

富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金

二〇二二年年度报告

2022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：交通银行股份有限公司

送出日期：2023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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 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 2022 年 5 月 17 日（基金合同生效日）起至 2022 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介 .....	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	13
§4 管理人报告 .....	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告 .....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	19
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 .....	19
§5 托管人报告 .....	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	19
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.....	20
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 .....	20
§6 审计报告 .....	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§7 年度财务报告 .....	23
7.1 资产负债表.....	23

7.2 利润表.....	24
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告.....	56
8.1 期末基金资产组合情况.....	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	56
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.....	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
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.....	63
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.....	63
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.....	63
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.....	63
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
8.12 投资组合报告附注.....	64
§9 基金份额持有人信息.....	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
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.....	66
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	66
§10 开放式基金份额变动.....	66
§11 重大事件揭示.....	67
11.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
11.4 基金投资策略的改变.....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	67
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
11.8 其他重大事件.....	70
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
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.....	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	71

§13 备查文件目录 ..... 71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金	
基金简称	富国沪港深优质资产混合发起式	
基金主代码	013989	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年05月17日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	20,432,996.77份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国沪港深优质资产混合发起式A	富国沪港深优质资产混合发起式C
下属分级基金的交易代码	013989	013990
报告期末下属分级基金的份额总额	14,676,185.22份	5,756,811.55份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选个股和风险控制，力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将以“深入研究、自下而上、尊重个性、长期回报”为投资理念，结合定性与定量的分析方法，并将投资理念和分析方法贯穿于资产配置、行业配置、个股选择以及组合风险管理的全过程。在股票投资方面，本基金股票池的构建将精选基本面良好、有长期投资价值的优质企业，挑选出高性价比的上市公司股票进行投资，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。在债券投资方面，本基金将采用久期控制下的主动性投资策略；本基金的股指期货投资策略、国债期货、股票期权投资策略和资产支持证券投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	恒生港股通指数收益率（经汇率调整后）×40%+沪深300指数收益率×40%+中债综合全价指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资港股通标的股票，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	交通银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	赵瑛	陆志俊
	联系电话	021-20361818	95559
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话	95105686、4008880688	95559	
传真	021-20361616	021-62701216	
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	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188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	中国(上海)长宁区仙霞路18号	
邮政编码	200120	200336	
法定代表人	裴长江	任德奇	

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 交通银行股份有限公司 中国(上海)长宁区仙霞路18号

## 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) 富国沪港深优质资产混合发起式 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022年5月17日(基金合同生效日)至2022年12月31日
本期已实现收益	-1,539,075.37
本期利润	-810,233.46
加权平均基金份额本期利润	-0.0519
本期加权平均净值利润率	-5.26%
本期基金份额净值增长率	-5.83%
3.1.2 期末数据和指标	2022年12月31日
期末可供分配利润	-1,505,217.06
期末可供分配基金份额利润	-0.1026
期末基金资产净值	13,820,381.93
期末基金份额净值	0.9417
3.1.3 累计期末指标	2022年12月31日
基金份额累计净值增长率	-5.83%

(2) 富国沪港深优质资产混合发起式C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022年5月17日(基金合同生效日)至2022年12月31日
本期已实现收益	-525,628.41
本期利润	-269,556.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0489
本期加权平均净值利润率	-4.96%
本期基金份额净值增长率	-6.18%
3.1.2 期末数据和指标	2022年12月31日
期末可供分配利润	-610,023.37
期末可供分配基金份额利润	-0.1060
期末基金资产净值	5,400,828.31
期末基金份额净值	0.9382
3.1.3 累计期末指标	2022年12月31日
基金份额累计净值增长率	-6.18%

注：本基金于2022年5月17日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。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) 富国沪港深优质资产混合发起式 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	-0.73%	1.20%	6.86%	1.32%	-7.59%	-0.12%
过去六个月	-13.10%	1.11%	-7.32%	1.08%	-5.78%	0.03%
自基金合同生效起至今	-5.83%	1.10%	0.30%	1.07%	-6.13%	0.03%

##### (2) 富国沪港深优质资产混合发起式 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	-0.87%	1.20%	6.86%	1.32%	-7.73%	-0.12%
过去六个月	-13.35%	1.12%	-7.32%	1.08%	-6.03%	0.04%
自基金合同生效起至今	-6.18%	1.11%	0.30%	1.07%	-6.48%	0.04%

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沪港深优质资产混合发起式 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 2022 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2022 年 5 月 17 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期 6 个月，从 2022 年 5 月 17 日起至 2022 年 11 月 16 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沪港深优质资产混合发起式 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

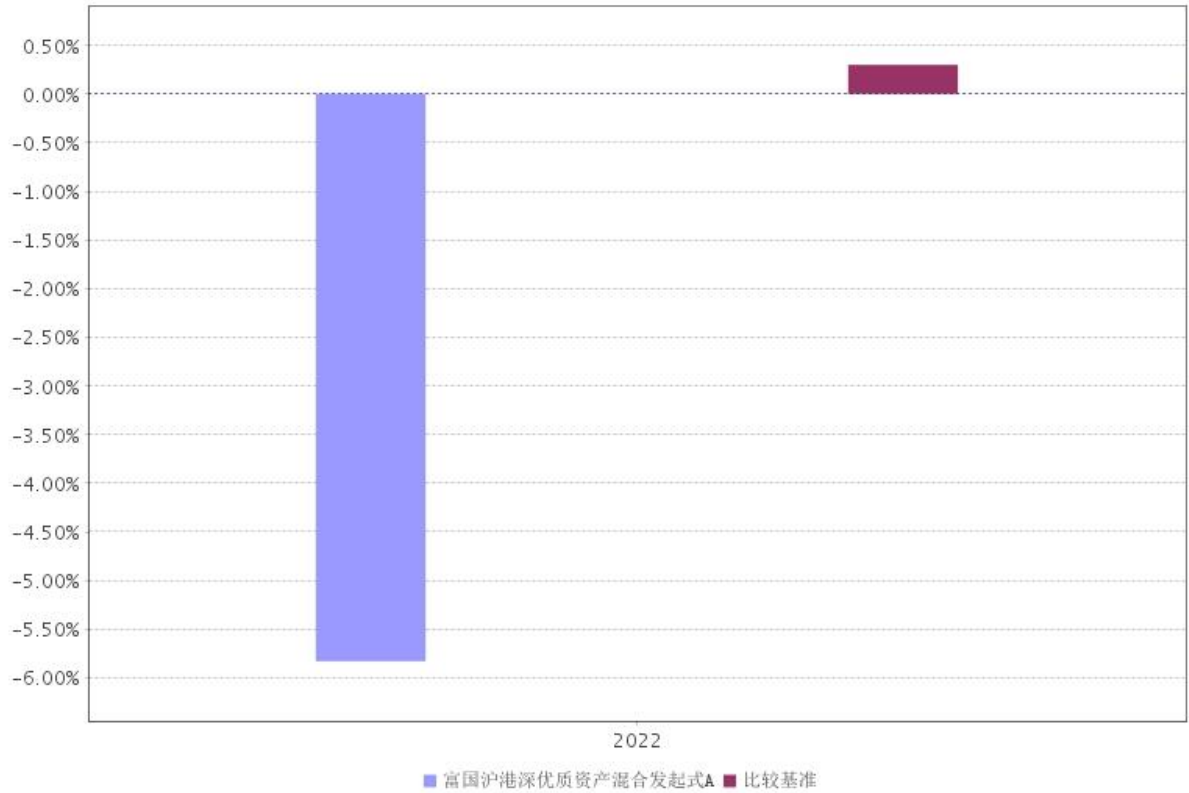


注：1、截止日期为 2022 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2022 年 5 月 17 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期 6 个月，从 2022 年 5 月 17 日起至 2022 年 11 月 16 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

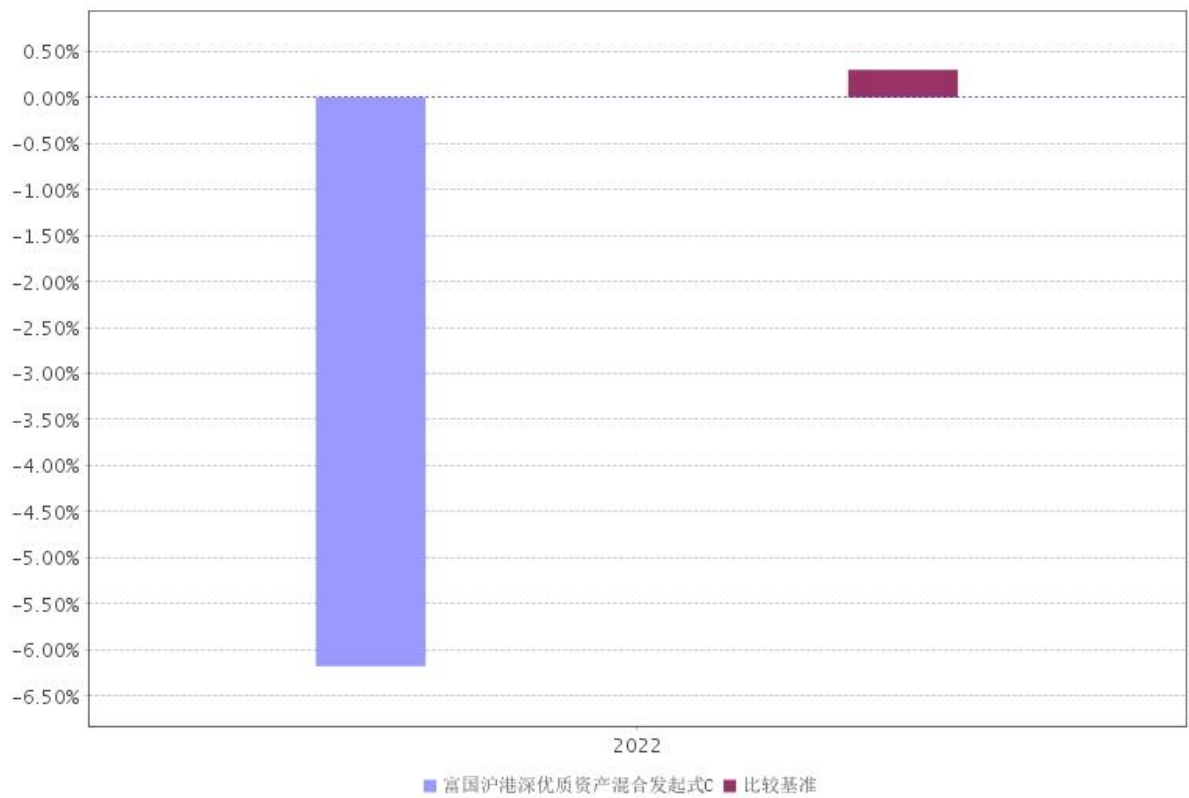
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 自基金合同生效以来富国沪港深优质资产混合发起式 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沪港深优质资产混合发起式 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。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

(1) 富国沪港深优质资产混合发起式 A

注：本基金 2022 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日未进行利润分配

(2) 富国沪港深优质资产混合发起式 C

注：本基金 2022 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 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。

截至 2022 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 287 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		
赵年坤	本基金现任基金经理	2022-07-07	—	9	硕士，曾任富达国际（香港）有限公司上海代表处股票分析师；自 2017 年 6 月加入富国基金管理有限公司，历任高级 QDII 研究员；现任富国基金海外权益投资部 QDII 基金经理。自 2020 年 08 月起任富国民裕进取沪港深成长精选混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 07 月起任富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
张峰	本基金现任基金经理	2022-05-17	—	21	硕士，曾任摩根士丹利股票研究助理，里昂证券分析员，摩根大通执行董事，美林证券高级董事；自 2009 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任周期行业负责人、QDII 基金经理、量化与海外投资部海外投资副总监、量化与海外投资部海外投资总监、海外权益投资部总经理；现任富国基金总经理助理，兼任富国基金海外权益投资部总经理、资深 QDII 基金经理。自 2012 年 09 月起任富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金（原富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金）基金经理；自 2019 年 05 月起任富国民裕进取沪港深成长精选混合型证券投资基金基金经理；自 2019 年 08 月起任富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）基金经理；自 2021 年 03 月起任富国沪港深业绩驱动混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 05 月起任富国沪港深优质资产混合型发起式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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### **4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明**

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国沪港深优质资产混合型发起式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》、《富国沪港深优质资产混合型发起式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未出现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**

受制于全球通胀和流动性压力、国内疫情和地产下行等压力，2022年A股、港股市场整体下行。随着4季度国内疫情政策和地产融资政策的积极调整，市场出现较大幅度反弹。全球流动性方面，伴随着中国疫情放开和欧洲经济好于预期，美联储收缩流动性的步伐进入后半段，美元指数触顶回落。

我们认为疫情管控放松的背景下，2023年的中国经济值得期待，随着全球流动性环境改善，我们对2023年的市场不悲观。在4季度，我们维持了对于长期看好公司较高的仓位，我们认为这些公司依然可以为持有人提供较好的风险回报比。我们也在积极寻找新的投资机会，不断拓展能力圈，希望能在2023年为



投资人找到更多长坡厚雪且估值合理的公司买入持有。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金份额净值 A 级为 0.9417 元，C 级为 0.9382 元；份额累计净值 A 级为 0.9417 元，C 级为 0.9382 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为-5.83%，C 级为-6.18%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 0.30%，C 级为 0.30%。

#### **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 2023 年，我们认为中国经济随着疫情政策放开温和复苏，很多股票依然体现出较高的风险回报比，因此我们对市场整体不悲观。我们看好线下消费场景和出行链复苏带来的超预期修复，同时继续看好双碳和互联网大型公司能够在复苏过程中继续成长。

我们在 2023 年希望继续提升投资研究能力，进而争取好的业绩。从个股研究的角度，我们需要进一步加强个股研究的深度，更好的理解企业如何构成竞争优势，更好的理解股票波动的驱动因素。从基金组合管理的角度，我们需要更好的理解宏观，进一步做好跨行业比较，更好的理解不同行业的定价方式，争取做好行业配置。

#### **4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告**

本基金管理人始终坚持持有人利益优先原则，报告期内持续完善内控管理机制，全方位推动监察稽核工作深入开展。在基础性工作的基础上，2022 年本基金管理人重点开展的监察稽核工作包括以下方面：

##### **（一）持续推进制度流程建设，保障业务合规开展**

公司以建立重点业务内控制度体系，规范各业务部门内部管理为重点，持续强化公司内控与风险防范水平。报告期内，公司新增、修订多项内部管理制度，并以制度为基础相应完善业务流程。

##### **（二）深入进行新规学习，扎实推动新规落地**

2022 年度，公司从新规解读、制度建立、系统建设、流程改造等方面持续推进各项重要法律法规、监管要求的落地工作，并对落地情况开展专项检查，确保各项业务合法合规开展。

##### **（三）夯实合规管理架构，强化合规管理职能**

公司以持续完善合规考核体系、优化专兼合规会议机制等作为抓手，加强一道防线合规履职效能，强化合规管理成效，推动合规工作深入开展。

#### （四）多措并举，全面提升员工合规意识

为持续提高全员合规意识，公司对新员工、特定业务条线员工、全体员工组织不同侧重点的合规培训与宣导，结合合规谈话及合规考试，多维度、多层次地进行文化贯宣，全面提升员工合规意识。

#### （五）立足于合规，不断拓展风险管理职能

报告期内，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，进一步根据系统升级迭代情况整合优化历史风控工具。公司持续强化合规风控培训工作，提升各部门主动合规的能力和意识。投资风险管理方面，公司针对各类投资品种开展风险管理系列专项工作，加强日常监测和定期风险评估，持续提升对于各类投资标的的风险管理水平。

#### （六）持续推进合规风控工作的系统化建设

报告期内，公司持续开展合规风控信息化建设，不断提升自主研发能力。通过搭建、完善覆盖事前、事中、事后的风控系统工具体系，助力有效监测、识别投资组合运作过程中的各类风险，提升整体风险防范能力。在合规管理方面，新增或优化系统管理功能模块包括产品营销模块、专兼合规管理模块、新一代报表报送平台等。通过系统建设，提升合规管理工作水平和效率。

#### （七）推动反洗钱工作深入开展

公司高度重视反洗钱工作，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求。除在客户尽职调查、大额和可疑交易报告、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，主要重点工作包括机构洗钱和恐怖融资风险自评估、新产品新业务洗钱风险评估、反洗钱系统建设、多层次立体化文化宣贯等。

#### （八）加强内部审计，发挥第三道防线功能

公司围绕各条线各部门制度框架体系建立情况、法规落实情况及当年工作重点开展审计工作。通过基础风险点例行检查与法规落实情况、监管重点排查相结合的方式，持续暴露内控缺陷并督导整改完善，切实起到第三道防线自查自纠、防范风险、保驾护航的作用。

#### （九）全面加强员工行为管理

报告期内，公司持续加强对从业人员的行为管控，内容包括监控录像、电子邮件、电话录音抽查，特定员工通讯工具集中管理，员工证券投资申报管理等方面。通过日常合规管理与定期事后检查相结合的方式，提升全员合规意识，防范利益冲突，确保各项业务合规开展。

#### **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**

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

基金合同生效三年后继续存续的，自基金合同生效满三年后的基金存续期内，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。

## **§ 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，基金托管人在富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利

益的行为。

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

本报告期内，富国基金管理有限公司在富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

## 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

本报告期内，由富国基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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(23)第 P00231 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	富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的富国沪港深优质资产混合型发起式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，公允反映了富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
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

	<p>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，我们独立于富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金，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。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>富国沪港深优质资产混合型发起式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。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的</p>

	<p>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：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对富国沪港深优质资产混合型发起式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沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得</p>
--	--

	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	2023 年 03 月 29 日	

## § 7 年度财务报告

### 7.1 资产负债表

会计主体：富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>	
银行存款	1,778,865.27
结算备付金	285,658.16
存出保证金	17,636.24
交易性金融资产	17,407,013.01
其中：股票投资	17,407,013.01
基金投资	—
债券投资	—
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—
其他投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收清算款	334,383.48
应收股利	710.53
应收申购款	896.74
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	19,825,163.43
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>	
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	509,533.02
应付赎回款	2,387.36
应付管理人报酬	24,301.16
应付托管费	4,050.19
应付销售服务费	2,660.85
应付投资顾问费	—
应交税费	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	61,020.61
负债合计	603,953.19
<b>净资产：</b>	
实收基金	20,432,996.77
其他综合收益	—
未分配利润	-1,211,786.53
净资产合计	19,221,210.24
负债和净资产总计	19,825,163.43

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9407 元，基金份额总额 20,432,996.77 份。其中：富国沪港深优质资产混合发起式 A 份额净值 0.9417 元，份额总额 14,676,185.22 份；富国沪港深优质资产混合发起式 C 份额净值 0.9382 元，份额总额 5,756,811.55 份。本基金合同生效日 2022 年 05 月 17 日。

## 7.2 利润表

会计主体：富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 05 月 17 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2022 年 5 月 17 日 (基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>	-818,322.03
1.利息收入	20,191.48
其中：存款利息收入	20,191.48
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	—
证券出借利息收入	—
其他利息收入	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	-1,836,926.34
其中：股票投资收益	-2,125,407.59
基金投资收益	—



债券投资收益	6,196.40
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	282,284.85
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）	984,914.24
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	13,498.59
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>261,467.51</b>
1. 管理人报酬	194,905.57
2. 托管费	32,484.25
3. 销售服务费	20,277.86
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	—
8. 其他费用	13,799.83
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-1,079,789.54</b>
减：所得税费用	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-1,079,789.54</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>	<b>—</b>
<b>六、综合收益总额</b>	<b>-1,079,789.54</b>

注：本基金合同生效日为2022年5月17日，无上年度同期对比数据。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022年05月17日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2022年5月17日(基金合同生效日) 至2022年12月31日		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、本期期初净资产（基金净值）	22,880,609. 03	—	22,880,609. 03
二、本期增减变动额（减少以“-” 号填列）	2,447,612.2 6	1,211,786.5 3	3,659,398.7 9
(一)、综合收益总额	—	—	—

		1,079,789.54	1,079,789.54
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,447,612.26	-131,996.99	-2,579,609.25
其中: 1. 基金申购款	4,197,435.11	-95,405.44	4,102,029.67
2. 基金赎回款	-6,645,047.37	-36,591.55	-6,681,638.92
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
三、本期期末净资产(基金净值)	20,432,996.77	1,211,786.53	19,221,210.24

注: 本基金合同生效日为 2022 年 5 月 17 日, 无上年度同期对比数据。

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

富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金(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[2022]696号《关于准予富国沪港深优质资产混合型发起式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 4 月 27 日至 2022 年 5 月 13 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 00217 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 5 月 17 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 22,878,375.18 元, 募集资金在募集期间产生的利息为人民币 2,233.85 元, 以上实收基金(本息)合计为人民币 22,880,609.03 元, 折合 22,880,609.03 份基金份额, 其中 A 类基金份额 16,804,242.48 份, C 类基金份额 6,076,366.55 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括内地依法发行上市的股票(包括主板、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、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券)、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、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中，投资于沪深交易所依法发行上市的股票、存托凭证及港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于沪深交易所依法发行上市的股票、存托凭证的比例不低于非现金基金资产的 20%，投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的 20%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票投资的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，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。如果法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：恒生港股通指数收益率(经汇率调整后)×40%+沪深 300 指数收益率×40%+中债综合全价指数收益率×20%。

#### **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、应用指南、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2022年12月31日的财务状况以及2022年5月17日（基金合同生效日）至2022年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **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2022年5月17日（基金合同生效日）至2022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）占基金净值比例计算的金额。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）占基金净值比例计算的金额。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，基金管理人可对本基金进行基金分红；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各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别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性不利影响的前提下，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‰；

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；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### **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）及地方教育费附加。

### 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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 (2022年12月31日)
活期存款	1,778,865.27
等于：本金	1,778,490.17
加：应计利息	375.10
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	1,778,865.27

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2022年12月31日）			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	16,422,098.77	—	17,407,013.01	984,914.24
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	16,422,098.77	—	17,407,013.01	984,914.24

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债，本基金合同生效日为 2022 年 5 月 17 日。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。

### 7.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2022 年 12 月 31 日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	0.03
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	48,020.58
其中：交易所市场	48,020.58
银行间市场	—
应付利息	—
预提审计费	13,000.00
合计	61,020.61

### 7.4.7.7 实收基金

富国沪港深优质资产混合发起式 A：

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日 2022 年 5 月 17 日	16,804,242.48	16,804,242.48
本期申购	1,429,606.43	1,429,606.43
本期赎回（以“-”号填列）	-3,557,663.69	-3,557,663.69

本期末	14,676,185.22	14,676,185.22
-----	---------------	---------------

富国沪港深优质资产混合发起式 C:

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日 2022 年 5 月 17 日	6,076,366.55	6,076,366.55
本期申购	2,767,828.68	2,767,828.68
本期赎回(以“-”号填列)	-3,087,383.68	-3,087,383.68
本期末	5,756,811.55	5,756,811.55

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

富国沪港深优质资产混合发起式 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
基金合同生效日 2022 年 5 月 17 日	—	—	—
本期利润	1,539,075.37	728,841.91	-810,233.46
本期基金份额交易产生的变动数	33,858.31	-79,428.14	-45,569.83
其中：基金申购款	-40,388.88	13,024.84	-27,364.04
基金赎回款	74,247.19	-92,452.98	-18,205.79
本期已分配利润	—	—	—
本期末	1,505,217.06	649,413.77	-855,803.29

富国沪港深优质资产混合发起式 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
基金合同生效日 2022 年 5 月 17 日	—	—	—
本期利润	-525,628.41	256,072.33	-269,556.08
本期基金份额交易产生的变动数	-84,394.96	-2,032.20	-86,427.16
其中：基金申购款	-124,358.47	56,317.07	-68,041.40
基金赎回款	39,963.51	-58,349.27	-18,385.76
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-610,023.37	254,040.13	-355,983.24

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 5 月 17 日(基金合同生效日)
----	-----------------------------

	至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	15,600.50
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	3,512.65
其他	1,078.33
合计	20,191.48

#### 7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	81,895,332.33
减：卖出股票成本总额	83,733,019.40
减：交易费用	287,720.52
买卖股票差价收入	-2,125,407.59

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	5.20
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	6,191.20
合计	6,196.40

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期2022年5月17日(基金合同生效日)至2022年12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	28,197.52
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	22,000.00
减：应计利息总额	5.20
减：交易费用	1.12
债券投资收益-差价收入	6,191.20



#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	282,284.85
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	282,284.85

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	984,914.24
股票投资	984,914.24
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	984,914.24

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	10,495.58
转换费收入	3,003.01
合计	13,498.59

#### 7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 5 月 17 日(基金合同生效 日)至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	13,000.00
信息披露费	—
证券出借违约金	—
其他	799.83
合计	13,799.83

#### 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

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、基金发起人
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

山东省国际信托股份有限公司	基金管理人的股东（2022年12月22日前）
山东省金融资产管理股份有限公司	基金管理人的股东（自2022年12月22日起）
蒙特利尔银行	基金管理人的股东

注：（1）根据富国基金管理有限公司股东会决议，并经中国证监会《关于核准富国基金管理有限公司变更持股5%以上股东的批复》（证监许可[2022]3007号）批准，富国基金管理有限公司原股东山东省国际信托股份有限公司将其持有的富国基金管理有限公司16.675%股权转让给山东省金融资产管理股份有限公司。上述事项已于2022年12月22日完成工商变更登记手续。

（2）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2022年5月17日(基金合同生效日)至 2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额 的比例(%)
海通证券	17,941,248.34	9.86
申万宏源	108,107,041.35	59.38

注：本基金合同生效日为2022年05月17日，无上年度同期对比数据。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为2022年05月17日，无上年度同期对比数据。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金合同生效日为2022年05月17日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。本基金合同生效日为2022年05月17日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2022年5月17日(基金合同生效日)至2022年12月31日			
	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	15,460.44	13.18	5,781.97	12.04
申万宏源	53,218.50	45.36	16,567.27	34.50

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。本基金合同生效日为2022年05月17日。无上年度同期对比数据。

#### 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2022年5月17日(基金合同生效日)至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	194,905.57
其中：支付销售机构的客户维护费	39,888.70

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。本基金合同生效日为2022年5月17日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	32,484.25

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。本基金合同生效日为 2022 年 5 月 17 日，无上年度同期对比数据。

#### 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 2022 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国沪港深优质资产混合发起式 A	富国沪港深优质资产混合发起式 C	合计
富国基金管理有限公司	—	616.84	616.84
海通证券股份有限公司	—	5.76	5.76
交通银行股份有限公司	—	962.70	962.70
合计	—	1,585.30	1,585.30

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。本基金合同生效日为 2022 年 5 月 17 日，无上年度同期对比数据。

#### 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：本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

本基金合同生效日 2022 年 05 月 17 日，无上年度同期对比数据。

#### 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:本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。

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

注:本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2022 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日	
	富国沪港深优质资产混合发起式 A	富国沪港深优质资产混合发起式 C
基金合同生效日(2022 年 05 月 17 日)持有的基金份额	10,000,450.05	—
期初持有的基金份额	—	—
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减:期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	10,000,450.05	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	68.14%	—

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

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。本基金合同生效日为 2022 年 05 月 17 日,无上年度末对比数据。

#### 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 2022 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	1,778,865.27	15,600.50

注：本基金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户的证券交易结算资金余额 2022 年末 285,658.16 元，本基金合同生效日为 2022 年 05 月 17 日，无上年度同期对比数据。

#### 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

本基金无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022 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

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 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
600038	中直股份	2022 年 12 月 26 日	重大事项停牌	46.41	2023 年 01 月 10 日	51.05	4,500.00	211,500.00	208,845.00	—

### **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 2022 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 2022 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### **7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## **7.4.13 金融工具风险及管理**

### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

### **7.4.13.2 信用风险**

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



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

### **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银行存款、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（2022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							
银行存款	1,778,865.27	—	—	—	—	—	1,778,865.27
结算备付金	285,658.16	—	—	—	—	—	285,658.16
存出保证金	17,636.24	—	—	—	—	—	17,636.24
交易性金融资产	—	—	—	—	—	17,407,013.01	17,407,013.01
应收清算款	—	—	—	—	—	334,383.48	334,383.48
应收股利	—	—	—	—	—	710.53	710.53
应收申购款	—	—	—	—	—	896.74	896.74
资产总计	2,082,159.67	—	—	—	—	17,743,003.76	19,825,163.43
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	509,533.02	509,533.02
应付赎回款	—	—	—	—	—	2,387.36	2,387.36
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	24,301.16	24,301.16
应付托管费	—	—	—	—	—	4,050.19	4,050.19
应付销售服务费	—	—	—	—	—	2,660.85	2,660.85
其他负债	—	—	—	—	—	61,020.61	61,020.61
负债总计	—	—	—	—	—	603,953.19	603,953.19
利率敏感度缺口	2,082,159.67	—	—	—	—	17,139,050.57	19,221,210.24

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末未持有债券资产（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。本基金合同生效日为 2022 年 05 月 17 日，无上年度同期对比数据。

#### 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（2022 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	—	8,275,758.01	—	—	8,275,758.01
应收股利	—	710.53	—	—	710.53
资产合计	—	8,276,468.54	—	—	8,276,468.54
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	—	8,276,468.54	—	—	8,276,468.54

##### 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（2022 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币贬值 1%	-82,764.69
	港币相对人民币升值 1%	82,764.69

### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括内地依法发行上市的股票（包括主板、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、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券）、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、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中，投资于沪深交易所依法发行上市的股票、存托凭证及港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于沪深交易所依法发行上市的股票、存托凭证的比例不低于非现金基金资产的 20%，投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的 20%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票投资的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，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。

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（2022 年 12 月 31 日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资	17,407,013.01	90.56
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	17,407,013.01	90.56

#### 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。基金合同生效日为 2022 年 05 月 17 日。

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（2022 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	164,329.28
	2. 业绩比较基准减少 1%	-164,329.28

### 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 (2022年12月31日)
第一层次	17,198,168.01
第二层次	208,845.00
第三层次	—
合计	17,407,013.01

##### 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业务等情况，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	17,407,013.01	87.80
	其中：股票	17,407,013.01	87.80
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	2,064,523.43	10.41
8	其他各项资产	353,626.99	1.78
9	合计	19,825,163.43	100.00

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 7,868,033.84 元，占资产净值比例为 40.93%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 407,724.17 元，占资产净值比例为 2.12%。

### 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	—	—
B	采矿业	199,980.00	1.04
C	制造业	6,964,284.00	36.23
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	187,200.00	0.97
G	交通运输、仓储和邮政业	531,232.00	2.76
H	住宿和餐饮业	233,400.00	1.21
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	632,254.00	3.29
M	科学研究和技术服务业	382,905.00	1.99
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	9,131,255.00	47.51

### 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（%）
工业	2,944,003.54	15.32
通信服务	1,793,060.88	9.33
非日常生活消费品	1,388,579.30	7.22
日常消费品	918,312.82	4.78
金融	520,222.58	2.71
医疗保健	475,755.60	2.48
公用事业	191,606.42	1.00
信息技术	44,216.87	0.23
合计	8,275,758.01	43.06

注：1、以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

2、以上行业分类的统计中已包含沪港通深港通投资的股票。

### 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	03898	时代电气	50,000	1,730,710.63	9.00
2	600519	贵州茅台	1,000	1,727,000.00	8.98
3	00700	腾讯控股	5,700	1,700,607.43	8.85
4	000568	泸州老窖	5,000	1,121,400.00	5.83
5	300750	宁德时代	2,400	944,208.00	4.91
6	01766	中国中车	260,000	731,588.13	3.81
7	00168	青岛啤酒股份	10,000	688,711.17	3.58
8	01880	中国中免	2,200	451,994.62	2.35
8	601888	中国中免	1,000	216,030.00	1.12
9	000858	五粮液	3,000	542,070.00	2.82
10	03690	美团-W	2,700	421,346.53	2.19

11	002415	海康威视	12,000	416,160.00	2.17
12	000729	燕京啤酒	36,900	391,878.00	2.04
13	300416	苏试试验	12,700	382,905.00	1.99
14	002352	顺丰控股	6,000	346,560.00	1.80
15	03320	华润医药	50,000	282,273.32	1.47
16	600754	锦江酒店	4,000	233,400.00	1.21
17	01299	友邦保险	3,000	232,607.51	1.21
18	603596	伯特利	2,800	223,440.00	1.16
19	301102	兆讯传媒	6,000	220,500.00	1.15
20	09979	绿城管理控股	40,000	214,384.80	1.12
21	603032	德新科技	2,400	210,624.00	1.10
22	688385	复旦微电	3,000	209,430.00	1.09
23	600038	中直股份	4,500	208,845.00	1.09
24	603198	迎驾贡酒	3,300	207,174.00	1.08
25	603369	今世缘	4,000	203,600.00	1.06
26	300832	新产业	4,000	200,560.00	1.04
27	600583	海油工程	33,000	199,980.00	1.04
28	300979	华利集团	3,500	199,885.00	1.04
29	002027	分众传媒	29,300	195,724.00	1.02
30	03759	康龙化成	4,000	193,482.28	1.01
31	02380	中国电力	65,000	191,606.42	1.00
32	02357	中航科工	60,000	188,122.66	0.98
33	000963	华东医药	4,000	187,200.00	0.97
34	600009	上海机场	3,200	184,672.00	0.96
35	00939	建设银行	40,000	174,723.61	0.91
36	002920	德赛西威	1,500	158,010.00	0.82
37	02331	李宁	2,000	121,038.09	0.63
38	06690	海尔智家	5,000	118,804.91	0.62
39	09987	百胜中国	300	117,643.66	0.61
40	00291	华润啤酒	2,000	97,455.76	0.51
41	02319	蒙牛乳业	3,000	94,865.27	0.49
42	00941	中国移动	2,000	92,453.45	0.48
43	00520	呷哺呷哺	10,000	79,322.38	0.41
44	02313	申洲国际	1,000	78,429.11	0.41
45	03808	中国重汽	5,000	48,593.89	0.25
46	00696	中国民航信息网络	3,000	44,216.87	0.23
47	02378	保诚	400	39,196.69	0.20
48	03988	中国银行	15,000	38,053.30	0.20
49	01876	百威亚太	1,700	37,280.62	0.19

50	02388	中银香港	1,500	35,641.47	0.19
51	00694	北京首都机场股份	6,000	30,603.43	0.16

#### 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	03898	时代电气	2,863,792.41	14.90
1	688187	时代电气	387,978.50	2.02
2	300750	宁德时代	3,199,944.00	16.65
3	00700	腾讯控股	3,164,333.87	16.46
4	000568	泸州老窖	3,105,078.00	16.15
5	03690	美团-W	2,861,044.48	14.88
6	600519	贵州茅台	2,661,577.00	13.85
7	03606	福耀玻璃	1,572,181.15	8.18
7	600660	福耀玻璃	733,934.00	3.82
8	00168	青岛啤酒股份	1,901,286.71	9.89
9	00941	中国移动	1,419,820.17	7.39
9	600941	中国移动	355,000.00	1.85
10	601888	中国中免	1,125,525.00	5.86
10	01880	中国中免	410,572.10	2.14
11	603179	新泉股份	1,256,472.90	6.54
12	00728	中国电信	910,127.98	4.74
12	601728	中国电信	332,204.00	1.73
13	000858	五粮液	1,177,993.00	6.13
14	600809	山西汾酒	1,147,764.00	5.97
15	600933	爱柯迪	1,140,704.00	5.93
16	002557	洽洽食品	1,042,595.00	5.42
17	002049	紫光国微	1,011,053.00	5.26
18	01299	友邦保险	993,090.13	5.17
19	688390	固德威	982,664.00	5.11
20	688385	复旦微电	908,463.14	4.73
21	00291	华润啤酒	849,991.46	4.42
22	600875	东方电气	434,702.00	2.26
22	01072	东方电气	413,971.98	2.15
23	06690	海尔智家	681,681.38	3.55
23	600690	海尔智家	161,796.00	0.84
24	601799	星宇股份	838,759.00	4.36
25	002517	恺英网络	815,959.00	4.25

26	300035	中科电气	807,479.00	4.20
27	02328	中国财险	795,749.99	4.14
28	02331	李宁	786,572.48	4.09
29	600048	保利发展	786,176.00	4.09
30	301168	通灵股份	783,332.00	4.08
31	00285	比亚迪电子	759,334.05	3.95
32	02238	广汽集团	758,314.48	3.95
33	01766	中国中车	721,784.80	3.76
34	01088	中国神华	706,073.86	3.67
35	03759	康龙化成	467,819.36	2.43
35	300759	康龙化成	228,253.50	1.19
36	300258	精锻科技	678,480.00	3.53
37	00019	太古股份公司 A	653,960.74	3.40
38	00883	中国海油	394,866.26	2.05
38	600938	中国海油	245,291.00	1.28
39	03320	华润医药	632,211.86	3.29
40	603198	迎驾贡酒	621,576.00	3.23
41	300416	苏试试验	615,980.00	3.20
42	688567	孚能科技	613,787.66	3.19
43	603596	伯特利	611,887.00	3.18
44	688148	芳源股份	597,049.63	3.11
45	000729	燕京啤酒	573,488.00	2.98
46	002507	涪陵榨菜	569,020.00	2.96
47	002475	立讯精密	564,695.00	2.94
48	09979	绿城管理控股	562,107.66	2.92
49	300832	新产业	555,262.00	2.89
50	600009	上海机场	554,173.00	2.88
51	00425	敏实集团	553,995.53	2.88
52	002920	德赛西威	548,902.00	2.86
53	601689	拓普集团	539,334.00	2.81
54	02319	蒙牛乳业	521,372.05	2.71
55	03968	招商银行	289,340.06	1.51
55	600036	招商银行	228,950.00	1.19
56	01211	比亚迪	494,448.43	2.57
57	002352	顺丰控股	488,950.00	2.54
58	600546	山煤国际	466,009.00	2.42
59	000596	古井贡酒	460,754.00	2.40
60	603369	今世缘	451,849.00	2.35
61	02269	药明生物	441,698.56	2.30
62	002241	歌尔股份	439,489.00	2.29
63	300014	亿纬锂能	439,231.00	2.29

64	000625	长安汽车	427,343.00	2.22
65	002142	宁波银行	423,283.00	2.20
66	300979	华利集团	421,951.00	2.20
67	002304	洋河股份	416,376.00	2.17
68	002415	海康威视	410,209.00	2.13
69	02669	中海物业	404,820.37	2.11
70	601006	大秦铁路	404,400.00	2.10
71	002050	三花智控	399,577.00	2.08

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	03606	福耀玻璃	1,440,706.72	7.50
1	600660	福耀玻璃	717,506.00	3.73
2	03690	美团-W	2,131,513.67	11.09
3	000568	泸州老窖	2,104,077.00	10.95
4	300750	宁德时代	1,943,204.00	10.11
5	00941	中国移动	1,275,510.24	6.64
5	600941	中国移动	356,397.00	1.85
6	03898	时代电气	1,238,415.50	6.44
6	688187	时代电气	387,488.81	2.02
7	00700	腾讯控股	1,437,148.04	7.48
8	00168	青岛啤酒股份	1,385,771.71	7.21
9	600933	爱柯迪	1,267,119.00	6.59
10	00728	中国电信	887,199.06	4.62
10	601728	中国电信	350,400.00	1.82
11	603179	新泉股份	1,234,875.00	6.42
12	600809	山西汾酒	1,150,526.51	5.99
13	600519	贵州茅台	1,050,344.00	5.46
14	601888	中国中免	996,860.00	5.19
15	688390	固德威	983,736.27	5.12
16	002557	洽洽食品	979,185.00	5.09
17	002049	紫光国微	924,741.00	4.81
18	600875	东方电气	463,618.00	2.41
18	01072	东方电气	438,807.32	2.28
19	02328	中国财险	850,872.31	4.43
20	601799	星宇股份	831,838.00	4.33

21	301168	通灵股份	826,582.00	4.30
22	002517	恺英网络	805,750.00	4.19
23	01299	友邦保险	792,436.27	4.12
24	02238	广汽集团	761,996.26	3.96
25	300035	中科电气	754,781.00	3.93
26	06690	海尔智家	585,857.21	3.05
26	600690	海尔智家	159,894.00	0.83
27	688385	复旦微电	737,047.27	3.83
28	600048	保利发展	728,956.00	3.79
29	00291	华润啤酒	723,670.00	3.76
30	02331	李宁	681,422.41	3.55
31	01088	中国神华	680,939.99	3.54
32	00019	太古股份公 司 A	677,286.77	3.52
33	00285	比亚迪电子	674,458.92	3.51
34	300258	精锻科技	662,390.00	3.45
35	000858	五粮液	610,119.00	3.17
36	00883	中国海油	358,394.82	1.86
36	600938	中国海油	243,117.00	1.26
37	688567	孚能科技	594,322.68	3.09
38	002507	涪陵榨菜	586,749.00	3.05
39	03759	康龙化成	336,489.32	1.75
39	300759	康龙化成	225,885.00	1.18
40	688148	芳源股份	555,729.82	2.89
41	000625	长安汽车	539,540.50	2.81
42	601689	拓普集团	536,882.00	2.79
43	03968	招商银行	283,119.12	1.47
43	600036	招商银行	224,141.00	1.17
44	603596	伯特利	495,822.00	2.58
45	000596	古井贡酒	493,579.00	2.57
46	00425	敏实集团	490,722.32	2.55
47	600546	山煤国际	486,647.00	2.53
48	01211	比亚迪	479,774.91	2.50
49	02269	药明生物	467,049.62	2.43
50	002475	立讯精密	466,290.00	2.43
51	300014	亿纬锂能	446,308.00	2.32
52	002241	歌尔股份	439,576.00	2.29
53	002304	洋河股份	415,231.25	2.16
54	000999	华润三九	412,989.00	2.15
55	002142	宁波银行	411,865.00	2.14
56	601006	大秦铁路	406,800.00	2.12

57	603198	迎驾贡酒	400,527.00	2.08
58	03311	中国建筑国际	395,357.04	2.06
59	002050	三花智控	389,794.00	2.03
60	02319	蒙牛乳业	389,776.31	2.03

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	100,155,118.17
卖出股票收入（成交）总额	81,895,332.33

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，降低投资组合的整体风险。

## 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，以套期保值为目的，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，确定参与国债期货交易的投资时机和投资比例。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，腾讯控股有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。

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

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

### 8.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	17,636.24
2	应收清算款	334,383.48
3	应收股利	710.53
4	应收利息	—
5	应收申购款	896.74
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—



8	其他	—
9	合计	353,626.99

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国沪港深优质资产混合发起式 A	261	56,230.59	10,000,450.05	68.14	4,675,735.17	31.86
富国沪港深优质资产混合发起式 C	628	9,166.90	—	—	5,756,811.55	100.00
合计	889	22,984.25	10,000,450.05	48.94	10,432,546.72	51.06

#### 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	富国沪港深优质资产混合发起式 A	50,623.53	0.3449
	富国沪港深优质资产混合发起式 C	—	—
	合计	50,623.53	0.2478

### 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	富国沪港深优质 资产混合发起式 A	0
	富国沪港深优质 资产混合发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	富国沪港深优质 资产混合发起式 A	0
	富国沪港深优质 资产混合发起式 C	0
	合计	0

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数 (份)	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数 (份)	发起份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	10,000,450.05	48.94	10,000,450.05	48.94	3年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,000,450.05	48.94	10,000,450.05	48.94	3年

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	富国沪港深优质资产 混合发起式 A	富国沪港深优质资产 混合发起式 C
基金合同生效日(2022年05月17日) 基金份额总额	16,804,242.48	6,076,366.55
基金合同生效日2022年5月17日起 至报告期期末基金总申购份额	1,429,606.43	2,767,828.68
减：基金合同生效日2022年5月17	3,557,663.69	3,087,383.68

日起至报告期期末基金总赎回份额		
基金合同生效日 2022 年 5 月 17 日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	14,676,185.22	5,756,811.55

## § 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，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

本报告期本基金管理人无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的机构由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)变更为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。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 1.3 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 1 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长城证券	1	2,216,646.00	1.22	2,042.21	1.74	—
方正证券	2	20,395,819.28	11.20	18,790.64	16.02	—
国泰君安	2	3,946,402.00	2.17	2,879.22	2.45	—
海通证券	1	17,941,248.34	9.86	15,460.44	13.18	—
华泰证券	1	3,363,961.26	1.85	2,772.11	2.36	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	2	108,107,041.35	59.38	53,218.50	45.36	—
银河证券	2	16,072,364.38	8.83	14,462.24	12.33	—
招商证券	1	6,994,239.89	3.84	5,076.14	4.33	—
浙商证券	2	—	—	—	—	—
中金财富	2	—	—	—	—	—
中金公司	1	—	—	—	—	—
中泰证券	1	2,514,511.00	1.38	2,245.26	1.91	—
中信证券	1	498,217.00	0.27	376.80	0.32	—

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。本基金合同生效日为2022年5月17日，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长城证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	28,197.52	100.00	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—

---

银河证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中金财富	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金合同生效公告	规定披露媒介	2022年05月18日
2	富国基金管理有限公司关于增聘富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金基金经理的公告	规定披露媒介	2022年07月09日
3	富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2022年07月14日
4	富国基金管理有限公司关于富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金 2022 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	规定披露媒介	2022年07月15日
5	富国基金管理有限公司基金关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	规定披露媒介	2022年11月11日
6	富国基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	规定披露媒介	2022年12月28日
7	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金 2023 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	规定披露媒介	2022年12月30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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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	2022-05-17 至 2022-12-31	10,000 ,450.0 5	—	—	10,000,450. 05	48.94%

#### 产品特有风险

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

#### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同及招募说明书等法律文件，经履行适当程序，基金管理人决定自 2022 年 11 月 10 日起，将本基金会计师事务所改聘为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。具体可参见基金管理人于 2022 年 11 月 11 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告》。

#### § 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沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金的文件	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： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。
2、富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金基金合同		
3、富国沪港深优质资产混合型发起式证券投资基金托管协议		
4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件		

---

5、富国沪港深优质资产混合型发起式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		
---	--	--