

富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

二〇二四年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

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

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	15
§4 管理人报告	16
4.1 基金管理人及基金经理情况	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	19
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	23
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	24
§5 托管人报告	24
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	24
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.....	24
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	24
§6 审计报告	24
6.1 审计报告基本信息.....	24
6.2 审计报告的基本内容.....	25
§7 年度财务报告	27
7.1 资产负债表.....	27

7.2 利润表.....	29
7.3 净资产变动表.....	30
7.4 报表附注.....	31
§8 投资组合报告	66
8.1 期末基金资产组合情况.....	66
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	67
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	68
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	89
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	91
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	91
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.....	91
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.....	91
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	92
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	92
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	92
8.12 投资组合报告附注.....	92
§9 基金份额持有人信息	93
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	93
9.2 期末上市基金前十名持有人	94
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	94
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	94
§10 开放式基金份额变动	95
§11 重大事件揭示	95
11.1 基金份额持有人大会决议	95
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	95
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	95
11.4 基金投资策略的改变.....	95
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	96
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	96
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	96
11.8 其他重大事件	99
§12 影响投资者决策的其他重要信息	99
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	99
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	100

§13 备查文件目录 100

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)		
基金简称	富国中证 500 指数增强 (LOF)		
基金主代码	161017		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 10 月 12 日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	3,753,435,355.51 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011 年 10 月 21 日		
下属分级基金的基金简称	富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B	富国中证 500 指数增强 (LOF) C	富国中证 500 指数增强 (LOF) Y
下属分级基金场内简称	500 增强 LOF	—	—
下属分级基金的交易代码	前端	后端	013332
	161017	161021	
报告期末下属分级基金的份额总额 (单位: 份)	3,241,973,482.36 份	510,247,925.66 份	1,213,947.49 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，主要策略为复制目标指数，即投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础，利用富国定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。本基金的标的指数、对目标指数的跟踪调整、存托凭证投资策略、债券投资策略、金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+1%(指年收益率，评价时按期间折算)。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	任航
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		裴长江	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	-15,705,946.50	-186,936,167.34	-613,902,914.93
本期利润	295,962,917.92	-116,063,347.42	-1,297,565,116.08
加权平均基金份额本期利润	0.0823	-0.0379	-0.4069
本期加权平均净值利润率	4.12%	-1.69%	-17.64%
本期基金份额净值增长率	5.27%	-2.08%	-16.09%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	3,085,639,766.78	3,374,973,688.15	3,663,964,328.70
期末可供分配基金份额利润	0.9518	1.1189	1.1640
期末基金资产净值	6,327,613,249.14	6,391,291,930.18	6,811,643,561.82
期末基金份额净值	1.952	2.119	2.164
3.1.3 累计期末指标	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	177.09%	163.22%	168.81%

(2) 富国中证 500 指数增强 (LOF) C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	10,655,501.81	-28,866,452.66	-16,109,901.48
本期利润	89,151,788.46	-27,948,042.02	-6,498,551.31
加权平均基金份额本期利润	0.1936	-0.1451	-0.0949
本期加权平均净值利润率	9.83%	-6.64%	-4.19%
本期基金份额净值增长率	5.05%	-2.27%	-16.29%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	478,821,974.72	426,147,987.81	100,788,927.31
期末可供分配基金份额利润	0.9384	1.1099	1.1592
期末基金资产净值	989,069,900.38	810,095,278.56	187,733,629.09
期末基金份额净值	1.938	2.110	2.159
3.1.3 累计期末指标	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日

基金份额累计净值增长率	-12.39%	-16.60%	-14.66%
-------------	---------	---------	---------

(3) 富国中证 500 指数增强 (LOF) Y

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	15,697.05	—	—
本期利润	-36,434.91	—	—
加权平均基金份额本期利润	-0.0852	—	—
本期加权平均净值利润率	-4.29%	—	—
本期基金份额净值增长率	-2.06%	—	—
3.1.2 期末数据和指标	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	1,155,644.97	—	—
期末可供分配基金份额利润	0.9520	—	—
期末基金资产净值	2,369,592.46	—	—
期末基金份额净值	1.952	—	—
3.1.3 累计期末指标	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	-2.06%	—	—

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末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）。本产品自 2024 年 12 月 13 日起增加 Y 类份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-2.11%	1.80%	0.02%	1.93%	-2.13%	-0.13%
过去六个月	9.03%	1.74%	15.70%	1.91%	-6.67%	-0.17%
过去一年	5.27%	1.60%	6.44%	1.73%	-1.17%	-0.13%
过去三年	-13.51%	1.25%	-18.54%	1.33%	5.03%	-0.08%
过去五年	30.91%	1.27%	14.42%	1.31%	16.49%	-0.04%

自基金合同生效起至今	177.09%	1.46%	71.02%	1.50%	106.07%	-0.04%
------------	---------	-------	--------	-------	---------	--------

(2) 富国中证 500 指数增强 (LOF) C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.17%	1.79%	0.02%	1.93%	-2.19%	-0.14%
过去六个月	8.92%	1.74%	15.70%	1.91%	-6.78%	-0.17%
过去一年	5.05%	1.60%	6.44%	1.73%	-1.39%	-0.13%
过去三年	-14.05%	1.25%	-18.54%	1.33%	4.49%	-0.08%
自基金分级生效日起至今	-12.39%	1.22%	-13.62%	1.29%	1.23%	-0.07%

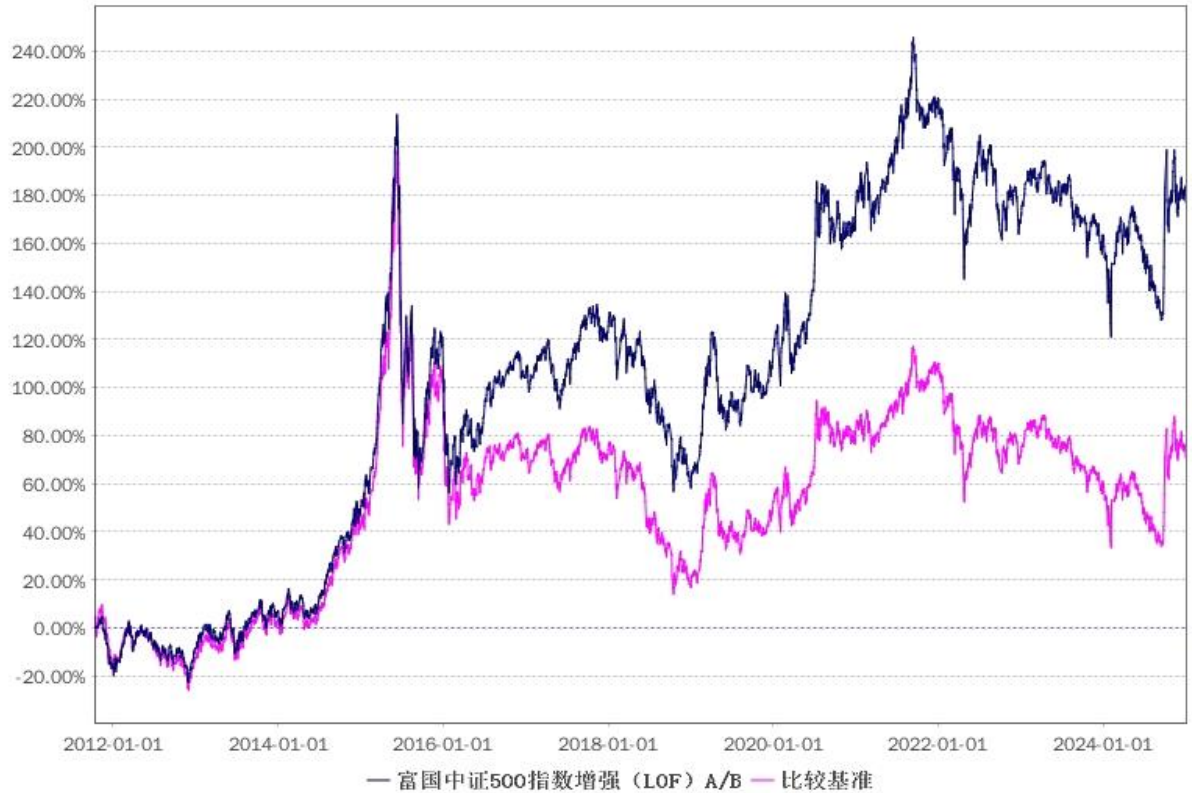
(3) 富国中证 500 指数增强 (LOF) Y

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
自基金分级生效日起至今	-2.06%	0.99%	-4.12%	1.16%	2.06%	-0.17%

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

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

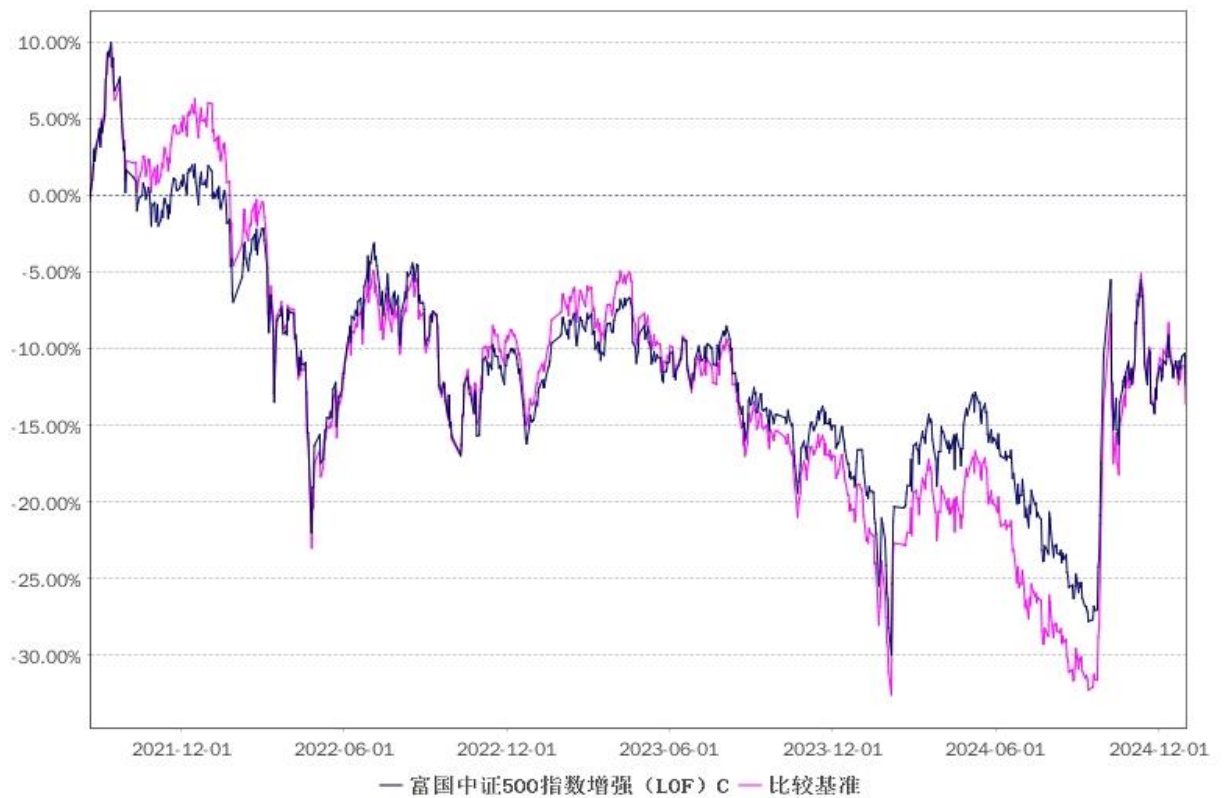
(1) 自基金合同生效以来富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2024 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2011 年 10 月 12 日成立，建仓期 6 个月，从 2011 年 10 月 12 日起至 2012 年 4 月 11 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

（2）自基金合同生效以来富国中证 500 指数增强（LOF）C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2024 年 12 月 31 日。

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

（3）自基金合同生效以来富国中证 500 指数增强 (LOF) Y 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

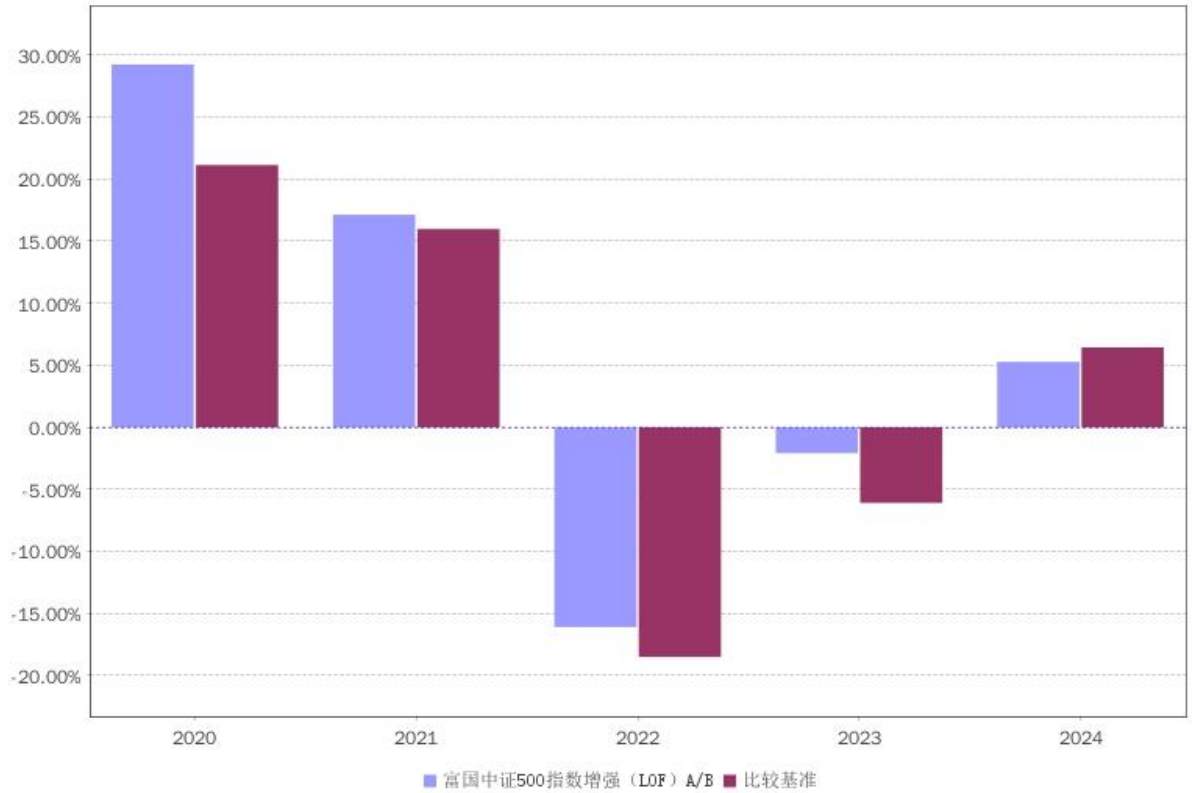


注：1、截止日期为 2024 年 12 月 31 日。

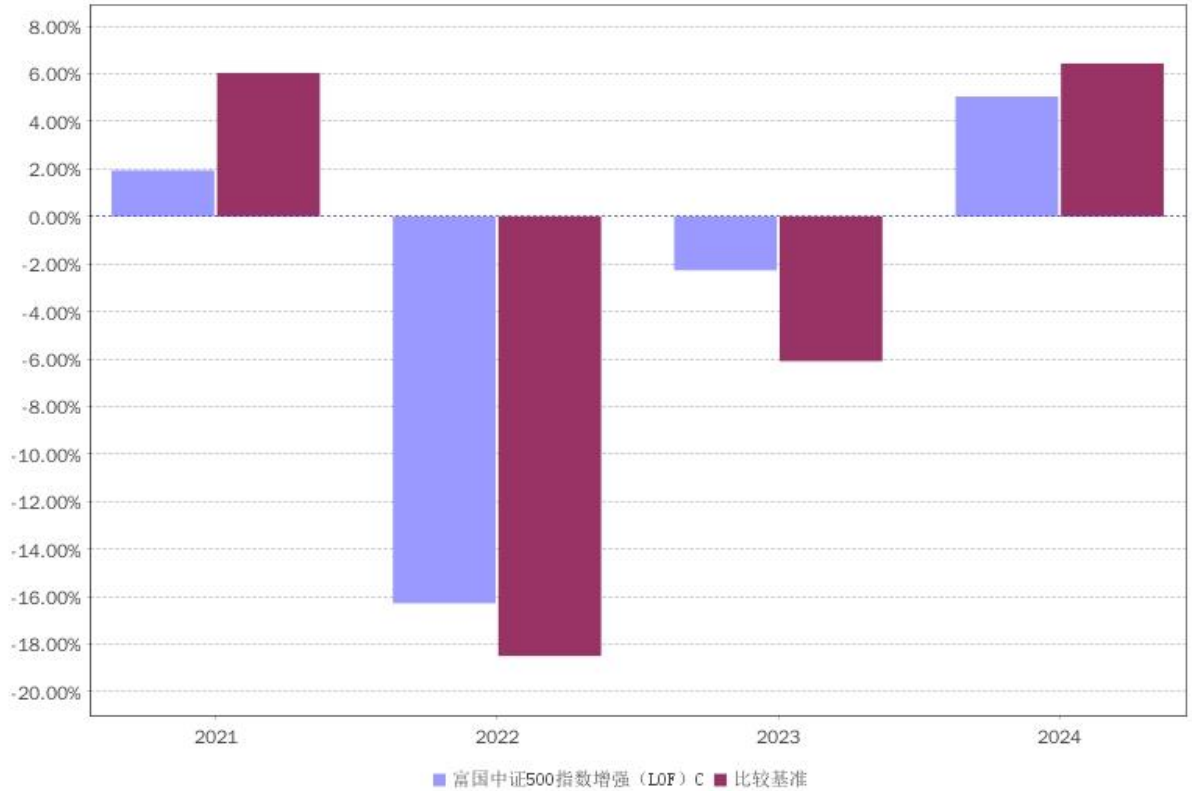
2、本基金自 2024 年 12 月 13 日起增加 Y 类份额，相关数据按实际存续期计算。

3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 过去五年以来富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



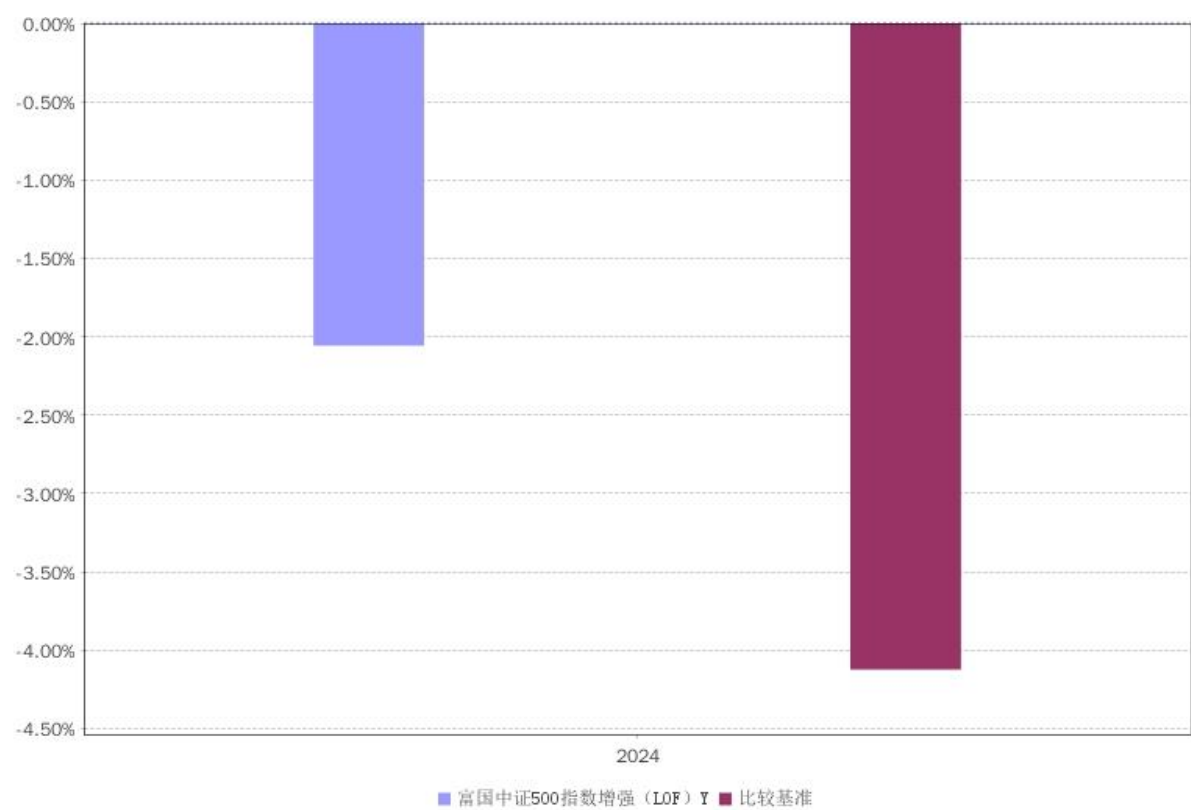
(2) 自基金合同生效以来富国中证 500 指数增强 (LOF) C 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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

(3) 自基金合同生效以来富国中证 500 指数增强 (LOF) Y 基金净值收益率与同

期业绩比较基准收益率的对比图



注：Y 类份额自 2024 年 12 月 16 日起有基金份额。2024 年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

(1) 富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024 年	2.370	614,620,231.68	322,181,955.36	936,802,187.04	1 次分红
2023 年	—	—	—	—	—
2022 年	—	—	—	—	—
合计	2.370	614,620,231.68	322,181,955.36	936,802,187.04	—

(2) 富国中证 500 指数增强 (LOF) C

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024 年	2.370	117,755,091.85	18,664,477.16	136,419,569.01	1 次分红
2023 年	—	—	—	—	—
2022 年	—	—	—	—	—
合计	2.370	117,755,091.85	18,664,477.16	136,419,569.01	—

(3) 富国中证 500 指数增强 (LOF) Y

注：过往三年本基金份额未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月，加拿大蒙特利尔银行 (BMO) 参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。

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

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

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金 (LOF)、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金 (LOF)、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基

金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 363 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐幼华	本基金现任基金经理	2011-10-12	—	20	硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资部经理助理；自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监，量化与海外投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部副总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。自 2011 年 05 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自 2011 年 10 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2018 年 05 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2018 年 07 月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理；自 2018 年 12 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自 2024 年 04 月起任富国 MSCI 中国 A50 互联互通增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
李笑薇	本基金现任基金经理	2011-10-12	—	22	博士，曾任摩根士丹利资本国际 Barra 公司（MSCIBARRA）高级研究员，巴克莱国际投资管理公司（BarclaysGlobal Investors）大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员；自 2009 年 6 月加入富国基金管理有限公司，历任量化与海外投资部总经理、基金经理、公司总经理助理；现任富国基金副总经理，兼任富国基金资深定

					量基金经理。自 2009 年 12 月起任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理；自 2011 年 10 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；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；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中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经

理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1 日内、3 日内、5 日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及 95% 的置信水平下，对同向交易价差进行 t 分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现 50 次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年开年以来，国内悲观预期加速释放，海外修正抢跑的降息预期，资金和情绪的负反馈导致市场调整加速。2 月，随着国内经济与政策预期得到重新修正，风险偏好改善驱动市场快速反弹。在海外 AI 技术迎来突破等信息刺激下，A 股迎来大幅反弹，月末沪指成功站上 3000 点。4 月末，美国降息预期推后下非美货币普遍贬值，而人民币汇率抗跌走出独立行情，中国资产在全球的配置性价比和逻辑开始凸显，引发外资回流。业绩期进入尾声后，内资风险偏好抬升，合力推动沪指突破 3100 点。6 月进入验证期，国内经济复苏再度放缓，PMI 回落枯荣线以下、信用扩张疲软、经济“供强需弱”特征延续。接连落空的预期验证放大悲观情绪，沪指连续调整至 3000 点以下。下半年，进入 7 月，市场提前交易美国大选风险，海外科技大盘股、金属商品等前期表现较好资产出现下跌，压制

全球市场风险偏好。9月18日美联储以50bp开启降息周期，为国内宽松打开空间。9月24日国内宽松即刻跟进，9月26日中央政治局会议罕见在9月讨论经济问题，全面聚焦增长，加力推出增量政策、实施有力度的降息、促进房地产市场止跌回稳、提振资本市场等积极表述超出市场预期，明确释放了政策全力聚焦稳增长，且后续仍有增量政策加力的积极信号，市场迎来大幅上涨。10月国庆假期回归后，市场对后续政策力度和微观流动性的预期回归理性，短期超涨后经历大波动。11月，美国大选等重要大事集中落地，海外扰动与内部积极因素交织，市场区间震荡。进入12月，随着两大重磅会议定调落地，市场风格迎来切换，前期高位股、小微盘股开始回落，市场风格逐步向大盘、红利倾斜，前期极致的风格分化持续收敛。

总体来看，2024年全年上证综指上涨12.67%，沪深300上涨14.68%，创业板指上涨13.23%，中证500指数上涨5.46%。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极追求获取超额收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2024年12月31日，本基金份额净值A/B级为1.952元，C级为1.938元，Y级为1.952元；份额累计净值A/B级为2.558元，C级为2.175元，Y级为1.952元；本报告期，本基金份额净值增长率A/B级为5.27%，C级为5.05%，Y级为-2.06%，同期业绩比较基准收益率A/B级为6.44%，C级为6.44%，Y级为-4.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2025年，在更加积极有为的宏观政策基调下，国内基本面有望逐步修复，预计市场呈现出螺旋式震荡上行的特征。从政策面看，如财政政策能够持续加码，有效提振内需，将改善企业盈利。从资金面看个人投资者和长期机构将有望成为增量资金主要来源。过去几年国内居民储蓄存款持续积累，随着市场环境逐步修复，可能使国内居民和全球资金对A股配置需求有更积极的边际变化。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

（一）落细落实各项监管要求

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

（二）持续完善内控制度及流程建设

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

（三）进一步强化合规管理效能

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

（四）加强文化建设，持续提升员工合规意识

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

（五）立足于合规，不断拓展风险管理职能

公司持续推进旗下组合的投资合规风控阈值多维度排查梳理和日常投资合规监督工作的规范化管理，不断拓展优化投资监督提示内容，进一步提升投资监督工作质量和效率。公司不断加强团队对新业务、新品种、新风险环境的学习研究，保持对各类风险的敏感度和识别响应能力。公司通过加强日常监测和定期回溯评估等方式，持续提升对于各类投资标的、投资行为的风险管理水平。

（六）信息化建设助力风控合规目标实现

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

（七）持续加强员工行为管理

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

（八）进一步提升反洗钱工作质效

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

（九）深入开展内部稽核审计

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金对本报告期内利润共进行 1 次收益分配。于 2024 年 8 月 23 日公告每

10 份 A/B 级基金份额派发红利 2.37 元,每 10 份 C 级基金份额派发红利 2.37 元。A/B 级基金份额共计派发红利 936802187.04 元, C 级基金份额共计派发红利 136419569.01 元。本基金本期分红已符合相关法律法规及《基金合同》约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70015656_B25 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定

	其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

	(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王珊珊	李倩妤
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
审计报告日期	2025 年 03 月 27 日	

§ 7 年度财务报告

7.1 资产负债表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	481,601,879.16	466,727,329.98
结算备付金	30,391,391.43	9,080,351.90
存出保证金	1,909,908.62	431,067.96
交易性金融资产	6,828,407,602.21	6,731,740,253.56

其中：股票投资	6,823,837,137.14	6,731,510,546.51
基金投资	—	—
债券投资	4,570,465.07	229,707.05
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	3,312,397.84	152,884.88
应收股利	—	—
应收申购款	3,936,812.43	13,655,126.97
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	7,349,559,991.69	7,221,787,015.25
负债和净资产	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	4,823,614.21	—
应付赎回款	13,960,088.40	7,538,210.31
应付管理人报酬	6,534,111.06	6,130,955.98
应付托管费	980,116.62	919,643.39
应付销售服务费	171,859.82	140,018.43
应付投资顾问费	—	—
应交税费	—	0.23
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	4,037,459.60	5,670,978.17
负债合计	30,507,249.71	20,399,806.51
净资产：		
实收基金	3,753,435,355.51	3,400,265,532.78
其他综合收益	—	—
未分配利润	3,565,617,386.47	3,801,121,675.96
净资产合计	7,319,052,741.98	7,201,387,208.74

负债和净资产总计	7,349,559,991.69	7,221,787,015.25
----------	------------------	------------------

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.950 元，基金份额总额 3,753,435,355.51 份。其中：富国中证 500 指数增强（LOF）A/B 份额净值 1.952 元，份额总额 3,241,973,482.36 份；富国中证 500 指数增强（LOF）C 份额净值 1.938 元，份额总额 510,247,925.66 份；富国中证 500 指数增强（LOF）Y 份额净值 1.952 元，份额总额 1,213,947.49 份。

7.2 利润表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

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

单位：人民币元

项 目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 12 月 31 日)
一、营业总收入	481,224,098.78	-58,154,687.81
1.利息收入	4,925,970.85	4,282,426.65
其中：存款利息收入	4,925,970.85	4,282,426.65
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）	80,845,818.52	-136,864,290.05
其中：股票投资收益	-90,391,399.43	-257,288,323.23
基金投资收益	—	—
债券投资收益	-266,246.12	1,294,577.87
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	171,503,464.07	119,129,455.31
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）	390,113,019.11	71,791,230.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	5,339,290.30	2,635,945.03
减：二、营业总支出	96,145,827.31	85,856,701.63
1. 管理人报酬	80,711,494.89	72,750,249.94
2. 托管费	12,106,724.24	10,912,537.41

3. 销售服务费	1,822,547.40	831,766.13
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	4.43	3.77
8. 其他费用	1,505,056.35	1,362,144.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	385,078,271.47	-144,011,389.44
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	385,078,271.47	-144,011,389.44
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	385,078,271.47	-144,011,389.44

7.3 净资产变动表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

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

单位：人民币元

项目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、上期期末净资产	3,400,265,532.78	3,801,121,675.96	7,201,387,208.74
二、本期期初净资产	3,400,265,532.78	3,801,121,675.96	7,201,387,208.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	353,169,822.73	— 235,504,289.49	117,665,533.24
（一）、综合收益总额	—	385,078,271.47	385,078,271.47
（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）	353,169,822.73	452,639,195.09	805,809,017.82
其中：1. 基金申购款	3,369,047,340.40	3,464,734,872.77	6,833,782,213.17
2. 基金赎回款	— 3,015,877,517.67	— 3,012,095,677.68	— 6,027,973,195.35
（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）	—	— 1,073,221,756.05	— 1,073,221,756.05
四、本期期末净资产	3,753,435,355.51	3,565,617,386.47	7,319,052,741.98
项目	上年度可比期间		

	(2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,234,623,934.90	3,764,753,256.01	6,999,377,190.91
二、本期期初净资产	3,234,623,934.90	3,764,753,256.01	6,999,377,190.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	165,641,597.88	36,368,419.95	202,010,017.83
（一）、综合收益总额	—	—	—
	—	144,011,389.44	144,011,389.44
（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）	165,641,597.88	180,379,809.39	346,021,407.27
其中：1.基金申购款	1,222,232,268.79	1,497,490,458.53	2,719,722,727.32
2.基金赎回款	—	—	—
	1,056,590,670.91	1,317,110,649.14	2,373,701,320.05
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—
四、本期期末净资产	3,400,265,532.78	3,801,121,675.96	7,201,387,208.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陈 戈

林志松

徐慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]1095 号《关于核准富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）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发行募集，基金合同于 2011 年 10 月 12 日正式生效，首次设立募集规模为 455,487,249.88 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人于 2021 年 8 月 17 日发布的

《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自 2021 年 8 月 19 日起，本基金增加 C 类份额。根据基金管理人于 2024 年 12 月 12 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 Y 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》，自 2024 年 12 月 13 日起，本基金增加 Y 类份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，A 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，C 类、Y 类基金份额的注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。其中，股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产（均含存托凭证）不低于股票资产的 80%；保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或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。

本基金业绩比较基准为 $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 1\%$ （指年收益率，评价时按期间折算）。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险

和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用

的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1. 本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金

份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同；

2. 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日该类每份基金份额可供分配利润的 25%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

3. 基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4. 基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

5. 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资。本基金场外 A 类和 C 类基金份额可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值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，本基金场外 A 类和 C 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；本基金 Y 类基金份额的收益分配方式是红利再投资；本基金场内 A 类基金份额只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

6. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市

公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2024 年 12 月 31 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
活期存款	481,601,879.16	466,727,329.98
等于：本金	481,499,699.72	466,614,471.47
加：应计利息	102,179.44	112,858.51
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	481,601,879.16	466,727,329.98

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末（2024 年 12 月 31 日）			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		6,780,847,858.34	—	6,823,837,137.14	42,989,278.80
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	4,522,500.00	49,315.07	4,570,465.07	-1,350.00
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	4,522,500.00	49,315.07	4,570,465.07	-1,350.00
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		6,785,370,358.34	49,315.07	6,828,407,602.21	42,987,928.80
项目		上年度末（2023 年 12 月 31 日）			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		7,078,635,636.82	—	6,731,510,546.51	-347,125,090.31
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	229,700.00	7.05	229,707.05	—
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	229,700.00	7.05	229,707.05	—
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		7,078,865,336.82	7.05	6,731,740,253.56	-347,125,090.31

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	49,961.89	23,475.53
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	3,454,818.00	5,167,775.27
其中：交易所市场	3,454,818.00	5,167,775.27
银行间市场	—	—
应付利息	—	—
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提审计费	68,000.00	68,000.00
应付指数使用费	344,679.71	291,727.37
合计	4,037,459.60	5,670,978.17

7.4.7.7 实收基金

富国中证 500 指数增强（LOF）A/B：

金额单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,016,318,242.03	3,016,318,242.03
本期申购	2,312,564,954.93	2,312,564,954.93
本期赎回（以“-”号填列）	-2,086,909,714.60	-2,086,909,714.60
本期末	3,241,973,482.36	3,241,973,482.36

富国中证 500 指数增强（LOF）C：

金额单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	383,947,290.75	383,947,290.75
本期申购	1,055,261,263.78	1,055,261,263.78
本期赎回（以“-”号填列）	-928,960,628.87	-928,960,628.87
本期末	510,247,925.66	510,247,925.66

富国中证 500 指数增强（LOF）Y：

金额单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）
----	--

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	—	—
本期申购	1, 221, 121. 69	1, 221, 121. 69
本期赎回（以“-”号填列）	-7, 174. 20	-7, 174. 20
本期末	1, 213, 947. 49	1, 213, 947. 49

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

富国中证 500 指数增强（LOF）A/B：

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	4, 027, 185, 097. 91	— 652, 211, 409. 76	3, 374, 973, 688. 15
本期期初	4, 027, 185, 097. 91	— 652, 211, 409. 76	3, 374, 973, 688. 15
本期利润	-15, 705, 946. 50	311, 668, 864. 42	295, 962, 917. 92
本期基金份额交易产生的变动数	450, 825, 569. 11	-99, 320, 221. 36	351, 505, 347. 75
其中：基金申购款	2, 724, 637, 818. 30	— 306, 610, 827. 68	2, 418, 026, 990. 62
基金赎回款	— 2, 273, 812, 249. 19	207, 290, 606. 32	— 2, 066, 521, 642. 87
本期已分配利润	-936, 802, 187. 04	—	-936, 802, 187. 04
本期末	3, 525, 502, 533. 48	— 439, 862, 766. 70	3, 085, 639, 766. 78

富国中证 500 指数增强（LOF）C：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	509, 072, 000. 02	-82, 924, 012. 21	426, 147, 987. 81
本期期初	509, 072, 000. 02	-82, 924, 012. 21	426, 147, 987. 81
本期利润	10, 655, 501. 81	78, 496, 286. 65	89, 151, 788. 46
本期基金份额交易产生的变动数	164, 893, 817. 86	-64, 952, 050. 40	99, 941, 767. 46
其中：基金申购款	1, 162, 007, 766. 13	— 116, 499, 120. 82	1, 045, 508, 645. 31
基金赎回款	-997, 113, 948. 27	51, 547, 070. 42	-945, 566, 877. 85
本期已分配利润	-136, 419, 569. 01	—	-136, 419, 569. 01
本期末	548, 201, 750. 68	-69, 379, 775. 96	478, 821, 974. 72

富国中证 500 指数增强（LOF）Y：

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	—	—	—
本期期初	—	—	—

本期利润	15,697.05	-52,131.96	-36,434.91
本期基金份额交易产生的变动数	1,304,627.04	-112,547.16	1,192,079.88
其中：基金申购款	1,312,431.89	-113,195.05	1,199,236.84
基金赎回款	-7,804.85	647.89	-7,156.96
本期已分配利润	—	—	—
本期末	1,320,324.09	-164,679.12	1,155,644.97

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年12月31日）	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年12月31日）
活期存款利息收入	4,256,581.61	3,993,081.72
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	300,226.04	214,342.95
其他	369,163.20	75,001.98
合计	4,925,970.85	4,282,426.65

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年12月31日）	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年12月31日）
卖出股票成交总额	31,376,471,486.15	17,870,893,601.55
减：卖出股票成本总额	31,425,579,331.50	18,083,606,798.09
减：交易费用	41,283,554.08	44,575,126.69
买卖股票差价收入	-90,391,399.43	-257,288,323.23

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年12月31日）	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年12月31日）
债券投资收益——利息收入	113,634.18	1,039.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-379,880.30	1,293,537.93
合计	-266,246.12	1,294,577.87

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年12月31日）	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年12月31日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	46,331,804.29	6,307,755.08
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	46,312,298.00	5,012,900.00
减：应计利息总额	399,234.69	1,064.86
减：交易费用	151.90	252.29
买卖债券差价收入	-379,880.30	1,293,537.93

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖贵金属交易。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年12月31日）	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年12月31日）
----	-----------------------------	----------------------------------

	日至 2024 年 12 月 31 日)	年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日)
股票投资产生的股利收益	171,503,464.07	119,129,455.31
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	171,503,464.07	119,129,455.31

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）
1. 交易性金融资产	390,113,019.11	71,791,230.56
股票投资	390,114,369.11	71,791,230.56
债券投资	-1,350.00	—
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	390,113,019.11	71,791,230.56

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）
基金赎回费收入	4,993,789.13	2,606,084.57
基金转换费收入	345,501.17	29,860.46
合计	5,339,290.30	2,635,945.03

7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）
审计费用	68,000.00	68,000.00

信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
银行费用	24,653.56	10,039.77
指数使用费	1,291,387.10	1,164,004.03
其他	1,015.69	100.58
合计	1,505,056.35	1,362,144.38

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
山东省金融资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
加拿大蒙特利尔银行	基金管理人的股东
富国鑫汇养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年12月31日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	6,987,761,083.60	11.18	4,933,882,647.70	13.66
申万宏源	4,999,812,943.71	8.00	5,268,231,998.80	14.58

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年12月31日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
海通证券	38,121.83	0.04	—	—
申万宏源	—	—	1,204,538.77	19.10

7.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年12月31日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	1,833,654.69	8.49	543,677.42	15.74

申万宏源	1,536,813.95	7.12	396,815.31	11.49
关联方名称	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年12月31日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	3,580,288.92	13.67	992,032.09	19.20
申万宏源	3,818,904.11	14.58	666,571.29	12.90

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。相关佣金协议已根据此规定完成了更新。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）
当期发生的基金应支付的管理费	80,711,494.89	72,750,249.94
其中：应支付销售机构的客户维护费	22,934,670.94	24,037,876.24
应支付基金管理人的净管理费	57,776,823.95	48,712,373.70

注：本基金自 2024 年 12 月 13 日起新增 Y 类份额事宜所涉基金合同的修订生效。

本基金 A 类和 C 类基金份额的管理费按前一日该类基金份额基金资产净值的 1.00% 年费率计提，本基金 Y 类基金份额的管理费按前一日 Y 类基金份额基金资产净值的 0.50%的年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H=E\times \text{该类基金份额的管理费年费率}\div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的基金管理费

E 为前一日的该类基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）
当期发生的基金应支付的托管费	12,106,724.24	10,912,537.41

注：本基金自 2024 年 12 月 13 日起新增 Y 类份额事宜所涉基金合同的修订生效。

本基金 A 类和 C 类基金份额的托管费按前一日该类基金份额基金资产净值的 0.15% 的年费率计提，本基金 Y 类基金份额的托管费按前一日 Y 类基金份额基金资产净值的 0.075% 的年费率计提。

托管费的计算方法如下： $H=E\times \text{该类基金份额的托管费年费率}\div \text{当年天数}$

H 为该类基金份额每日应计提的基金托管费

E 为前一日的该类基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	富国中证 500 指数增强（LOF）A/B	富国中证 500 指数增强（LOF）C	富国中证 500 指数增强（LOF）Y	合计
富国基金管理有限公司	—	1,149,066.85	—	1,149,066.85
海通证券股份有限公司	—	142.79	—	142.79
申万宏源证券有限公司	—	1,051.47	—	1,051.47
合计	—	1,150,261.11	—	1,150,261.11

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	富国中证 500 指数增强（LOF）	富国中证 500 指数增强（LOF）C	富国中证 500 指数增强（LOF）Y	合计

	A/B			
富国基金管理有限公司	—	580,154.69	—	580,154.69
海通证券股份有限公司	—	97.39	—	97.39
申万宏源证券有限公司	—	1,289.04	—	1,289.04
合计	—	581,541.12	—	581,541.12

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.20% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计提，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）			上年度可比期间 (2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日)		
	富国中证 500 指数增强（LOF）A/B	富国中证 500 指数增强（LOF）C	富国中证 500 指数增强（LOF）Y	富国中证 500 指数增强（LOF）A/B	富国中证 500 指数增强（LOF）C	富国中证 500 指数增强（LOF）Y
基金合同生效日（2011 年 10 月 12 日）持有的基金份额	—	—	—	—	—	—
期初持有的基金份额	12,657,866.18	—	—	2,657,866.18	395.26	—
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	—	—	—	—	395.26	—
期末持有的基金份额	12,657,866.18	—	—	2,657,866.18	—	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.39%	—	—	0.42%	—	—

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

富国中证 500 指数增强（LOF）C：

份额单位：份

关联方名称	本期末（2024 年 12 月 31 日）		上期末（2023 年 12 月 31 日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
富国鑫汇养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	3,042,228.40	0.60	3,042,228.40	0.79
富国鑫旺均衡养	—	—	2,489,573.07	0.65

老目标三年持有 期混合型发起式 基金中基金 (FOF)				
--------------------------------------	--	--	--	--

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）		上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份 有限公司	481,601,879.16	4,256,581.61	466,727,329.98	3,993,081.72

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证
券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

富国中证 500 指数增强（LOF）A/B：

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基金 份额分红数	现金形式发 放总额	再投资形式 发放总额	利润分配合 计	备注
		(场外)	(场内)					
1	2024-08-27	2024-08- 27	2024-08- 28	2.370	614,620,23 1.68	322,181,95 5.36	936,802,18 7.04	—
合 计				2.370	614,620,23 1.68	322,181,95 5.36	936,802,18 7.04	—

富国中证 500 指数增强（LOF）C：

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份基金 份额分红数	现金形式发放 总额	再投资形式 发放总额	利润分配合 计	备注
1	2024-08-27	2024-08- 27	2.370	117,755,091. 85	18,664,477 .16	136,419,56 9.01	—
合 计			2.370	117,755,091.	18,664,477	136,419,56	—

				85	. 16	9. 01	
--	--	--	--	----	------	-------	--

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001391	国货航	2024-12-23	6 个月	新股限售	2. 30	6. 80	4, 686	10, 777. 80	31, 864. 80	—
301522	上大股份	2024-10-09	6 个月	新股限售	6. 88	24. 84	816	5, 614. 08	20, 269. 44	—
301551	无线传媒	2024-09-19	6 个月	新股限售	9. 40	43. 23	652	6, 128. 80	28, 185. 96	—
301552	科力装备	2024-07-15	6 个月	新股限售	30. 00	56. 87	143	4, 290. 00	8, 132. 41	—
301556	托普云农	2024-10-10	6 个月	新股限售	14. 50	59. 05	267	3, 871. 50	15, 766. 35	—
301571	国科天成	2024-08-14	6 个月	新股限售	11. 14	40. 83	350	3, 899. 00	14, 290. 50	—
301585	蓝宇股份	2024-12-10	6 个月	新股限售	23. 95	35. 85	210	5, 029. 50	7, 528. 50	—
301586	佳力奇	2024-08-21	6 个月	新股限售	18. 09	53. 14	215	3, 889. 35	11, 425. 10	—
301603	乔锋智能	2024-07-03	6 个月	新股限售	26. 50	41. 98	233	6, 174. 50	9, 781. 34	—
301606	绿联科技	2024-07-17	6 个月	新股限售	21. 21	36. 49	396	8, 399. 16	14, 450. 04	—
301607	富特科技	2024-08-28	6 个月	新股限售	14. 00	36. 14	257	3, 598. 00	9, 287. 98	—
301608	博实结	2024-07-25	6 个月	新股限售	44. 50	65. 38	184	8, 188. 00	12, 029. 92	—
301613	新铝时代	2024-10-18	6 个月	新股限售	27. 70	41. 77	276	7, 645. 20	11, 528. 52	—
301617	博苑股份	2024-12-03	6 个月	新股限售	27. 76	39. 79	253	7, 023. 28	10, 066. 87	—
301622	英思特	2024-11-26	6 个月	新股限售	22. 36	44. 92	306	6, 842. 16	13, 745. 52	—
301626	苏州天脉	2024-10-17	6 个月	新股限售	21. 23	65. 78	957	20, 317. 11	62, 951. 46	—
603072	天和磁材	2024-12-24	1 个月内 (含)	新股认购	12. 30	12. 30	2, 029	24, 956. 70	24, 956. 70	—
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股限售	12. 30	12. 30	226	2, 779. 80	2, 779. 80	—
603194	中力股份	2024-12-17	6 个月	新股限售	20. 32	28. 13	291	5, 913. 12	8, 185. 83	—
603207	小方制药	2024-08-19	6 个月	新股限售	12. 47	26. 65	185	2, 306. 95	4, 930. 25	—
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新股限售	18. 65	22. 61	129	2, 405. 85	2, 916. 69	—
603310	巍华新材	2024-08-07	6 个月	新股限售	17. 39	17. 95	254	4, 417. 06	4, 559. 30	—
603395	红四方	2024-11-19	6 个月	新股限售	7. 98	35. 77	154	1, 228. 92	5, 508. 58	—
688449	联芸科技	2024-11-20	6 个月	新股限售	11. 25	29. 44	1, 406	15, 817. 50	41, 392. 64	—
688708	佳驰科技	2024-11-27	6 个月	新股限售	27. 08	48. 95	780	21, 122. 40	38, 181. 00	—
688726	拉普拉斯	2024-10-22	6 个月	新股限售	17. 58	33. 06	979	17, 210. 82	32, 365. 74	—
688750	金天钛业	2024-11-12	6 个月	新股限售	7. 16	15. 44	1, 685	12, 064. 60	26, 016. 40	—

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024 年 12 月 23 日	重大事项停牌	6.96	2025 年 01 月 07 日	6.93	674,300.00	5,072,975.38	4,693,128.00	—

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元		
长期信用评级	本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
AAA	—	—
AAA 以下	—	229,707.05
未评级	—	—
合计	—	229,707.05

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

7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系,审慎评估各类资产的流动性,针对性制定流动性风险管理措施,对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险,并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配,确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除在 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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

单位：人民币元

本期末（2024 年 12 月 31 日）	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	481,601,879.16	—	—	—	—	—	481,601,879.16
结算备付金	30,391,391.43	—	—	—	—	—	30,391,391.43
存出保证金	1,909,908.62	—	—	—	—	—	1,909,908.62
交易性金融资产	—	—	4,570,465.07	—	—	6,823,837,137.14	6,828,407,602.21
应收清算款	—	—	—	—	—	3,312,397.84	3,312,397.84
应收申购款	92,904.40	—	—	—	—	3,843,908.03	3,936,812.43
资产总计	513,996,083.61	—	4,570,465.07	—	—	6,830,993,443.01	7,349,559,991.69
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	4,823,614.21	4,823,614.21
应付赎回款	—	—	—	—	—	13,960,088.40	13,960,088.40
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	6,534,111.06	6,534,111.06
应付托管费	—	—	—	—	—	980,116.62	980,116.62
应付销售服务费	—	—	—	—	—	171,859.82	171,859.82
其他负债	—	—	—	—	—	4,037,459.60	4,037,459.60
负债总计	—	—	—	—	—	30,507,249.71	30,507,249.71
利率敏感度缺口	513,996,083.61	—	4,570,465.07	—	—	6,800,486,193.30	7,319,052,741.98
上年度末（2023 年 12 月 31 日）	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	466,727,329.98	—	—	—	—	—	466,727,329.98

结算备付金	9,080,351.90	—	—	—	—	—	9,080,351.90
存出保证金	431,067.96	—	—	—	—	—	431,067.96
交易性金融资产	—	—	229,707.05	—	—	6,731,510,546.51	6,731,740,253.56
应收清算款	—	—	—	—	—	152,884.88	152,884.88
应收申购款	168,281.93	—	—	—	—	13,486,845.04	13,655,126.97
资产总计	476,407,031.77	—	229,707.05	—	—	6,745,150,276.43	7,221,787,015.25
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	7,538,210.31	7,538,210.31
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	6,130,955.98	6,130,955.98
应付托管费	—	—	—	—	—	919,643.39	919,643.39
应付销售服务费	—	—	—	—	—	140,018.43	140,018.43
应交税费	—	—	—	—	—	0.23	0.23
其他负债	—	—	—	—	—	5,670,978.17	5,670,978.17
负债总计	—	—	—	—	—	20,399,806.51	20,399,806.51
利率敏感度缺口	476,407,031.77	—	229,707.05	—	—	6,724,750,469.92	7,201,387,208.74

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 基准点利率增加 0.1%	-2,082.30	—
	2. 基准点利率减少 0.1%	2,082.30	—

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会

的相关规定。其中，股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于股票资产的 80%。保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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：

项目	本期末（2024 年 12 月 31 日）		上年度末（2023 年 12 月 31 日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	6,823,837,137.14	93.23	6,731,510,546.51	93.48
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	4,570,465.07	0.06	229,707.05	0.00
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	6,828,407,602.21	93.30	6,731,740,253.56	93.48

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	66,978,836.66	67,530,427.20

	2. 业绩比较基准减少 1%	-66,978,836.66	-67,530,427.20
--	----------------	----------------	----------------

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 (2024 年 12 月 31 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
第一层次	6,818,670,911.50	6,725,470,538.53
第二层次	9,291,329.57	5,348,954.93
第三层次	445,361.14	920,760.10
合计	6,828,407,602.21	6,731,740,253.56

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	—	920,760.10	920,760.10
当期购买	—	340,788.28	340,788.28
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	1,000,847.98	1,000,847.98
当期利得或损失总额	—	184,660.74	184,660.74
其中：计入损益的利得或损失	—	184,660.74	184,660.74
期末余额	—	445,361.14	445,361.14
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	—	251,186.48	251,186.48
项目	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	—	100,474,344.45	100,474,344.45
当期购买	—	45,387,035.20	45,387,035.20
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	169,105,491.02	169,105,491.02
当期利得或损失总额	—	24,164,871.47	24,164,871.47
其中：计入损益的利得或损失	—	24,164,871.47	24,164,871.47
期末余额	—	920,760.10	920,760.10
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	—	58,305.41	58,305.41

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	445,361.14	平均价格 亚式期权 模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.3423- 4.9648	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	920,760.10	平均价格 亚式期权 模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1462- 2.1775	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6,823,837,137.14	92.85
	其中：股票	6,823,837,137.14	92.85

2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	4,570,465.07	0.06
	其中：债券	4,570,465.07	0.06
	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	511,993,270.59	6.97
8	其他各项资产	9,159,118.89	0.12
9	合计	7,349,559,991.69	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

8.2.1.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	74,205,225.00	1.01
B	采矿业	141,468,261.56	1.93
C	制造业	3,545,167,157.32	48.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	361,714,037.38	4.94
E	建筑业	104,612,174.02	1.43
F	批发和零售业	104,370,281.69	1.43
G	交通运输、仓储和邮政业	150,643,066.07	2.06
H	住宿和餐饮业	7,711,771.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	437,622,000.74	5.98
J	金融业	575,141,687.05	7.86
K	房地产业	56,366,343.08	0.77
L	租赁和商务服务业	30,241,344.00	0.41
M	科学研究和技术服务业	16,980,397.53	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	22,805,863.86	0.31
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	906,440.00	0.01
Q	卫生和社会工作	4,727,303.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	110,194,341.09	1.51
S	综合	3,285.39	0.00
	合计	5,744,880,979.78	78.49

8.2.1.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,369,619.00	0.05
B	采矿业	36,601,792.40	0.50
C	制造业	597,675,670.13	8.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,616,411.00	0.21
E	建筑业	1,900,478.12	0.03
F	批发和零售业	1,990,837.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	92,778,425.30	1.27
H	住宿和餐饮业	701.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	130,069,183.47	1.78
J	金融业	178,546,427.18	2.44
K	房地产业	296,210.00	0.00
L	租赁和商务服务业	806,586.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	13,250,270.76	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	3,192,840.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	600,256.00	0.01
Q	卫生和社会工作	2,260,450.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,078,956,157.36	14.74

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600299	安迪苏	7,256,371	91,067,456.05	1.24
2	600096	云天化	4,048,465	90,280,769.50	1.23
3	000729	燕京啤酒	5,621,843	67,686,989.72	0.92
4	600352	浙江龙盛	6,546,249	67,360,902.21	0.92
5	002261	拓维信息	3,504,600	64,169,226.00	0.88
6	601108	财通证券	7,567,977	61,830,372.09	0.84
7	300001	特锐德	2,673,891	58,691,907.45	0.80
8	000988	华工科技	1,342,132	58,114,315.60	0.79
9	600642	申能股份	5,917,073	56,153,022.77	0.77
10	601231	环旭电子	3,282,279	54,157,603.50	0.74
11	000728	国元证券	6,466,904	54,063,317.44	0.74
12	600707	彩虹股份	6,043,851	49,680,455.22	0.68

13	002625	光启技术	1,022,870	48,893,186.00	0.67
14	600021	上海电力	5,149,000	47,216,330.00	0.65
15	600901	江苏金租	8,590,223	44,840,964.06	0.61
16	600737	中粮糖业	4,283,620	43,735,760.20	0.60
17	601098	中南传媒	2,883,639	43,283,421.39	0.59
18	002444	巨星科技	1,319,400	42,682,590.00	0.58
19	002138	顺络电子	1,353,300	42,601,884.00	0.58
20	600598	北大荒	2,876,408	42,427,018.00	0.58
21	600177	雅戈尔	4,701,156	41,840,288.40	0.57
22	600863	内蒙华电	9,456,400	40,946,212.00	0.56
23	601611	中国核建	4,469,500	40,404,280.00	0.55
24	300866	安克创新	411,191	40,148,689.24	0.55
25	600350	山东高速	3,847,371	39,550,973.88	0.54
26	600008	首创环保	11,984,800	39,310,144.00	0.54
27	000513	丽珠集团	1,028,113	39,068,294.00	0.53
28	600879	航天电子	4,339,949	38,885,943.04	0.53
29	600038	中直股份	983,400	37,919,904.00	0.52
30	300212	易华录	1,570,696	36,754,286.40	0.50
31	002273	水晶光电	1,648,676	36,633,580.72	0.50
32	605358	立昂微	1,461,061	36,190,480.97	0.49
33	000738	航发控制	1,623,345	36,103,192.80	0.49
34	002340	格林美	5,516,090	36,020,067.70	0.49
35	300677	英科医疗	1,422,537	35,961,735.36	0.49
36	002078	太阳纸业	2,413,555	35,889,562.85	0.49
37	002517	恺英网络	2,601,800	35,410,498.00	0.48
38	002202	金风科技	3,402,330	35,146,068.90	0.48
39	601577	长沙银行	3,941,705	35,041,757.45	0.48
40	300724	捷佳伟创	547,709	34,620,685.89	0.47
41	000060	中金岭南	7,381,500	34,619,235.00	0.47
42	300207	欣旺达	1,539,700	34,350,707.00	0.47
43	002595	豪迈科技	683,505	34,305,115.95	0.47
44	300002	神州泰岳	2,948,800	34,176,592.00	0.47
45	000623	吉林敖东	1,973,112	34,075,644.24	0.47
46	000066	中国长城	2,301,400	33,531,398.00	0.46
47	600143	金发科技	3,788,300	32,730,912.00	0.45
48	603893	瑞芯微	296,720	32,657,003.20	0.45
49	002064	华峰化学	3,951,334	32,321,912.12	0.44
50	600339	中油工程	9,011,400	32,260,812.00	0.44
51	603885	吉祥航空	2,346,380	32,145,406.00	0.44
52	300373	扬杰科技	726,400	31,612,928.00	0.43
53	002153	石基信息	4,370,044	31,202,114.16	0.43

54	600909	华安证券	5,093,548	30,866,900.88	0.42
55	601118	海南橡胶	5,672,400	30,687,684.00	0.42
56	000538	云南白药	506,800	30,382,660.00	0.42
57	600820	隧道股份	4,165,258	29,948,205.02	0.41
58	601991	大唐发电	10,443,000	29,762,550.00	0.41
59	601866	中远海发	11,383,300	29,710,413.00	0.41
60	000050	深天马A	3,181,849	28,732,096.47	0.39
61	000636	风华高科	1,993,900	28,612,465.00	0.39
62	600418	江淮汽车	754,332	28,287,450.00	0.39
63	600312	平高电气	1,433,600	27,525,120.00	0.38
64	600873	梅花生物	2,737,100	27,453,113.00	0.38
65	601168	西部矿业	1,704,002	27,383,312.14	0.37
66	002966	苏州银行	3,358,040	27,233,704.40	0.37
67	600298	安琪酵母	751,400	27,087,970.00	0.37
68	601212	白银有色	9,715,600	27,009,368.00	0.37
69	600153	建发股份	2,546,800	26,792,336.00	0.37
70	600282	南钢股份	5,709,600	26,778,024.00	0.37
71	002831	裕同科技	988,067	26,776,615.70	0.37
72	300573	兴齐眼药	381,160	26,597,344.80	0.36
73	000423	东阿阿胶	422,100	26,474,112.00	0.36
74	600919	江苏银行	2,614,200	25,671,444.00	0.35
75	600521	华海药业	1,425,092	25,466,394.04	0.35
76	000739	普洛药业	1,566,000	25,463,160.00	0.35
77	600528	中铁工业	3,085,400	24,868,324.00	0.34
78	600516	方大炭素	5,131,156	24,783,483.48	0.34
79	600704	物产中大	4,878,100	24,683,186.00	0.34
80	688276	百克生物	968,765	24,325,689.15	0.33
81	000887	中鼎股份	1,840,303	24,144,775.36	0.33
82	600977	中国电影	2,062,100	23,940,981.00	0.33
83	300339	润和软件	468,600	23,444,058.00	0.32
84	600885	宏发股份	735,900	23,416,338.00	0.32
85	688777	中控技术	470,692	23,379,271.64	0.32
86	002414	高德红外	3,136,431	23,303,682.33	0.32
87	600563	法拉电子	194,500	23,129,940.00	0.32
88	000598	兴蓉环境	3,024,143	22,953,245.37	0.31
89	600862	中航高科	904,600	22,850,196.00	0.31
90	688005	容百科技	718,232	22,660,219.60	0.31
91	600487	亨通光电	1,292,840	22,262,704.80	0.30
92	002507	涪陵榨菜	1,558,380	22,019,909.40	0.30
93	603568	伟明环保	1,010,822	21,864,079.86	0.30
94	002128	电投能源	1,101,774	21,572,734.92	0.29

95	002472	双环传动	699,200	21,409,504.00	0.29
96	600988	赤峰黄金	1,369,300	21,374,773.00	0.29
97	000830	鲁西化工	1,823,223	21,313,476.87	0.29
98	600166	福田汽车	8,454,400	21,220,544.00	0.29
99	002797	第一创业	2,527,772	21,106,896.20	0.29
100	601198	东兴证券	1,915,100	21,085,251.00	0.29
101	300699	光威复材	603,157	20,899,390.05	0.29
102	600497	驰宏锌锗	3,735,700	20,807,849.00	0.28
103	002223	鱼跃医疗	562,660	20,531,463.40	0.28
104	000559	万向钱潮	3,299,987	20,294,920.05	0.28
105	600578	京能电力	5,754,900	20,257,248.00	0.28
106	600925	苏能股份	3,821,048	20,251,554.40	0.28
107	000825	太钢不锈	5,789,940	20,148,991.20	0.28
108	601990	南京证券	2,323,000	20,117,180.00	0.27
109	002408	齐翔腾达	3,979,764	20,018,212.92	0.27
110	600208	衢州发展	6,740,600	19,952,176.00	0.27
111	002432	九安医疗	480,022	19,575,297.16	0.27
112	601688	华泰证券	1,107,700	19,484,443.00	0.27
113	600887	伊利股份	641,500	19,360,470.00	0.26
114	600004	白云机场	2,014,900	19,343,040.00	0.26
115	000967	盈峰环境	3,884,700	19,306,959.00	0.26
116	002459	晶澳科技	1,396,600	19,203,250.00	0.26
117	688469	芯联集成	3,711,053	19,037,701.89	0.26
118	601997	贵阳银行	3,167,762	19,006,572.00	0.26
119	688390	固德威	454,708	18,597,557.20	0.25
120	601555	东吴证券	2,383,607	18,592,134.60	0.25
121	600373	中文传媒	1,468,800	18,433,440.00	0.25
122	600380	健康元	1,635,017	18,426,641.59	0.25
123	688169	石头科技	82,775	18,151,729.75	0.25
124	603605	珀莱雅	213,127	18,051,856.90	0.25
125	000725	京东方A	4,097,200	17,986,708.00	0.25
126	601696	中银证券	1,608,500	17,950,860.00	0.25
127	601728	中国电信	2,477,000	17,883,940.00	0.24
128	600511	国药股份	517,586	17,711,792.92	0.24
129	300529	健帆生物	601,100	17,636,274.00	0.24
130	600941	中国移动	148,700	17,570,392.00	0.24
131	601016	节能风电	5,444,700	17,259,699.00	0.24
132	300601	康泰生物	1,000,436	17,157,477.40	0.23
133	688180	君实生物	623,686	17,045,338.38	0.23
134	300017	网宿科技	1,602,138	16,934,598.66	0.23
135	002532	天山铝业	2,145,000	16,881,150.00	0.23

136	002185	华天科技	1,453,058	16,870,003.38	0.23
137	300476	胜宏科技	399,300	16,806,537.00	0.23
138	600377	宁沪高速	1,096,250	16,783,587.50	0.23
139	601162	天风证券	3,738,500	16,748,480.00	0.23
140	601228	广州港	4,918,200	16,672,698.00	0.23
141	300142	沃森生物	1,375,000	16,610,000.00	0.23
142	600655	豫园股份	2,571,000	16,531,530.00	0.23
143	688099	晶晨股份	238,960	16,411,772.80	0.22
144	300627	华测导航	389,378	16,276,000.40	0.22
145	600098	广州发展	2,516,100	16,153,362.00	0.22
146	000878	云南铜业	1,323,200	16,129,808.00	0.22
147	600663	陆家嘴	1,634,112	16,079,662.08	0.22
148	601615	明阳智能	1,270,300	16,018,483.00	0.22
149	002368	太极股份	670,700	15,882,176.00	0.22
150	600968	海油发展	3,701,000	15,803,270.00	0.22
151	002410	广联达	1,332,500	15,670,200.00	0.21
152	002156	通富微电	528,900	15,628,995.00	0.21
153	603185	弘元绿能	961,737	15,628,226.25	0.21
154	600688	上海石化	5,159,700	15,582,294.00	0.21
155	688578	艾力斯	260,048	15,576,875.20	0.21
156	600582	天地科技	2,517,948	15,560,918.64	0.21
157	601928	凤凰传媒	1,344,581	15,516,464.74	0.21
158	300558	贝达药业	285,000	15,370,050.00	0.21
159	600958	东方证券	1,455,000	15,364,800.00	0.21
160	300073	当升科技	378,200	15,233,896.00	0.21
161	601099	太平洋	3,515,800	14,977,308.00	0.20
162	603160	汇顶科技	184,003	14,819,601.62	0.20
163	002423	中粮资本	1,096,900	14,687,491.00	0.20
164	600517	国网英大	2,614,967	14,408,468.17	0.20
165	601158	重庆水务	2,934,400	14,378,560.00	0.20
166	601816	京沪高铁	2,300,400	14,170,464.00	0.19
167	601568	北元集团	3,336,910	14,015,022.00	0.19
168	600900	长江电力	471,500	13,932,825.00	0.19
169	601988	中国银行	2,518,300	13,875,833.00	0.19
170	600028	中国石化	2,074,930	13,860,532.40	0.19
171	601939	建设银行	1,574,600	13,840,734.00	0.19
172	600032	浙江新能	1,864,000	13,793,600.00	0.19
173	000021	深科技	720,632	13,735,245.92	0.19
174	600536	中国软件	292,976	13,679,049.44	0.19
175	000429	粤高速 A	929,190	13,659,093.00	0.19
176	300054	鼎龙股份	519,500	13,517,390.00	0.18

177	002984	森麒麟	540,800	13,336,128.00	0.18
178	601717	郑煤机	1,023,651	13,286,989.98	0.18
179	601077	渝农商行	2,163,600	13,089,780.00	0.18
180	002353	杰瑞股份	348,900	12,905,811.00	0.18
181	600765	中航重机	624,700	12,787,609.00	0.17
182	688375	国博电子	258,397	12,754,475.92	0.17
183	601006	大秦铁路	1,862,000	12,624,360.00	0.17
184	603290	斯达半导	140,420	12,612,524.40	0.17
185	000987	越秀资本	1,780,700	12,500,514.00	0.17
186	000683	远兴能源	2,231,745	12,475,454.55	0.17
187	688234	天岳先进	243,021	12,442,675.20	0.17
188	688516	奥特维	286,338	12,401,298.78	0.17
189	600839	四川长虹	1,269,900	12,254,535.00	0.17
190	000778	新兴铸管	3,166,400	12,158,976.00	0.17
191	300750	宁德时代	45,537	12,112,842.00	0.17
192	688213	思特威	154,932	12,041,315.04	0.16
193	603858	步长制药	755,500	11,936,900.00	0.16
194	603939	益丰药房	492,596	11,886,341.48	0.16
195	002385	大北农	2,743,100	11,877,623.00	0.16
196	600926	杭州银行	809,800	11,831,178.00	0.16
197	301236	软通动力	200,556	11,774,642.76	0.16
198	601608	中信重工	2,801,200	11,765,040.00	0.16
199	002281	光迅科技	225,400	11,759,118.00	0.16
200	601399	国机重装	3,799,300	11,701,844.00	0.16
201	002967	广电计量	692,142	11,351,128.80	0.16
202	603826	坤彩科技	588,280	11,324,390.00	0.15
203	002203	海亮股份	1,053,331	11,323,308.25	0.15
204	002294	信立泰	365,600	11,308,008.00	0.15
205	601128	常熟银行	1,478,197	11,189,951.29	0.15
206	603087	甘李药业	252,680	11,143,188.00	0.15
207	001227	兰州银行	4,499,800	11,069,508.00	0.15
208	688220	翱捷科技	204,033	11,036,144.97	0.15
209	600361	创新新材	2,850,148	11,001,571.28	0.15
210	300136	信维通信	431,100	10,967,184.00	0.15
211	300408	三环集团	280,800	10,813,608.00	0.15
212	601398	工商银行	1,529,950	10,587,254.00	0.14
213	002465	海格通信	957,666	10,515,172.68	0.14
214	600316	洪都航空	327,300	10,512,876.00	0.14
215	002865	钧达股份	204,476	10,448,723.60	0.14
216	002558	巨人网络	819,000	10,393,110.00	0.14
217	002008	大族激光	413,800	10,345,000.00	0.14

218	688301	奕瑞科技	107,952	10,316,972.64	0.14
219	601766	中国中车	1,230,250	10,309,495.00	0.14
220	601665	齐鲁银行	1,834,713	10,256,045.67	0.14
221	688819	天能股份	375,605	10,223,968.10	0.14
222	601818	光大银行	2,631,900	10,185,453.00	0.14
223	601966	玲珑轮胎	562,800	10,152,912.00	0.14
224	600390	五矿资本	1,562,600	10,078,770.00	0.14
225	002683	广东宏大	378,806	10,030,782.88	0.14
226	000733	振华科技	235,800	9,943,686.00	0.14
227	002152	广电运通	852,379	9,938,739.14	0.14
228	600109	国金证券	1,130,200	9,866,646.00	0.13
229	002508	老板电器	453,900	9,727,077.00	0.13
230	603338	浙江鼎力	150,723	9,724,647.96	0.13
231	300803	指南针	101,000	9,690,950.00	0.13
232	600438	通威股份	437,600	9,675,336.00	0.13
233	000783	长江证券	1,418,220	9,672,260.40	0.13
234	600637	东方明珠	1,224,746	9,504,028.96	0.13
235	300394	天孚通信	104,000	9,501,440.00	0.13
236	002568	百润股份	333,100	9,330,131.00	0.13
237	688252	天德钰	381,180	9,129,261.00	0.12
238	001286	陕西能源	982,800	9,120,384.00	0.12
239	600549	厦门钨业	473,088	9,116,405.76	0.12
240	002387	维信诺	873,793	8,982,592.04	0.12
241	002373	千方科技	884,800	8,971,872.00	0.12
242	301327	华宝新能	116,600	8,944,386.00	0.12
243	601958	金钼股份	880,700	8,859,842.00	0.12
244	002056	横店东磁	679,600	8,807,616.00	0.12
245	002850	科达利	89,300	8,722,824.00	0.12
246	601088	中国神华	199,700	8,682,956.00	0.12
247	600895	张江高科	321,600	8,618,880.00	0.12
248	300012	华测检测	689,700	8,572,971.00	0.12
249	300024	机器人	477,100	8,563,945.00	0.12
250	688425	铁建重工	1,939,427	8,533,478.80	0.12
251	601319	中国人保	1,117,639	8,516,409.18	0.12
252	600216	浙江医药	534,500	8,477,170.00	0.12
253	603650	彤程新材	239,700	8,382,309.00	0.11
254	001965	招商公路	593,600	8,280,720.00	0.11
255	688525	佰维存储	133,113	8,249,012.61	0.11
256	600998	九州通	1,607,685	8,231,347.20	0.11
257	002409	雅克科技	141,516	8,200,852.20	0.11
258	002500	山西证券	1,298,100	8,152,068.00	0.11

259	002563	森马服饰	1,160,625	8,147,587.50	0.11
260	002085	万丰奥威	425,700	8,067,015.00	0.11
261	601456	国联民生	595,000	8,044,400.00	0.11
262	301165	锐捷网络	110,769	7,997,521.80	0.11
263	603995	甬金股份	431,400	7,890,306.00	0.11
264	000883	湖北能源	1,570,800	7,822,584.00	0.11
265	002926	华西证券	932,500	7,749,075.00	0.11
266	600258	首旅酒店	525,500	7,709,085.00	0.11
267	301029	怡合达	309,540	7,651,828.80	0.10
268	600079	人福医药	325,700	7,614,866.00	0.10
269	600183	生益科技	313,500	7,539,675.00	0.10
270	301358	湖南裕能	166,074	7,526,473.68	0.10
271	688521	芯原股份	142,499	7,471,222.57	0.10
272	002739	万达电影	613,814	7,451,701.96	0.10
273	300604	长川科技	167,800	7,405,014.00	0.10
274	002025	航天电器	151,912	7,376,846.72	0.10
275	000975	山金国际	474,100	7,286,917.00	0.10
276	605117	德业股份	85,500	7,250,400.00	0.10
277	300114	中航电测	99,770	7,161,490.60	0.10
278	300223	北京君正	105,000	7,161,000.00	0.10
279	603707	健友股份	519,520	6,894,030.40	0.09
280	601009	南京银行	646,800	6,888,420.00	0.09
281	600859	王府井	446,700	6,883,647.00	0.09
282	601106	中国一重	2,354,300	6,851,013.00	0.09
283	300763	锦浪科技	111,400	6,803,198.00	0.09
284	000034	神州数码	193,200	6,771,660.00	0.09
285	600301	华锡有色	398,000	6,769,980.00	0.09
286	601000	唐山港	1,431,150	6,740,716.50	0.09
287	601061	中信金属	921,600	6,690,816.00	0.09
288	600398	海澜之家	884,453	6,633,397.50	0.09
289	301377	鼎泰高科	312,465	6,608,634.75	0.09
290	603067	振华股份	515,500	6,510,765.00	0.09
291	688617	惠泰医疗	17,464	6,502,371.12	0.09
292	601155	新城控股	541,500	6,476,340.00	0.09
293	603688	石英股份	223,388	6,417,937.24	0.09
294	301498	乖宝宠物	81,000	6,343,920.00	0.09
295	000539	粤电力A	1,392,800	6,309,384.00	0.09
296	605499	东鹏饮料	25,207	6,264,443.64	0.09
297	688063	派能科技	156,150	6,253,807.50	0.09
298	000039	中集集团	789,450	6,134,026.50	0.08
299	688536	思瑞浦	64,625	5,977,812.50	0.08

300	688321	微芯生物	319,920	5,944,113.60	0.08
301	605305	中际联合	208,400	5,903,972.00	0.08
302	002928	华夏航空	757,100	5,875,096.00	0.08
303	002073	软控股份	705,400	5,826,604.00	0.08
304	600196	复星医药	228,700	5,683,195.00	0.08
305	603606	东方电缆	107,800	5,664,890.00	0.08
306	000528	柳工	468,700	5,652,522.00	0.08
307	601567	三星医疗	182,100	5,601,396.00	0.08
308	000997	新大陆	279,462	5,575,266.90	0.08
309	688076	诺泰生物	106,203	5,514,059.76	0.08
310	600906	财达证券	775,200	5,503,920.00	0.08
311	688599	天合光能	283,199	5,465,740.70	0.07
312	002001	新和成	248,732	5,464,642.04	0.07
313	688018	乐鑫科技	24,909	5,430,162.00	0.07
314	000089	深圳机场	774,500	5,336,305.00	0.07
315	688563	航材股份	95,501	5,332,775.84	0.07
316	300502	新易盛	45,935	5,309,167.30	0.07
317	688235	百济神州	32,326	5,205,132.52	0.07
318	600995	南网储能	506,500	5,125,780.00	0.07
319	000027	深圳能源	783,633	5,077,941.84	0.07
320	002155	湖南黄金	322,700	5,076,071.00	0.07
321	603444	吉比特	23,100	5,055,204.00	0.07
322	000563	陕国投A	1,418,630	5,050,322.80	0.07
323	301301	川宁生物	414,800	4,919,528.00	0.07
324	300308	中际旭创	39,656	4,897,912.56	0.07
325	600482	中国动力	200,100	4,896,447.00	0.07
326	000960	锡业股份	348,800	4,893,664.00	0.07
327	600329	达仁堂	156,200	4,810,960.00	0.07
328	002624	完美世界	462,930	4,782,066.90	0.07
329	600085	同仁堂	117,800	4,781,502.00	0.07
330	688095	福昕软件	70,941	4,764,397.56	0.07
331	002262	恩华药业	195,468	4,759,645.80	0.07
332	600155	华创云信	640,701	4,741,187.40	0.06
333	603556	海兴电力	127,994	4,734,498.06	0.06
334	600141	兴发集团	218,100	4,732,770.00	0.06
335	600062	华润双鹤	238,325	4,718,835.00	0.06
336	688798	艾为电子	67,563	4,717,248.66	0.06
337	688248	南网科技	146,834	4,711,903.06	0.06
338	002014	永新股份	429,500	4,707,320.00	0.06
339	000630	铜陵有色	1,457,292	4,707,053.16	0.06
340	002252	上海莱士	674,300	4,693,128.00	0.06

341	000895	双汇发展	178,900	4,644,244.00	0.06
342	002970	锐明技术	95,000	4,524,850.00	0.06
343	301339	通行宝	221,300	4,501,242.00	0.06
344	601658	邮储银行	786,500	4,467,320.00	0.06
345	688122	西部超导	103,606	4,436,408.92	0.06
346	000776	广发证券	273,000	4,425,330.00	0.06
347	600718	东软集团	398,600	4,292,922.00	0.06
348	603456	九洲药业	311,922	4,267,092.96	0.06
349	600989	宝丰能源	252,000	4,243,680.00	0.06
350	300390	天华新能	181,254	4,177,904.70	0.06
351	601127	赛力斯	31,200	4,161,768.00	0.06
352	002608	江苏国信	541,300	4,151,771.00	0.06
353	688253	英诺特	111,664	4,048,936.64	0.06
354	600498	烽火通信	207,755	4,042,912.30	0.06
355	600372	中航机载	325,761	4,016,633.13	0.05
356	688052	纳芯微	30,816	4,015,324.80	0.05
357	002673	西部证券	489,400	3,988,610.00	0.05
358	600160	巨化股份	164,000	3,955,680.00	0.05
359	603658	安图生物	90,374	3,943,921.36	0.05
360	000977	浪潮信息	75,800	3,932,504.00	0.05
361	600378	昊华科技	135,250	3,910,077.50	0.05
362	600118	中国卫星	143,200	3,909,360.00	0.05
363	603596	伯特利	86,780	3,869,520.20	0.05
364	600580	卧龙电驱	223,868	3,848,290.92	0.05
365	002483	润邦股份	737,900	3,844,459.00	0.05
366	002206	海利得	895,600	3,842,124.00	0.05
367	601825	沪农商行	450,900	3,837,159.00	0.05
368	600399	抚顺特钢	647,900	3,757,820.00	0.05
369	600219	南山铝业	956,200	3,738,742.00	0.05
370	300577	开润股份	148,500	3,690,225.00	0.05
371	600927	永安期货	277,000	3,653,630.00	0.05
372	688008	澜起科技	53,423	3,627,421.70	0.05
373	603039	泛微网络	73,700	3,611,300.00	0.05
374	689009	九号公司	76,021	3,610,997.50	0.05
375	601021	春秋航空	62,400	3,598,608.00	0.05
376	600050	中国联通	672,900	3,573,099.00	0.05
377	000681	视觉中国	170,200	3,543,564.00	0.05
378	688385	复旦微电	91,856	3,526,351.84	0.05
379	600548	深高速	260,500	3,511,540.00	0.05
380	601156	东航物流	207,487	3,500,305.69	0.05
381	601838	成都银行	203,500	3,481,885.00	0.05

382	603379	三美股份	90,140	3,459,573.20	0.05
383	002003	伟星股份	242,900	3,441,893.00	0.05
384	002615	哈尔斯	430,600	3,423,270.00	0.05
385	002284	亚太股份	442,100	3,421,854.00	0.05
386	688172	燕东微	168,573	3,379,888.65	0.05
387	603612	索通发展	248,300	3,354,533.00	0.05
388	600699	均胜电子	213,007	3,337,819.69	0.05
389	603986	兆易创新	31,200	3,332,160.00	0.05
390	600131	国网信通	175,400	3,316,814.00	0.05
391	301187	欧圣电气	96,600	3,294,060.00	0.05
392	002268	电科网安	200,329	3,255,346.25	0.04
393	300003	乐普医疗	286,986	3,254,421.24	0.04
394	603737	三棵树	76,300	3,250,380.00	0.04
395	000009	中国宝安	351,208	3,213,553.20	0.04
396	002380	科远智慧	172,800	3,193,344.00	0.04
397	003031	中瓷电子	60,840	3,187,407.60	0.04
398	300433	蓝思科技	144,900	3,173,310.00	0.04
399	002938	鹏鼎控股	86,800	3,166,464.00	0.04
400	600546	山煤国际	264,200	3,125,486.00	0.04
401	688538	和辉光电	1,335,497	3,098,353.04	0.04
402	603516	淳中科技	55,520	3,069,145.60	0.04
403	600566	济川药业	105,310	3,062,414.80	0.04
404	002384	东山精密	103,900	3,033,880.00	0.04
405	000401	冀东水泥	576,500	3,015,095.00	0.04
406	002430	杭氧股份	138,193	3,012,607.40	0.04
407	002916	深南电路	24,000	3,000,000.00	0.04
408	603129	春风动力	19,000	2,984,330.00	0.04
409	688331	荣昌生物	99,099	2,983,870.89	0.04
410	300253	卫宁健康	416,700	2,983,572.00	0.04
411	600660	福耀玻璃	47,700	2,976,480.00	0.04
412	688120	华海清科	18,204	2,967,069.96	0.04
413	688188	柏楚电子	15,225	2,957,456.25	0.04
414	300595	欧普康视	150,176	2,845,835.20	0.04
415	000831	中国稀土	100,700	2,824,635.00	0.04
416	300674	宇信科技	144,200	2,814,784.00	0.04
417	601169	北京银行	454,400	2,794,560.00	0.04
418	000519	中兵红箭	193,200	2,791,740.00	0.04
419	601233	桐昆股份	236,300	2,788,340.00	0.04
420	688598	金博股份	131,762	2,774,907.72	0.04
421	688088	虹软科技	71,796	2,768,453.76	0.04
422	300888	稳健医疗	65,000	2,735,200.00	0.04

423	002439	启明星辰	170,300	2,694,146.00	0.04
424	600535	天士力	186,220	2,692,741.20	0.04
425	688381	帝奥微	139,096	2,681,770.88	0.04
426	600867	通化东宝	330,600	2,664,636.00	0.04
427	603416	信捷电气	62,400	2,617,680.00	0.04
428	300496	中科创达	43,500	2,590,860.00	0.04
429	000898	鞍钢股份	1,078,000	2,587,200.00	0.04
430	601139	深圳燃气	364,140	2,570,828.40	0.04
431	601666	平煤股份	255,200	2,557,104.00	0.03
432	300624	万兴科技	40,400	2,551,260.00	0.03
433	300036	超图软件	149,000	2,530,020.00	0.03
434	688111	金山办公	8,830	2,528,823.70	0.03
435	300996	普联软件	139,120	2,520,854.40	0.03
436	002939	长城证券	307,100	2,518,220.00	0.03
437	688009	中国通号	399,940	2,503,624.40	0.03
438	002906	华阳集团	81,100	2,493,825.00	0.03
439	002120	韵达股份	331,400	2,492,128.00	0.03
440	000400	许继电气	89,826	2,472,909.78	0.03
441	688032	禾迈股份	21,796	2,455,101.44	0.03
442	002230	科大讯飞	50,500	2,440,160.00	0.03
443	688711	宏微科技	139,812	2,415,951.36	0.03
444	603529	爱玛科技	58,800	2,411,976.00	0.03
445	688297	中无人机	59,852	2,410,838.56	0.03
446	600848	上海临港	235,160	2,375,116.00	0.03
447	688981	中芯国际	24,952	2,360,958.24	0.03
448	300229	拓尔思	111,650	2,337,951.00	0.03
449	002080	中材科技	178,600	2,336,088.00	0.03
450	688567	孚能科技	201,229	2,334,256.40	0.03
451	300900	广联航空	106,000	2,332,000.00	0.03
452	600728	佳都科技	497,400	2,327,832.00	0.03
453	001339	智微智能	63,200	2,312,488.00	0.03
454	688183	生益电子	58,876	2,311,471.76	0.03
455	688049	炬芯科技	51,209	2,297,747.83	0.03
456	688281	华秦科技	24,660	2,295,846.00	0.03
457	688352	颀中科技	188,870	2,290,993.10	0.03
458	301171	易点天下	80,700	2,274,933.00	0.03
459	300033	同花顺	7,900	2,271,250.00	0.03
460	300015	爱尔眼科	170,600	2,260,450.00	0.03
461	300383	光环新网	154,902	2,260,020.18	0.03
462	688608	恒玄科技	6,920	2,251,560.40	0.03
463	300438	鹏辉能源	78,800	2,215,068.00	0.03

464	000888	峨眉山 A	167,000	2,209,410.00	0.03
465	600348	华阳股份	310,450	2,201,090.50	0.03
466	300676	华大基因	52,351	2,197,171.47	0.03
467	600392	盛和资源	212,600	2,185,528.00	0.03
468	300418	昆仑万维	56,503	2,174,235.44	0.03
469	300474	景嘉微	23,200	2,168,968.00	0.03
470	603317	天味食品	159,476	2,127,409.84	0.03
471	688123	聚辰股份	36,311	2,124,919.72	0.03
472	601179	中国西电	279,517	2,121,534.03	0.03
473	300285	国瓷材料	122,200	2,082,288.00	0.03
474	300782	卓胜微	23,100	2,072,070.00	0.03
475	600732	爱旭股份	188,000	2,071,760.00	0.03
476	688348	昱能科技	42,405	2,069,364.00	0.03
477	688396	华润微	43,559	2,055,549.21	0.03
478	688508	芯朋微	47,736	2,051,215.92	0.03
479	603927	中科软	94,296	2,046,223.20	0.03
480	688019	安集科技	14,520	2,023,507.20	0.03
481	300118	东方日升	167,500	2,006,650.00	0.03
482	000032	深桑达 A	113,300	1,998,612.00	0.03
483	601916	浙商银行	685,800	1,995,678.00	0.03
484	300661	圣邦股份	24,400	1,995,432.00	0.03
485	002945	华林证券	129,900	1,991,367.00	0.03
486	601919	中远海控	127,600	1,977,800.00	0.03
487	300058	蓝色光标	212,100	1,968,288.00	0.03
488	601877	正泰电器	84,000	1,966,440.00	0.03
489	688368	晶丰明源	21,995	1,957,555.00	0.03
490	300458	全志科技	50,500	1,957,380.00	0.03
491	688107	安路科技	66,136	1,956,302.88	0.03
492	688223	晶科能源	272,230	1,935,555.30	0.03
493	601369	陕鼓动力	222,020	1,931,574.00	0.03
494	688114	华大智造	41,120	1,924,004.80	0.03
495	000951	中国重汽	112,400	1,908,552.00	0.03
496	688256	寒武纪	2,881	1,895,698.00	0.03
497	688233	神工股份	80,250	1,881,862.50	0.03
498	301308	江波龙	21,800	1,874,800.00	0.03
499	603501	韦尔股份	17,900	1,868,939.00	0.03
500	002487	大金重工	91,000	1,864,590.00	0.03
501	002777	久远银海	108,000	1,859,760.00	0.03
502	300360	炬华科技	110,400	1,851,408.00	0.03
503	688126	沪硅产业	97,719	1,839,071.58	0.03
504	600460	士兰微	70,500	1,834,410.00	0.03

505	688766	普冉股份	18,045	1,827,236.70	0.02
506	002244	滨江集团	210,900	1,815,849.00	0.02
507	600115	中国东航	451,000	1,804,000.00	0.02
508	000591	太阳能	377,600	1,797,376.00	0.02
509	002709	天赐材料	89,000	1,755,080.00	0.02
510	300181	佐力药业	114,200	1,754,112.00	0.02
511	002958	青农商行	574,300	1,745,872.00	0.02
512	600060	海信视像	87,500	1,744,750.00	0.02
513	002738	中矿资源	49,140	1,744,470.00	0.02
514	300498	温氏股份	105,000	1,733,550.00	0.02
515	300765	新诺威	65,008	1,728,562.72	0.02
516	300124	汇川技术	28,900	1,692,962.00	0.02
517	000932	华菱钢铁	404,682	1,691,570.76	0.02
518	300979	华利集团	21,500	1,690,975.00	0.02
519	300413	芒果超媒	62,000	1,667,180.00	0.02
520	688561	奇安信	61,994	1,663,299.02	0.02
521	300972	万辰集团	20,300	1,632,323.00	0.02
522	300623	捷捷微电	47,700	1,629,432.00	0.02
523	600019	宝钢股份	232,200	1,625,400.00	0.02
524	000404	长虹华意	218,400	1,616,160.00	0.02
525	600739	辽宁成大	153,611	1,589,873.85	0.02
526	600095	湘财股份	219,700	1,581,840.00	0.02
527	603799	华友钴业	53,960	1,578,869.60	0.02
528	300144	宋城演艺	168,600	1,566,294.00	0.02
529	002371	北方华创	4,000	1,564,000.00	0.02
530	002405	四维图新	162,000	1,561,680.00	0.02
531	688510	航亚科技	89,509	1,559,246.78	0.02
532	603882	金域医学	56,300	1,549,939.00	0.02
533	300748	金力永磁	86,600	1,548,408.00	0.02
534	002922	伊戈尔	86,400	1,539,648.00	0.02
535	000426	兴业银锡	136,706	1,520,170.72	0.02
536	300666	江丰电子	21,400	1,486,230.00	0.02
537	300776	帝尔激光	23,341	1,484,020.78	0.02
538	600755	厦门国贸	223,000	1,480,720.00	0.02
539	300009	安科生物	170,165	1,470,225.60	0.02
540	300037	新宙邦	39,200	1,467,648.00	0.02
541	600009	上海机场	42,900	1,465,035.00	0.02
542	688522	纳睿雷达	25,799	1,453,515.66	0.02
543	600872	中炬高新	66,000	1,453,320.00	0.02
544	600012	皖通高速	81,900	1,445,535.00	0.02
545	300146	汤臣倍健	118,900	1,432,745.00	0.02

546	600036	招商银行	36,400	1,430,520.00	0.02
547	300842	帝科股份	34,640	1,420,932.80	0.02
548	002881	美格智能	46,800	1,402,128.00	0.02
549	300274	阳光电源	18,900	1,395,387.00	0.02
550	300850	新强联	73,000	1,395,030.00	0.02
551	601618	中国中冶	421,200	1,389,960.00	0.02
552	300083	创世纪	212,200	1,381,422.00	0.02
553	601211	国泰君安	74,000	1,380,100.00	0.02
554	600745	闻泰科技	35,500	1,376,690.00	0.02
555	002065	东华软件	188,357	1,367,471.82	0.02
556	600176	中国巨石	120,000	1,366,800.00	0.02
557	000155	川能动力	127,000	1,356,360.00	0.02
558	600596	新安股份	154,000	1,352,120.00	0.02
559	688082	盛美上海	13,508	1,350,800.00	0.02
560	000703	恒逸石化	214,880	1,349,446.40	0.02
561	688072	拓荆科技	8,749	1,344,458.83	0.02
562	688153	唯捷创芯	39,981	1,337,764.26	0.02
563	301080	百普赛斯	30,100	1,328,614.00	0.02
564	000893	亚钾国际	65,400	1,318,464.00	0.02
565	000902	新洋丰	101,100	1,318,344.00	0.02
566	600529	山东药玻	50,917	1,312,131.09	0.02
567	002318	久立特材	55,500	1,299,255.00	0.02
568	002531	天顺风能	164,000	1,297,240.00	0.02
569	603883	老百姓	79,040	1,293,884.80	0.02
570	688041	海光信息	8,600	1,288,194.00	0.02
571	002139	拓邦股份	94,500	1,286,145.00	0.02
572	688556	高测股份	113,714	1,271,322.52	0.02
573	002044	美年健康	276,400	1,268,676.00	0.02
574	301267	华夏眼科	66,200	1,260,448.00	0.02
575	300918	南山智尚	122,200	1,259,882.00	0.02
576	000959	首钢股份	412,500	1,258,125.00	0.02
577	002468	申通快递	123,700	1,253,081.00	0.02
578	300685	艾德生物	54,900	1,251,720.00	0.02
579	003035	南网能源	298,600	1,248,148.00	0.02
580	000848	承德露露	139,100	1,247,727.00	0.02
581	000963	华东医药	35,900	1,242,140.00	0.02
582	601901	方正证券	149,000	1,241,170.00	0.02
583	001203	大中矿业	142,600	1,234,916.00	0.02
584	688110	东芯股份	49,369	1,229,288.10	0.02
585	600416	湘电股份	108,000	1,219,320.00	0.02
586	002557	洽洽食品	41,400	1,202,670.00	0.02

587	688286	敏芯股份	19,794	1,192,588.50	0.02
588	300919	中伟股份	33,000	1,191,960.00	0.02
589	000629	钒钛股份	413,800	1,191,744.00	0.02
590	688595	芯海科技	36,319	1,191,263.20	0.02
591	600584	长电科技	29,000	1,184,940.00	0.02
592	002407	多氟多	98,560	1,182,720.00	0.02
593	002756	永兴材料	31,200	1,176,864.00	0.02
594	002867	周大生	80,900	1,175,477.00	0.02
595	002987	京北方	82,300	1,171,129.00	0.02
596	605333	沪光股份	35,800	1,168,154.00	0.02
597	002049	紫光国微	17,800	1,145,786.00	0.02
598	301004	嘉益股份	9,900	1,144,935.00	0.02
599	688728	格科微	84,511	1,135,827.84	0.02
600	605111	新洁能	33,088	1,122,014.08	0.02
601	601058	赛轮轮胎	77,237	1,106,806.21	0.02
602	300327	中颖电子	45,100	1,103,597.00	0.02
603	600499	科达制造	140,600	1,096,680.00	0.01
604	000998	隆平高科	97,500	1,089,075.00	0.01
605	600959	江苏有线	322,913	1,081,758.55	0.01
606	600435	北方导航	109,100	1,064,816.00	0.01
607	002436	兴森科技	95,600	1,062,116.00	0.01
608	600325	华发股份	182,000	1,048,320.00	0.01
609	002372	伟星新材	82,200	1,038,186.00	0.01
610	300130	新国都	47,800	1,035,348.00	0.01
611	600803	新奥股份	47,700	1,034,136.00	0.01
612	603712	七一二	52,967	1,031,267.49	0.01
613	603228	景旺电子	36,779	1,023,927.36	0.01
614	603138	海量数据	70,500	1,013,085.00	0.01
615	688498	源杰科技	7,482	1,004,084.40	0.01
616	002159	三特索道	63,000	983,430.00	0.01
617	300747	锐科激光	50,800	973,328.00	0.01
618	300680	隆盛科技	40,400	967,984.00	0.01
619	688066	航天宏图	47,170	962,268.00	0.01
620	603209	兴通股份	59,800	955,604.00	0.01
621	300070	碧水源	186,000	941,160.00	0.01
622	600271	航天信息	101,654	926,067.94	0.01
623	600056	中国医药	82,780	918,858.00	0.01
624	603589	口子窖	23,400	918,216.00	0.01
625	300790	宇瞳光学	47,597	908,626.73	0.01
626	002607	中公教育	266,600	906,440.00	0.01
627	603728	鸣志电器	16,400	885,600.00	0.01

628	603179	新泉股份	20,700	883,890.00	0.01
629	603486	科沃斯	18,700	878,900.00	0.01
630	002129	TCL 中环	97,000	860,390.00	0.01
631	300525	博思软件	54,100	842,878.00	0.01
632	301332	德尔玛	83,000	831,660.00	0.01
633	002603	以岭药业	50,600	810,106.00	0.01
634	688559	海目星	23,500	808,400.00	0.01
635	300349	金卡智能	58,700	802,429.00	0.01
636	002707	众信旅游	107,100	791,469.00	0.01
637	603000	人民网	35,700	786,828.00	0.01
638	002463	沪电股份	19,500	773,175.00	0.01
639	002460	赣锋锂业	21,200	742,212.00	0.01
640	600456	宝钛股份	24,800	705,560.00	0.01
641	300855	图南股份	32,000	701,440.00	0.01
642	600764	中国海防	24,600	696,672.00	0.01
643	601607	上海医药	32,500	682,500.00	0.01
644	300769	德方纳米	18,280	674,166.40	0.01
645	002807	江阴银行	154,700	672,945.00	0.01
646	688349	三一重能	21,674	669,293.12	0.01
647	688772	珠海冠宇	41,500	667,320.00	0.01
648	301039	中集车辆	72,000	651,600.00	0.01
649	002034	旺能环境	41,900	649,450.00	0.01
650	600763	通策医疗	14,600	648,240.00	0.01
651	002461	珠江啤酒	65,114	643,977.46	0.01
652	603309	维力医疗	53,400	639,732.00	0.01
653	300773	拉卡拉	36,000	637,200.00	0.01
654	688146	中船特气	21,810	633,362.40	0.01
655	600132	重庆啤酒	9,900	623,898.00	0.01
656	688639	华恒生物	19,084	614,695.64	0.01
657	301153	中科江南	21,863	610,852.22	0.01
658	300218	安利股份	39,400	606,760.00	0.01
659	603323	苏农银行	114,200	604,118.00	0.01
660	002659	凯文教育	132,800	600,256.00	0.01
661	600129	太极集团	24,000	593,280.00	0.01
662	603408	建霖家居	47,000	588,910.00	0.01
663	000723	美锦能源	127,900	576,829.00	0.01
664	603983	丸美生物	17,700	571,002.00	0.01
665	688472	阿特斯	43,933	551,798.48	0.01
666	600295	鄂尔多斯	55,800	544,608.00	0.01
667	300119	瑞普生物	28,800	529,056.00	0.01
668	300363	博腾股份	32,500	512,525.00	0.01

669	601186	中国铁建	55,600	509,852.00	0.01
670	002550	千红制药	81,100	502,820.00	0.01
671	601598	中国外运	91,100	487,385.00	0.01
672	300708	聚灿光电	38,400	479,616.00	0.01
673	003022	联泓新科	34,600	476,442.00	0.01
674	600583	海油工程	87,000	475,890.00	0.01
675	300463	迈克生物	36,000	475,200.00	0.01
676	300140	节能环境	77,200	462,428.00	0.01
677	603337	杰克股份	15,100	459,946.00	0.01
678	688363	华熙生物	7,796	397,907.84	0.01
679	688475	萤石网络	13,101	395,519.19	0.01
680	002726	龙大美食	49,400	391,248.00	0.01
681	002020	京新药业	30,000	384,000.00	0.01
682	300861	美畅股份	19,100	381,045.00	0.01
683	002851	麦格米特	6,100	374,906.00	0.01
684	688017	绿的谐波	3,227	348,709.62	0.00
685	601137	博威合金	17,000	345,100.00	0.00
686	603508	思维列控	14,500	344,810.00	0.00
687	002895	川恒股份	14,000	344,400.00	0.00
688	603298	杭叉集团	19,141	342,432.49	0.00
689	002839	张家港行	77,200	337,364.00	0.00
690	002690	美亚光电	22,000	326,040.00	0.00
691	002649	博彦科技	26,900	326,028.00	0.00
692	000750	国海证券	75,900	324,852.00	0.00
693	603733	仙鹤股份	15,200	313,576.00	0.00
694	688278	特宝生物	4,080	299,349.60	0.00
695	300957	贝泰妮	7,000	298,830.00	0.00
696	600641	万业企业	20,200	295,324.00	0.00
697	300770	新媒股份	7,200	290,952.00	0.00
698	688362	甬矽电子	8,242	277,590.56	0.00
699	300725	药石科技	8,000	268,800.00	0.00
700	002233	塔牌集团	34,500	264,615.00	0.00
701	688046	药康生物	19,694	253,067.90	0.00
702	601965	中国汽研	14,200	250,204.00	0.00
703	002961	瑞达期货	17,400	250,038.00	0.00
704	601222	林洋能源	34,900	246,743.00	0.00
705	000063	中兴通讯	5,900	238,360.00	0.00
706	605376	博迁新材	7,900	228,705.00	0.00
707	603218	日月股份	18,586	223,961.30	0.00
708	600483	福能股份	19,700	196,409.00	0.00
709	688047	龙芯中科	1,197	158,339.16	0.00

710	300568	星源材质	14,118	137,226.96	0.00
711	603288	海天味业	2,900	133,110.00	0.00
712	688543	国科军工	1,686	84,502.32	0.00
713	002111	威海广泰	6,200	68,324.00	0.00
714	605056	咸亨国际	5,300	66,197.00	0.00
715	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.00
716	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
717	688271	联影医疗	316	39,942.40	0.00
718	603259	药明康德	700	38,528.00	0.00
719	301589	诺瓦星云	221	38,365.60	0.00
720	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
721	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
722	001391	国货航	4,686	31,864.80	0.00
723	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
724	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
725	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
726	688141	杰华特	832	25,467.52	0.00
727	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
728	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
729	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
730	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
731	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
732	601799	星宇股份	100	13,348.00	0.00
733	688322	奥比中光	275	12,787.50	0.00
734	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
735	300781	因赛集团	200	11,806.00	0.00
736	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
737	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
738	688192	迪哲医药	263	10,906.61	0.00
739	600612	老凤祥	200	10,854.00	0.00
740	601318	中国平安	200	10,530.00	0.00
741	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
742	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
743	605589	圣泉集团	400	9,432.00	0.00
744	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
745	600066	宇通客车	330	8,705.40	0.00
746	002422	科伦药业	290	8,679.70	0.00
747	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
748	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
749	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
750	002028	思源电气	100	7,270.00	0.00

751	300570	太辰光	100	7,270.00	0.00
752	300832	新产业	100	7,085.00	0.00
753	688105	诺唯赞	318	7,050.06	0.00
754	002997	瑞鹄模具	200	6,930.00	0.00
755	001380	华纬科技	295	6,460.50	0.00
756	300454	深信服	100	5,740.00	0.00
757	600570	恒生电子	200	5,598.00	0.00
758	000408	藏格矿业	200	5,546.00	0.00
759	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
760	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
761	603281	江瀚新材	200	4,880.00	0.00
762	002142	宁波银行	200	4,862.00	0.00
763	300487	蓝晓科技	100	4,787.00	0.00
764	600585	海螺水泥	200	4,756.00	0.00
765	300014	亿纬锂能	100	4,674.00	0.00
766	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
767	000651	格力电器	100	4,545.00	0.00
768	603881	数据港	200	4,530.00	0.00
769	600285	羚锐制药	200	4,432.00	0.00
770	600893	航发动力	100	4,145.00	0.00
771	002352	顺丰控股	100	4,030.00	0.00
772	300590	移为通信	250	3,865.00	0.00
773	603383	顶点软件	100	3,750.00	0.00
774	002841	视源股份	100	3,691.00	0.00
775	603324	盛剑科技	140	3,624.60	0.00
776	002891	中宠股份	100	3,570.00	0.00
777	002572	索菲亚	200	3,436.00	0.00
778	002929	润建股份	100	3,362.00	0.00
779	600673	东阳光	291	3,285.39	0.00
780	600114	东睦股份	200	3,234.00	0.00
781	002979	雷赛智能	100	3,079.00	0.00
782	601869	长飞光纤	100	2,989.00	0.00
783	600845	宝信软件	100	2,926.00	0.00
784	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00
785	300738	奥飞数据	200	2,900.00	0.00
786	688089	嘉必优	150	2,854.50	0.00
787	600754	锦江酒店	100	2,686.00	0.00
788	300378	鼎捷数智	100	2,587.00	0.00
789	002130	沃尔核材	100	2,525.00	0.00
790	300775	三角防务	100	2,493.00	0.00
791	000818	航锦科技	128	2,444.80	0.00

792	603093	南华期货	200	2,380.00	0.00
793	603890	春秋电子	200	2,350.00	0.00
794	605080	浙江自然	100	2,350.00	0.00
795	603193	润本股份	100	2,335.00	0.00
796	300226	上海钢联	100	2,287.00	0.00
797	603156	养元饮品	100	2,284.00	0.00
798	002791	坚朗五金	100	2,274.00	0.00
799	002518	科士达	100	2,253.00	0.00
800	002544	普天科技	100	2,143.00	0.00
801	002245	蔚蓝锂芯	200	2,138.00	0.00
802	002074	国轩高科	100	2,122.00	0.00
803	601858	中国科传	100	2,038.00	0.00
804	300357	我武生物	100	2,032.00	0.00
805	300761	立华股份	100	1,946.00	0.00
806	300602	飞荣达	100	1,922.00	0.00
807	002648	卫星化学	100	1,879.00	0.00
808	600884	杉杉股份	251	1,869.95	0.00
809	603233	大参林	124	1,867.44	0.00
810	300031	宝通科技	100	1,832.00	0.00
811	000048	京基智农	100	1,800.00	0.00
812	000876	新 希 望	200	1,796.00	0.00
813	600882	妙可蓝多	100	1,790.00	0.00
814	600597	光明乳业	200	1,708.00	0.00
815	000933	神火股份	100	1,690.00	0.00
816	601311	骆驼股份	200	1,658.00	0.00
817	603018	华设集团	200	1,642.00	0.00
818	300115	长盈精密	100	1,624.00	0.00
819	002182	宝武镁业	140	1,579.20	0.00
820	603305	旭升集团	120	1,578.00	0.00
821	601881	中国银河	100	1,523.00	0.00
822	002275	桂林三金	100	1,509.00	0.00
823	002299	圣农发展	100	1,448.00	0.00
824	600522	中天科技	100	1,432.00	0.00
825	600985	淮北矿业	100	1,407.00	0.00
826	300772	运达股份	100	1,324.00	0.00
827	002668	TCL 智家	100	1,312.00	0.00
828	000937	冀中能源	200	1,264.00	0.00
829	000958	电投产融	200	1,246.00	0.00
830	002438	江苏神通	100	1,220.00	0.00
831	300682	朗新集团	100	1,220.00	0.00
832	000001	平安银行	100	1,170.00	0.00

833	600552	凯盛科技	100	1,141.00	0.00
834	002019	亿帆医药	100	1,072.00	0.00
835	603998	方盛制药	100	1,042.00	0.00
836	002242	九阳股份	100	1,036.00	0.00
837	600869	远东股份	200	950.00	0.00
838	601298	青岛港	100	911.00	0.00
839	600048	保利发展	100	886.00	0.00
840	688677	海泰新光	22	828.52	0.00
841	601111	中国国航	100	791.00	0.00
842	601328	交通银行	100	777.00	0.00
843	300887	谱尼测试	100	764.00	0.00
844	002452	长高电新	100	742.00	0.00
845	002027	分众传媒	100	703.00	0.00
846	601007	金陵饭店	100	701.00	0.00
847	601226	华电科工	100	676.00	0.00
848	600195	中牧股份	100	671.00	0.00
849	601669	中国电建	122	666.12	0.00
850	002658	雪迪龙	100	640.00	0.00
851	002266	浙富控股	200	624.00	0.00
852	002429	兆驰股份	100	578.00	0.00
853	688006	杭可科技	32	571.52	0.00
854	000877	天山股份	100	566.00	0.00
855	600556	天下秀	100	520.00	0.00
856	600369	西南证券	100	467.00	0.00
857	601828	美凯龙	100	321.00	0.00
858	600808	马钢股份	100	309.00	0.00
859	600170	上海建工	100	265.00	0.00

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300017	网宿科技	189,165,176.40	2.63
2	600096	云天化	186,475,889.01	2.59
3	600839	四川长虹	183,095,635.00	2.54
4	000830	鲁西化工	164,394,541.64	2.28
5	601108	财通证券	150,014,208.20	2.08

6	000729	燕京啤酒	149,532,409.40	2.08
7	601058	赛轮轮胎	147,568,390.05	2.05
8	600988	赤峰黄金	147,245,452.00	2.04
9	601555	东吴证券	146,936,657.10	2.04
10	002078	太阳纸业	140,969,402.59	1.96
11	000887	中鼎股份	139,510,997.62	1.94
12	600873	梅花生物	138,748,317.00	1.93
13	300502	新易盛	137,862,157.52	1.91
14	000423	东阿阿胶	136,306,624.99	1.89
15	601077	渝农商行	136,035,723.00	1.89
16	002064	华峰化学	132,230,849.48	1.84
17	000630	铜陵有色	131,134,022.00	1.82
18	002273	水晶光电	124,819,077.80	1.73
19	000728	国元证券	124,344,877.94	1.73
20	600580	卧龙电驱	123,007,661.32	1.71

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300017	网宿科技	233,130,242.45	3.24
2	000630	铜陵有色	218,190,065.24	3.03
3	600839	四川长虹	182,879,340.20	2.54
4	600066	宇通客车	181,386,336.65	2.52
5	601058	赛轮轮胎	175,968,972.00	2.44
6	002422	科伦药业	168,163,252.76	2.34
7	600580	卧龙电驱	167,602,238.00	2.33
8	002128	电投能源	157,732,759.83	2.19
9	600497	驰宏锌锗	157,222,630.92	2.18
10	002152	广电运通	156,304,192.87	2.17
11	603228	景旺电子	155,564,871.91	2.16
12	000830	鲁西化工	150,205,472.08	2.09
13	600096	云天化	146,312,855.28	2.03
14	600988	赤峰黄金	144,730,774.95	2.01
15	002078	太阳纸业	143,362,495.00	1.99
16	000725	京东方A	142,997,371.00	1.99
17	300502	新易盛	142,616,164.32	1.98
18	002185	华天科技	137,511,458.61	1.91
19	000513	丽珠集团	137,277,656.39	1.91

20	601077	渝农商行	136,681,962.00	1.90
----	--------	------	----------------	------

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	31,127,791,553.02
卖出股票收入（成交）总额	31,376,471,486.15

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,570,465.07	0.06
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）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	4,570,465.07	0.06

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019706	23 国债 13	45,000	4,570,465.07	0.06

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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,909,908.62
2	应收清算款	3,312,397.84
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	3,936,812.43
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	9,159,118.89

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国中证500指数增强(LOF) A/B	518,520	6,252.36	642,890,346.53	19.83	2,599,083,135.83	80.17
富国中证500指数增强(LOF) C	9,545	53,457.09	456,946,671.40	89.55	53,301,254.26	10.45
富国中证500指数增强(LOF) Y	573	2,118.58	—	—	1,213,947.49	100.00
合计	528,638	7,100.20	1,099,837,017.93	29.30	2,653,598,337.58	70.70

9.2 期末上市基金前十名持有人

富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	合肥黄山大厦酒店管理集团有限公司	1,031,747.00	1.68
2	吴林萍	707,463.00	1.15
3	范伟	700,000.00	1.14
4	厦门市营嘉系统集成技术有限公司	619,958.00	1.01
5	丁飞	597,700.00	0.97
6	陈阳	500,000.00	0.81
7	唐文萍	414,800.00	0.67
8	董理	404,400.00	0.66
9	孙选艳	401,718.00	0.65
10	李宏伟	362,575.00	0.59

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B	1,241,021.71	0.0383
	富国中证 500 指数增强 (LOF) C	86,656.84	0.0170
	富国中证 500 指数增强 (LOF) Y	26,950.14	2.2200
	合计	1,354,628.69	0.0361

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B	50~100
	富国中证 500 指数增强 (LOF) C	0
	富国中证 500 指数增强 (LOF) Y	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B	0~10

	富国中证 500 指数 增强 (LOF) C	0
	富国中证 500 指数 增强 (LOF) Y	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	富国中证 500 指 数增强 (LOF) A/B	富国中证 500 指 数增强 (LOF) C	富国中证 500 指 数增强 (LOF) Y
基金合同生效日 (2011 年 10 月 12 日) 基金份额总额	455,487,249.88	—	—
报告期期初基金份额总额	3,016,318,242.03	383,947,290.75	—
本报告期基金总申购份额	2,312,564,954.93	1,055,261,263.78	1,221,121.69
减：本报告期基金总赎回份额	2,086,909,714.60	928,960,628.87	7,174.20
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	3,241,973,482.36	510,247,925.66	1,213,947.49

注：本基金自 2024 年 12 月 13 日起增加 Y 类份额，相关数据按实际存续期计算。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 6.8 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 22 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	富国基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-02-02
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	—
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	督察长
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-02-02
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	—

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，未发生托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

东北证券	2	96,013.51	0.00	70.65	0.00	—
东方证券	4	1,729,488,251.10	2.77	1,272,741.60	5.90	—
广发证券	2	5,128,896,128.20	8.21	697,203.58	3.23	—
国海证券	2	7,827,313,180.05	12.52	5,760,101.76	26.68	—
国联民生	1	1,015,009,768.79	1.62	746,984.83	3.46	—
国泰君安	2	7,448,593,296.69	11.92	1,469,877.91	6.81	—
国投证券	2	246,436,375.84	0.39	181,358.15	0.84	—
国信证券	2	8,755,474,186.28	14.01	1,189,972.75	5.51	—
海通证券	1	6,987,761,083.60	11.18	1,833,654.69	8.49	—
华兴证券	1	—	—	—	—	—
汇丰前海	2	—	—	—	—	—
开源证券	2	493,691,303.19	0.79	363,306.85	1.68	—
申万宏源	3	4,999,812,943.71	8.00	1,536,813.95	7.12	—
兴业证券	2	972,584,637.39	1.56	715,731.80	3.32	—
浙商证券	1	333,649,107.09	0.53	245,536.44	1.14	—
中泰证券	1	6,161,286,049.89	9.86	1,577,032.99	7.31	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中信证券	3	10,400,874,654.65	16.64	3,997,414.60	18.52	—

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

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）
德邦证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—

东方证券	249,275.03	0.27	—	—	—	—
广发证券	3,315,773.98	3.57	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国联民生	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
国投证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	46,834,598.00	50.49	—	—	—	—
海通证券	38,121.83	0.04	—	—	—	—
华兴证券	—	—	—	—	—	—
汇丰前海	—	—	—	—	—	—
开源证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中泰证券	194,649.34	0.21	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	42,136,018.00	45.42	—	—	—	—

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2024 年 06 月 14 日
2	关于富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2024 年 06 月 27 日
3	关于富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2024 年 08 月 22 日
4	富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)2024 年第一次收益分配公告	规定披露媒介	2024 年 08 月 23 日
5	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 Y 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告	规定披露媒介	2024 年 12 月 12 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024-05-28 至 2024-07-04	—	973,770,682.86	924,044,178.63	49,726,504.23	1.32%

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《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运作管理办法》、《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，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定自 2024 年 12 月 13 日起，对本基金增加针对个人养老金投资基金业务单独设立的 Y 类基金份额，并对本基金的基金合同及托管协议的相应条款进行修订。具体可参见基金管理人于 2024 年 12 月 12 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 Y 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》及修订后的基金合同、托管协议。

§ 13 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的文件 2、富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同 3、富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 财务报	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 。

表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告		
-------------------------------	--	--