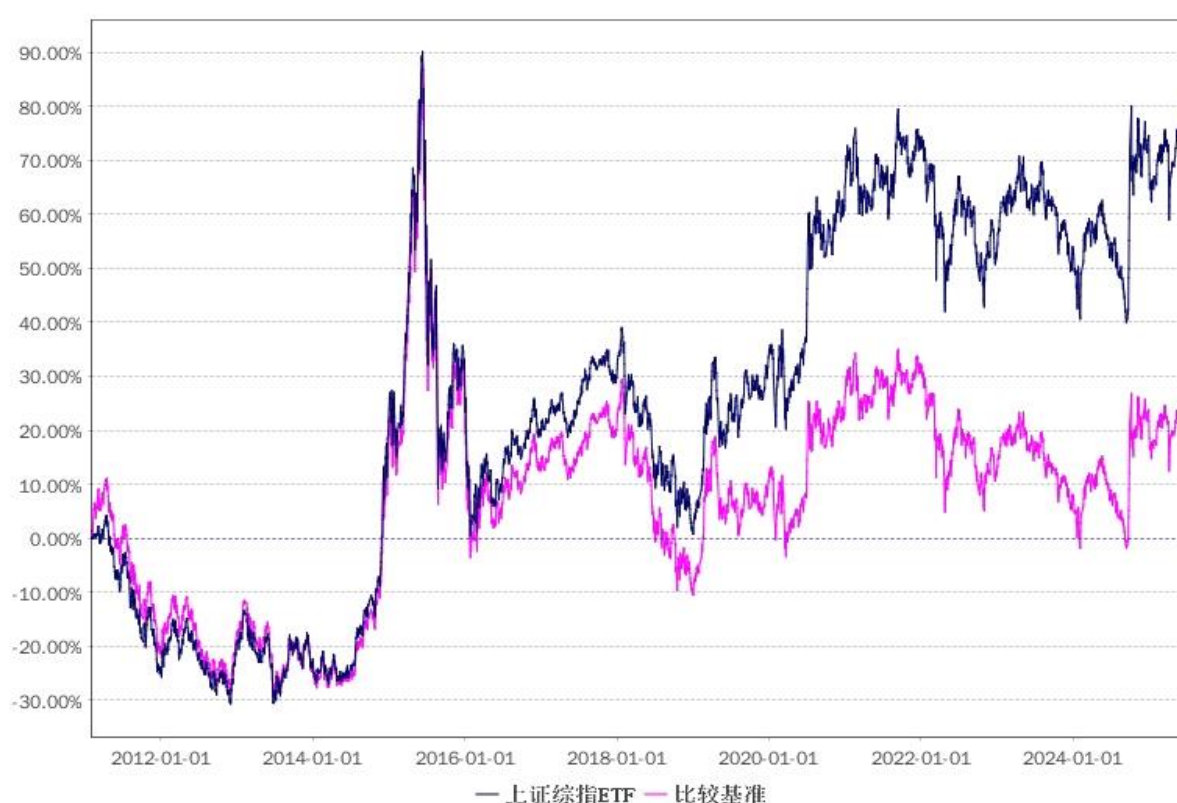
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.62%	0.55%	2.90%	0.55%	0.72%	0.00%
过去三个月	5.53%	1.13%	3.26%	1.11%	2.27%	0.02%
过去六个月	5.40%	1.00%	2.76%	0.99%	2.64%	0.01%
过去一年	17.99%	1.27%	16.08%	1.27%	1.91%	0.00%

过去三年	8.68%	1.00%	1.35%	1.00%	7.33%	0.00%
自基金合同生效起至今	81.13%	1.23%	25.13%	1.25%	56.00%	-0.02%

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

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



注：1、截止日期为2025年6月30日。 2、本基金于2011年1月30日成立，建仓期3个月，从2011年1月30日起至2011年4月29日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 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：国泰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。根据 2025 年 4 月 4 日《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，存续公司正式更名为“国泰海通证券股份有限公司”。

截至 2025 年 6 月 30 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 391 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王保合	本基金现任基金经理	2011-03-03	—	19	博士，自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监、量化与海外投资部量化投资总监、量化投资部总经理；现任富国基金总经理助理，兼任富国基金量化投资部总经理、资深定量基金经理。自 2011 年 03 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2011 年 03 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2015 年 04 月起任富国中证国有企业改革指数型证券投资基金(原富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金)基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证全指证券公司指数型证券投资基金(原富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金)基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证银行指数型证券投资基金(原富国中证银行指数分级证券投资基金)基金经理；自 2020 年 09 月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2022 年 10 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国创业板增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 09 月起任富国致弘量化选股股票型证券投资基金基金经理；自 2023 年 12 月起任富国致航量化选股股票型证

					券投资基金基金经理；自 2025 年 06 月起任富国致享量化选股股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
方旻	本基金现任基金经理	2014-11-19	—	15	硕士，自 2010 年 2 月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、高级定量基金经理、量化投资部量化投资副总监、量化投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼资深定量基金经理。自 2014 年 11 月起任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2018 年 05 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2019 年 01 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自 2020 年 02 月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理；自 2025 年 04 月起任富国致盛量化选股股票型证券投资基金基金经理；自 2025 年 05 月起任富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金经理；自 2025 年 06 月起任富国致享量化选股股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
王保合	公募基金	12	10,758,411,510.56	2011-03-03
	私募资产管理计划	2	57,379,849.61	2025-05-21
	其他组合	1	485,921,174.95	2025-06-27
	合计	15	11,301,712,535.12	

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和相关法规要求，制定了《证券投资公平交易管理办法》，保证公司旗下不同投资组合在系统控制、日常操作层面享有公平的交易机会，并保持各投资组合的独立投资决策权。

本报告期内公司旗下基金严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 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。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间，出现 20 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，为投资组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发

现不公平对待投资组合或利益输送等情况。

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

2025 年初，外部关税担忧给全球风险资产带来扰动，市场迎来快速调整。春节后，国内大模型的出现，缩小了市场对于中美 AI 发展前景的认知差异，市场以 AI 为核心开启了新一轮上行，内外资共振流入重估中国资产。随着两会积极的政策定调、以及一系列更加聚焦需求侧、民生侧的政策密集落地，市场由前期 AI 板块的“一枝独秀”，逐步扩散至消费、金融、周期等低位顺周期板块。4 月初，由于美国对全球加征不合理关税，中国随后进行反制，中美关税摩擦逐步升级，中美进入“不可贸易”状态。美国滥施关税给全球资本市场带来大规模冲击。4 月 8 日，中央汇金发布公告，通过增持 ETF 进入市场，同时中央部门、地方政府与上市公司合力维护市场稳定，指数稳步上行。国内方面，5 月 7 日国内推出一揽子金融支持政策，包含全面降准降息、维护股市楼市。海外方面，中美在关税问题上达成共识，缓解贸易摩擦，该阶段市场普涨。5 月中旬起，由于海外关税存在反复，美债及日债拍卖利率跳升，对全球市场流动性存在扰动，同时伊朗与以色列冲突加剧全球避险情绪，市场整体振幅加大。6 月下旬，随着伊朗与以色列阶段性停火，鲍威尔表态偏鸽、美联储 7 月降息的可能性提升，市场开始反弹。

总体来看，2025 年上半年上证综指上涨 2.76%，沪深 300 上涨 0.03%，创业板指上涨 0.53%，中证 500 指数上涨 3.31%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.859 元；份额累计净值为 1.769 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 5.40%；同期业绩比较基准收益率为 2.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，市场逐步向好的条件在持续累积。随着稳定资本市场政策逐步深入人心，市场对于阶段性宏观数据扰动有所免疫，风险偏好有望提升。伴随着反内卷政策的出台，市场对于短期可能存在的需求回落担忧也有望缓解，着眼未来，在减少资本开支的大背景下，上游周期和中游制造产能过剩情况均有望持续好转，企业盈利有望逐步改善。与此同时，在中美谈判持续推进和国内外 AI 模型持续发展的背景下，科技也有望进一步打开估值空间。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等信息的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	22,950,383.82	13,231,294.05
结算备付金	7,128,444.56	9,265,582.41
存出保证金	105,097.68	281,455.03
交易性金融资产	3,447,601,718.68	6,305,195,316.57
其中：股票投资	3,447,379,706.03	6,305,195,316.57
基金投资	—	—
债券投资	222,012.65	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	3,053,312.89	6,462,392.97
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	3,480,838,957.63	6,334,436,041.03
负债和净资产	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	1,585,808.90	1,210,670.46
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	1,482,065.90	2,820,311.53
应付托管费	296,413.19	564,062.29
应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—
应交税费	0.44	2.28
应付利润	—	—

递延所得税负债	—	—
其他负债	1,272,897.26	1,777,358.45
负债合计	4,637,185.69	6,372,405.01
净资产：		
实收基金	2,364,592,519.13	4,538,558,297.74
其他综合收益	—	—
未分配利润	1,111,609,252.81	1,789,505,338.28
净资产合计	3,476,201,771.94	6,328,063,636.02
负债和净资产总计	3,480,838,957.63	6,334,436,041.03

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.859 元，基金份额总额 4,046,192,565.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	304,471,213.39	141,795,089.09
1. 利息收入	74,198.77	131,607.21
其中：存款利息收入	74,198.77	131,607.21
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	381,129,350.50	-21,668,367.24
其中：股票投资收益	321,524,554.27	-103,481,366.28
基金投资收益	—	—
债券投资收益	123,814.55	400,413.46
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	59,480,981.68	81,412,585.58
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）	-65,699,647.14	164,076,409.31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-11,032,688.74	-744,560.19
减：二、营业总支出	15,796,692.40	21,710,096.92
1. 管理人报酬	12,753,547.31	17,155,245.02
2. 托管费	2,550,709.49	3,431,049.01
3. 销售服务费	—	—
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	0.42	1.22
8. 其他费用	492,435.18	1,123,801.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	288,674,520.99	120,084,992.17
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	288,674,520.99	120,084,992.17
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	288,674,520.99	120,084,992.17

6.3 净资产变动表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2025年01月01日至2025年06月30日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、上期期末净资产	4,538,558,297.74	1,789,505,338.28	6,328,063,636.02
二、本期期初净资产	4,538,558,297.74	1,789,505,338.28	6,328,063,636.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	—	—	—
	2,173,965,778.61	677,896,085.47	2,851,861,864.08
（一）、综合收益总额	—	288,674,520.99	288,674,520.99
（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）	—	—	—
	2,173,965,778.61	966,570,606.46	3,140,536,385.07
其中：1. 基金申购款	4,170,858,538.16	1,485,678,368.73	5,656,536,906.89
2. 基金赎回款	—	—	—
	6,344,824,316.77	2,452,248,975.19	8,797,073,291.96

（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）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	2,364,592,519.13	1,111,609,252.81	3,476,201,771.94
项目	上年度可比期间 （2024年01月01日至2024年06月30日）		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,685,149,924.27	1,414,565,091.27	7,099,715,015.54
二、本期期初净资产	5,685,149,924.27	1,414,565,091.27	7,099,715,015.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	380,444,012.34	76,702,110.82	457,146,123.16
（一）、综合收益总额	—	120,084,992.17	120,084,992.17
（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）	380,444,012.34	—43,382,881.35	337,061,130.99
其中：1. 基金申购款	6,879,549,769.65	1,566,660,188.77	8,446,209,958.42
2. 基金赎回款	—6,499,105,757.31	—1,610,043,070.12	—8,109,148,827.43
（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）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	6,065,593,936.61	1,491,267,202.09	7,556,861,138.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈 戈	林志松	徐慧
_____	_____	_____
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上证综指交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中

国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2010]1379号《关于核准上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2011年1月30日正式生效，首次设立募集规模为320,363,407.00份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在10个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于存托凭证、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人将在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准为上证综合指数。

6.4.2 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3号《半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。

6.4.3 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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2025 年 06 月 30 日)
活期存款	22,950,383.82
等于：本金	22,947,600.30
加：应计利息	2,783.52
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	22,950,383.82

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末（2025年06月30日）			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,278,271,32 3.87	—	3,447,379,70 6.03	169,108,382. 16
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	222,000.00	12.65	222,012.65	—
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	222,000.00	12.65	222,012.65	—
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		3,278,493,32 3.87	12.65	3,447,601,71 8.68	169,108,382. 16

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2025年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—

应付证券出借违约金	—
应付交易费用	593,223.60
其中：交易所市场	593,223.60
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	180,000.00
预提审计费	101,720.30
应付指数使用费	397,953.36
合计	1,272,897.26

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,766,192,565.00	4,538,558,297.74
本期申购	7,137,000,000.00	4,170,858,538.16
本期赎回（以“-”号填列）	-10,857,000,000.00	-6,344,824,316.77
本期末	4,046,192,565.00	2,364,592,519.13

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,784,065,853.13	994,560,514.85	1,789,505,338.28
本期期初	2,784,065,853.13	994,560,514.85	1,789,505,338.28
本期利润	354,374,168.13	65,699,647.14	288,674,520.99
本期基金份额交易产生的变动数	1,429,664,019.75	463,093,413.29	966,570,606.46
其中：基金申购款	2,683,645,391.56	1,197,967,022.83	1,485,678,368.73
基金赎回款	4,113,309,411.31	1,661,060,436.12	2,452,248,975.19
本期已分配利润	—	—	—
本期末	1,708,776,00	—	1,111,609,25

	1.51	597,166,748.70	2.81
--	------	----------------	------

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
活期存款利息收入	61,692.12
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	12,229.92
其他	276.73
合计	74,198.77

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	167,133,376.54
股票投资收益——赎回差价收入	154,391,177.73
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	321,524,554.27

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
卖出股票成交总额	4,816,163,896.55
减：卖出股票成本总额	4,644,617,095.77
减：交易费用	4,413,424.24
买卖股票差价收入	167,133,376.54

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
赎回基金份额对价总额	8,797,073,291.96
减：现金支付赎回款总额	14,935,053.96
减：赎回股票成本总额	8,627,747,060.27
减：交易费用	—
赎回差价收入	154,391,177.73

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
债券投资收益——利息收入	114.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	123,699.67
合计	123,814.55

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	671,832.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	548,000.00
减：应计利息总额	105.70
减：交易费用	26.91
买卖债券差价收入	123,699.67

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
股票投资产生的股利收益	59,480,981.68
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	59,480,981.68

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
1. 交易性金融资产	-65,699,647.14
股票投资	-65,699,647.14
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-65,699,647.14

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
基金赎回费收入	—
替代损益	-11,032,688.74
合计	-11,032,688.74

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
审计费用	33,720.30
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	310.00
指数使用费	397,953.36
其他	451.52
合计	492,435.18

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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吸收合并海通证券股份有限公司。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰海通证券股份有限公司（由国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 4 月变更名称而来，以下简称“国泰海通”）承继及承接海通证券股份有限公司的全部资产、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国泰海通，即国泰海通成为本公司的主要股东。变更后，本公司的股东为国泰海通证券股份有限公司，出资比例为 27.775%；申万宏源证券有限公司，出资比例为 27.775%；加拿大蒙特利尔银行，出资比例为 27.775%；山东省金融资产管理股份有限公司，出资比例为 16.675%。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构（2025 年 3 月 14 日前）
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	基金管理人的股东、基金代销机构（自 2025 年 3 月 14 日起）
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人

富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
--------------------------	----------

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。关联方国泰海通证券有限公司（简称“国泰海通”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原关联方海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2024年01月01日至2024年06月30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（%）
申万宏源	1,241,421,260.41	12.38	5,437,522,921.32	100.00

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2024年01月01日至2024年06月30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（%）
申万宏源	—	—	2,252,513.74	100.00

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2025年01月01日至2025年06月30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（%）
申万宏源	168,703.31	12.38	99,214.66	16.72
关联方名称	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年06月30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（%）
申万宏源	4,001,576.97	100.00	2,559,011.96	100.00

注：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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	12,753,547.31	17,155,245.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,262,951.63	263,963.62
应支付基金管理人的净管理费	10,490,595.68	16,891,281.40

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.50\%/ \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年06月30日）
----	-----------------------------	----------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	2,550,709.49	3,431,049.01
----------------	--------------	--------------

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 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

关联方名称	本期末（2025 年 06 月 30 日）		上年度末（2024 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 (%)
富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	596,489,134.00	14.74	851,697,134.00	10.97
国泰海通证券股份有限公司	2,450.00	—	—	—
海通证券股份有限公司	—	—	937,000.00	0.01
申万宏源证券有限公司	1,923,574.00	0.05	6,123,074.00	0.08

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	22,950,383.82	61,692.12	104,457,109.24	104,890.88

6.4.10.7 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。

6.4.10.8其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股限售	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	—
603049	中策橡胶	2025-05-27	6 个月	新股限售	46.50	42.85	724	33,666.00	31,023.40	—
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股限售	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	—
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月	新股限售	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	—
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新股限售	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	—
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新股限售	93.50	90.66	166	15,521.00	15,049.56	—
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	新股限售	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	—
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	新股限售	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	—
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	新股限售	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	—
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	新股限售	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	—
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	新股限售	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	—
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	新股限售	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	—
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	新股限售	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	—
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新股限售	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	—
688757	胜科纳米	2025-03-18	6 个月	新股限售	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	—
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月	新股限售	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	—
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	新股限售	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	—

6.4.12.1.2 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
------	------	-------	-----	--------	------	--------	--------------	--------	--------	----

111022	锡振转债	2025-06-19	1 个月内 (含)	认购新发 证券	100. 00	100.01	2,220	222,000.00	222,012.65	—
--------	------	------------	--------------	------------	------------	--------	-------	------------	------------	---

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 06 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%，但标的指数成分券不受此限。本基金在交易所进行的交易均

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

6.4.13.2.1 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。

6.4.13.2.2 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（2025 年 06 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
AAA	—	—
AAA 以下	222,012.65	—
未评级	—	—
合计	222,012.65	—

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

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 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（2025 年 06 月 30 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	22,950,383.82	—	—	—	—	—	22,950,383.82
结算备付金	7,128,444.56	—	—	—	—	—	7,128,444.56
存出保证金	105,097.68	—	—	—	—	—	105,097.68
交易性金融资产	—	—	222,012.65	—	—	3,447,379,706.03	3,447,601,718.68
应收清算款	—	—	—	—	—	3,053,312.89	3,053,312.89
资产总计	30,183,926.06	—	222,012.65	—	—	3,450,433,018.92	3,480,838,957.63
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	1,585,808.90	1,585,808.90
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,482,065.90	1,482,065.90
应付托管费	—	—	—	—	—	296,413.19	296,413.19
应交税费	—	—	—	—	—	0.44	0.44
其他负债	—	—	—	—	—	1,272,897.26	1,272,897.26
负债总计	—	—	—	—	—	4,637,185.69	4,637,185.69
利率敏感度缺口	30,183,926.06	—	222,012.65	—	—	3,445,795,833.23	3,476,201,771.94
上年度末（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	13,231,294.05	—	—	—	—	—	13,231,294.05

结算备付金	9,265,582.41	—	—	—	—	—	9,265,582.41
存出保证金	281,455.03	—	—	—	—	—	281,455.03
交易性金融资产	—	—	—	—	—	6,305,195,316.57	6,305,195,316.57
应收清算款	—	—	—	—	—	6,462,392.97	6,462,392.97
资产总计	22,778,331.49	—	—	—	—	6,311,657,709.54	6,334,436,041.03
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	1,210,670.46	1,210,670.46
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,820,311.53	2,820,311.53
应付托管费	—	—	—	—	—	564,062.29	564,062.29
应交税费	—	—	—	—	—	2.28	2.28
其他负债	—	—	—	—	—	1,777,358.45	1,777,358.45
负债总计	—	—	—	—	—	6,372,405.01	6,372,405.01
利率敏感度缺口	22,778,331.49	—	—	—	—	6,305,285,304.53	6,328,063,636.02

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于存托凭证、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人将在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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 (2025 年 06 月 30 日)		上年度末 (2024 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	3,447,379,706.03	99.17	6,305,195,316.57	99.64
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	222,012.65	0.01	—	—

交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	3,447,601,718.68	99.18	6,305,195,316.57	99.64

6.4.13.4.3.2 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 (2025年06月30日)	上年度末 (2024年12月31日)
	1. 业绩比较基准增加 1%	34,643,609.23	62,292,162.10
	2. 业绩比较基准减少 1%	-34,643,609.23	-62,292,162.10

6.4.14 公允价值

6.4.14.1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。

6.4.14.2持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 (2025 年 06 月 30 日)	上年度末 (2024 年 12 月 31 日)
第一层次	3,447,139,796.73	6,292,038,202.04
第二层次	222,012.65	12,993,058.10
第三层次	239,909.30	164,056.43
合计	3,447,601,718.68	6,305,195,316.57

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3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。

6.4.14.4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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 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。

6.4.15.2 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。

§7 投资组合报告

7.1 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	3,447,379,706.03	99.04
	其中：股票	3,447,379,706.03	99.04
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	222,012.65	0.01
	其中：债券	222,012.65	0.01
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	30,078,828.38	0.86
8	其他各项资产	3,158,410.57	0.09
9	合计	3,480,838,957.63	100.00

注：上表中的股票投资金额含可退替代款估值增值

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	13,882,277.44	0.40
B	采矿业	277,957,610.22	8.00
C	制造业	1,371,480,647.84	39.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	191,198,863.32	5.50
E	建筑业	70,132,914.18	2.02
F	批发和零售业	40,426,449.82	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	156,488,710.53	4.50
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	211,210,611.44	6.08
J	金融业	929,161,437.12	26.73

K	房地产业	66,209,629.75	1.90
L	租赁和商务服务业	26,866,938.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	46,363,122.46	1.33
N	水利、环境和公共设施管理业	3,407,040.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	3,569,375.00	0.10
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	38,732,293.00	1.11
S	综合	—	—
	合计	3,447,087,920.12	99.16

7.2.1.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	223,082.80	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	16,826.50	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	239,909.30	0.01

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601288	农业银行	23,905,139	140,562,217.32	4.04
2	600519	贵州茅台	63,565	89,596,138.80	2.58

3	601857	中国石油	10,073,045	86,124,534.75	2.48
4	600900	长江电力	2,100,985	63,323,687.90	1.82
5	600036	招商银行	1,099,885	50,539,715.75	1.45
6	601728	中国电信	6,391,018	49,530,389.50	1.42
7	601988	中国银行	8,647,211	48,597,325.82	1.40
8	600919	江苏银行	4,046,761	48,318,326.34	1.39
9	601658	邮储银行	8,412,700	46,017,469.00	1.32
10	601899	紫金矿业	2,280,900	44,477,550.00	1.28
11	601166	兴业银行	1,790,933	41,800,376.22	1.20
12	601319	中国人保	4,573,100	39,831,701.00	1.15
13	601628	中国人寿	889,751	36,648,843.69	1.05
14	601318	中国平安	659,740	36,602,375.20	1.05
15	601225	陕西煤业	1,865,800	35,897,992.00	1.03
16	601328	交通银行	4,474,502	35,796,016.00	1.03
17	600276	恒瑞医药	666,077	34,569,396.30	0.99
18	603288	海天味业	832,915	32,408,722.65	0.93
19	600000	浦发银行	2,173,865	30,173,246.20	0.87
20	600096	云天化	1,330,119	29,222,714.43	0.84
21	603259	药明康德	417,558	29,041,158.90	0.84
22	601138	工业富联	1,334,600	28,533,748.00	0.82
23	601668	中国建筑	4,805,791	27,729,414.07	0.80
24	600999	招商证券	1,512,498	26,604,839.82	0.77
25	605499	东鹏饮料	84,300	26,474,415.00	0.76
26	600031	三一重工	1,465,210	26,300,519.50	0.76
27	600926	杭州银行	1,527,700	25,695,914.00	0.74
28	600030	中信证券	927,389	25,614,484.18	0.74
29	601169	北京银行	3,716,743	25,385,354.69	0.73
30	688041	海光信息	177,325	25,054,249.25	0.72
31	601088	中国神华	617,801	25,045,652.54	0.72
32	600482	中国动力	1,082,201	24,966,377.07	0.72
33	601998	中信银行	2,902,728	24,673,188.00	0.71
34	601985	中国核电	2,623,200	24,448,224.00	0.70
35	600809	山西汾酒	135,268	23,859,922.52	0.69
36	600415	小商品城	1,138,200	23,537,976.00	0.68
37	601600	中国铝业	3,212,900	22,618,816.00	0.65
38	601009	南京银行	1,889,173	21,952,190.26	0.63
39	600299	安迪苏	2,222,000	21,442,300.00	0.62
40	688321	微芯生物	868,154	20,644,702.12	0.59
41	601766	中国中车	2,923,300	20,580,032.00	0.59
42	601601	中国太保	536,700	20,131,617.00	0.58
43	603993	洛阳钼业	2,367,360	19,933,171.20	0.57

44	601816	京沪高铁	3,332,100	19,159,575.00	0.55
45	600663	陆家嘴	2,146,996	19,022,384.56	0.55
46	600066	宇通客车	758,000	18,843,880.00	0.54
47	600015	华夏银行	2,368,487	18,734,732.17	0.54
48	600109	国金证券	2,123,300	18,621,341.00	0.54
49	601919	中远海控	1,217,820	18,316,012.80	0.53
50	601989	中国重工	3,937,500	18,270,000.00	0.53
51	600176	中国巨石	1,488,131	16,964,693.40	0.49
52	603529	爱玛科技	486,800	16,745,920.00	0.48
53	600050	中国联通	3,101,300	16,560,942.00	0.48
54	600585	海螺水泥	768,793	16,505,985.71	0.47
55	600428	中远海特	2,627,425	16,421,406.25	0.47
56	600021	上海电力	1,863,900	16,383,681.00	0.47
57	601688	华泰证券	915,000	16,296,150.00	0.47
58	600578	京能电力	3,623,900	16,271,311.00	0.47
59	600208	衢州发展	5,478,600	16,216,656.00	0.47
60	688256	寒武纪	26,863	16,158,094.50	0.46
61	603071	物产环能	1,265,400	16,108,542.00	0.46
62	601991	大唐发电	5,017,700	15,906,109.00	0.46
63	600968	海油发展	3,898,381	15,905,394.48	0.46
64	600025	华能水电	1,655,266	15,807,790.30	0.45
65	603893	瑞芯微	103,200	15,671,952.00	0.45
66	601877	正泰电器	687,960	15,596,053.20	0.45
67	688225	亚信安全	747,102	15,233,409.78	0.44
68	601377	兴业证券	2,449,786	15,164,175.34	0.44
69	603995	甬金股份	844,900	14,937,832.00	0.43
70	688114	华大智造	228,646	14,823,120.18	0.43
71	600019	宝钢股份	2,157,633	14,218,801.47	0.41
72	600690	海尔智家	555,200	13,757,856.00	0.40
73	600757	长江传媒	1,427,900	13,250,912.00	0.38
74	603379	三美股份	275,000	13,233,000.00	0.38
75	601818	光大银行	3,081,400	12,787,810.00	0.37
76	600760	中航沈飞	217,048	12,723,353.76	0.37
77	603816	顾家家居	466,315	11,900,358.80	0.34
78	600028	中国石化	2,108,438	11,891,590.32	0.34
79	600642	申能股份	1,378,712	11,856,923.20	0.34
80	688183	生益电子	229,557	11,753,318.40	0.34
81	601118	海南橡胶	2,455,402	11,589,497.44	0.33
82	601777	千里科技	1,325,900	11,256,891.00	0.32
83	601111	中国国航	1,413,200	11,150,148.00	0.32
84	600460	士兰微	446,600	11,084,612.00	0.32

85	600489	中金黄金	748,234	10,946,663.42	0.31
86	688588	凌志软件	748,456	10,905,003.92	0.31
87	600004	白云机场	1,178,700	10,726,170.00	0.31
88	603699	纽威股份	332,420	10,361,531.40	0.30
89	688196	卓越新能	212,830	10,230,738.10	0.29
90	688336	三生国健	188,429	10,220,388.96	0.29
91	601928	凤凰传媒	905,500	10,114,435.00	0.29
92	601939	建设银行	1,051,989	9,930,776.16	0.29
93	688278	特宝生物	135,851	9,796,215.61	0.28
94	688008	澜起科技	118,128	9,686,496.00	0.28
95	600183	生益科技	319,500	9,632,925.00	0.28
96	600160	巨化股份	325,900	9,346,812.00	0.27
97	601669	中国电建	1,918,900	9,345,043.00	0.27
98	600377	宁沪高速	589,701	9,046,013.34	0.26
99	600535	天士力	560,013	8,764,203.45	0.25
100	603986	兆易创新	68,000	8,604,040.00	0.25
101	601633	长城汽车	397,093	8,529,557.64	0.25
102	688207	格灵深瞳	562,323	8,491,077.30	0.24
103	688579	山大地纬	756,053	8,460,233.07	0.24
104	601229	上海银行	788,488	8,365,857.68	0.24
105	600018	上港集团	1,454,100	8,302,911.00	0.24
106	600660	福耀玻璃	143,600	8,186,636.00	0.24
107	688692	达梦数据	36,684	8,176,496.76	0.24
108	601117	中国化学	1,065,000	8,168,550.00	0.23
109	601665	齐鲁银行	1,260,300	7,965,096.00	0.23
110	600989	宝丰能源	484,000	7,811,760.00	0.22
111	688252	天德钰	316,331	7,712,149.78	0.22
112	600350	山东高速	713,500	7,605,910.00	0.22
113	600887	伊利股份	270,900	7,552,692.00	0.22
114	603185	弘元绿能	506,869	7,527,004.65	0.22
115	600406	国电南瑞	332,628	7,454,193.48	0.21
116	600901	江苏金租	1,228,897	7,447,115.82	0.21
117	603633	徕木股份	850,600	7,391,714.00	0.21
118	601838	成都银行	365,817	7,352,921.70	0.21
119	600885	宏发股份	328,748	7,334,367.88	0.21
120	601618	中国中冶	2,427,175	7,232,981.50	0.21
121	600941	中国移动	63,300	7,124,415.00	0.20
122	600674	川投能源	443,766	7,118,006.64	0.20
123	601311	骆驼股份	775,500	7,002,765.00	0.20
124	600219	南山铝业	1,728,584	6,620,476.72	0.19
125	688111	金山办公	23,290	6,522,364.50	0.19

126	600352	浙江龙盛	637,400	6,475,984.00	0.19
127	688681	科汇股份	451,098	6,315,372.00	0.18
128	600201	生物股份	783,400	6,282,868.00	0.18
129	688095	福昕软件	91,917	6,242,083.47	0.18
130	600016	民生银行	1,312,700	6,235,325.00	0.18
131	688093	世华科技	200,670	6,230,803.50	0.18
132	601555	东吴证券	707,869	6,193,853.75	0.18
133	600020	中原高速	1,294,714	6,188,732.92	0.18
134	605166	聚合顺	552,600	6,183,594.00	0.18
135	600383	金地集团	1,609,500	6,100,005.00	0.18
136	601021	春秋航空	109,203	6,077,146.95	0.17
137	688238	和元生物	977,112	6,058,094.40	0.17
138	601231	环旭电子	413,382	6,047,778.66	0.17
139	600298	安琪酵母	170,102	5,982,487.34	0.17
140	601825	沪农商行	610,100	5,917,970.00	0.17
141	601965	中国汽研	329,200	5,843,300.00	0.17
142	601577	长沙银行	579,500	5,760,230.00	0.17
143	601066	中信建投	237,500	5,711,875.00	0.16
144	600808	马钢股份	1,652,000	5,699,400.00	0.16
145	600741	华域汽车	322,565	5,693,272.25	0.16
146	600115	中国东航	1,406,900	5,669,807.00	0.16
147	688235	百济神州	24,000	5,607,360.00	0.16
148	600268	国电南自	716,264	5,601,184.48	0.16
149	601689	拓普集团	118,148	5,582,493.00	0.16
150	605117	德业股份	104,110	5,482,432.60	0.16
151	688233	神工股份	171,494	5,448,364.38	0.16
152	688315	诺禾致源	383,893	5,420,569.16	0.16
153	605333	沪光股份	197,100	5,410,395.00	0.16
154	600435	北方导航	346,300	5,398,817.00	0.16
155	601000	唐山港	1,321,151	5,363,873.06	0.15
156	600688	上海石化	1,853,800	5,283,330.00	0.15
157	603885	吉祥航空	385,948	5,198,719.56	0.15
158	688469	芯联集成	1,084,599	5,173,537.23	0.15
159	601128	常熟银行	698,004	5,144,289.48	0.15
160	688009	中国通号	1,000,406	5,142,086.84	0.15
161	600420	国药现代	482,700	5,140,755.00	0.15
162	688512	慧智微	467,278	5,098,002.98	0.15
163	600531	豫光金铅	655,000	5,069,700.00	0.15
164	600301	华锡有色	253,700	5,066,389.00	0.15
165	601528	瑞丰银行	874,980	5,066,134.20	0.15
166	600909	华安证券	863,667	5,035,178.61	0.14

167	688776	国光电气	47,337	4,993,106.76	0.14
168	603328	依顿电子	506,500	4,968,765.00	0.14
169	600029	南方航空	831,800	4,907,620.00	0.14
170	600236	桂冠电力	780,333	4,892,687.91	0.14
171	600707	彩虹股份	756,841	4,889,192.86	0.14
172	600271	航天信息	528,443	4,882,813.32	0.14
173	688578	艾力斯	52,005	4,838,545.20	0.14
174	600150	中国船舶	148,400	4,828,936.00	0.14
175	600418	江淮汽车	119,400	4,786,746.00	0.14
176	605178	时空科技	244,000	4,772,640.00	0.14
177	600061	国投资本	634,477	4,771,267.04	0.14
178	600925	苏能股份	903,002	4,722,700.46	0.14
179	688608	恒玄科技	13,533	4,709,213.34	0.14
180	688191	智洋创新	197,129	4,687,727.62	0.13
181	600547	山东黄金	146,385	4,674,073.05	0.13
182	605305	中际联合	166,800	4,633,704.00	0.13
183	600739	辽宁成大	419,200	4,611,200.00	0.13
184	688689	银河微电	195,548	4,511,292.36	0.13
185	600346	恒力石化	315,321	4,496,477.46	0.13
186	688586	江航装备	396,774	4,463,707.50	0.13
187	601127	赛力斯	33,100	4,445,992.00	0.13
188	688055	龙腾光电	1,193,088	4,414,425.60	0.13
189	688088	虹软科技	90,677	4,375,165.25	0.13
190	600906	财达证券	641,386	4,374,252.52	0.13
191	688276	百克生物	207,075	4,348,575.00	0.13
192	600886	国投电力	294,636	4,342,934.64	0.12
193	600515	海南机场	1,225,800	4,339,332.00	0.12
194	601611	中国核建	471,600	4,334,004.00	0.12
195	600710	苏美达	448,400	4,309,124.00	0.12
196	600643	爱建集团	575,531	4,270,440.02	0.12
197	600988	赤峰黄金	171,600	4,269,408.00	0.12
198	688303	大全能源	200,238	4,269,074.16	0.12
199	600684	珠江股份	950,800	4,212,044.00	0.12
200	601155	新城控股	306,580	4,194,014.40	0.12
201	600267	海正药业	452,800	4,188,400.00	0.12
202	600521	华海药业	224,100	4,174,983.00	0.12
203	603678	火炬电子	108,600	4,130,058.00	0.12
204	601599	浙文影业	1,100,400	4,115,496.00	0.12
205	688270	臻镭科技	87,725	4,084,476.00	0.12
206	688677	海泰新光	103,923	4,054,036.23	0.12
207	688425	铁建重工	987,185	4,027,714.80	0.12

208	600438	通威股份	239,500	4,011,625.00	0.12
209	688549	中巨芯	517,842	4,008,097.08	0.12
210	603596	伯特利	76,020	4,005,493.80	0.12
211	600246	万通发展	655,300	4,003,883.00	0.12
212	688307	中润光学	140,160	3,986,150.40	0.11
213	601811	新华文轩	272,100	3,964,497.00	0.11
214	600380	健康元	356,185	3,928,720.55	0.11
215	688025	杰普特	54,633	3,906,259.50	0.11
216	600085	同仁堂	107,100	3,862,026.00	0.11
217	688562	航天软件	204,802	3,837,989.48	0.11
218	603369	今世缘	97,600	3,799,568.00	0.11
219	688033	天宜新材	591,497	3,791,495.77	0.11
220	688001	华兴源创	149,654	3,781,756.58	0.11
221	605589	圣泉集团	136,100	3,776,775.00	0.11
222	603799	华友钴业	101,650	3,763,083.00	0.11
223	688506	百利天恒	12,671	3,752,136.52	0.11
224	688210	统联精密	164,539	3,751,489.20	0.11
225	600372	中航机载	309,329	3,730,507.74	0.11
226	600038	中直股份	96,100	3,729,641.00	0.11
227	605050	福然德	268,400	3,690,500.00	0.11
228	688510	航亚科技	152,353	3,683,895.54	0.11
229	605080	浙江自然	129,400	3,597,320.00	0.10
230	600732	爱旭股份	272,920	3,575,252.00	0.10
231	600730	中国高科	571,100	3,569,375.00	0.10
232	600770	综艺股份	666,500	3,532,450.00	0.10
233	688518	联赢激光	171,265	3,492,093.35	0.10
234	688373	盟科药业	555,490	3,482,922.30	0.10
235	688682	霍莱沃	110,564	3,460,653.20	0.10
236	601198	东兴证券	305,700	3,408,555.00	0.10
237	600155	华创云信	489,700	3,408,312.00	0.10
238	603177	德创环保	374,400	3,407,040.00	0.10
239	605286	同力日升	85,875	3,402,367.50	0.10
240	603195	公牛集团	70,210	3,387,632.50	0.10
241	688599	天合光能	230,426	3,348,089.78	0.10
242	600537	亿晶光电	1,138,200	3,346,308.00	0.10
243	688031	星环科技	71,631	3,340,153.53	0.10
244	601888	中国中免	54,600	3,328,962.00	0.10
245	601006	大秦铁路	502,400	3,315,840.00	0.10
246	601881	中国银河	190,899	3,273,917.85	0.09
247	688387	信科移动	577,717	3,264,101.05	0.09
248	600483	福能股份	336,100	3,240,004.00	0.09

249	603661	恒林股份	112,900	3,228,940.00	0.09
250	603421	鼎信通讯	479,700	3,228,381.00	0.09
251	605319	无锡振华	94,400	3,224,704.00	0.09
252	603057	紫燕食品	147,500	3,224,350.00	0.09
253	601222	林洋能源	564,700	3,218,790.00	0.09
254	600958	东方证券	332,000	3,213,760.00	0.09
255	601098	中南传媒	244,600	3,209,152.00	0.09
256	603008	喜临门	183,400	3,205,832.00	0.09
257	688778	厦钨新能	57,321	3,205,390.32	0.09
258	603169	兰石重装	406,500	3,203,220.00	0.09
259	688012	中微公司	17,427	3,176,942.10	0.09
260	601336	新华保险	54,300	3,176,550.00	0.09
261	600801	华新水泥	267,200	3,163,648.00	0.09
262	601800	中国交建	353,369	3,141,450.41	0.09
263	601298	青岛港	361,300	3,139,697.00	0.09
264	603939	益丰药房	128,260	3,138,522.20	0.09
265	601100	恒立液压	42,939	3,091,608.00	0.09
266	688690	纳微科技	135,350	3,090,040.50	0.09
267	601678	滨化股份	744,206	3,081,012.84	0.09
268	601058	赛轮轮胎	234,210	3,072,835.20	0.09
269	688371	菲沃泰	185,313	3,068,783.28	0.09
270	601019	山东出版	323,300	3,061,651.00	0.09
271	688523	航天环宇	141,478	3,043,191.78	0.09
272	600630	龙头股份	370,500	3,038,100.00	0.09
273	688348	昱能科技	70,473	3,028,224.81	0.09
274	600728	佳都科技	554,800	3,023,660.00	0.09
275	600820	隧道股份	494,500	3,016,450.00	0.09
276	601898	中煤能源	272,400	2,980,056.00	0.09
277	603517	绝味食品	195,400	2,979,850.00	0.09
278	688198	佰仁医疗	29,000	2,978,010.00	0.09
279	600748	上实发展	959,931	2,966,186.79	0.09
280	688981	中芯国际	33,607	2,963,129.19	0.09
281	603933	睿能科技	171,824	2,958,809.28	0.09
282	600641	万业企业	211,800	2,939,784.00	0.08
283	600143	金发科技	283,406	2,921,915.86	0.08
284	603267	鸿远电子	58,000	2,915,660.00	0.08
285	688126	沪硅产业	155,439	2,909,818.08	0.08
286	603737	三棵树	78,936	2,908,791.60	0.08
287	603444	吉比特	9,600	2,898,720.00	0.08
288	688385	复旦微电	57,915	2,853,472.05	0.08
289	601700	风范股份	604,200	2,821,614.00	0.08

290	601515	东峰集团	730,700	2,791,274.00	0.08
291	605088	冠盛股份	73,300	2,779,536.00	0.08
292	600600	青岛啤酒	39,757	2,761,521.22	0.08
293	601061	中信金属	349,082	2,761,238.62	0.08
294	601012	隆基绿能	182,196	2,736,583.92	0.08
295	601018	宁波港	746,500	2,732,190.00	0.08
296	600702	舍得酒业	53,000	2,724,200.00	0.08
297	605155	西大门	227,500	2,723,175.00	0.08
298	600391	航发科技	92,700	2,706,840.00	0.08
299	688819	天能股份	97,449	2,705,184.24	0.08
300	600033	福建高速	760,800	2,693,232.00	0.08
301	605577	龙版传媒	208,100	2,676,166.00	0.08
302	688007	光峰科技	184,999	2,675,085.54	0.08
303	603390	通达电气	194,100	2,664,993.00	0.08
304	601162	天风证券	540,000	2,662,200.00	0.08
305	603707	健友股份	238,700	2,661,505.00	0.08
306	603992	松霖科技	121,600	2,658,176.00	0.08
307	688589	力合微	123,632	2,644,488.48	0.08
308	600827	百联股份	286,900	2,622,266.00	0.08
309	600320	振华重工	599,846	2,621,327.02	0.08
310	688330	宏力达	100,901	2,591,137.68	0.07
311	688502	茂莱光学	8,992	2,586,638.72	0.07
312	603380	易德龙	97,000	2,580,200.00	0.07
313	603833	欧派家居	45,400	2,562,830.00	0.07
314	603151	邦基科技	126,700	2,559,340.00	0.07
315	603659	璞泰来	136,100	2,555,958.00	0.07
316	688082	盛美上海	22,376	2,549,521.44	0.07
317	600893	航发动力	66,000	2,543,640.00	0.07
318	603188	亚邦股份	600,900	2,535,798.00	0.07
319	603062	麦加芯彩	57,600	2,532,672.00	0.07
320	605058	澳弘电子	82,800	2,530,368.00	0.07
321	601865	福莱特	166,000	2,524,860.00	0.07
322	600233	圆通速递	195,717	2,522,792.13	0.07
323	600570	恒生电子	74,500	2,498,730.00	0.07
324	600312	平高电气	160,400	2,468,556.00	0.07
325	688232	新点软件	81,855	2,458,924.20	0.07
326	601900	南方传媒	157,000	2,455,480.00	0.07
327	688337	普源精电	68,400	2,439,828.00	0.07
328	605056	咸亨国际	157,700	2,428,580.00	0.07
329	600587	新华医疗	159,600	2,416,344.00	0.07
330	600933	爱柯迪	150,600	2,411,106.00	0.07

331	600717	天津港	526,367	2,400,233.52	0.07
332	601608	中信重工	548,200	2,395,634.00	0.07
333	600284	浦东建设	362,482	2,392,381.20	0.07
334	603386	骏亚科技	189,000	2,390,850.00	0.07
335	601698	中国卫通	116,600	2,386,802.00	0.07
336	601233	桐昆股份	223,600	2,370,160.00	0.07
337	688363	华熙生物	45,983	2,361,227.05	0.07
338	600104	上汽集团	146,500	2,351,325.00	0.07
339	600353	旭光电子	176,100	2,349,174.00	0.07
340	600259	广晟有色	44,200	2,347,904.00	0.07
341	603683	晶华新材	159,400	2,341,586.00	0.07
342	688139	海尔生物	75,630	2,336,210.70	0.07
343	600557	康缘药业	157,900	2,333,762.00	0.07
344	600497	驰宏锌锗	437,846	2,316,205.34	0.07
345	600598	北大荒	159,000	2,292,780.00	0.07
346	600487	亨通光电	148,800	2,276,640.00	0.07
347	603266	天龙股份	120,900	2,269,293.00	0.07
348	600386	北巴传媒	491,600	2,246,612.00	0.06
349	601126	四方股份	137,300	2,233,871.00	0.06
350	688768	容知日新	50,178	2,227,401.42	0.06
351	600563	法拉电子	20,348	2,219,763.32	0.06
352	600895	张江高科	86,200	2,215,340.00	0.06
353	603719	良品铺子	181,100	2,200,365.00	0.06
354	600863	内蒙华电	534,743	2,197,793.73	0.06
355	605068	明新旭腾	122,100	2,194,137.00	0.06
356	600079	人福医药	103,900	2,179,822.00	0.06
357	603197	保隆科技	55,300	2,160,571.00	0.06
358	688327	云从科技	155,470	2,143,931.30	0.06
359	600330	天通股份	298,900	2,143,113.00	0.06
360	600285	羚锐制药	93,300	2,115,111.00	0.06
361	600141	兴发集团	102,300	2,100,219.00	0.06
362	600699	均胜电子	119,700	2,087,568.00	0.06
363	600273	嘉化能源	246,400	2,084,544.00	0.06
364	603501	豪威集团	16,264	2,076,099.60	0.06
365	603170	宝立食品	165,000	2,057,550.00	0.06
366	601799	星宇股份	16,400	2,050,000.00	0.06
367	600927	永安期货	137,709	2,039,470.29	0.06
368	600742	富维股份	213,900	2,034,189.00	0.06
369	600516	方大炭素	425,347	1,973,610.08	0.06
370	600256	广汇能源	326,300	1,964,326.00	0.06
371	601990	南京证券	233,500	1,886,680.00	0.05

372	600023	浙能电力	354,200	1,877,260.00	0.05
373	601107	四川成渝	309,000	1,860,180.00	0.05
374	600938	中国海油	65,500	1,710,205.00	0.05
375	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
376	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
377	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
378	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
379	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
380	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
381	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
382	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
383	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
384	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
385	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
386	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
387	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
388	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
389	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
390	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
391	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601899	紫金矿业	57,568,834.00	0.91
2	600036	招商银行	54,556,761.00	0.86
3	600031	三一重工	52,222,623.67	0.83
4	601288	农业银行	51,942,467.00	0.82
5	601088	中国神华	43,047,964.00	0.68
6	601601	中国太保	41,175,155.00	0.65
7	601728	中国电信	39,717,020.00	0.63
8	601985	中国核电	39,191,486.00	0.62
9	688256	寒武纪	38,390,760.65	0.61
10	601857	中国石油	37,889,067.00	0.60
11	601988	中国银行	36,603,900.00	0.58
12	600900	长江电力	36,479,581.00	0.58
13	601689	拓普集团	36,379,907.19	0.57
14	601225	陕西煤业	36,339,193.00	0.57
15	600276	恒瑞医药	35,975,716.00	0.57

16	688321	微芯生物	35,851,708.79	0.57
17	600415	小商品城	35,268,587.00	0.56
18	600096	云天化	33,185,549.00	0.52
19	603369	今世缘	33,165,432.00	0.52
20	600299	安迪苏	33,081,489.00	0.52

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。

7.4.2 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	688385	复旦微电	384,158,352.92	6.07
2	600519	贵州茅台	127,422,133.45	2.01
3	601088	中国神华	74,583,129.00	1.18
4	600028	中国石化	59,633,479.98	0.94
5	601988	中国银行	50,380,780.00	0.80
6	600418	江淮汽车	39,771,014.44	0.63
7	601288	农业银行	34,099,400.00	0.54
8	601127	赛力斯	32,716,509.53	0.52
9	600036	招商银行	31,943,722.00	0.50
10	601899	紫金矿业	30,634,011.00	0.48
11	601985	中国核电	26,283,930.00	0.42
12	603501	豪威集团	26,003,870.25	0.41
13	601628	中国人寿	25,072,798.00	0.40
14	600900	长江电力	24,836,300.00	0.39
15	600893	航发动力	24,578,740.00	0.39
16	600887	伊利股份	24,417,390.00	0.39
17	600958	东方证券	24,114,648.72	0.38
18	688256	寒武纪	23,688,763.91	0.37
19	601689	拓普集团	23,500,903.00	0.37
20	688700	东威科技	23,441,567.80	0.37

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。

7.4.3 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	5,211,100,339.39
卖出股票收入（成交）总额	4,816,163,896.55

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。

7.5 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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	222,012.65	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	222,012.65	0.01

7.6 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	111022	锡振转债	2,220	222,012.65	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

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。

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	105,097.68
2	应收清算款	3,053,312.89
3	应收股利	—
4	应收利息	—

5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,158,410.57

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688775	影石创新	71,143.68	0.00	新股限售
2	603049	中策橡胶	31,023.40	0.00	新股限售
3	688545	兴福电子	26,788.30	0.00	新股限售
4	688583	思看科技	18,087.36	0.00	新股限售
5	603202	天有为	15,049.56	0.00	新股限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		富国上证综指交易型 开放式指数证券投资 基金联接基金	
		持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
87,453	46,267.05	1,417,166, 824.00	35.02	2,629,025, 741.00	64.98	596,489,13 4.00	14.74

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例 （%）
1	友邦人寿保险有限公司—传统	175,163,300.00	4.33
2	国联人寿保险股份有限公司—分红 产品一号	69,637,800.00	1.72
3	国联人寿保险股份有限公司—自有 资金	66,829,400.00	1.65
4	中银三星人寿保险有限公司—万能	62,625,000.00	1.55
5	国联人寿保险股份有限公司—分红 产品三号	57,926,400.00	1.43
6	张序宝	50,398,400.00	1.25
7	友邦人寿保险有限公司—分红	44,695,900.00	1.10
8	中银三星人寿保险有限公司—分红	27,280,000.00	0.67
9	国寿永丰企业年金集合计划—中国 农业银行股份有限公司	27,140,600.00	0.67
10	侯宏国	21,725,200.00	0.54
11	富国上证综指交易型开放式指数证 券投资基金联接基金	596,489,134.00	14.74

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年01月30日)基金份额总额	320,363,407.00
报告期期初基金份额总额	7,766,192,565.00
本报告期基金总申购份额	7,137,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	10,857,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	4,046,192,565.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	1	—	—	—	—	—
东吴证券	1	—	—	—	—	—

华泰证券	1	3,632,741,214 .97	36.23	493,776.89	36.24	—
申万宏源	1	1,241,421,260 .41	12.38	168,703.31	12.38	—
银河证券	2	5,151,861,116 .10	51.38	700,185.88	51.38	—

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金新增券商交易单元：东吴证券（723506）。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）
长江证券	—	—	—	—	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
银河证券	671,832.28	100.00	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于变更主要股东事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告	规定披露媒介	2025年01月21日
2	富国基金管理有限公司关于公司主要股东变更的公告	规定披露媒介	2025年03月18日
3	关于富国基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	规定披露媒介	2025年03月20日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，根据中国证券监督管理委员会于 2025 年 1 月 17 日出具的《关于同意国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司并募集配套资金注册、核准国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司、海富通基金管理有限公司变更主要股东及实际控制人、富国基金管理有限公司变更主要股东、海通期货股份有限公司变更主要股东及实际控制人的批复》，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，并依法承接富国基金管理有限公司 14,443 万元出资（占注册资本比例 27.775%）。自吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安成为基金管理人的主要股东。具体可参见基金管理人于 2025 年 1 月 21 日发布的《富国基金管理有限公司关于变更主要股东事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告》、2025 年 3 月 18 日发布的《富国基金管理有限公司关于公司主要股东变更的公告》。根据国泰海通证券股份有限公司于 2025 年 4 月 4 日发布的相关公告，国泰君安的公司名称变更为国泰海通证券股份有限公司。

二、本报告期内，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规的规定和基金合同的约定，为降低投资者的理财成本，经与本基金托管人协商一致，自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费调整为由基金管理人承担，并相应修订基金合同有关内容。具体可参见基金管理人于 2025 年 3 月 20 日发布的《关于富国基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》及修订后的基金合同、托管协议等法律文件。

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