

富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金
二〇二三年年度报告

2023 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 03 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
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	20
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	20
§6 审计报告	21
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	21
§7 年度财务报告	23
7.1 资产负债表.....	23

7.2 利润表.....	25
7.3 净资产变动表.....	26
7.4 报表附注.....	27
§8 投资组合报告.....	61
8.1 期末基金资产组合情况.....	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	62
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.....	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	77
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	79
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.....	79
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.....	79
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.....	79
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.....	79
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	79
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	80
8.12 投资组合报告附注.....	80
§9 基金份额持有人信息.....	81
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	81
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	81
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	81
§10 开放式基金份额变动.....	82
§11 重大事件揭示.....	82
11.1 基金份额持有人大会决议.....	82
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.....	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	83
11.4 基金投资策略的改变.....	83
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	83
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.....	83
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	83
11.8 其他重大事件.....	87
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	88
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.....	88
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	88
§13 备查文件目录.....	89

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金	
基金简称	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强	
基金主代码	006034	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 12 月 25 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	106,245,420.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C
下属分级基金的交易代码	006034	014170
报告期末下属分级基金的份额总额	100,821,769.97 份	5,423,650.40 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 MSCI 中国 A 股国际通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。本基金在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。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 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。本基金的股票、存托凭证、债券、资产支持证券、金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	95%×MSCI 中国 A 股国际通指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、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	中国建设银行股份有限公司

			司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	王小飞
	联系电话	021-20361818	021-60637103
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	95105686、4008880688	021-60637228	
传真	021-20361616	021-60635778	
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼	
邮政编码	200120	100033	
法定代表人	裴长江	田国立	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	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 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国MSCI中国A股国际通指数增强A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年	2022年	2021年
---------------	-------	-------	-------

本期已实现收益	-7,137,511.35	-17,181,422.00	26,702,262.49
本期利润	-11,061,705.65	-32,464,822.62	18,200,231.10
加权平均基金份额本期利润	-0.0984	-0.3412	0.2323
本期加权平均净值利润率	-5.24%	-17.64%	11.04%
本期基金份额净值增长率	-4.26%	-14.82%	12.70%
3.1.2 期末数据和指标	2023年12月31日	2022年12月31日	2021年12月31日
期末可供分配利润	76,662,206.40	76,786,677.22	102,766,254.98
期末可供分配基金份额利润	0.7604	0.8388	1.0937
期末基金资产净值	177,483,976.37	168,335,105.93	202,841,633.87
期末基金份额净值	1.7604	1.8388	2.1588
3.1.3 累计期末指标	2023年12月31日	2022年12月31日	2021年12月31日
基金份额累计净值增长率	76.04%	83.88%	115.88%

(2) 富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年	2022年	2021年
本期已实现收益	-42,817.12	—	—
本期利润	109,100.30	—	—
加权平均基金份额本期利润	0.3818	—	—
本期加权平均净值利润率	21.88%	—	—
本期基金份额净值增长率	-5.70%	—	—
3.1.2 期末数据和指标	2023年12月31日	2022年12月31日	2021年12月31日
期末可供分配利润	4,120,173.83	—	—
期末可供分配基金份额利润	0.7597	—	—
期末基金资产净值	9,543,824.23	—	—
期末基金份额净值	1.7597	—	—
3.1.3 累计期末指标	2023年12月31日	2022年12月31日	2021年12月31日
基金份额累计净值增长率	-5.70%	—	—

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上

本期公允价值变动收益。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。本产品自 2023 年 9 月 22 日起增加 C 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 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-4.69%	0.68%	-6.10%	0.74%	1.41%	-0.06%
过去六个月	-6.75%	0.72%	-9.88%	0.79%	3.13%	-0.07%
过去一年	-4.26%	0.71%	-12.18%	0.77%	7.92%	-0.06%
过去三年	-8.10%	1.05%	-29.86%	1.04%	21.76%	0.01%
过去五年	75.90%	1.13%	21.41%	1.14%	54.49%	-0.01%
自基金合同生效起至今	76.04%	1.13%	20.71%	1.14%	55.33%	-0.01%

(2) 富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 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	-4.73%	0.68%	-6.10%	0.74%	1.37%	-0.06%
自基金分级生效日起至今	-5.70%	0.65%	-7.01%	0.72%	1.31%	-0.07%

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

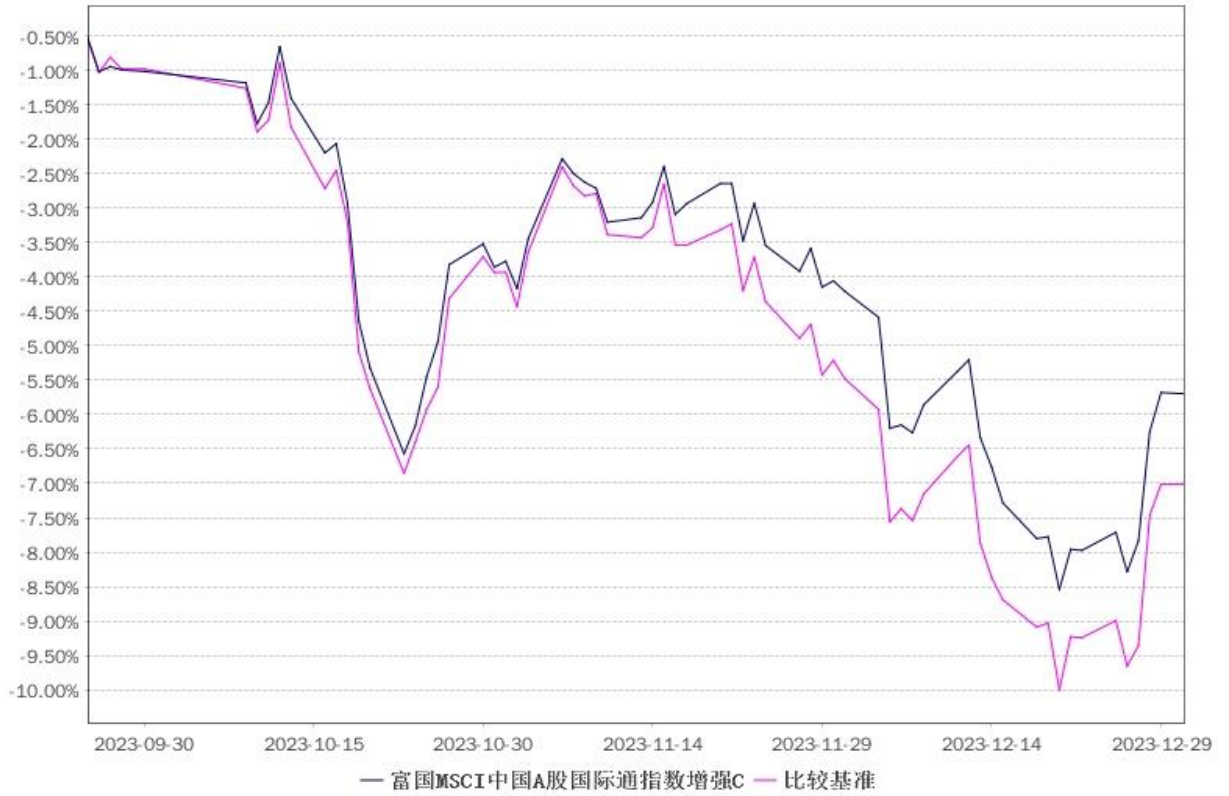
(1) 自基金合同生效以来富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2023年12月31日。

2、本基金于2018年12月25日成立，建仓期6个月，从2018年12月25日起至2019年6月24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MSCI中国A股国际通指数增强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

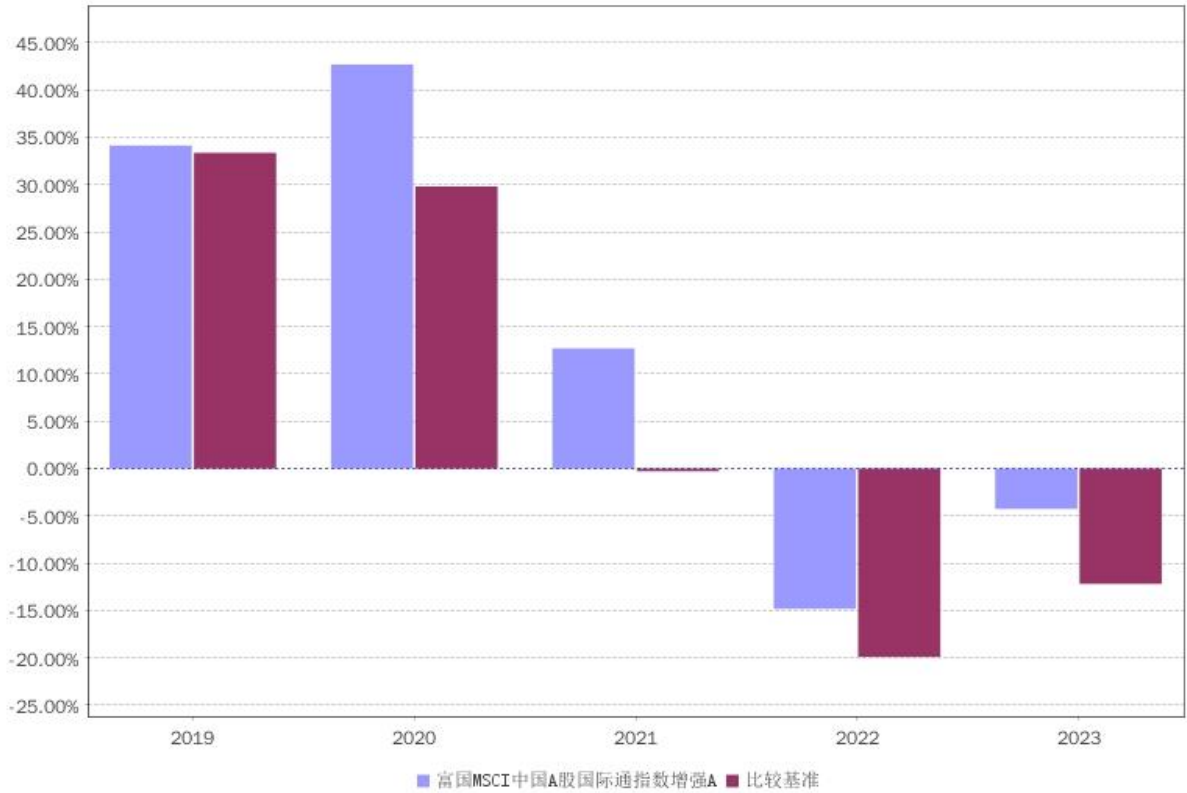


注：1、截止日期为 2023 年 12 月 31 日。

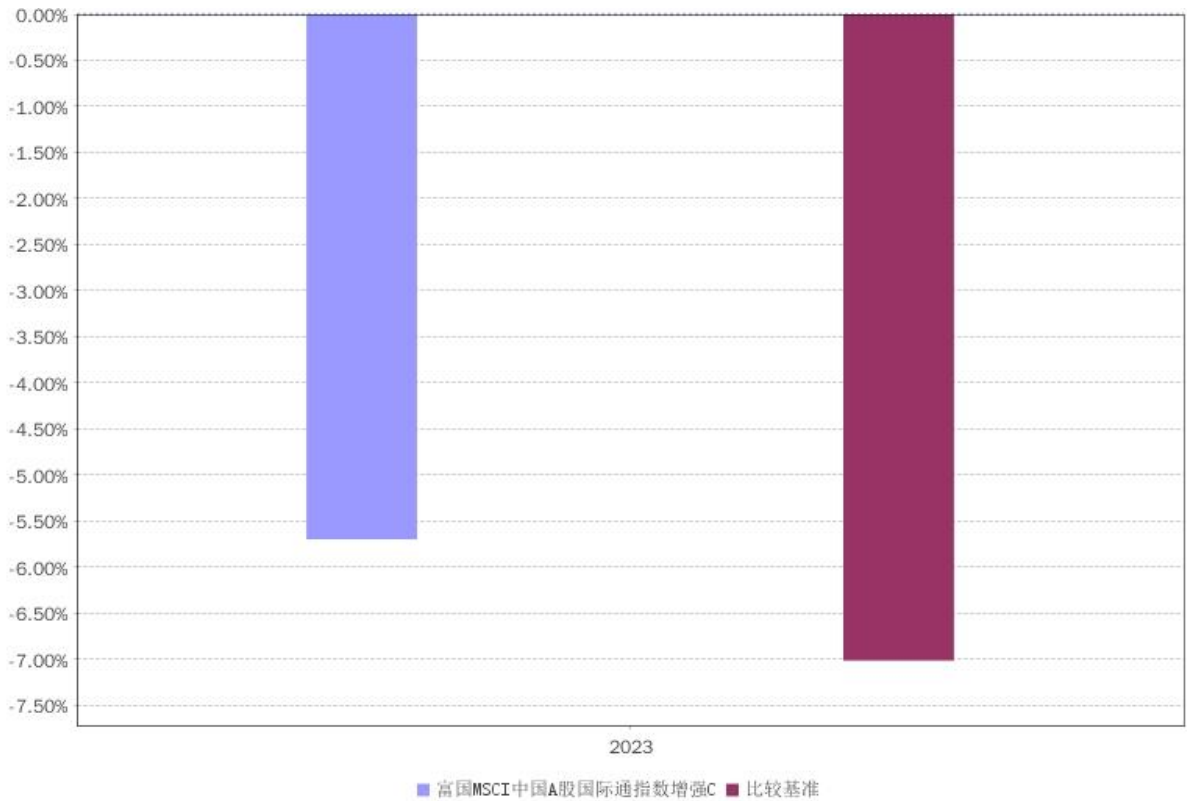
2、本基金自 2023 年 9 月 22 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

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 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



(2)过去五年以来富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 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2023年9月25日起有基金份额。2023年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

(1) 富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A

注：过往三年本基金未进行利润分配。

(2) 富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C

注：过往三年本基金未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至 2023 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 330 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	2018-12-25	—	19	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 月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金基金经理；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 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；具有基金从业资格。
方旻	本基金现任基金经理	2019-01-07	—	14	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 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易

系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现29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

2023 年初以来，随着主要城市疫情高峰过去，疫情对经济的冲击逐步减小，投资者对 2023 年经济复苏预期变动更加乐观，A 股迎来开门红。进入 3 月，由于两会政府工作报告公布的 GDP 增速目标低于市场预期，市场迎来一轮快速调整。4 月以来，由于 3 月 PMI 验证经济进一步向好，提振市场信心。在经济弱复苏，流动性宽裕的背景下，人工智能相关板块迎来加速上涨。石油化工、建筑等板块在中特估及一带一路等主题概念的驱动下也迎来靓丽表现。进入 5 月中旬，由于金融、通胀数据均回落，指向经济内生动能不强，复苏斜率放缓压制市场情绪，同时海外银行业危机和债务违约风险持续发酵，引发市场担忧加剧，各板块均迎来快速调整。2023 年下半年以来，由于国内经济增长压力仍然较大，二季度 GDP 数据不及预期，人民币贬值压力再度加大，市场出现调整。7 月末，随着政治局会议超预期释放利好，美联储如期加息 25bps 但表态偏鸽，指数强势回升。进入 8 月，由于 7 月多项经济金融数据超预期回落，政治局会议后政策出台密度和力度不及预期，同时美债收益率大幅攀升、美联储连续放鹰等外部冲击持续，北向资金大幅流出。进入 4 季度，由于公布的 9 月地产数据超预期下行、物价延续走低等引发市场担忧，资金面出现赎回等负反馈，沪指下破 3000 点。另外，美十年期国债突破新高、巴以冲突等海外风险持续压制全球风险资产。随着中央汇金持续增持 ETF，叠加万亿国债增发出台，市场悲观情绪缓解，走出底部反弹态势，沪指重回 3000 点以上。11 月，海外利率快速下行带动市场走出谷底，但国内经济复苏依然偏缓，市场波折震荡。12 月，海外抢跑降息预期，但国内经济复苏再次放缓叠加政策预期较低，市场创出年内新低。总体来看，2023 年上证综指下跌 3.7%，沪深 300 下跌 11.38%，创业板指下跌 19.41%，中证 500 指数下跌 7.42%。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，积极获取超额收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值 A 级为 1.7604 元，C 级为 1.7597 元；份额累计净值 A 级为 1.7604 元，C 级为 1.7597 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为-4.26%，C 级为-5.70%，同期业绩比较基准收益率 A 级为-12.18%，C 级为-7.01%。

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 2024 年，随着年初的快速调整，市场整体风险进一步释放，已具备较高的中长期配置价值。从政策层面看，呵护力度显著提升。其中，央行超预期降准，且下调支农支小再贷款、再贴现利率。房地产政策开始加码发力，“做好经营性物业贷款管理，满足房地产企业合理融资需求”，上海、苏州、广州等地购房政策进一步放开。从估值来看，1 月末市场估值处于历史底部，性价比凸显。沪深 300 指数股权风险溢价再次突破+2x 标准差，其估值分位数回落至近十年 13% 分位附近，创业板指已处于历史估值最底部。从中长期来看，市场具备较高的配置价值。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

本基金管理人始终坚持持有人利益优先原则，报告期内持续完善内控管理机制，全方位推动监察稽核工作深入开展。在基础性工作的基础上，2023 年度基金管理人重点开展的监察稽核工作包括以下方面：

（一）持续推进制度流程建设，保障业务合规开展

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

（二）深入进行新规学习，扎实推动新规落地

2023 年度，公司从新规解读、制度建立、系统建设、流程改造等方面持续推进各项重要法律法规、监管要求的落地工作，并对落地情况开展专项检查，确保各项业务合法合规开展。

（三）培育合规文化，全面提升员工合规意识

为持续提高全员合规意识，公司对新员工、特定业务条线员工、全体员工开展不同侧重点的合规培训与宣导，结合多维度、多层次的合规谈话及合规考试，多管齐下全面提升员工的合规意识。

（四）立足于合规，不断拓展风险管理职能

报告期内，公司持续推进旗下组合的投资合规风控阈值多维度排查梳理和日常投资合规监督工作的规范化管理，进一步根据系统升级迭代情况整合优化历史风控工具。公司持续强化合规风控培训工作，提升各部门主动合规的能力和意识。

公司不断加强对新业务、新品种及整体风险控制能力的研究，保持对各类风险的敏感度，加强日常监测和定期风险评估，持续提升对于各类投资标的的风险管理水平。

（五）持续推进合规风控工作的系统化建设

2023 年公司结合自主研发和专业系统外采等多种途径，持续推动合规风控信息化建设。公司通过搭建、完善覆盖事前、事中、事后的风控系统工具体系，助力有效监测、识别投资组合运作过程中的各类风险，加强投资过程中各类风险的管理能力。在合规管理方面，新增或优化系统管理功能模块包括合规考试、合规谈话、采购及合同一体化管理流程等。通过系统建设，提升合规管理工作质效。

（六）全面加强员工行为管理

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

（七）扎实推进反洗钱工作

公司高度重视反洗钱工作，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求。除在客户尽职调查、大额和可疑交易报告、客户资料和交易记录保存等反洗钱核心义务方面积极履职外，还通过重点专项工作等方式有序推动反洗钱工作深入开展。报告期内，主要重点工作包括开展机构洗钱风险评估、持续推动系统建设和数据治理工作、强化客户身份识别前端管控、多层次立体化文化宣贯等。

（八）深入开展内部审计，发挥第三道防线功能

公司围绕各条线各部门制度框架体系建立情况、法规落实情况及当年工作重点开展审计工作。通过基础风险点例行检查与法规落实情况、监管重点排查相结合的方式，深入开展内部审计检查并督导整改完善。报告期内，公司开展多项专项审计，涵盖投研、交易、销售、信息技术、反洗钱等各业务领域。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估

值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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（2024）审字第 70015656_B121 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 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 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 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责

	<p>任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。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。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p>

	<p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。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。</p>	
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	费泽旭
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	2024 年 03 月 28 日	

§ 7 年度财务报告

7.1 资产负债表

会计主体：富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

资产：		
货币资金	14,484,365.25	10,845,248.18
结算备付金	152,650.08	110,494.89
存出保证金	22,080.28	19,254.50
交易性金融资产	172,301,467.31	157,642,470.73
其中：股票投资	172,301,467.31	157,642,470.73
基金投资	—	—
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	—	134,913.22
应收股利	—	—
应收申购款	5,871,479.66	139,616.46
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	192,832,042.58	168,891,997.98
负债和净资产	本期末	上年度末
	2023年12月	2022年12月31
	31日	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	5,133,599.56	—
应付赎回款	100,611.92	18,002.73
应付管理人报酬	156,783.65	154,956.45
应付托管费	23,517.56	23,243.46
应付销售服务费	231.24	—
应付投资顾问费	—	—
应交税费	—	0.43
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	389,498.05	360,688.98
负债合计	5,804,241.98	556,892.05
净资产：		
实收基金	106,245,420.37	91,548,428.71
其他综合收益	—	—
未分配利润	80,782,380.23	76,786,677.22
净资产合计	187,027,800.60	168,335,105.93

负债和净资产总计	192,832,042.58	168,891,997.98
----------	----------------	----------------

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.7603 元，基金份额总额 106,245,420.37 份。其中：富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A 份额净值 1.7604 元，份额总额 100,821,769.97 份；富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C 份额净值 1.7597 元，份额总额 5,423,650.40 份。

7.2 利润表

会计主体：富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日)
一、营业总收入	-8,223,471.02	-30,052,787.24
1.利息收入	74,524.96	59,289.93
其中：存款利息收入	74,524.96	59,289.93
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）	-4,673,942.71	-14,917,597.55
其中：股票投资收益	-9,068,716.93	-18,345,665.69
基金投资收益	—	—
债券投资收益	37,566.52	153,389.25
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	4,357,207.70	3,274,678.89
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）	-3,772,276.88	-15,283,400.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	148,223.61	88,921.00
减：二、营业总支出	2,729,134.33	2,412,035.38
1. 管理人报酬	2,115,958.21	1,841,513.10
2. 托管费	317,393.82	276,226.96
3. 销售服务费	257.20	—
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	—

其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	0.10	0.32
8. 其他费用	295,525.00	294,295.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-10,952,605.35	-32,464,822.62
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-10,952,605.35	-32,464,822.62
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	-10,952,605.35	-32,464,822.62

7.3 净资产变动表

会计主体：富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 (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	91,548,428. 71	76,786,677. 22	168,335,105 .93
二、本期期初净资产	91,548,428. 71	76,786,677. 22	168,335,105 .93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	14,696,991. 66	3,995,703.0 1	18,692,694. 67
（一）、综合收益总额	—	—	—
	—	10,952,605. 35	10,952,605. 35
（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）	14,696,991. 66	14,948,308. 36	29,645,300. 02
其中：1. 基金申购款	86,650,626. 73	76,101,086. 51	162,751,713 .24
2. 基金赎回款	—	—	—
	71,953,635. 07	61,152,778. 15	133,106,413 .22
（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	106,245,420. 37	80,782,380.2 3	187,027,800. 60
项目	上年度可比期间 (2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日)		
	实收基金	未分配	净资产合计

		利润	
一、上期期末净资产	93,960,909.57	108,880,724.30	202,841,633.87
二、本期期初净资产	93,960,909.57	108,880,724.30	202,841,633.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,412,480.86	-32,094,047.08	-34,506,527.94
（一）、综合收益总额	-	-32,464,822.62	-32,464,822.62
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,412,480.86	370,775.54	-2,041,705.32
其中：1.基金申购款	63,721,778.67	60,888,425.85	124,610,204.52
2.基金赎回款	-66,134,259.53	-60,517,650.31	-126,651,909.84
（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	91,548,428.71	76,786,677.22	168,335,105.93

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
基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]818 号文《关于准予富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于 2018 年 12 月 25 日正式生效，首次设立募集规模为 227,607,631.34 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 2023 年 9 月 20 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证

券投资基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自 2023 年 9 月 22 日起，本基金增加 C 类份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括 MSCI 中国 A 股国际通指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于 MSCI 中国 A 股国际通指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{MSCI 中国 A 股国际通指数收益率} + 5\% \times \text{人民币活期存款利率（税后）}$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和中期报告》》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为

初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

整，确定公允价值。

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比

例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利

息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式默认为现金分红；基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金红利，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为相应类别的基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；

2、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、本基金同一类别的每一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；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

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；

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

2 增值税

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

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

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

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

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

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向

流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 (2023年12月31日)	上年度末 (2022年12月31日)
活期存款	14,484,365.25	10,845,248.18
等于：本金	14,482,719.32	10,843,459.01
加：应计利息	1,645.93	1,789.17
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	14,484,365.25	10,845,248.18

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（2023年12月31日）			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	183,921,114.14	—	172,301,467.31	—11,619,646.83
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	183,921,114.14	—	172,301,467.31	—11,619,646.83
项目	上年度末（2022年12月31日）			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	165,489,840.68	—	157,642,470.73	—7,847,369.95
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	165,489,840.68	—	157,642,470.73	—7,847,369.95

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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	144.77	42.40
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	128,911.78	218,767.58
其中：交易所市场	128,911.78	218,767.58
银行间市场	—	—
应付利息	—	—
预提信息披露费	120,000.00	—
预提审计费	33,000.00	38,000.00
应付指数使用费	107,441.50	103,879.00
合计	389,498.05	360,688.98

7.4.7.7 实收基金

富国MSCI中国A股国际通指数增强A：

金额单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	91,548,428.71	91,548,428.71
本期申购	81,007,829.89	81,007,829.89
本期赎回（以“-”号填列）	-71,734,488.63	-71,734,488.63
本期末	100,821,769.97	100,821,769.97

富国MSCI中国A股国际通指数增强C：

金额单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	—	—
本期申购	5,642,796.84	5,642,796.84
本期赎回（以“-”号填列）	-219,146.44	-219,146.44
本期末	5,423,650.40	5,423,650.40

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 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	82,911,137.48	—	76,786,677.22
本期期初	82,911,137.48	—	76,786,677.22
本期利润	-7,137,511.35	3,924,194.30	-11,061,705.65
本期基金份额交易产生的变动数	8,906,837.79	2,030,397.04	10,937,234.83
其中：基金申购款	74,273,070.78	—	71,927,323.35
基金赎回款	—	4,376,144.47	-60,990,088.52
本期已分配利润	—	—	—
本期末	84,680,463.92	—	76,662,206.40

富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 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	—	—	—
本期期初	—	—	—
本期利润	-42,817.12	151,917.42	109,100.30
本期基金份额交易产生的变动数	4,594,458.62	-583,385.09	4,011,073.53
其中：基金申购款	4,783,292.91	-609,529.75	4,173,763.16
基金赎回款	-188,834.29	26,144.66	-162,689.63
本期已分配利润	—	—	—
本期末	4,551,641.50	-431,467.67	4,120,173.83

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
活期存款利息收入	58,364.69	51,715.49

定期存款利息收入	—	—
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	6,508.72	4,990.56
其他	9,651.55	2,583.88
合计	74,524.96	59,289.93

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
卖出股票成交总额	545,041,009.91	489,460,992.85
减：卖出股票成本总额	552,742,306.38	506,366,047.51
减：交易费用	1,367,420.46	1,440,611.03
买卖股票差价收入	-9,068,716.93	-18,345,665.69

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（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
债券投资收益——利息收入	279.10	3,786.32
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	37,287.42	149,602.93
合计	37,566.52	153,389.25

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（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,741,781.31	1,049,286.37
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,663,070.00	895,080.00
减：应计利息总额	41,416.15	4,589.13
减：交易费用	7.74	14.31
买卖债券差价收入	37,287.42	149,602.93

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（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
股票投资产生的股利收益	4,357,207.70	3,274,678.89
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	4,357,207.70	3,274,678.89

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
1. 交易性金融资产	-3,772,276.88	-15,283,400.62
股票投资	-3,772,276.88	-15,278,563.02

债券投资	—	-4,837.60
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	-3,772,276.88	-15,283,400.62

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
基金赎回费收入	147,656.27	88,517.53
基金转换费收入	567.34	403.47
合计	148,223.61	88,921.00

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（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
审计费用	33,000.00	38,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
银行费用	725.00	675.00
指数使用费	141,800.00	135,620.00
合计	295,525.00	294,295.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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
中国建设银行股份有限公司	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
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	基金管理人的股东控制的子公司

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（2023年01月01日至2023年12月31日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022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	151,643,422.53	13.68	159,656,252.68	16.43
申万宏源	124,198,802.40	11.20	113,766,222.21	11.70

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（2023年01月01日至2023年12月31日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022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	39,970.07	0.43	163,616.86	19.37
申万宏源	25,071.86	0.27	33,960.37	4.02

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（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	110,157.04	13.71	25,695.59	19.93
申万宏源	89,933.26	11.20	5,667.58	4.40
关联方名称	上年度可比期间（2022年01月01日至2022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	144,272.41	16.92	29,358.34	13.42
申万宏源	102,296.88	12.00	20,646.73	9.44

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

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（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	2,115,958.21	1,841,513.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	405,461.33	327,725.74
应支付基金管理人的净管理费	1,710,496.88	1,513,787.36

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提。

计算方法如下： $H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	317,393.82	276,226.96

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（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MSCI中国A股国际通指数增强A	富国MSCI中国A股国际通指数增强C	合计
富国基金管理有限公司	—	131.96	131.96
合计	—	131.96	131.96

注：2023年9月22日起，本基金增加收取销售服务费的C类基金份额。本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费将专门用于本基金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：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

C类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债

券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2023年01月01日至2023年12月31日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）	
	富国MSCI中国A股国际通指数增强A	富国MSCI中国A股国际通指数增强C	富国MSCI中国A股国际通指数增强A	富国MSCI中国A股国际通指数增强C
基金合同生效日（2018年12月25日）持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	—	—	—	—
期间申购/买入总份额	—	535.91	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	—	535.91	—	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	0.01%	—	—

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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（2023年01月01日至2023年12月31日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022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
中国建设银行股份有限公司	14,484,365.25	58,364.69	10,845,248.18	51,715.49

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2023年01月01日至2023年12月31日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	301525	儒竞科技	IPO网下申购	579	57,651.03
海通证券股份有限公司	301568	思泰克	IPO网下申购	1,849	42,952.27
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	603193	润本股份	IPO网下申购	1,525	26,504.50
海通证券股份有限公司	688469	芯联集成	IPO网下申购	23,528	133,874.32
海通证券股份有限公司	688515	裕太微	IPO网下申购	1,016	93,939.36
海通证券股份有限公司	688531	日联科技	IPO网下申购	750	114,285.00
海通证券股份有限公司	688548	广钢气体	IPO网下申购	7,196	71,024.52

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	688267	中触媒	IPO网下申购	834	35,119.32
海通证券股份	688271	联影医	IPO网	1,031	113,852.71

有限公司		疗	下申购		
海通证券股份 有限公司	688220	翱捷科 技	IPO网 下申购	1,047	173,134.75
海通证券股份 有限公司	688062	迈威生 物	IPO网 下申购	4,527	158,327.30

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023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
001239	永达股份	2023-12-04	6个月	新股限售	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	—
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月	新股限售	53.63	75.36	45	2,413.35	3,391.20	—
001326	联域股份	2023-11-01	6个月	新股限售	41.18	48.64	83	3,417.94	4,037.12	—
001358	兴欣新材	2023-12-14	6个月	新股限售	41.00	44.16	58	2,378.00	2,561.28	—
001378	德冠新材	2023-10-23	6个月	新股限售	31.68	31.27	128	4,055.04	4,002.56	—
300904	威力传动	2023-08-02	6个月	新股限售	35.41	61.53	218	7,719.38	13,413.54	—
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股限售	25.82	31.80	195	5,034.90	6,201.00	—
301251	威尔高	2023-08-30	6个月	新股限售	28.88	34.59	212	6,122.56	7,333.08	—
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股限售	36.90	50.85	133	4,907.70	6,763.05	—
301272	英华特	2023-07-06	6个月	新股限售	51.39	53.38	118	6,064.02	6,298.84	—
301329	信音电子	2023-07-05	6个月	新股限售	21.00	22.23	252	5,292.00	5,601.96	—
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6个月	新股限售	18.08	44.57	351	6,346.08	15,644.07	—
301393	昊帆生物	2023-07-05	6个月	新股限售	67.68	59.37	86	5,820.48	5,105.82	—
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新股限售	26.68	18.69	265	7,070.20	4,952.85	—
301413	安培龙	2023-12-11	6个月	新股限售	33.25	58.19	137	4,555.25	7,972.03	—
301418	协昌科技	2023-08-10	6个月	新股限售	51.88	50.20	101	5,239.88	5,070.20	—
301421	波长光电	2023-08-16	6个月	新股限售	29.38	59.37	202	5,934.76	11,992.74	—
301456	盘古智能	2023-07-06	6个月	新股限售	37.96	30.39	155	5,883.80	4,710.45	—

301469	恒达新材	2023-08-10	6个月	新股限售	36.58	33.09	177	6,474.66	5,856.93	—
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	新股限售	57.66	47.25	127	7,322.82	6,000.75	—
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股限售	39.78	69.09	187	7,438.86	12,919.83	—
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月	新股限售	23.97	20.89	204	4,889.88	4,261.56	—
301505	苏州规划	2023-07-12	6个月	新股限售	26.35	35.81	184	4,848.40	6,589.04	—
301508	中机认检	2023-11-23	6个月	新股限售	16.82	26.68	282	4,743.24	7,523.76	—
301510	固高科技	2023-08-04	6个月	新股限售	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	—
301515	港通医疗	2023-07-13	6个月	新股限售	31.16	28.27	141	4,393.56	3,986.07	—
301516	中远通	2023-12-01	6个月	新股限售	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	—
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月	新股限售	26.87	43.69	155	4,164.85	6,771.95	—
301520	万邦医药	2023-09-18	6个月	新股限售	67.88	52.74	87	5,905.56	4,588.38	—
301525	儒竞科技	2023-08-23	6个月	新股限售	99.57	81.46	58	5,775.06	4,724.68	—
301528	多浦乐	2023-08-17	6个月	新股限售	71.80	68.91	83	5,959.40	5,719.53	—
301533	威马农机	2023-08-07	6个月	新股限售	29.50	33.16	189	5,575.50	6,267.24	—
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月	新股限售	37.56	43.57	136	5,108.16	5,925.52	—
301555	惠柏新材	2023-10-24	6个月	新股限售	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	—
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	新股限售	8.90	22.14	518	4,610.20	11,468.52	—
301568	思泰克	2023-11-21	6个月	新股限售	23.23	35.58	185	4,297.55	6,582.30	—
301578	辰奕智能	2023-12-21	6个月	新股限售	48.94	68.32	88	4,306.72	6,012.16	—
601096	宏盛华源	2023-12-15	6个月	新股限售	1.70	4.06	1,773	3,014.10	7,198.38	—
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6个月	新股限售	16.80	31.19	93	1,562.40	2,900.67	—
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6个月	新股限售	58.08	57.81	40	2,323.20	2,312.40	—
603107	上海汽配	2023-10-25	6个月	新股限售	14.23	18.19	132	1,878.36	2,401.08	—
603193	润本股份	2023-10-09	6个月	新股限售	17.38	16.66	153	2,659.14	2,548.98	—
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6个月	新股限售	21.29	21.53	87	1,852.23	1,873.11	—
603275	众辰科技	2023-08-16	6个月	新股限售	49.97	39.70	60	2,998.20	2,382.00	—
603276	恒兴新材	2023-09-18	6个月	新股限售	25.73	24.88	94	2,418.62	2,338.72	—
603373	安邦护卫	2023-12-13	6个月	新股限售	19.10	34.75	83	1,585.30	2,884.25	—
688548	广钢气体	2023-08-08	6个月	新股限售	9.87	12.75	720	7,106.40	9,180.00	—
688563	航材股份	2023-07-12	6个月	新股限售	78.99	60.49	137	10,821.63	8,287.13	—
688591	泰凌微	2023-08-18	6个月	新股限售	24.98	28.02	292	7,294.16	8,181.84	—
688592	司南导航	2023-08-07	6个月	新股限售	50.50	50.53	194	9,797.00	9,802.82	—
688602	康鹏科技	2023-07-13	6个月	新股限售	8.66	11.06	563	4,875.58	6,226.78	—
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股限售	55.00	74.14	108	5,940.00	8,007.12	—
688610	埃科光电	2023-07-10	6个月	新股限售	73.33	51.00	111	8,139.63	5,661.00	—
688627	精智达	2023-07-11	6个月	新股限售	46.77	87.72	111	5,191.47	9,736.92	—
688638	誉辰智能	2023-07-04	6个月	新股限售	83.90	59.68	90	7,551.00	5,371.20	—
688646	逸飞激光	2023-07-21	6个月	新股限售	46.80	36.07	132	6,177.60	4,761.24	—
688648	中邮科技	2023-11-06	6个月	新股限售	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	—
688651	盛邦安全	2023-07-19	6个月	新股限售	39.90	46.05	149	5,945.10	6,861.45	—
688652	京仪装备	2023-11-22	6个月	新股限售	31.95	52.25	148	4,728.60	7,733.00	—

688653	康希通信	2023-11-10	6 个月	新股限售	10.50	15.99	442	4,641.00	7,067.58	—
688671	碧兴物联	2023-08-02	6 个月	新股限售	36.12	34.30	213	7,693.56	7,305.90	—
688702	盛科通信	2023-09-06	6 个月	新股限售	42.66	48.18	144	6,143.04	6,937.92	—
688719	爱科赛博	2023-09-20	6 个月	新股限售	69.98	60.10	94	6,578.12	5,649.40	—

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2023 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 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

7.4.13.2 信用风险

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的信用债。

7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

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

变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末及上年度末无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价

值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（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	14,484,365.25	—	—	—	—	—	14,484,365.25
结算备付金	152,650.08	—	—	—	—	—	152,650.08
存出保证金	22,080.28	—	—	—	—	—	22,080.28
交易性金融资产	—	—	—	—	—	172,301,467.31	172,301,467.31
应收申购款	5,051,953.00	—	—	—	—	819,526.66	5,871,479.66
资产总计	19,711,048.61	—	—	—	—	173,120,993.97	192,832,042.58
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	5,133,599.56	5,133,599.56
应付赎回款	—	—	—	—	—	100,611.92	100,611.92
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	156,783.65	156,783.65
应付托管费	—	—	—	—	—	23,517.56	23,517.56
应付销售服务费	—	—	—	—	—	231.24	231.24
其他负债	—	—	—	—	—	389,498.05	389,498.05
负债总计	—	—	—	—	—	5,804,241.98	5,804,241.98
利率敏感度缺口	19,711,048.61	—	—	—	—	167,316,751.99	187,027,800.60
上年度末（2022年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	10,845,248.18	—	—	—	—	—	10,845,248.18
结算备付金	110,494.89	—	—	—	—	—	110,494.89

存出保证金	19,254.50	—	—	—	—	—	19,254.50
交易性金融资产	—	—	—	—	—	157,642,470.73	157,642,470.73
应收清算款	—	—	—	—	—	134,913.22	134,913.22
应收申购款	16,242.00	—	—	—	—	123,374.46	139,616.46
资产总计	10,991,239.57	—	—	—	—	157,900,758.41	168,891,997.98
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	18,002.73	18,002.73
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	154,956.45	154,956.45
应付托管费	—	—	—	—	—	23,243.46	23,243.46
应交税费	—	—	—	—	—	0.43	0.43
其他负债	—	—	—	—	—	360,688.98	360,688.98
负债总计	—	—	—	—	—	556,892.05	556,892.05
利率敏感度缺口	10,991,239.57	—	—	—	—	157,343,866.36	168,335,105.93

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

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

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括 MSCI 中国 A 股国际通指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于 MSCI 中国 A 股国际通指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2023年12月31日）		上年度末（2022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	172,301,467.31	92.13	157,642,470.73	93.65
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	172,301,467.31	92.13	157,642,470.73	93.65

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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	1,687,592.95	1,653,000.88
2. 业绩比较基准减少 1%	-1,687,592.95	-1,653,000.88	

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 (2023年12月31日)	上年度末 (2022年12月31日)
第一层次	171,896,849.68	157,248,099.47
第二层次	—	157,092.00
第三层次	404,617.63	237,279.26
合计	172,301,467.31	157,642,470.73

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（2023年01月01日至2023年12月31日）		合计
	交易性金融资产		
	债券投资	股票投资	

期初余额	—	237,279.26	237,279.26
当期购买	—	691,413.90	691,413.90
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	658,383.83	658,383.83
当期利得或损失总额	—	134,308.30	134,308.30
其中：计入损益的利得或损失	—	134,308.30	134,308.30
期末余额	—	404,617.63	404,617.63
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	—	80,728.84	80,728.84
项目	上年度可比期间（2022年01月01日至2022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	—	1,423,257.17	1,423,257.17
当期购买	—	252,969.67	252,969.67
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	1,241,693.43	1,241,693.43
当期利得或损失总额	—	-197,254.15	-197,254.15
其中：计入损益的利得或损失	—	-197,254.15	-197,254.15
期末余额	—	237,279.26	237,279.26
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	—	-15,690.41	-15,690.41

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	404,617.63	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1855-2.1775	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	237,279.26	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	0.2127- 2.4756	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	172,301,467.31	89.35
	其中：股票	172,301,467.31	89.35
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	14,637,015.33	7.59
8	其他各项资产	5,893,559.94	3.06
9	合计	192,832,042.58	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 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	244,818.00	0.13
C	制造业	15,347,760.02	8.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	98,382.00	0.05
E	建筑业	30,240.00	0.02
F	批发和零售业	331,372.00	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	509,368.00	0.27
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,418,939.97	2.90
J	金融业	2,435,506.00	1.30
K	房地产业	353,160.00	0.19
L	租赁和商务服务业	2,884.25	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,068,537.00	0.57
N	水利、环境和公共设施管理业	145,348.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	15,420.00	0.01
Q	卫生和社会工作	51,600.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	647,239.00	0.35
S	综合	—	—
	合计	26,700,574.24	14.28

8.2.1.2 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	65,888.00	0.04
B	采矿业	7,939,565.00	4.25

C	制造业	90,797,054.45	48.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,943,988.00	2.11
E	建筑业	1,003,454.00	0.54
F	批发和零售业	3,668,386.83	1.96
G	交通运输、仓储和邮政业	3,607,204.00	1.93
H	住宿和餐饮业	198,772.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,184,118.49	3.31
J	金融业	24,277,030.30	12.98
K	房地产业	842,408.00	0.45
L	租赁和商务服务业	1,312,032.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	105,600.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	550,800.00	0.29
Q	卫生和社会工作	75,084.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	458,944.00	0.25
S	综合	570,564.00	0.31
	合计	145,600,893.07	77.85

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

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	5,800	10,010,800.00	5.35
2	000858	五粮液	20,700	2,904,417.00	1.55
3	300750	宁德时代	15,460	2,523,999.60	1.35
4	000725	京东方A	636,900	2,483,910.00	1.33
5	601766	中国中车	430,100	2,262,326.00	1.21
6	601319	中国人保	445,400	2,155,736.00	1.15
7	600276	恒瑞医药	45,880	2,075,152.40	1.11
8	600104	上汽集团	152,300	2,060,619.00	1.10
9	000338	潍柴动力	148,600	2,028,390.00	1.08
10	002001	新和成	113,200	1,919,872.00	1.03
11	600000	浦发银行	285,300	1,888,686.00	1.01
12	601211	国泰君安	125,000	1,860,000.00	0.99
13	000538	云南白药	35,740	1,756,621.00	0.94
14	600887	伊利股份	65,600	1,754,800.00	0.94
15	000100	TCL科技	393,170	1,690,631.00	0.90
16	600900	长江电力	71,500	1,668,810.00	0.89
17	002128	电投能源	113,000	1,612,510.00	0.86

18	600406	国电南瑞	70,400	1,571,328.00	0.84
19	002252	上海莱士	195,100	1,560,800.00	0.83
20	002736	国信证券	179,800	1,535,492.00	0.82
21	000063	中兴通讯	54,200	1,435,216.00	0.77
22	601328	交通银行	241,300	1,385,062.00	0.74
23	600015	华夏银行	243,600	1,369,032.00	0.73
24	601398	工商银行	281,900	1,347,482.00	0.72
25	603993	洛阳钼业	256,600	1,334,320.00	0.71
26	002475	立讯精密	38,400	1,322,880.00	0.71
27	601006	大秦铁路	183,400	1,322,314.00	0.71
28	002304	洋河股份	12,000	1,318,800.00	0.71
29	600885	宏发股份	47,700	1,318,428.00	0.70
30	002027	分众传媒	207,600	1,312,032.00	0.70
31	600999	招商证券	95,500	1,302,620.00	0.70
32	600016	民生银行	344,400	1,288,056.00	0.69
33	601818	光大银行	442,900	1,284,410.00	0.69
34	000157	中联重科	195,700	1,277,921.00	0.68
35	600660	福耀玻璃	34,100	1,274,999.00	0.68
36	600741	华域汽车	75,960	1,236,628.80	0.66
37	601600	中国铝业	211,500	1,192,860.00	0.64
38	000630	铜陵有色	362,400	1,188,672.00	0.64
39	600998	九州通	168,983	1,184,570.83	0.63
40	601607	上海医药	69,600	1,164,408.00	0.62
41	300760	迈瑞医疗	3,800	1,104,280.00	0.59
42	601877	正泰电器	51,300	1,103,463.00	0.59
43	601899	紫金矿业	87,800	1,093,988.00	0.58
44	601318	中国平安	26,200	1,055,860.00	0.56
45	600875	东方电气	71,800	1,049,716.00	0.56
46	000651	格力电器	32,500	1,045,525.00	0.56
47	600690	海尔智家	45,700	959,700.00	0.51
48	688538	和辉光电	390,700	949,401.00	0.51
49	000513	丽珠集团	25,700	899,757.00	0.48
50	601088	中国神华	28,700	899,745.00	0.48
51	600704	物产中大	202,800	898,404.00	0.48
52	002065	东华软件	143,800	887,246.00	0.47
53	601169	北京银行	194,400	880,632.00	0.47
54	600219	南山铝业	299,300	879,942.00	0.47
55	600161	天坛生物	27,500	850,850.00	0.45
56	603589	口子窖	18,200	824,460.00	0.44
57	688009	中国通号	183,730	804,737.40	0.43
58	601229	上海银行	133,600	797,592.00	0.43

59	600346	恒力石化	60,300	794,151.00	0.42
60	600066	宇通客车	58,700	777,775.00	0.42
61	002185	华天科技	90,200	768,504.00	0.41
62	600637	东方明珠	101,900	766,288.00	0.41
63	601216	君正集团	202,900	758,846.00	0.41
64	002129	TCL 中环	48,225	754,239.00	0.40
65	002600	领益智造	108,500	733,460.00	0.39
66	601988	中国银行	179,900	717,801.00	0.38
67	300628	亿联网络	24,040	710,382.00	0.38
68	600489	中金黄金	67,900	676,284.00	0.36
69	600036	招商银行	23,800	662,116.00	0.35
70	000938	紫光股份	33,300	644,355.00	0.34
71	600177	雅戈尔	97,300	637,315.00	0.34
72	000027	深圳能源	96,700	623,715.00	0.33
73	002152	广电运通	50,800	622,808.00	0.33
74	688567	孚能科技	37,712	615,082.72	0.33
75	600018	上港集团	123,600	605,640.00	0.32
76	600703	三安光电	41,700	577,545.00	0.31
77	601168	西部矿业	40,300	575,081.00	0.31
78	000009	中国宝安	48,600	570,564.00	0.31
79	000738	航发控制	28,600	569,140.00	0.30
80	600438	通威股份	22,500	563,175.00	0.30
81	600028	中国石化	100,900	563,022.00	0.30
82	600309	万华化学	7,300	560,786.00	0.30
83	600886	国投电力	42,400	558,832.00	0.30
84	601138	工业富联	36,800	556,416.00	0.30
85	000425	徐工机械	101,700	555,282.00	0.30
86	002673	西部证券	86,800	552,916.00	0.30
87	002607	中公教育	135,000	550,800.00	0.29
88	002049	紫光国微	8,100	546,345.00	0.29
89	601816	京沪高铁	110,100	541,692.00	0.29
90	600019	宝钢股份	90,700	537,851.00	0.29
91	600332	白云山	18,200	520,520.00	0.28
92	600426	华鲁恒升	18,500	510,415.00	0.27
93	600050	中国联通	113,900	498,882.00	0.27
94	000800	一汽解放	58,200	494,700.00	0.26
95	603369	今世缘	10,100	492,375.00	0.26
96	600061	国投资本	71,500	481,910.00	0.26
97	601231	环旭电子	31,500	475,965.00	0.25
98	002414	高德红外	64,600	471,580.00	0.25
99	000895	双汇发展	17,500	467,425.00	0.25

100	601727	上海电气	107,500	448,275.00	0.24
101	601928	凤凰传媒	49,800	438,738.00	0.23
102	601058	赛轮轮胎	36,800	432,400.00	0.23
103	600522	中天科技	34,400	429,656.00	0.23
104	600196	复星医药	16,700	418,001.00	0.22
105	600845	宝信软件	8,534	416,459.20	0.22
106	600011	华能国际	53,800	414,260.00	0.22
107	600893	航发动力	10,600	396,228.00	0.21
108	600497	驰宏锌锗	78,400	395,920.00	0.21
109	002064	华峰化学	59,000	395,890.00	0.21
110	000596	古井贡酒	1,700	395,760.00	0.21
111	002180	纳思达	17,387	393,467.81	0.21
112	600989	宝丰能源	26,200	386,974.00	0.21
113	601618	中国中冶	123,500	377,910.00	0.20
114	603659	璞泰来	17,930	375,274.90	0.20
115	600481	双良节能	42,900	362,934.00	0.19
116	600584	长电科技	12,000	358,320.00	0.19
117	002422	科伦药业	11,800	342,790.00	0.18
118	002938	鹏鼎控股	15,200	339,264.00	0.18
119	600115	中国东航	85,100	330,188.00	0.18
120	600030	中信证券	15,900	323,883.00	0.17
121	603858	步长制药	18,300	311,283.00	0.17
122	000728	国元证券	44,900	306,667.00	0.16
123	600570	恒生电子	10,500	301,980.00	0.16
124	688728	格科微	14,750	301,932.50	0.16
125	000001	平安银行	31,900	299,541.00	0.16
126	601991	大唐发电	118,200	286,044.00	0.15
127	601601	中国太保	12,000	285,360.00	0.15
128	600166	福田汽车	104,200	284,466.00	0.15
129	002841	视源股份	6,000	274,560.00	0.15
130	002493	荣盛石化	26,300	272,205.00	0.15
131	600563	法拉电子	2,900	268,540.00	0.14
132	600383	金地集团	60,800	265,088.00	0.14
133	600029	南方航空	45,800	263,808.00	0.14
134	300751	迈为股份	2,000	259,020.00	0.14
135	300014	亿纬锂能	6,000	253,200.00	0.14
136	601688	华泰证券	18,000	251,100.00	0.13
137	601166	兴业银行	15,100	244,771.00	0.13
138	603939	益丰药房	6,100	244,244.00	0.13
139	600089	特变电工	17,660	243,708.00	0.13
140	688032	禾迈股份	900	243,000.00	0.13

141	600919	江苏银行	36,070	241,308.30	0.13
142	688126	沪硅产业	13,900	240,748.00	0.13
143	600600	青岛啤酒	3,200	239,200.00	0.13
144	000408	藏格矿业	9,400	238,196.00	0.13
145	002007	华兰生物	10,700	236,791.00	0.13
146	600352	浙江龙盛	27,600	231,840.00	0.12
147	601668	中国建筑	48,100	231,361.00	0.12
148	300433	蓝思科技	17,471	230,617.20	0.12
149	603156	养元饮品	10,700	227,482.00	0.12
150	002916	深南电路	3,200	227,168.00	0.12
151	601360	三六零	24,900	224,349.00	0.12
152	600588	用友网络	12,600	224,154.00	0.12
153	002456	欧菲光	25,700	223,847.00	0.12
154	600549	厦门钨业	13,000	223,340.00	0.12
155	002202	金风科技	27,800	222,400.00	0.12
156	603444	吉比特	900	220,608.00	0.12
157	600085	同仁堂	4,100	220,170.00	0.12
158	000937	冀中能源	28,500	203,490.00	0.11
159	300454	深信服	2,800	202,412.00	0.11
160	002032	苏泊尔	3,800	201,438.00	0.11
161	600183	生益科技	10,900	199,579.00	0.11
162	002153	石基信息	20,490	199,572.60	0.11
163	002594	比亚迪	1,000	198,000.00	0.11
164	600515	海南机场	53,300	197,210.00	0.11
165	000050	深天马A	18,200	193,830.00	0.10
166	600398	海澜之家	25,800	191,436.00	0.10
167	000783	长江证券	34,300	184,534.00	0.10
168	601390	中国中铁	31,900	181,192.00	0.10
169	600547	山东黄金	7,800	178,386.00	0.10
170	300059	东方财富	12,600	176,904.00	0.09
171	688521	芯原股份	3,500	174,860.00	0.09
172	000975	银泰黄金	11,600	174,000.00	0.09
173	002601	龙佰集团	9,800	167,874.00	0.09
174	000987	越秀资本	27,500	165,550.00	0.09
175	601919	中远海控	17,100	163,818.00	0.09
176	000069	华侨城A	51,700	160,787.00	0.09
177	002568	百润股份	6,500	159,965.00	0.09
178	601633	长城汽车	6,300	158,886.00	0.08
179	601179	中国西电	31,600	155,788.00	0.08
180	000625	长安汽车	9,200	154,836.00	0.08
181	600009	上海机场	4,700	154,066.00	0.08

182	688561	奇安信	3,841	153,985.69	0.08
183	601198	东兴证券	18,200	149,786.00	0.08
184	601857	中国石油	20,700	146,142.00	0.08
185	002028	思源电气	2,800	145,712.00	0.08
186	600702	舍得酒业	1,500	145,050.00	0.08
187	600380	健康元	11,600	144,188.00	0.08
188	600873	梅花生物	15,000	143,250.00	0.08
189	600566	济川药业	4,500	141,435.00	0.08
190	000423	东阿阿胶	2,800	138,096.00	0.07
191	688223	晶科能源	15,450	136,887.00	0.07
192	002236	大华股份	7,400	136,530.00	0.07
193	600918	中泰证券	19,600	134,456.00	0.07
194	601012	隆基绿能	5,800	132,820.00	0.07
195	002056	横店东磁	9,800	132,692.00	0.07
196	601108	财通证券	16,800	130,368.00	0.07
197	600926	杭州银行	12,900	129,129.00	0.07
198	600048	保利发展	12,800	126,720.00	0.07
199	688036	传音控股	900	124,560.00	0.07
200	002371	北方华创	500	122,855.00	0.07
201	000729	燕京啤酒	14,000	120,820.00	0.06
202	603233	大参林	4,800	119,520.00	0.06
203	600096	云天化	7,600	118,560.00	0.06
204	688008	澜起科技	2,000	117,520.00	0.06
205	300122	智飞生物	1,900	116,109.00	0.06
206	002340	格林美	21,200	115,752.00	0.06
207	601111	中国国航	15,700	115,238.00	0.06
208	300274	阳光电源	1,300	113,867.00	0.06
209	300308	中际旭创	1,000	112,910.00	0.06
210	601985	中国核电	14,900	111,750.00	0.06
211	600129	太极集团	2,400	111,504.00	0.06
212	601021	春秋航空	2,200	110,440.00	0.06
213	600031	三一重工	8,000	110,160.00	0.06
214	605499	东鹏饮料	600	109,506.00	0.06
215	601288	农业银行	29,800	108,472.00	0.06
216	600039	四川路桥	14,400	107,856.00	0.06
217	002648	卫星化学	7,300	107,675.00	0.06
218	300676	华大基因	2,200	105,600.00	0.06
219	002459	晶澳科技	5,096	105,589.12	0.06
220	601669	中国电建	21,500	105,135.00	0.06
221	000999	华润三九	2,100	104,433.00	0.06
222	603688	石英股份	1,200	104,256.00	0.06

223	600699	均胜电子	5,800	104,168.00	0.06
224	600258	首旅酒店	6,600	103,092.00	0.06
225	002602	世纪华通	19,800	102,168.00	0.05
226	605358	立昂微	3,700	101,343.00	0.05
227	601555	东吴证券	13,800	100,878.00	0.05
228	000977	浪潮信息	3,000	99,600.00	0.05
229	601377	兴业证券	16,900	99,203.00	0.05
230	600027	华电国际	19,000	97,660.00	0.05
231	300866	安克创新	1,100	97,460.00	0.05
232	600754	锦江酒店	3,200	95,680.00	0.05
233	601838	成都银行	8,400	94,584.00	0.05
234	600809	山西汾酒	400	92,292.00	0.05
235	300724	捷佳伟创	1,200	88,812.00	0.05
236	000786	北新建材	3,600	84,096.00	0.04
237	601238	广汽集团	9,500	83,125.00	0.04
238	300073	当升科技	2,100	80,220.00	0.04
239	603882	金域医学	1,200	75,084.00	0.04
240	600674	川投能源	4,900	74,088.00	0.04
241	000568	泸州老窖	400	71,768.00	0.04
242	601788	光大证券	4,600	70,932.00	0.04
243	002268	电科网安	3,100	69,626.00	0.04
244	600079	人福医药	2,800	69,608.00	0.04
245	300316	晶盛机电	1,500	66,135.00	0.04
246	002714	牧原股份	1,600	65,888.00	0.04
247	603986	兆易创新	700	64,673.00	0.03
248	600848	上海临港	6,300	63,315.00	0.03
249	600038	中直股份	1,600	61,648.00	0.03
250	000876	新希望	6,600	61,512.00	0.03
251	002405	四维图新	6,700	59,630.00	0.03
252	600585	海螺水泥	2,600	58,656.00	0.03
253	002532	天山铝业	9,700	58,297.00	0.03
254	600511	国药股份	2,000	57,240.00	0.03
255	601615	明阳智能	4,400	55,176.00	0.03
256	600745	闻泰科技	1,300	55,003.00	0.03
257	300394	天孚通信	600	54,912.00	0.03
258	002541	鸿路钢构	2,500	54,325.00	0.03
259	688385	复旦微电	1,400	54,082.00	0.03
260	601336	新华保险	1,700	52,921.00	0.03
261	601225	陕西煤业	2,500	52,225.00	0.03
262	688099	晶晨股份	800	50,104.00	0.03
263	002384	东山精密	2,700	49,086.00	0.03

264	600023	浙能电力	9,700	44,717.00	0.02
265	688536	思瑞浦	300	43,890.00	0.02
266	603345	安井食品	400	41,844.00	0.02
267	300408	三环集团	1,200	35,340.00	0.02
268	601658	邮储银行	8,000	34,800.00	0.02
269	603160	汇顶科技	500	34,550.00	0.02
270	600583	海油工程	5,800	34,452.00	0.02
271	002078	太阳纸业	2,800	34,076.00	0.02
272	600795	国电电力	7,900	32,864.00	0.02
273	601577	长沙银行	4,800	32,736.00	0.02
274	601901	方正证券	4,000	32,240.00	0.02
275	000591	太阳能	5,600	31,248.00	0.02
276	002797	第一创业	5,200	30,212.00	0.02
277	000002	万科A	2,800	29,288.00	0.02
278	000932	华菱钢铁	5,600	28,840.00	0.02
279	600418	江淮汽车	1,600	25,840.00	0.01
280	600392	盛和资源	2,400	24,432.00	0.01
281	000893	亚钾国际	800	20,992.00	0.01
282	603737	三棵树	400	19,044.00	0.01
283	002709	天赐材料	700	17,556.00	0.01
284	002074	国轩高科	800	17,200.00	0.01
285	002624	完美世界	1,400	16,576.00	0.01
286	300251	光线传媒	2,000	16,300.00	0.01
287	000703	恒逸石化	2,400	16,128.00	0.01
288	603288	海天味业	400	15,180.00	0.01
289	002500	山西证券	2,800	15,092.00	0.01
290	601881	中国银河	1,200	14,460.00	0.01
291	600487	亨通光电	1,200	14,328.00	0.01
292	002531	天顺风能	1,200	13,920.00	0.01
293	603707	健友股份	800	12,000.00	0.01
294	601865	福莱特	400	10,680.00	0.01
295	603529	爱玛科技	400	10,016.00	0.01
296	002430	杭氧股份	300	8,763.00	0.00
297	002739	万达电影	300	3,906.00	0.00
298	600958	东方证券	200	1,740.00	0.00

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002925	盈趣科技	48,400	942,348.00	0.50

2	600760	中航沈飞	14,900	628,482.00	0.34
3	601728	中国电信	113,300	612,953.00	0.33
4	600901	江苏金租	124,800	604,032.00	0.32
5	688819	天能股份	21,300	594,696.00	0.32
6	600562	国睿科技	39,700	549,448.00	0.29
7	600941	中国移动	5,500	547,140.00	0.29
8	002410	广联达	30,960	530,654.40	0.28
9	603228	景旺电子	23,300	525,648.00	0.28
10	688248	南网科技	19,606	489,561.82	0.26
11	603323	苏农银行	114,400	475,904.00	0.25
12	601311	骆驼股份	55,300	442,953.00	0.24
13	000997	新大陆	21,700	425,537.00	0.23
14	300451	创业慧康	62,200	407,410.00	0.22
15	601801	皖新传媒	56,900	395,455.00	0.21
16	601665	齐鲁银行	101,100	395,301.00	0.21
17	002533	金杯电工	42,600	344,208.00	0.18
18	688100	威胜信息	11,700	338,364.00	0.18
19	300627	华测导航	10,700	331,914.00	0.18
20	601869	长飞光纤	11,400	313,044.00	0.17
21	000878	云南铜业	28,400	309,276.00	0.17
22	600556	天下秀	49,400	291,954.00	0.16
23	603883	老百姓	9,700	289,933.00	0.16
24	688779	长远锂科	37,686	275,107.80	0.15
25	688661	和林微纳	5,930	271,712.60	0.15
26	601998	中信银行	50,600	267,674.00	0.14
27	600350	山东高速	37,800	262,332.00	0.14
28	002839	张家港行	63,800	247,544.00	0.13
29	688107	安路科技	6,600	242,748.00	0.13
30	000682	东方电子	29,900	240,695.00	0.13
31	300870	欧陆通	5,400	239,058.00	0.13
32	688690	纳微科技	8,400	230,328.00	0.12
33	002373	千方科技	20,100	225,321.00	0.12
34	300383	光环新网	21,200	206,064.00	0.11
35	601369	陕鼓动力	25,800	205,884.00	0.11
36	600580	卧龙电驱	17,000	199,410.00	0.11
37	688105	诺唯赞	6,200	198,524.00	0.11
38	000555	神州信息	17,500	197,575.00	0.11
39	603096	新经典	9,900	194,832.00	0.10
40	688381	帝奥微	7,500	189,900.00	0.10
41	600372	中航机载	14,000	184,520.00	0.10
42	600927	永安期货	11,100	174,381.00	0.09

43	600938	中国海油	7,700	161,469.00	0.09
44	600007	中国国贸	8,200	158,916.00	0.08
45	002922	伊戈尔	10,200	151,470.00	0.08
46	002968	新大正	12,000	150,120.00	0.08
47	300253	卫宁健康	20,700	148,833.00	0.08
48	000012	南玻A	26,700	148,719.00	0.08
49	300389	艾比森	8,400	145,656.00	0.08
50	301011	华立科技	6,200	145,080.00	0.08
51	300009	安科生物	14,000	143,080.00	0.08
52	603039	泛微网络	3,000	140,700.00	0.08
53	300286	安科瑞	5,400	140,022.00	0.07
54	601222	林洋能源	21,800	139,302.00	0.07
55	601567	三星医疗	6,700	137,350.00	0.07
56	600312	平高电气	10,800	137,052.00	0.07
57	000967	盈峰环境	28,000	133,000.00	0.07
58	688768	容知日新	3,599	132,479.19	0.07
59	002283	天润工业	22,600	132,210.00	0.07
60	603639	海利尔	8,100	127,170.00	0.07
61	300639	凯普生物	13,500	126,090.00	0.07
62	002913	奥士康	4,100	125,665.00	0.07
63	002706	良信股份	14,100	124,503.00	0.07
64	603337	杰克股份	5,600	120,960.00	0.06
65	688368	晶丰明源	1,100	118,734.00	0.06
66	603236	移远通信	2,200	118,250.00	0.06
67	002171	楚江新材	15,300	114,444.00	0.06
68	002245	蔚蓝锂芯	13,400	114,168.00	0.06
69	000089	深圳机场	17,600	113,168.00	0.06
70	002179	中航光电	2,900	113,100.00	0.06
71	688078	龙软科技	2,800	112,896.00	0.06
72	603218	日月股份	9,100	112,567.00	0.06
73	300476	胜宏科技	6,100	112,545.00	0.06
74	002429	兆驰股份	19,600	109,368.00	0.06
75	688139	海尔生物	2,600	105,352.00	0.06
76	000887	中鼎股份	8,400	103,908.00	0.06
77	603225	新凤鸣	7,300	103,660.00	0.06
78	601187	厦门银行	20,200	102,414.00	0.05
79	000902	新洋丰	8,800	100,232.00	0.05
80	301278	快可电子	1,700	99,025.00	0.05
81	600025	华能水电	11,400	98,382.00	0.05
82	002053	云南能投	10,200	98,124.00	0.05
83	688707	振华新材	4,700	96,350.00	0.05

84	000921	海信家电	4,700	95,880.00	0.05
85	002203	海亮股份	8,500	94,775.00	0.05
86	000333	美的集团	1,700	92,871.00	0.05
87	603171	税友股份	2,600	91,988.00	0.05
88	603605	珀莱雅	924	91,845.60	0.05
89	600718	东软集团	9,900	91,575.00	0.05
90	301165	锐捷网络	2,400	90,936.00	0.05
91	002478	常宝股份	16,300	88,835.00	0.05
92	002484	江海股份	5,500	88,330.00	0.05
93	301117	佳缘科技	1,600	87,216.00	0.05
94	603040	新坐标	3,300	86,295.00	0.05
95	300887	谱尼测试	7,200	85,032.00	0.05
96	603881	数据港	4,200	83,244.00	0.04
97	002990	盛视科技	2,400	82,872.00	0.04
98	002063	远光软件	13,200	81,576.00	0.04
99	002583	海能达	13,600	80,920.00	0.04
100	300590	移为通信	6,700	80,467.00	0.04
101	688578	艾力斯	1,900	79,154.00	0.04
102	000589	贵州轮胎	12,900	78,948.00	0.04
103	300452	山河药辅	5,500	78,320.00	0.04
104	301179	泽宇智能	3,000	77,850.00	0.04
105	300217	东方电热	14,400	77,472.00	0.04
106	002801	微光股份	3,500	76,125.00	0.04
107	688102	斯瑞新材	5,700	75,183.00	0.04
108	688121	卓然股份	3,700	74,851.00	0.04
109	688349	三一重能	2,600	74,412.00	0.04
110	600216	浙江医药	6,900	74,037.00	0.04
111	601126	四方股份	5,100	72,216.00	0.04
112	600737	中粮糖业	8,700	71,688.00	0.04
113	603678	火炬电子	2,700	71,469.00	0.04
114	688095	福昕软件	1,000	69,850.00	0.04
115	300856	科思股份	1,100	68,453.00	0.04
116	301090	华润材料	6,300	68,418.00	0.04
117	000951	中国重汽	5,100	68,136.00	0.04
118	603859	能科科技	1,700	64,141.00	0.03
119	002948	青岛银行	20,900	63,745.00	0.03
120	002986	宇新股份	3,900	60,840.00	0.03
121	000636	风华高科	4,400	60,104.00	0.03
122	000877	天山股份	8,900	59,452.00	0.03
123	002807	江阴银行	16,500	58,575.00	0.03
124	688556	高测股份	1,500	58,485.00	0.03

125	688232	新点软件	1,600	57,920.00	0.03
126	002461	珠江啤酒	7,300	57,670.00	0.03
127	002859	洁美科技	2,300	57,385.00	0.03
128	601098	中南传媒	5,600	56,952.00	0.03
129	603301	振德医疗	2,300	56,350.00	0.03
130	301168	通灵股份	1,200	55,392.00	0.03
131	603866	桃李面包	7,200	55,152.00	0.03
132	688372	伟测科技	700	54,880.00	0.03
133	688170	德龙激光	1,400	54,670.00	0.03
134	688208	道通科技	2,300	54,625.00	0.03
135	300593	新雷能	3,600	53,172.00	0.03
136	301195	北路智控	1,300	52,754.00	0.03
137	600662	外服控股	10,900	52,320.00	0.03
138	300404	博济医药	5,800	51,910.00	0.03
139	301239	普瑞眼科	600	51,600.00	0.03
140	605166	聚合顺	5,200	51,584.00	0.03
141	688018	乐鑫科技	500	51,475.00	0.03
142	600986	浙文互联	9,200	50,232.00	0.03
143	301047	义翘神州	600	49,440.00	0.03
144	002847	盐津铺子	700	48,636.00	0.03
145	603676	卫信康	4,600	47,978.00	0.03
146	601898	中煤能源	4,900	47,481.00	0.03
147	688045	必易微	1,100	47,113.00	0.03
148	688206	概伦电子	2,134	46,521.20	0.02
149	603279	景津装备	2,100	46,431.00	0.02
150	603258	电魂网络	2,000	45,960.00	0.02
151	688006	杭可科技	1,800	42,264.00	0.02
152	688133	泰坦科技	900	41,715.00	0.02
153	600612	老凤祥	600	41,400.00	0.02
154	000860	顺鑫农业	1,700	36,193.00	0.02
155	600548	深高速	4,000	35,960.00	0.02
156	603730	岱美股份	2,400	34,776.00	0.02
157	000567	海德股份	3,200	34,016.00	0.02
158	688066	航天宏图	800	33,792.00	0.02
159	300594	朗进科技	1,600	33,408.00	0.02
160	000811	冰轮环境	2,400	32,568.00	0.02
161	688080	映翰通	800	32,464.00	0.02
162	002035	华帝股份	5,200	32,292.00	0.02
163	300773	拉卡拉	2,000	32,080.00	0.02
164	688589	力合微	800	31,928.00	0.02
165	688373	盟科药业	4,800	31,344.00	0.02

166	600458	时代新材	3,400	31,314.00	0.02
167	600572	康恩贝	6,000	30,300.00	0.02
168	603611	诺力股份	1,600	30,288.00	0.02
169	600284	浦东建设	4,800	30,240.00	0.02
170	002206	海利得	6,000	30,120.00	0.02
171	002851	麦格米特	1,200	29,520.00	0.02
172	001914	招商积余	2,400	28,704.00	0.02
173	603308	应流股份	2,000	28,660.00	0.02
174	603916	苏博特	2,800	28,532.00	0.02
175	688510	航亚科技	1,600	28,192.00	0.02
176	603520	司太立	2,000	28,160.00	0.02
177	301122	采纳股份	800	27,088.00	0.01
178	603997	继峰股份	2,000	26,940.00	0.01
179	300366	创意信息	2,000	26,240.00	0.01
180	002978	安宁股份	800	25,328.00	0.01
181	002378	章源钨业	4,400	24,904.00	0.01
182	002008	大族激光	1,200	24,864.00	0.01
183	300617	安靠智电	800	24,288.00	0.01
184	688295	中复神鹰	800	24,248.00	0.01
185	300855	图南股份	800	24,160.00	0.01
186	301177	迪阿股份	800	23,592.00	0.01
187	301181	标榜股份	800	22,584.00	0.01
188	600389	江山股份	1,200	20,880.00	0.01
189	002121	科陆电子	3,700	20,757.00	0.01
190	301162	国能日新	400	20,752.00	0.01
191	301302	华如科技	800	20,088.00	0.01
192	300384	三联虹普	1,200	19,152.00	0.01
193	300622	博士眼镜	900	17,847.00	0.01
194	601333	广深铁路	6,800	17,612.00	0.01
195	600377	宁沪高速	1,600	16,400.00	0.01
196	603855	华荣股份	800	15,968.00	0.01
197	600500	中化国际	3,600	15,912.00	0.01
198	688287	观典防务	1,600	15,792.00	0.01
199	002212	天融信	1,600	15,648.00	0.01
200	301348	蓝箭电子	351	15,644.07	0.01
201	688147	微导纳米	400	15,596.00	0.01
202	601512	中新集团	2,000	15,420.00	0.01
203	605098	行动教育	400	15,420.00	0.01
204	600409	三友化工	2,800	15,372.00	0.01
205	603330	天洋新材	2,000	15,160.00	0.01
206	688697	纽威数控	800	15,064.00	0.01

207	000913	钱江摩托	1,200	14,964.00	0.01
208	688238	和元生物	1,600	14,384.00	0.01
209	603809	豪能股份	1,200	14,220.00	0.01
210	301510	固高科技	396	13,863.96	0.01
211	300708	聚灿光电	1,200	13,536.00	0.01
212	300904	威力传动	218	13,413.54	0.01
213	600867	通化东宝	1,200	12,996.00	0.01
214	301488	豪恩汽电	187	12,919.83	0.01
215	300774	倍杰特	1,200	12,348.00	0.01
216	002006	精工科技	800	12,224.00	0.01
217	301421	波长光电	202	11,992.74	0.01
218	002961	瑞达期货	800	11,920.00	0.01
219	605336	帅丰电器	800	11,904.00	0.01
220	603056	德邦股份	800	11,576.00	0.01
221	301566	达利凯普	518	11,468.52	0.01
222	300012	华测检测	800	11,360.00	0.01
223	601918	新集能源	2,000	10,540.00	0.01
224	603919	金徽酒	400	9,848.00	0.01
225	688592	司南导航	194	9,802.82	0.01
226	688627	精智达	111	9,736.92	0.01
227	301516	中远通	604	9,368.04	0.01
228	688548	广钢气体	720	9,180.00	0.00
229	601965	中国汽研	400	8,824.00	0.00
230	688563	航材股份	137	8,287.13	0.00
231	688591	泰凌微	292	8,181.84	0.00
232	688603	天承科技	108	8,007.12	0.00
233	301413	安培龙	137	7,972.03	0.00
234	688652	京仪装备	148	7,733.00	0.00
235	301508	中机认检	282	7,523.76	0.00
236	301251	威尔高	212	7,333.08	0.00
237	688671	碧兴物联	213	7,305.90	0.00
238	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
239	601096	宏盛华源	1,773	7,198.38	0.00
240	688653	康希通信	442	7,067.58	0.00
241	688702	盛科通信	144	6,937.92	0.00
242	688651	盛邦安全	149	6,861.45	0.00
243	301517	陕西华达	155	6,771.95	0.00
244	301261	恒工精密	133	6,763.05	0.00
245	301505	苏州规划	184	6,589.04	0.00
246	301568	思泰克	185	6,582.30	0.00
247	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00

248	301272	英华特	118	6,298.84	0.00
249	301533	威马农机	189	6,267.24	0.00
250	688602	康鹏科技	563	6,226.78	0.00
251	301202	朗威股份	195	6,201.00	0.00
252	301578	辰奕智能	88	6,012.16	0.00
253	301486	致尚科技	127	6,000.75	0.00
254	301550	斯菱股份	136	5,925.52	0.00
255	301469	恒达新材	177	5,856.93	0.00
256	301528	多浦乐	83	5,719.53	0.00
257	688610	埃科光电	111	5,661.00	0.00
258	688719	爱科赛博	94	5,649.40	0.00
259	301329	信音电子	252	5,601.96	0.00
260	688638	誉辰智能	90	5,371.20	0.00
261	301393	昊帆生物	86	5,105.82	0.00
262	301418	协昌科技	101	5,070.20	0.00
263	301395	仁信新材	265	4,952.85	0.00
264	688646	逸飞激光	132	4,761.24	0.00
265	301525	儒竞科技	58	4,724.68	0.00
266	301456	盘古智能	155	4,710.45	0.00
267	301520	万邦医药	87	4,588.38	0.00
268	301500	飞南资源	204	4,261.56	0.00
269	001326	联域股份	83	4,037.12	0.00
270	001378	德冠新材	128	4,002.56	0.00
271	301515	港通医疗	141	3,986.07	0.00
272	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
273	002563	森马服饰	600	3,462.00	0.00
274	001306	夏厦精密	45	3,391.20	0.00
275	603004	鼎龙科技	93	2,900.67	0.00
276	603373	安邦护卫	83	2,884.25	0.00
277	001358	兴欣新材	58	2,561.28	0.00
278	603193	润本股份	153	2,548.98	0.00
279	603107	上海汽配	132	2,401.08	0.00
280	603275	众辰科技	60	2,382.00	0.00
281	603276	恒兴新材	94	2,338.72	0.00
282	603062	麦加芯彩	40	2,312.40	0.00
283	603231	索宝蛋白	87	1,873.11	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	600519	贵州茅台	6,629,583.00	3.94
2	000858	五粮液	5,819,266.00	3.46
3	601012	隆基绿能	4,675,994.00	2.78
4	000063	中兴通讯	4,521,554.42	2.69
5	600276	恒瑞医药	4,468,540.40	2.65
6	300059	东方财富	4,283,121.00	2.54
7	600887	伊利股份	4,161,940.00	2.47
8	601766	中国中车	3,935,950.00	2.34
9	601318	中国平安	3,903,854.00	2.32
10	002475	立讯精密	3,887,908.00	2.31
11	000725	京东方 A	3,880,319.00	2.31
12	600406	国电南瑞	3,801,046.00	2.26
13	600050	中国联通	3,703,514.00	2.20
14	300750	宁德时代	3,628,422.00	2.16
15	601319	中国人保	3,559,880.00	2.11
16	600104	上汽集团	3,541,057.00	2.10
17	601818	光大银行	3,464,187.00	2.06
18	000338	潍柴动力	3,326,166.00	1.98
19	300760	迈瑞医疗	3,270,946.00	1.94
20	300124	汇川技术	3,068,951.00	1.82

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	600519	贵州茅台	5,765,996.00	3.43
2	601012	隆基绿能	4,893,243.00	2.91
3	002594	比亚迪	4,822,417.00	2.86
4	000568	泸州老窖	4,198,426.00	2.49
5	300059	东方财富	4,104,496.00	2.44
6	600276	恒瑞医药	3,879,108.20	2.30
7	600887	伊利股份	3,681,804.00	2.19
8	600050	中国联通	3,656,059.00	2.17
9	601318	中国平安	3,650,238.00	2.17
10	000858	五粮液	3,403,600.00	2.02
11	300750	宁德时代	3,308,867.00	1.97
12	601138	工业富联	3,281,405.00	1.95
13	688981	中芯国际	3,203,730.06	1.90

14	300760	迈瑞医疗	3,034,648.00	1.80
15	600926	杭州银行	3,004,029.00	1.78
16	300124	汇川技术	2,980,046.00	1.77
17	601658	邮储银行	2,881,915.00	1.71
18	601668	中国建筑	2,852,126.00	1.69
19	601390	中国中铁	2,812,771.00	1.67
20	600919	江苏银行	2,806,714.00	1.67

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	571,173,579.84
卖出股票收入（成交）总额	545,041,009.91

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

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	22,080.28
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	5,871,479.66
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,893,559.94

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 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A	9,673	10,423.01	51,283,897.22	50.87	49,537,872.75	49.13
富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C	41	132,284.16	4,428,089.87	81.64	995,560.53	18.36
合计	9,714	10,937.35	55,711,987.09	52.44	50,533,433.28	47.56

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A	421,662.04	0.4182
	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C	—	—
	合计	421,662.04	0.3969

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A	0
	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A	10~50
	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C	0
	合计	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 A	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强 C
基金合同生效日(2018年12月25日)基金份额总额	227,607,631.34	—
报告期期初基金份额总额	91,548,428.71	—
本报告期基金总申购份额	81,007,829.89	5,642,796.84
减：本报告期基金总赎回份额	71,734,488.63	219,146.44
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	100,821,769.97	5,423,650.40

注：本基金自 2023 年 9 月 22 日起增加 C 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

本基金管理人于 2023 年 11 月 23 日发布公告，李强先生自 2023 年 11 月 22 日起担任首席信息官，同日起林志松先生不再兼任首席信息官。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 3.3 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 21 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：根据我行审计报告，本行不存在涉嫌犯罪被依法立案调查的情况，本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施、涉嫌严重违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责的情况；本行或者本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或者受到中国证监会行政处罚，或者受到其他有权机关重大行政处罚，或者被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分的情况；本行董事、监事、高级管理人员不存在因涉嫌违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责的情况。

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 (%)	
国投证券	2	24,738,783.42	2.23	18,205.55	2.27	—
渤海证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	1	43,188,114.85	3.90	31,260.90	3.89	—
长江证券	3	42,683,158.52	3.85	30,787.71	3.83	—

德邦证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	2	52,114.56	0.00	37.74	0.00	—
东财证券	2	89,078,258.92	8.03	64,572.95	8.04	—
方正证券	2	46,843,121.80	4.22	34,167.22	4.25	—
高盛中国	1	207,354.54	0.02	191.04	0.02	—
光大证券	2	51,995,748.42	4.69	37,699.09	4.69	—
广发证券	2	39,461,129.92	3.56	28,573.33	3.56	—
国海证券	2	4,048,134.84	0.37	2,979.15	0.37	—
国盛证券	2	165,521,341.99	14.93	119,449.64	14.87	—
国泰君安	2	16,376,485.88	1.48	11,911.20	1.48	—
国信证券	2	27,921.20	0.00	20.54	0.00	—
海通证券	2	151,643,422.53	13.68	110,157.04	13.71	—
华泰证券	1	8,346,199.80	0.75	6,141.04	0.76	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	124,198,802.40	11.20	89,933.26	11.20	—
太平洋证券	2	21,269,208.29	1.92	15,341.48	1.91	—
天风证券	2	23,090,060.33	2.08	16,776.64	2.09	—
西南证券	2	76,853.59	0.01	56.56	0.01	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—
信达证券	2	19,337,982.44	1.74	14,231.28	1.77	—
兴业证券	1	23,104,137.89	2.08	16,665.07	2.07	—
招商证券	1	30,170,759.61	2.72	21,762.91	2.71	—
中航证券	2	48,934,107.73	4.41	35,374.66	4.40	—
中金公司	2	13,053,002.87	1.18	9,423.56	1.17	—
中泰证券	2	63,017,404.34	5.68	45,452.90	5.66	—
中信建投	1	22,298,116.83	2.01	16,083.67	2.00	—
中信证券	4	36,012,849.77	3.25	25,978.97	3.23	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

注：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：德邦证券（50401）。本报告期本基金新增券商交易单元：中信证券（017462、58563）。

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 (%)
国投证券	—	—	—	—	—	—
渤海证券	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	7,761.59	0.08	—	—	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东财证券	6,037.20	0.07	—	—	—	—
方正证券	4,506,525.00	48.95	—	—	—	—
高盛中国	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	6,946.88	0.08	—	—	—	—
国盛证券	47,143.20	0.51	—	—	—	—
国泰君安	4,505,670.00	48.94	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	39,970.07	0.43	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—
上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	25,071.86	0.27	—	—	—	—
太平洋证券	26,818.00	0.29	—	—	—	—
天风证券	—	—	—	—	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	3,398.17	0.04	—	—	—	—
兴业证券	29,210.50	0.32	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中航证券	1,514.86	0.02	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—

中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
中银证券	—	—	—	—	—	—

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年02月02日
2	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年03月25日
3	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年05月04日
4	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年08月09日
5	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年08月24日
6	富国基金管理有限公司关于富国MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金增加C类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告	规定披露媒介	2023年09月20日
7	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年10月10日
8	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年11月22日
9	富国基金管理有限公司关于高级	规定披露媒介	2023年11月23日

	管理人员变更的公告		
--	-----------	--	--

§ 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	2023-01-16 至 2023-05-24	—	26,562,601.91	26,562,601.91	—	—
产品特有风险							
<p>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。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、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 2023 年 9 月 22 日起，对本基金增加 C 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 2023 年 9 月 20 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》及修订后的基金合同、托管协议。二、本报告期内，经基金管理人董事会七届一次会议审议通过并按规定备案，李强先生自 2023 年 11 月 22 日起担任首席信息官，同日起林志松先生不再兼任首席信息官。具体可参见基金管理人于 2023 年 11 月 23 日发布的《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

§ 13 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金的文件 2、富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金合同 3、富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	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 。