

富国中证 1000 优选股票型证券投资基金  
二〇二四年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：东方证券股份有限公司

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。

基金托管人东方证券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.....	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 .....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	16
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 .....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	21
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 .....	21
§5 托管人报告 .....	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	21
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.....	21
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 .....	21
§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 .....	24
7.1 资产负债表.....	24

7.2 利润表.....	25
7.3 净资产变动表.....	26
7.4 报表附注.....	28
§8 投资组合报告 .....	60
8.1 期末基金资产组合情况.....	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	61
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	61
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 .....	79
8.12 投资组合报告附注.....	79
§9 基金份额持有人信息 .....	80
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	80
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 .....	81
§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 .....	82
11.4 基金投资策略的改变 .....	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	82
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 .....	82
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.....	84
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	84
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 .....	84
§13 备查文件目录 .....	84



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 1000 优选股票型证券投资基金	
基金简称	富国中证 1000 优选股票	
基金主代码	017038	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 22 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	东方证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	74,159,689.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国中证 1000 优选股票 A	富国中证 1000 优选股票 C
下属分级基金的交易代码	017038	017039
报告期末下属分级基金的份额总额	69,151,350.84 份	5,008,338.46 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、公司价值评估以及组合风险管理全过程中。在股票投资方面，本基金在资产配置的框架下，通过定性和定量分析相结合的方法对上市公司基本面、估值、成长性等进行深入分析，精选中证 1000 指数中成长性良好且估值合理的上市公司股票构建投资组合，并根据市场状况及变化，不定期对策略权重进行优化调整，力求获得超越业绩比较基准的投资回报；本基金投资存托凭证将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断进行投资；在债券投资方面，本基金将采用久期控制下的主动性投资策略；本基金的股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、信用衍生品和参与融资业务的投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
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	东方证券股份有限公司

信息披露负责人	姓名	赵瑛	郭卫峰
	联系电话	021-20361818	021-63325888
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	dftg@orientsec.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95503
传真		021-20361616	021-63320039
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	上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦
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	上海市黄浦区中山南路 318 号东方国际金融广场 2 号楼 3 楼
邮政编码		200120	200010
法定代表人		裴长江	龚德雄

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 东方证券股份有限公司 上海市黄浦区中山南路 318 号东方国际金融广场 2 号楼 3 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	富国基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国中证 1000 优选股票 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年 11 月 22 日 (基金合同生效日)
---------------	--------	--------	-------------------------------

			至 2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-2,804,632.40	6,432,278.54	-350,091.39
本期利润	-288,317.41	3,445,656.15	-3,173,155.16
加权平均基金份额本期利润	-0.0025	0.0218	-0.0156
本期加权平均净值利润率	-0.28%	2.15%	-1.57%
本期基金份额净值增长率	2.05%	-0.82%	-1.56%
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	-255,689.37	-3,607,526.49	-3,173,155.16
期末可供分配基金份额利润	-0.0037	-0.0237	-0.0156
期末基金资产净值	68,895,661.47	148,511,577.12	200,672,129.49
期末基金份额净值	0.9963	0.9763	0.9844
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	-0.37%	-2.37%	-1.56%

(2) 富国中证 1000 优选股票 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 11 月 22 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-1,249,598.26	-7,661.92	-27,001.25
本期利润	-397,612.74	262,467.34	-185,799.98
加权平均基金份额本期利润	-0.0407	0.0254	-0.0162
本期加权平均净值利润率	-4.56%	2.54%	-1.63%
本期基金份额净值增长率	1.43%	-1.43%	-1.62%
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	-82,018.55	-584,708.19	-185,799.98
期末可供分配基金份额利润	-0.0164	-0.0303	-0.0162
期末基金资产净值	4,926,319.91	18,711,459.85	11,284,991.31
期末基金份额净值	0.9836	0.9697	0.9838
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	-1.64%	-3.03%	-1.62%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式



基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### (1) 富国中证 1000 优选股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.01%	2.13%	4.23%	2.28%	-2.22%	-0.15%
过去六个月	17.42%	1.97%	20.68%	2.13%	-3.26%	-0.16%
过去一年	2.05%	1.90%	1.41%	2.01%	0.64%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-0.37%	1.43%	-10.11%	1.52%	9.74%	-0.09%

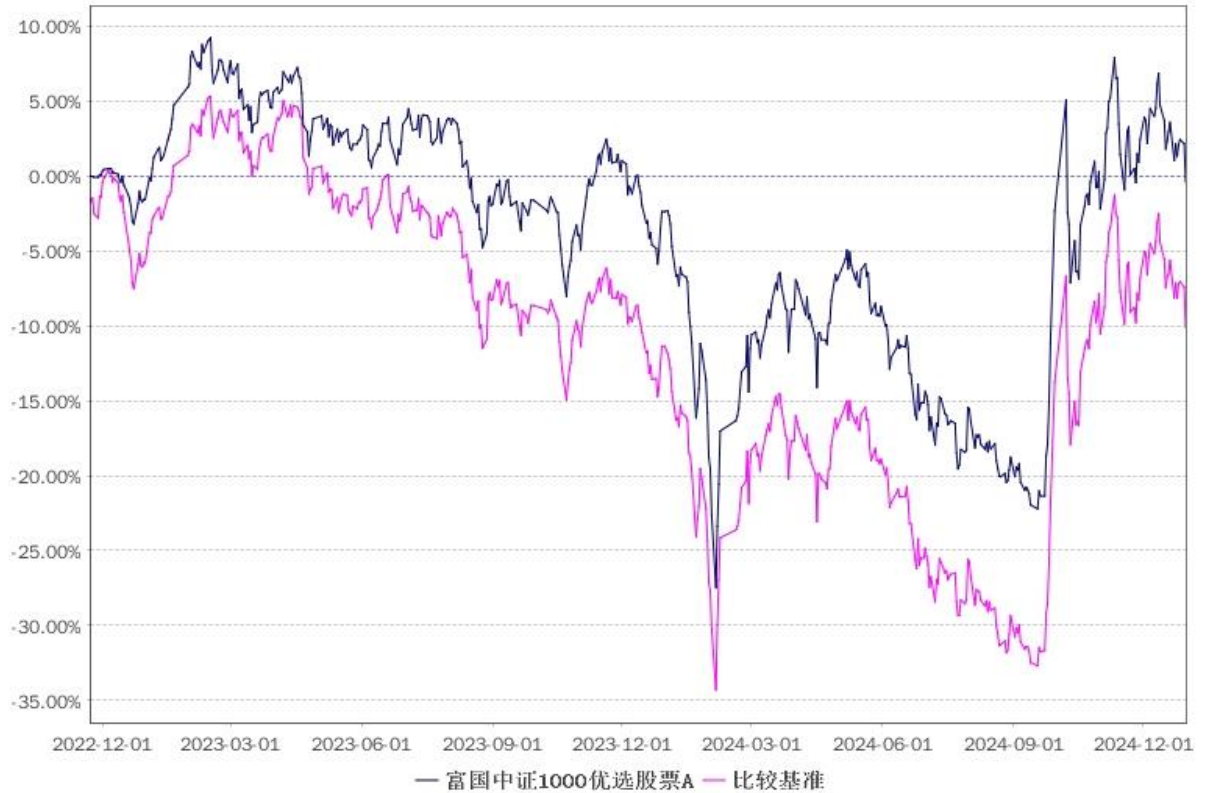
##### (2) 富国中证 1000 优选股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.85%	2.13%	4.23%	2.28%	-2.38%	-0.15%
过去六个月	17.07%	1.97%	20.68%	2.13%	-3.61%	-0.16%
过去一年	1.43%	1.90%	1.41%	2.01%	0.02%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-1.64%	1.43%	-10.11%	1.52%	8.47%	-0.09%

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

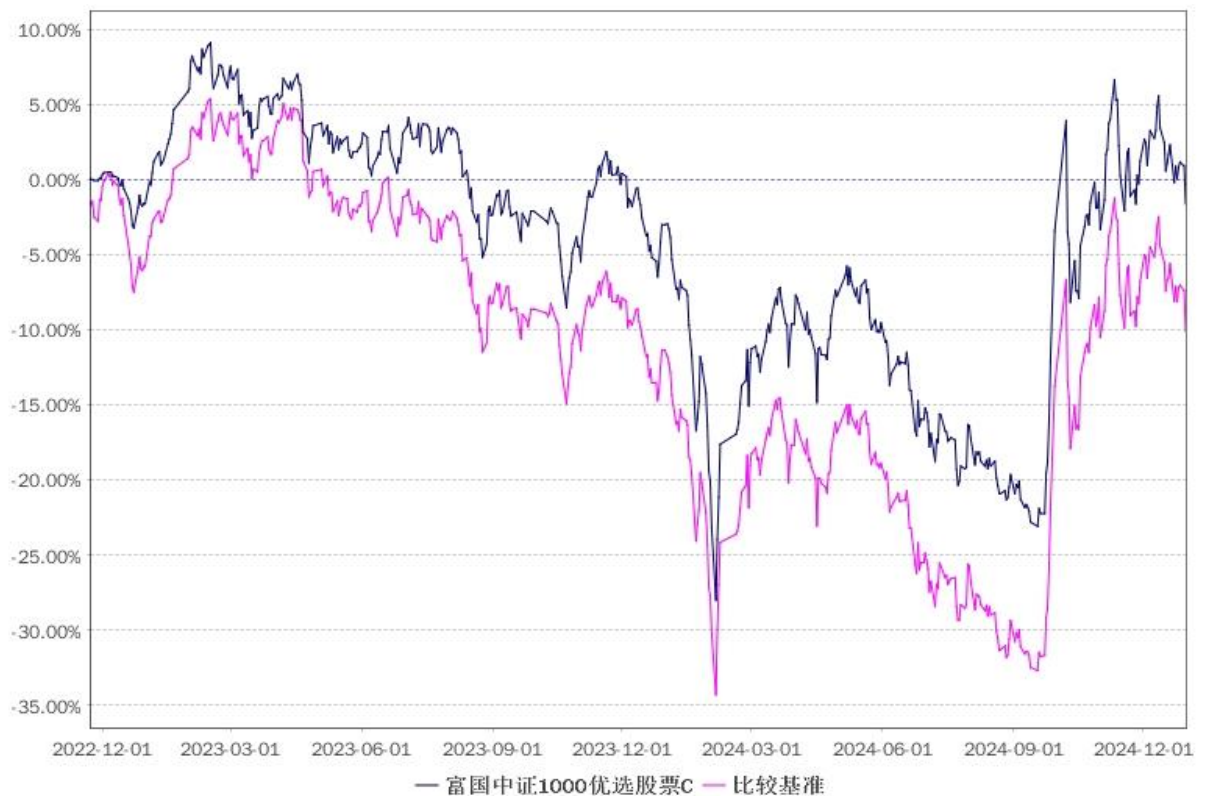
(1) 自基金合同生效以来富国中证 1000 优选股票 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2024 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2022 年 11 月 22 日成立，建仓期 6 个月，从 2022 年 11 月 22 日起至 2023 年 5 月 21 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 1000 优选股票 C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

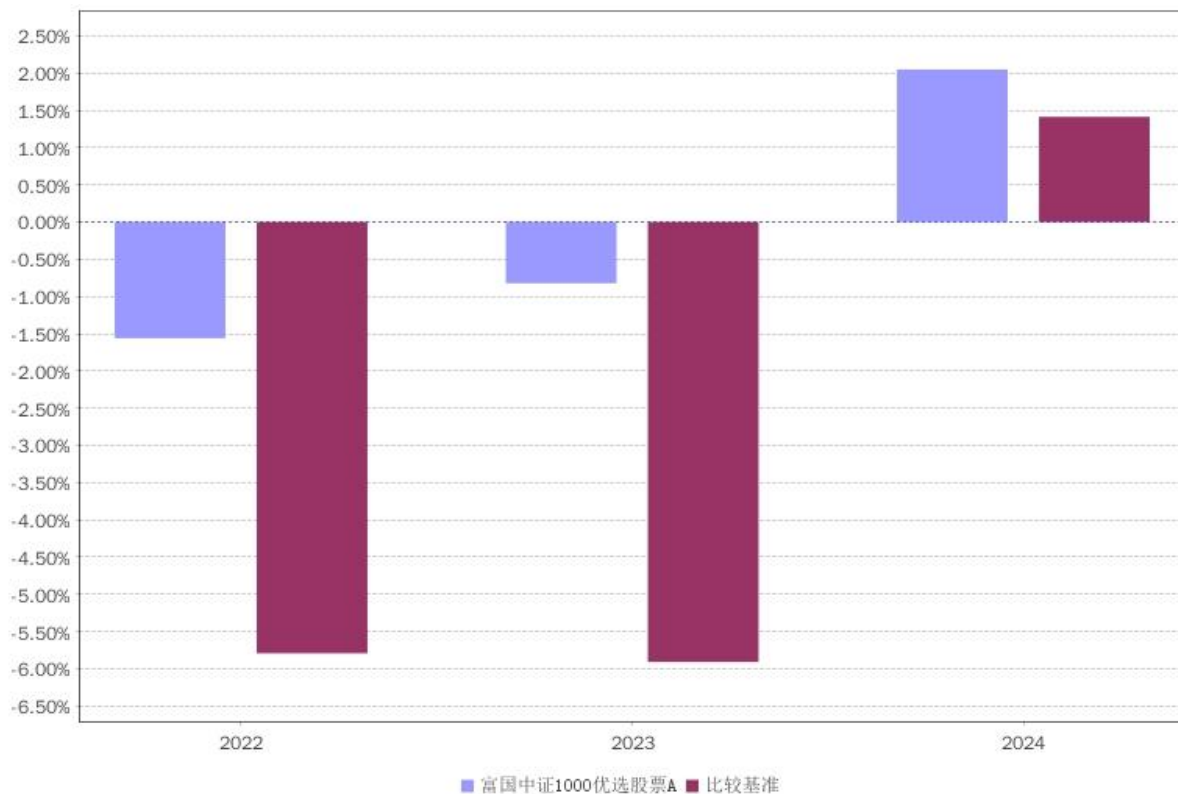


注：1、截止日期为 2024 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2022 年 11 月 22 日成立，建仓期 6 个月，从 2022 年 11 月 22 日起至 2023 年 5 月 21 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

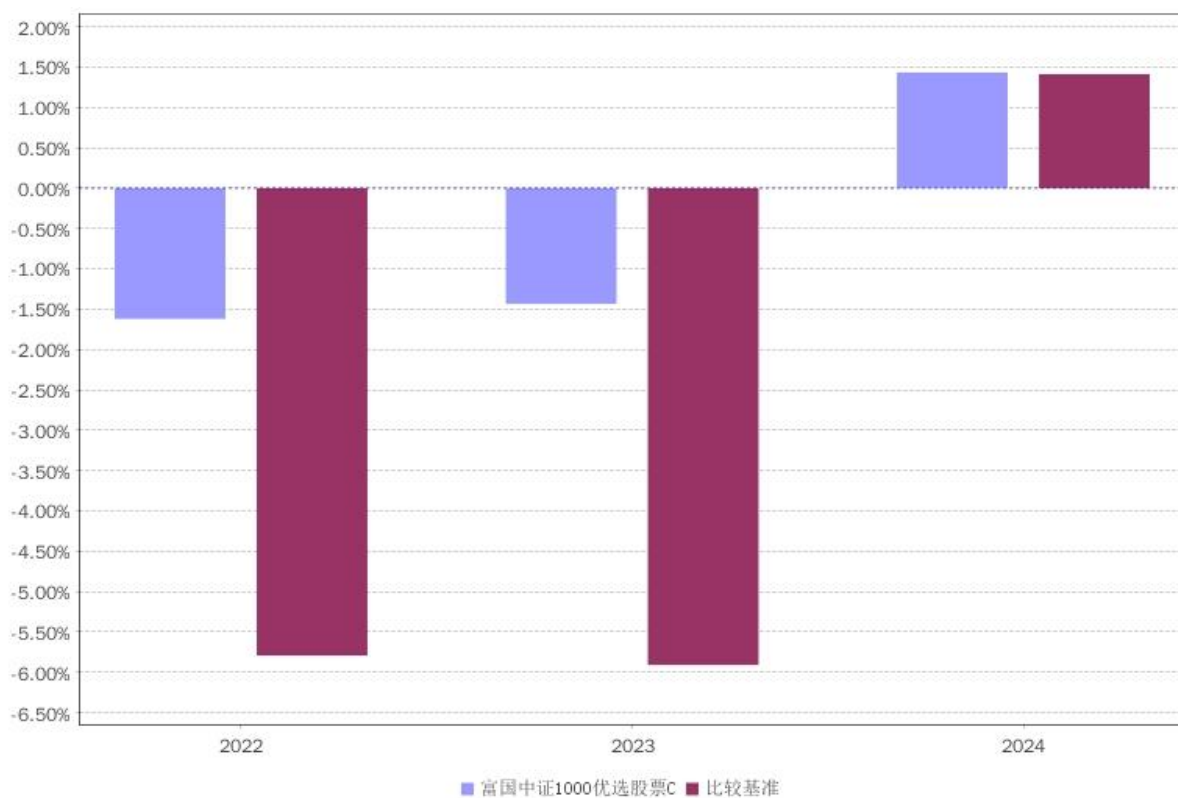
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 自基金合同生效以来富国中证 1000 优选股票 A 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2022 年按实际存续期计算。

(2) 自基金合同生效以来富国中证 1000 优选股票 C 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2022 年按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### （1）富国中证 1000 优选股票 A

注：本基金 2022 年 11 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日未进行利润分配

#### （2）富国中证 1000 优选股票 C

注：本基金 2022 年 11 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日未进行利润分配

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王保合	本基金现任基金经理	2022-11-22	—	19	博士，自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监、量化与海外投资部量化投资总监、量化投资部总经理；现任富国基金总经理助理，兼任富国基金量化投资部总经理、资深定量基金经理。自 2011 年 03 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2011 年 03 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2015 年 04 月起任富国中证国有企业改革指数型证券投资基金（原富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金）基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证全指证券公司指数型证券投资基金（原富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金）基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证银行指数型证券投资基金（原富国中证银行指数分级证券投资基金）基金经理；自 2020 年 09 月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金

					<p>(LOF) 基金经理；自 2022 年 10 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国创业板增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 09 月起任富国致弘量化选股股票型证券投资基金基金经理；自 2023 年 12 月起任富国致航量化选股股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。</p>
方旻	本基金现任基金经理	2022-11-22	—	15	<p>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。</p>

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 1000 优选股票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》、《富国中证 1000 优选股票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15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 级为 0.9963 元，C 级为 0.9836 元；份额累计净值 A 级为 0.9963 元，C 级为 0.9836 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为 2.05%，C 级为 1.43%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 1.41%，C 级为 1.41%。

#### **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

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

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，东方证券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

本报告期内，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。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，本基金托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(25)第 P00628 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 1000 优选股票型证券投资基金

	金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国中证 1000 优选股票型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的富国中证 1000 优选股票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，公允反映了富国中证 1000 优选股票型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富国中证 1000 优选股票型证券投资基金，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	<p>富国中证 1000 优选股票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。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	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

	<p>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中证 1000 优选股票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中证 1000 优选股票型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。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，就可能导致对富国中证 1000 优选股票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</p>

	<p>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 1000 优选股票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。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	汪芳	冯适
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2025 年 03 月 27 日	

## § 7 年度财务报告

### 7.1 资产负债表

会计主体：富国中证 1000 优选股票型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
货币资金	4,226,646.21	16,248,348.41
结算备付金	667,219.83	20,187.80
存出保证金	—	—
交易性金融资产	66,482,707.79	150,993,300.75
其中：股票投资	66,482,707.79	150,993,300.75
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	—	—



应收股利	—	—
应收申购款	3,002,422.65	479,158.73
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	74,378,996.48	167,740,995.69
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末</b> 2024 年 12 月 31 日	<b>上年度末</b> 2023 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	—	—
应付赎回款	199,648.51	161,608.73
应付管理人报酬	78,179.45	172,425.39
应付托管费	13,029.93	28,737.59
应付销售服务费	2,803.76	6,750.07
应付投资顾问费	—	—
应交税费	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	263,353.45	148,436.94
负债合计	557,015.10	517,958.72
<b>净资产：</b>		
实收基金	74,159,689.30	171,415,271.65
其他综合收益	—	—
未分配利润	-337,707.92	-4,192,234.68
净资产合计	73,821,981.38	167,223,036.97
负债和净资产总计	74,378,996.48	167,740,995.69

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9954 元，基金份额总额 74,159,689.30 份。其中：富国中证 1000 优选股票 A 份额净值 0.9963 元，份额总额 69,151,350.84 份；富国中证 1000 优选股票 C 份额净值 0.9836 元，份额总额 5,008,338.46 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国中证 1000 优选股票型证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
-----	----	---------

	(2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日)	(2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日)
<b>一、营业总收入</b>	<b>1,114,312.97</b>	<b>6,560,412.04</b>
1.利息收入	145,602.73	148,095.23
其中：存款利息收入	145,602.73	148,095.23
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）	-2,625,937.25	7,012,673.11
其中：股票投资收益	-5,904,527.40	4,704,265.23
基金投资收益	—	—
债券投资收益	11,007.92	23,130.93
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	1,756,537.24	7,709.73
股利收益	1,511,044.99	2,277,567.22
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）	3,368,300.51	-2,716,493.13
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	226,346.98	2,116,136.83
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>1,800,243.12</b>	<b>2,852,288.55</b>
1. 管理人报酬	1,360,148.15	2,264,478.99
2. 托管费	226,691.29	377,413.23
3. 销售服务费	54,067.11	62,347.76
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	6,335.18	28.57
8. 其他费用	153,001.39	148,020.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-685,930.15</b>	<b>3,708,123.49</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-685,930.15</b>	<b>3,708,123.49</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>	<b>—</b>	<b>—</b>
<b>六、综合收益总额</b>	<b>-685,930.15</b>	<b>3,708,123.49</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：富国中证 1000 优选股票型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、上期期末净资产	171,415,271.65	-4,192,234.68	167,223,036.97
二、本期期初净资产	171,415,271.65	-4,192,234.68	167,223,036.97
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-97,255,582.35	3,854,526.76	-93,401,055.59
（一）、综合收益总额	—	-685,930.15	-685,930.15
（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）	-97,255,582.35	4,540,456.91	-92,715,125.44
其中：1. 基金申购款	56,888,344.23	-5,591,410.14	51,296,934.09
2. 基金赎回款	-154,143,926.58	10,131,867.05	-144,012,059.53
（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	74,159,689.30	-337,707.92	73,821,981.38
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	215,316,075.94	-3,358,955.14	211,957,120.80
二、本期期初净资产	215,316,075.94	-3,358,955.14	211,957,120.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-43,900,804.29	-833,279.54	-44,734,083.83
（一）、综合收益总额	—	3,708,123.49	3,708,123.49
（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）	-43,900,804.29	4,541,403.03	-48,442,207.32

	9		2
其中：1.基金申购款	379,294,898.33	8,583,729.50	387,878,627.83
2.基金赎回款	423,195,702.62	13,125,132.53	436,320,835.15
(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	171,415,271.65	-4,192,234.68	167,223,036.97

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

富国中证 1000 优选股票型证券投资基金（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[2022] 2480 号《关于准予富国中证 1000 优选股票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自 2022 年 11 月 7 日至 2022 年 11 月 18 日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具德师报(验)字(22)第 00545 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2022 年 11 月 22 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的净有效认购金额为人民币 215,273,937.85 元，其中归属于 A 类基金份额为人民币 203,803,397.46 元，归属于 C 类基金份额为人民币 11,470,540.39 元。经基金注册登记机构计算并确认的认购资金利息计人民币 42,138.09 元，其中归属于 A 类基金份额为 41,887.19 元，归属于 C 类基金份额 250.90 元。合计为人民币 215,316,075.94 元，折算基金份额计 215,316,075.94 份。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为东方证券股份有限公司。

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（包括主板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股指期货、信用衍生品、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。在未来条件许可的情况下，本基金可根据相关法律法规，在履行适当程序后，参与融券业务和转融通证券出借业务。

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。

本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 80%-95%；本基金投资于中证 1000 指数的成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例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、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金业绩比较基准：中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### **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

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) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入。出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收

入计入投资收益；

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

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

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

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红；若基金合同生效不满 3 个月，本基金可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

4、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 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

#### **7.4.4.12 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

并作为一个经营分部。

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	3,801,730.07	1,112,853.44
等于：本金	3,799,930.17	1,112,300.93
加：应计利息	1,799.90	552.51
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	424,916.14	15,135,494.97
等于：本金	424,847.78	15,132,124.28

加：应计利息	68.36	3,370.69
减：坏账准备	—	—
合计	4,226,646.21	16,248,348.41

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。其他存款本期末及上年度末余额均为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 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		68,812,762.91	—	66,482,707.79	— 2,330,055.12
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		68,812,762.91	—	66,482,707.79	— 2,330,055.12
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		156,691,656.38	—	150,993,300.75	— 5,698,355.63
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		156,691,656.38	—	150,993,300.75	— 5,698,355.63

#### 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	353.45	436.94
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	—	—
其中：交易所市场	—	—
银行间市场	—	—
应付利息	—	—
预提信息披露费	230,000.00	110,000.00
预提审计费	33,000.00	38,000.00
合计	263,353.45	148,436.94

**7.4.7.7 实收基金**

富国中证 1000 优选股票 A：

金额单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	152,119,103.61	152,119,103.61
本期申购	34,382,869.07	34,382,869.07
本期赎回（以“-”号填列）	-117,350,621.84	-117,350,621.84
本期末	69,151,350.84	69,151,350.84

富国中证 1000 优选股票 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	19,296,168.04	19,296,168.04



本期申购	22,505,475.16	22,505,475.16
本期赎回（以“-”号填列）	-36,793,304.74	-36,793,304.74
本期末	5,008,338.46	5,008,338.46

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 1000 优选股票 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	7,618,061.36	- 11,225,587.85	-3,607,526.49
本期期初	7,618,061.36	- 11,225,587.85	-3,607,526.49
本期利润	- 2,804,632.40	2,516,314.99	-288,317.41
本期基金份额交易产生的变动数	3,024,829.77	615,324.76	3,640,154.53
其中：基金申购款	- 1,016,761.47	-1,366,821.66	-2,383,583.13
基金赎回款	4,041,591.24	1,982,146.42	6,023,737.66
本期已分配利润	—	—	—
本期末	7,838,258.73	-8,093,948.10	-255,689.37

富国中证 1000 优选股票 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	835,619.48	- 1,420,327.67	-584,708.19
本期期初	835,619.48	- 1,420,327.67	-584,708.19
本期利润	- 1,249,598.26	851,985.52	-397,612.74
本期基金份额交易产生的变动数	914,196.16	-13,893.78	900,302.38
其中：基金申购款	-396,728.17	- 2,811,098.84	-3,207,827.01
基金赎回款	1,310,924.33	2,797,205.06	4,108,129.39
本期已分配利润	—	—	—
本期末	500,217.38	-582,235.93	-82,018.55

#### 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	40,625.21	45,925.88
定期存款利息收入	—	—
其他存款利息收入	86,239.38	93,730.40
结算备付金利息收入	17,701.79	7,308.88
其他	1,036.35	1,130.07
合计	145,602.73	148,095.23

#### 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	713,779,825.31	1,448,439,300.54
减：卖出股票成本总额	718,802,864.55	1,441,341,114.06
减：交易费用	881,488.16	2,393,921.25
买卖股票差价收入	-5,904,527.40	4,704,265.23

#### 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	4.92	213.05
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	11,003.00	22,917.88
合计	11,007.92	23,130.93

##### 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	45,410.18	734,574.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	34,400.00	706,105.00
减：应计利息总额	4.92	5,484.19
减：交易费用	2.26	66.96
买卖债券差价收入	11,003.00	22,917.88

**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**

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）
股指期货投资收益	1,756,537.24	7,709.73

**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）
股票投资产生的股利收益	1,511,044.99	2,277,567.22
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	1,511,044.99	2,277,567.22

**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	3,368,300.51	-2,716,493.13
股票投资	3,368,300.51	-2,716,493.13
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
基金投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他	—	—
2. 衍生工具	—	—
权证投资	—	—
3. 其他	—	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—	—
合计	3,368,300.51	-2,716,493.13

#### 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	219,123.89	2,081,320.48
基金转换费收入	7,223.09	34,816.35
合计	226,346.98	2,116,136.83

#### 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	33,000.00	38,000.00
信息披露费	120,000.00	110,000.00
证券出借违约金	—	—
银行费用	—	20.00
其他	1.39	—
合计	153,001.39	148,020.00

#### 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

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
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	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
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（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（%）
东方证券	1,344,452,946.10	100.00	2,896,839,926.90	100.00

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（%）
东方证券	45,410.18	100.00	1,328,616.07	100.00

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（%）
东方证券	438,314.94	100.00	—	—
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（%）
东方证券	945,230.46	100.00	—	—

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	1,360,148.15	2,264,478.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	505,376.24	800,746.75
应支付基金管理人的净管理费	854,771.91	1,463,732.24

注：2023 年 7 月 10 日前，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提，自 2023 年 7 月 10 日起，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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	226,691.29	377,413.23

注：2023 年 7 月 10 日前，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提，自 2023 年 7 月 10 日起，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

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，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 1000 优选股票 A	富国中证 1000 优选股票 C	合计
东方证券股份有限公司	—	1,300.63	1,300.63
富国基金管理有限公司	—	36,353.09	36,353.09
合计	—	37,653.72	37,653.72

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国中证 1000 优选股票 A	富国中证 1000 优选股票 C	合计
东方证券股份有限公司	—	8,472.13	8,472.13
富国基金管理有限公司	—	7,789.93	7,789.93
合计	—	16,262.06	16,262.06

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

$$H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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**

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

**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（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
东方证券	424,916.14	86,239.38	15,135,494.97	93,730.40

**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

上年度可比期间（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
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	1,354	23,532.52

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### **7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

##### **7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金无其他关联交易事项。

#### **7.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

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

##### **7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### **7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

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 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	4,226,646.21	—	—	—	—	—	4,226,646.21
结算备付金	667,219.83	—	—	—	—	—	667,219.83
交易性金融资产	—	—	—	—	—	66,482,707.79	66,482,707.79
应收申购款	—	—	—	—	—	3,002,422.65	3,002,422.65
资产总计	4,893,866.04	—	—	—	—	69,485,130.44	74,378,996.48
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	199,648.51	199,648.51
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	78,179.45	78,179.45
应付托管费	—	—	—	—	—	13,029.93	13,029.93
应付销售服务费	—	—	—	—	—	2,803.76	2,803.76
其他负债	—	—	—	—	—	263,353.45	263,353.45
负债总计	—	—	—	—	—	557,015.10	557,015.10
利率敏感度缺口	4,893,866.04	—	—	—	—	68,928,115.34	73,821,981.38
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	16,248,348.41	—	—	—	—	—	16,248,348.41
结算备付金	20,187.80	—	—	—	—	—	20,187.80
交易性金融资产	—	—	—	—	—	150,993,300.75	150,993,300.75
应收申购款	—	—	—	—	—	479,158.73	479,158.73

资产总计	16,268,536.21	—	—	—	—	151,472,459.48	167,740,995.69
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	161,608.73	161,608.73
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	172,425.39	172,425.39
应付托管费	—	—	—	—	—	28,737.59	28,737.59
应付销售服务费	—	—	—	—	—	6,750.07	6,750.07
其他负债	—	—	—	—	—	148,436.94	148,436.94
负债总计	—	—	—	—	—	517,958.72	517,958.72
利率敏感度缺口	16,268,536.21	—	—	—	—	150,954,500.76	167,223,036.97

#### **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股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### **7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股指期货、信用衍生品、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。在未来条件许可的情况下，本基金可根据相关法律法规，在履行适当程序后，参与融券业务和转融通证券出借业务。

本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 80%-95%；本基金投资于中证 1000 指数的成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例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、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于



基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（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	66,482,707.79	90.06	150,993,300.75	90.29
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	66,482,707.79	90.06	150,993,300.75	90.29

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%	691,304.37	1,492,728.46
	2. 业绩比较基准减少 1%	-691,304.37	-1,492,728.46

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	66,482,707.79	150,390,530.41
第二层次	—	280,768.00
第三层次	—	322,002.34
合计	66,482,707.79	150,993,300.75

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	—	322,002.34	322,002.34
当期购买	—	25,188.22	25,188.22
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	298,414.72	298,414.72
当期利得或损失总额	—	-48,775.84	-48,775.84
其中：计入损益的利得或损失	—	-48,775.84	-48,775.84
期末余额	—	—	—
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	—	—	—
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	—	—	—
当期购买	—	268,531.85	268,531.85
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	29,740.10	29,740.10
当期利得或损失总额	—	83,210.59	83,210.59
其中：计入损益的利得或损失	—	83,210.59	83,210.59
期末余额	—	322,002.34	322,002.34
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	—	77,840.10	77,840.10

#### 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
—	—	—	—	—	—
项目			不可观察输入值		

	上年度末公允价值	采用的估值技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	322,002.34	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	0.1969- 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	66,482,707.79	89.38
	其中：股票	66,482,707.79	89.38
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	—	—

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	4,893,866.04	6.58
8	其他各项资产	3,002,422.65	4.04
9	合计	74,378,996.48	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

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	330,921.00	0.45
B	采矿业	636,711.00	0.86
C	制造业	42,217,947.33	57.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,393,584.00	3.24
E	建筑业	871,293.00	1.18
F	批发和零售业	1,561,788.00	2.12
G	交通运输、仓储和邮政业	4,225,302.00	5.72
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,612,760.68	8.96
J	金融业	2,954,996.00	4.00
K	房地产业	1,338,144.20	1.81
L	租赁和商务服务业	652,133.00	0.88
M	科学研究和技术服务业	1,371,565.58	1.86
N	水利、环境和公共设施管理业	706,102.00	0.96
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	96,515.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	512,945.00	0.69
S	综合	—	—
	合计	66,482,707.79	90.06

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002456	欧菲光	61,400	735,572.00	1.00
2	002967	广电计量	44,800	734,720.00	1.00
3	600073	光明肉业	91,900	637,786.00	0.86
4	300627	华测导航	13,800	576,840.00	0.78
5	002815	崇达技术	54,500	555,900.00	0.75
6	002851	麦格米特	7,700	473,242.00	0.64

7	601083	锦江航运	49,400	470,288.00	0.64
8	600246	万通发展	62,800	467,860.00	0.63
9	301175	中科环保	85,500	461,700.00	0.63
10	600269	赣粤高速	81,800	458,898.00	0.62
11	000966	长源电力	94,700	449,825.00	0.61
12	600874	创业环保	75,300	449,541.00	0.61
13	002063	远光软件	77,500	446,400.00	0.60
14	600633	浙数文化	42,500	444,550.00	0.60
15	000581	威孚高科	22,200	419,136.00	0.57
16	300088	长信科技	62,800	410,712.00	0.56
17	601333	广深铁路	119,600	410,228.00	0.56
18	002249	大洋电机	69,400	407,378.00	0.55
19	300455	航天智装	31,000	401,760.00	0.54
20	000062	深圳华强	17,900	400,960.00	0.54
21	600330	天通股份	56,300	399,730.00	0.54
22	000848	承德露露	44,400	398,268.00	0.54
23	002023	海特高新	39,200	397,880.00	0.54
24	601860	紫金银行	137,600	392,160.00	0.53
25	600037	歌华有线	52,300	390,158.00	0.53
26	300079	数码视讯	71,800	388,438.00	0.53
27	300735	光弘科技	13,700	383,463.00	0.52
28	600017	日照港	118,500	379,200.00	0.51
29	300185	通裕重工	147,200	378,304.00	0.51
30	600063	皖维高新	94,200	376,800.00	0.51
31	688586	江航装备	38,918	372,445.26	0.50
32	600963	岳阳林纸	72,500	368,300.00	0.50
33	600618	氯碱化工	36,600	360,876.00	0.49
34	002226	江南化工	66,300	359,346.00	0.49
35	600648	外高桥	29,400	350,154.00	0.47
36	600301	华锡有色	20,500	348,705.00	0.47
37	300663	科蓝软件	19,900	345,464.00	0.47
38	688041	海光信息	2,284	342,120.36	0.46
39	601975	招商南油	107,900	337,727.00	0.46
40	601222	林洋能源	47,600	336,532.00	0.46
41	300303	聚飞光电	49,200	335,544.00	0.45
42	300857	协创数据	3,100	331,359.00	0.45
43	600664	哈药股份	79,000	326,270.00	0.44
44	600496	精工钢构	107,300	324,046.00	0.44
45	600667	太极实业	46,800	323,856.00	0.44
46	603609	禾丰股份	37,500	323,250.00	0.44
47	601702	华峰铝业	17,627	322,926.64	0.44

48	603881	数据港	14,202	321,675.30	0.44
49	601375	中原证券	74,400	321,408.00	0.44
50	603300	海南华铁	55,400	320,212.00	0.43
51	688550	瑞联新材	10,213	319,564.77	0.43
52	688141	杰华特	10,384	317,854.24	0.43
53	600438	通威股份	14,000	309,540.00	0.42
54	688321	微芯生物	16,594	308,316.52	0.42
55	603067	振华股份	24,300	306,909.00	0.42
56	688596	正帆科技	8,626	306,654.30	0.42
57	600252	中恒集团	123,400	303,564.00	0.41
58	300525	博思软件	18,700	291,346.00	0.39
59	002489	浙江永强	88,800	287,712.00	0.39
60	300181	佐力药业	18,700	287,232.00	0.39
61	600751	海航科技	109,200	287,196.00	0.39
62	600169	太原重工	115,100	286,599.00	0.39
63	600572	康恩贝	61,200	285,192.00	0.39
64	688352	颀中科技	23,156	280,882.28	0.38
65	002446	盛路通信	42,500	278,375.00	0.38
66	002807	江阴银行	63,900	277,965.00	0.38
67	688046	药康生物	20,954	269,258.90	0.36
68	601619	嘉泽新能	80,800	268,256.00	0.36
69	600064	南京高科	34,460	267,754.20	0.36
70	001380	华纬科技	12,200	267,180.00	0.36
71	300674	宇信科技	13,500	263,520.00	0.36
72	600873	梅花生物	25,800	258,774.00	0.35
73	300263	隆华科技	35,100	256,230.00	0.35
74	600305	恒顺醋业	31,800	253,764.00	0.34
75	000503	国新健康	23,100	253,638.00	0.34
76	300685	艾德生物	11,100	253,080.00	0.34
77	688235	百济神州	1,570	252,801.40	0.34
78	002459	晶澳科技	18,300	251,625.00	0.34
79	002901	大博医疗	8,100	249,804.00	0.34
80	603075	热威股份	13,300	247,779.00	0.34
81	688531	日联科技	5,193	247,342.59	0.34
82	688337	普源精电	6,270	244,530.00	0.33
83	002153	石基信息	34,200	244,188.00	0.33
84	300369	绿盟科技	33,700	242,303.00	0.33
85	600757	长江传媒	25,000	239,250.00	0.32
86	601515	东峰集团	59,500	236,810.00	0.32
87	300573	兴齐眼药	3,320	231,669.60	0.31
88	600595	中孚实业	81,400	230,362.00	0.31

89	002191	劲嘉股份	54,200	227,640.00	0.31
90	603477	巨星农牧	12,800	227,200.00	0.31
91	600649	城投控股	50,600	225,170.00	0.31
92	002626	金达威	14,900	224,990.00	0.30
93	603301	振德医疗	10,100	222,099.00	0.30
94	688639	华恒生物	6,868	221,218.28	0.30
95	300045	华力创通	10,300	215,167.00	0.29
96	002204	大连重工	42,800	213,144.00	0.29
97	600422	昆药集团	13,400	212,390.00	0.29
98	688593	新相微	11,513	210,687.90	0.29
99	600490	鹏欣资源	63,400	208,586.00	0.28
100	600812	华北制药	40,000	206,800.00	0.28
101	002061	浙江交科	50,600	206,448.00	0.28
102	603693	江苏新能	20,800	204,880.00	0.28
103	002881	美格智能	6,700	200,732.00	0.27
104	300855	图南股份	9,000	197,280.00	0.27
105	300679	电连技术	3,300	197,010.00	0.27
106	600732	爱旭股份	17,800	196,156.00	0.27
107	688526	科前生物	13,517	193,157.93	0.26
108	600740	山西焦化	47,600	191,828.00	0.26
109	688981	中芯国际	1,982	187,536.84	0.25
110	301031	中熔电气	1,800	187,236.00	0.25
111	000828	东莞控股	17,400	186,006.00	0.25
112	688313	仕佳光子	11,288	185,010.32	0.25
113	600550	保变电气	23,500	184,475.00	0.25
114	000488	ST晨鸣	59,700	182,085.00	0.25
115	002003	伟星股份	12,800	181,376.00	0.25
116	000429	粤高速A	12,200	179,340.00	0.24
117	601137	博威合金	8,800	178,640.00	0.24
118	002948	青岛银行	45,900	178,092.00	0.24
119	603169	兰石重装	32,400	176,580.00	0.24
120	002267	陕天然气	20,800	175,760.00	0.24
121	002906	华阳集团	5,600	172,200.00	0.23
122	688700	东威科技	5,742	169,159.32	0.23
123	601369	陕鼓动力	19,400	168,780.00	0.23
124	002237	恒邦股份	16,700	168,670.00	0.23
125	002928	华夏航空	21,700	168,392.00	0.23
126	300232	洲明科技	24,200	166,254.00	0.23
127	600420	国药现代	13,900	165,966.00	0.22
128	300346	南大光电	4,300	165,937.00	0.22
129	600428	中远海特	22,700	165,710.00	0.22



130	301155	海力风电	3,100	165,261.00	0.22
131	603995	甬金股份	9,000	164,610.00	0.22
132	300598	诚迈科技	3,400	164,560.00	0.22
133	002837	英维克	4,000	161,600.00	0.22
134	300762	上海瀚讯	7,500	157,725.00	0.21
135	300415	伊之密	7,800	156,468.00	0.21
136	600100	同方股份	22,000	156,420.00	0.21
137	688076	诺泰生物	3,003	155,915.76	0.21
138	301339	通行宝	7,600	154,584.00	0.21
139	002498	汉缆股份	45,400	153,906.00	0.21
140	600961	株冶集团	19,400	152,678.00	0.21
141	002130	沃尔核材	6,000	151,500.00	0.21
142	301180	万祥科技	9,700	150,059.00	0.20
143	002550	千红制药	23,600	146,320.00	0.20
144	002649	博彦科技	12,000	145,440.00	0.20
145	600643	爱建集团	27,600	142,692.00	0.19
146	605589	圣泉集团	6,000	141,480.00	0.19
147	301050	雷电微力	2,700	139,266.00	0.19
148	300476	胜宏科技	3,300	138,897.00	0.19
149	300036	超图软件	8,100	137,538.00	0.19
150	600919	江苏银行	13,800	135,516.00	0.18
151	300119	瑞普生物	7,300	134,101.00	0.18
152	688488	艾迪药业	17,017	133,753.62	0.18
153	688372	伟测科技	2,284	133,659.68	0.18
154	603323	苏农银行	25,000	132,250.00	0.18
155	300705	九典制药	7,300	131,035.00	0.18
156	002668	TCL 智家	9,900	129,888.00	0.18
157	000528	柳工	10,700	129,042.00	0.17
158	002635	安洁科技	8,100	128,952.00	0.17
159	601963	重庆银行	13,800	128,064.00	0.17
160	688658	悦康药业	8,886	128,047.26	0.17
161	601279	英利汽车	33,100	126,773.00	0.17
162	000977	浪潮信息	2,400	124,512.00	0.17
163	300827	上能电气	2,800	122,920.00	0.17
164	002428	云南锗业	6,500	122,850.00	0.17
165	603162	海通发展	13,300	122,360.00	0.17
166	688336	三生国健	5,706	122,222.52	0.17
167	300274	阳光电源	1,600	118,128.00	0.16
168	600033	福建高速	30,400	117,952.00	0.16
169	603612	索通发展	8,600	116,186.00	0.16
170	300737	科顺股份	22,900	116,103.00	0.16

171	603305	旭升集团	8,800	115,720.00	0.16
172	600151	航天机电	14,500	115,710.00	0.16
173	600266	城建发展	22,500	114,750.00	0.16
174	603299	苏盐井神	10,200	113,628.00	0.15
175	688019	安集科技	814	113,439.04	0.15
176	601528	瑞丰银行	20,100	113,163.00	0.15
177	000543	皖能电力	14,300	113,113.00	0.15
178	300113	顺网科技	6,700	112,627.00	0.15
179	600216	浙江医药	7,100	112,606.00	0.15
180	600641	万业企业	7,700	112,574.00	0.15
181	002916	深南电路	900	112,500.00	0.15
182	002651	利君股份	15,300	112,149.00	0.15
183	601311	骆驼股份	13,400	111,086.00	0.15
184	300366	创意信息	11,900	110,670.00	0.15
185	300002	神州泰岳	9,500	110,105.00	0.15
186	300443	金雷股份	5,500	109,560.00	0.15
187	000685	中山公用	11,700	107,991.00	0.15
188	603986	兆易创新	1,000	106,800.00	0.14
189	603678	火炬电子	3,500	106,750.00	0.14
190	002517	恺英网络	7,800	106,158.00	0.14
191	603920	世运电路	3,600	105,840.00	0.14
192	688185	康希诺	1,728	105,494.40	0.14
193	002987	京北方	7,400	105,302.00	0.14
194	603358	华达科技	3,100	103,540.00	0.14
195	002891	中宠股份	2,900	103,530.00	0.14
196	300623	捷捷微电	3,000	102,480.00	0.14
197	688582	芯动联科	2,008	101,022.48	0.14
198	600710	苏美达	10,800	100,440.00	0.14
199	000719	中原传媒	8,800	99,968.00	0.14
200	301327	华宝新能	1,300	99,723.00	0.14
201	000881	中广核技	13,600	99,688.00	0.14
202	688798	艾为电子	1,415	98,795.30	0.13
203	601869	长飞光纤	3,300	98,637.00	0.13
204	688508	芯朋微	2,290	98,401.30	0.13
205	688598	金博股份	4,655	98,034.30	0.13
206	688150	莱特光电	4,318	97,241.36	0.13
207	688388	嘉元科技	6,583	96,967.59	0.13
208	600531	豫光金铅	15,000	96,300.00	0.13
209	002068	黑猫股份	9,000	95,760.00	0.13
210	002567	唐人神	18,700	95,370.00	0.13
211	603337	杰克股份	3,100	94,426.00	0.13

212	688603	天承科技	809	94,248.50	0.13
213	600601	方正科技	21,300	93,507.00	0.13
214	002075	沙钢股份	14,900	93,274.00	0.13
215	002468	申通快递	9,200	93,196.00	0.13
216	300327	中颖电子	3,800	92,986.00	0.13
217	002745	木林森	10,600	92,432.00	0.13
218	600160	巨化股份	3,800	91,656.00	0.12
219	600115	中国东航	22,900	91,600.00	0.12
220	300821	东岳硅材	11,700	90,792.00	0.12
221	300031	宝通科技	4,900	89,768.00	0.12
222	300035	中科电气	6,000	89,700.00	0.12
223	600195	中牧股份	13,200	88,572.00	0.12
224	688443	智翔金泰	3,505	87,940.45	0.12
225	300850	新强联	4,600	87,906.00	0.12
226	601677	明泰铝业	7,300	87,819.00	0.12
227	688091	上海谊众	2,198	87,744.16	0.12
228	300123	亚光科技	15,100	87,580.00	0.12
229	688232	新点软件	2,983	86,477.17	0.12
230	002461	珠江啤酒	8,700	86,043.00	0.12
231	600882	妙可蓝多	4,800	85,920.00	0.12
232	002091	江苏国泰	11,700	85,644.00	0.12
233	002034	旺能环境	5,500	85,250.00	0.12
234	300777	中简科技	3,000	84,870.00	0.11
235	002488	金固股份	8,100	84,564.00	0.11
236	300641	正丹股份	3,400	84,456.00	0.11
237	601163	三角轮胎	5,600	84,392.00	0.11
238	688183	生益电子	2,147	84,291.22	0.11
239	603583	捷昌驱动	3,400	84,014.00	0.11
240	301080	百普赛斯	1,900	83,866.00	0.11
241	300761	立华股份	4,300	83,678.00	0.11
242	300261	雅本化学	12,200	83,570.00	0.11
243	601200	上海环境	10,200	83,334.00	0.11
244	605333	沪光股份	2,500	81,575.00	0.11
245	300773	拉卡拉	4,600	81,420.00	0.11
246	600850	电科数字	3,400	81,260.00	0.11
247	688128	中国电研	3,851	80,909.51	0.11
248	688608	恒玄科技	248	80,691.76	0.11
249	601838	成都银行	4,700	80,417.00	0.11
250	603005	晶方科技	2,800	79,100.00	0.11
251	688381	帝奥微	4,044	77,968.32	0.11
252	002222	福晶科技	2,400	77,760.00	0.11

253	600548	深高速	5,700	76,836.00	0.10
254	000422	湖北宜化	6,000	75,720.00	0.10
255	300027	华谊兄弟	28,900	75,718.00	0.10
256	600986	浙文互联	12,600	75,348.00	0.10
257	002597	金禾实业	3,300	75,339.00	0.10
258	002544	普天科技	3,500	75,005.00	0.10
259	601288	农业银行	14,000	74,760.00	0.10
260	601398	工商银行	10,800	74,736.00	0.10
261	688408	中信博	1,037	74,664.00	0.10
262	300618	寒锐钴业	2,200	74,294.00	0.10
263	301090	华润材料	10,700	74,258.00	0.10
264	601988	中国银行	13,400	73,834.00	0.10
265	000582	北部湾港	9,300	73,284.00	0.10
266	601169	北京银行	11,900	73,185.00	0.10
267	688362	甬矽电子	2,169	73,051.92	0.10
268	601328	交通银行	9,400	73,038.00	0.10
269	000725	京东方A	16,600	72,874.00	0.10
270	002284	亚太股份	9,400	72,756.00	0.10
271	601818	光大银行	18,800	72,756.00	0.10
272	300143	盈康生命	7,900	72,680.00	0.10
273	600248	陕建股份	16,200	72,576.00	0.10
274	688088	虹软科技	1,880	72,492.80	0.10
275	601009	南京银行	6,800	72,420.00	0.10
276	600908	无锡银行	12,200	72,102.00	0.10
277	002233	塔牌集团	9,400	72,098.00	0.10
278	002839	张家港行	16,400	71,668.00	0.10
279	601187	厦门银行	12,700	71,628.00	0.10
280	600717	天津港	14,500	70,615.00	0.10
281	600125	铁龙物流	11,900	70,567.00	0.10
282	600929	雪天盐业	12,600	70,434.00	0.10
283	000089	深圳机场	10,200	70,278.00	0.10
284	601816	京沪高铁	11,400	70,224.00	0.10
285	000088	盐田港	14,400	70,128.00	0.09
286	601006	大秦铁路	10,300	69,834.00	0.09
287	601326	秦港股份	20,800	69,680.00	0.09
288	001213	中铁特货	16,700	69,639.00	0.09
289	600020	中原高速	16,500	69,630.00	0.09
290	600810	神马股份	8,600	69,574.00	0.09
291	600502	安徽建工	14,500	69,310.00	0.09
292	000012	南玻A	13,100	69,168.00	0.09
293	000968	蓝焰控股	10,400	69,160.00	0.09

294	002274	华昌化工	8,900	69,153.00	0.09
295	601107	四川成渝	13,200	69,036.00	0.09
296	600461	洪城环境	6,900	68,655.00	0.09
297	600116	三峡水利	9,800	68,502.00	0.09
298	002004	华邦健康	15,100	68,252.00	0.09
299	000030	富奥股份	13,300	68,229.00	0.09
300	600821	金开新能	12,600	68,040.00	0.09
301	301358	湖南裕能	1,500	67,980.00	0.09
302	688127	蓝特光学	2,506	67,912.60	0.09
303	601939	建设银行	7,700	67,683.00	0.09
304	600409	三友化工	12,500	67,500.00	0.09
305	601886	江河集团	12,500	67,500.00	0.09
306	603218	日月股份	5,600	67,480.00	0.09
307	300130	新国都	3,100	67,146.00	0.09
308	001287	中电港	3,300	67,023.00	0.09
309	002139	拓邦股份	4,900	66,689.00	0.09
310	002483	润邦股份	12,800	66,688.00	0.09
311	603565	中谷物流	6,800	66,640.00	0.09
312	600328	中盐化工	8,400	66,108.00	0.09
313	600138	中青旅	6,500	65,910.00	0.09
314	603281	江瀚新材	2,700	65,880.00	0.09
315	300416	苏试试验	5,600	65,856.00	0.09
316	300475	香农芯创	2,300	65,527.00	0.09
317	603496	恒为科技	2,400	65,232.00	0.09
318	688766	普冉股份	640	64,806.40	0.09
319	601678	滨化股份	17,200	64,672.00	0.09
320	002563	森马服饰	9,200	64,584.00	0.09
321	300527	中船应急	8,000	64,560.00	0.09
322	688498	源杰科技	481	64,550.20	0.09
323	605358	立昂微	2,600	64,402.00	0.09
324	603055	台华新材	5,800	64,264.00	0.09
325	000927	中国铁物	24,400	64,172.00	0.09
326	600059	古越龙山	7,200	63,936.00	0.09
327	002053	云南能投	5,600	63,840.00	0.09
328	000019	深粮控股	9,700	63,729.00	0.09
329	000901	航天科技	5,800	63,626.00	0.09
330	600651	飞乐音响	15,300	63,342.00	0.09
331	600388	龙净环保	5,000	63,250.00	0.09
332	603551	奥普科技	5,900	63,012.00	0.09
333	002405	四维图新	6,500	62,660.00	0.08
334	000690	宝新能源	13,800	61,824.00	0.08

335	001301	尚太科技	900	61,695.00	0.08
336	300409	道氏技术	4,500	61,245.00	0.08
337	603025	大豪科技	4,000	61,000.00	0.08
338	601615	明阳智能	4,800	60,528.00	0.08
339	300590	移为通信	3,900	60,294.00	0.08
340	000426	兴业银锡	5,400	60,048.00	0.08
341	002190	成飞集成	3,100	59,954.00	0.08
342	002706	良信股份	7,800	59,904.00	0.08
343	601658	邮储银行	10,500	59,640.00	0.08
344	000034	神州数码	1,700	59,585.00	0.08
345	002194	武汉凡谷	5,300	59,466.00	0.08
346	300790	宇瞳光学	3,100	59,179.00	0.08
347	600361	创新新材	15,300	59,058.00	0.08
348	601096	宏盛华源	13,500	58,725.00	0.08
349	600236	桂冠电力	8,600	58,480.00	0.08
350	601231	环旭电子	3,500	57,750.00	0.08
351	603379	三美股份	1,500	57,570.00	0.08
352	688123	聚辰股份	974	56,998.48	0.08
353	600114	东睦股份	3,500	56,595.00	0.08
354	600900	长江电力	1,900	56,145.00	0.08
355	688018	乐鑫科技	256	55,808.00	0.08
356	688208	道通科技	1,417	55,489.72	0.08
357	600399	抚顺特钢	9,500	55,100.00	0.07
358	605376	博迁新材	1,900	55,005.00	0.07
359	300888	稳健医疗	1,300	54,704.00	0.07
360	000029	深深房A	3,600	54,216.00	0.07
361	002895	川恒股份	2,200	54,120.00	0.07
362	600456	宝钛股份	1,900	54,055.00	0.07
363	601127	赛力斯	400	53,356.00	0.07
364	000758	中色股份	10,800	53,352.00	0.07
365	300750	宁德时代	200	53,200.00	0.07
366	300593	新雷能	4,700	52,640.00	0.07
367	600894	广日股份	3,600	52,560.00	0.07
368	688522	纳睿雷达	931	52,452.54	0.07
369	601811	新华文轩	3,300	52,305.00	0.07
370	688299	长阳科技	3,550	52,185.00	0.07
371	688378	奥来德	2,265	51,664.65	0.07
372	688559	海目星	1,492	51,324.80	0.07
373	002245	蔚蓝锂芯	4,800	51,312.00	0.07
374	300075	数字政通	2,900	50,170.00	0.07
375	002847	盐津铺子	800	50,080.00	0.07

376	000676	智度股份	5,900	49,914.00	0.07
377	601718	际华集团	17,400	49,416.00	0.07
378	300596	利安隆	1,600	48,800.00	0.07
379	002097	山河智能	6,500	48,750.00	0.07
380	000090	天健集团	11,800	48,498.00	0.07
381	603132	金徽股份	4,300	48,289.00	0.07
382	600563	法拉电子	400	47,568.00	0.06
383	600662	外服控股	9,200	46,644.00	0.06
384	300458	全志科技	1,200	46,512.00	0.06
385	300638	广和通	2,300	46,345.00	0.06
386	300413	芒果超媒	1,700	45,713.00	0.06
387	601921	浙版传媒	5,800	45,704.00	0.06
388	003006	百亚股份	1,900	45,581.00	0.06
389	000035	中国天楹	9,300	45,291.00	0.06
390	605128	上海沿浦	1,200	44,340.00	0.06
391	600602	云赛智联	2,800	44,296.00	0.06
392	603173	福斯达	1,900	43,795.00	0.06
393	002938	鹏鼎控股	1,200	43,776.00	0.06
394	688270	臻镭科技	1,247	43,645.00	0.06
395	600019	宝钢股份	6,200	43,400.00	0.06
396	300453	三鑫医疗	5,800	43,268.00	0.06
397	300811	铂科新材	800	43,128.00	0.06
398	002438	江苏神通	3,500	42,700.00	0.06
399	000680	山推股份	4,400	42,680.00	0.06
400	002151	北斗星通	1,600	42,464.00	0.06
401	603308	应流股份	3,000	42,300.00	0.06
402	688380	中微半导	1,413	42,248.70	0.06
403	300457	赢合科技	2,200	42,108.00	0.06
404	600389	江山股份	2,900	41,905.00	0.06
405	601022	宁波远洋	5,200	41,756.00	0.06
406	600185	格力地产	5,800	41,702.00	0.06
407	600267	海正药业	5,000	41,500.00	0.06
408	600480	凌云股份	3,800	41,078.00	0.06
409	688326	经纬恒润	485	40,788.50	0.06
410	300284	苏交科	4,000	40,600.00	0.05
411	300770	新媒股份	1,000	40,410.00	0.05
412	601519	大智慧	4,300	39,775.00	0.05
413	002239	奥特佳	13,000	39,650.00	0.05
414	688009	中国通号	6,325	39,594.50	0.05
415	688552	航天南湖	2,357	39,361.90	0.05
416	688383	新益昌	875	39,261.25	0.05

417	002145	中核钛白	9,100	38,584.00	0.05
418	000885	城发环境	2,900	38,019.00	0.05
419	688484	南芯科技	1,052	37,914.08	0.05
420	300083	创世纪	5,800	37,758.00	0.05
421	688556	高测股份	3,377	37,754.86	0.05
422	300726	宏达电子	1,200	37,320.00	0.05
423	002088	鲁阳节能	2,900	37,091.00	0.05
424	600350	山东高速	3,600	37,008.00	0.05
425	688523	航天环宇	1,846	36,920.00	0.05
426	300655	晶瑞电材	3,900	36,504.00	0.05
427	002966	苏州银行	4,500	36,495.00	0.05
428	002421	达实智能	10,600	36,358.00	0.05
429	601500	通用股份	6,800	36,244.00	0.05
430	688390	固德威	886	36,237.40	0.05
431	688252	天德钰	1,504	36,020.80	0.05
432	300352	北信源	6,800	35,904.00	0.05
433	300926	博俊科技	1,600	35,216.00	0.05
434	001389	广合科技	700	35,210.00	0.05
435	300918	南山智尚	3,400	35,054.00	0.05
436	600577	精达股份	4,700	34,263.00	0.05
437	000597	东北制药	6,500	34,255.00	0.05
438	600163	中闽能源	5,600	34,104.00	0.05
439	002707	众信旅游	4,600	33,994.00	0.05
440	002389	航天彩虹	1,800	32,490.00	0.04
441	688192	迪哲医药	774	32,097.78	0.04
442	601069	西部黄金	2,800	32,060.00	0.04
443	600452	涪陵电力	3,000	31,770.00	0.04
444	600210	紫江企业	4,800	31,728.00	0.04
445	300724	捷佳伟创	500	31,605.00	0.04
446	688279	峰昭科技	200	31,540.00	0.04
447	601577	长沙银行	3,500	31,115.00	0.04
448	601728	中国电信	4,300	31,046.00	0.04
449	603699	纽威股份	1,400	31,038.00	0.04
450	002726	龙大美食	3,900	30,888.00	0.04
451	002368	太极股份	1,300	30,784.00	0.04
452	600323	瀚蓝环境	1,300	30,706.00	0.04
453	000415	渤海租赁	8,100	30,537.00	0.04
454	002123	梦网科技	2,802	30,289.62	0.04
455	603383	顶点软件	800	30,000.00	0.04
456	688503	聚和材料	664	29,408.56	0.04
457	603267	鸿远电子	800	28,984.00	0.04



458	688066	航天宏图	1,419	28,947.60	0.04
459	300151	昌红科技	1,700	28,900.00	0.04
460	603638	艾迪精密	1,700	28,713.00	0.04
461	301376	致欧科技	1,500	28,680.00	0.04
462	000810	创维数字	1,800	28,656.00	0.04
463	002970	锐明技术	600	28,578.00	0.04
464	605090	九丰能源	1,000	28,530.00	0.04
465	000100	TCL 科技	5,600	28,168.00	0.04
466	300134	大富科技	2,400	28,152.00	0.04
467	002215	诺 普 信	2,500	28,075.00	0.04
468	600171	上海贝岭	700	27,776.00	0.04
469	688776	国光电气	586	27,735.38	0.04
470	601952	苏垦农发	2,800	27,412.00	0.04
471	603236	移远通信	400	27,376.00	0.04
472	688368	晶丰明源	307	27,323.00	0.04
473	600623	华谊集团	3,900	27,300.00	0.04
474	300026	红日药业	7,200	27,288.00	0.04
475	605111	新洁能	800	27,128.00	0.04
476	603018	华设集团	3,300	27,093.00	0.04
477	688016	心脉医疗	243	26,693.55	0.04
478	002558	巨人网络	2,100	26,649.00	0.04
479	000032	深桑达A	1,500	26,460.00	0.04
480	000888	峨眉山A	2,000	26,460.00	0.04
481	688348	昱能科技	538	26,254.40	0.04
482	600552	凯盛科技	2,300	26,243.00	0.04
483	301078	孩子王	2,300	26,174.00	0.04
484	001309	德明利	300	26,160.00	0.04
485	603885	吉祥航空	1,900	26,030.00	0.04
486	600446	金证股份	1,500	25,860.00	0.04
487	002036	联创电子	2,700	25,380.00	0.03
488	002014	永新股份	2,300	25,208.00	0.03
489	300579	数字认证	800	25,136.00	0.03
490	001236	弘业期货	2,600	25,064.00	0.03
491	301332	德尔玛	2,500	25,050.00	0.03
492	603529	爱玛科技	600	24,612.00	0.03
493	603138	海量数据	1,700	24,429.00	0.03
494	688333	铂力特	608	23,973.44	0.03
495	002212	天融信	3,700	23,865.00	0.03
496	300244	迪安诊断	2,100	23,835.00	0.03
497	600869	远东股份	5,000	23,750.00	0.03
498	000420	吉林化纤	6,500	23,465.00	0.03

499	000550	江铃汽车	1,000	23,450.00	0.03
500	603871	嘉友国际	1,200	23,220.00	0.03
501	688025	杰普特	487	23,132.50	0.03
502	300408	三环集团	600	23,106.00	0.03
503	688037	芯源微	276	23,081.88	0.03
504	002911	佛燃能源	1,800	22,752.00	0.03
505	300677	英科医疗	900	22,752.00	0.03
506	605305	中际联合	800	22,664.00	0.03
507	688568	中科星图	441	22,504.23	0.03
508	603317	天味食品	1,600	21,344.00	0.03
509	601998	中信银行	3,000	20,940.00	0.03
510	002281	光迅科技	400	20,868.00	0.03
511	000736	中交地产	2,400	20,640.00	0.03
512	601827	三峰环境	2,400	20,592.00	0.03
513	300058	蓝色光标	2,200	20,416.00	0.03
514	688789	宏华数科	304	20,179.52	0.03
515	688005	容百科技	638	20,128.90	0.03
516	002170	芭田股份	2,300	20,079.00	0.03
517	600522	中天科技	1,400	20,048.00	0.03
518	300687	赛意信息	1,100	20,020.00	0.03
519	688212	澳华内镜	497	19,969.46	0.03
520	000997	新大陆	1,000	19,950.00	0.03
521	600888	新疆众和	2,800	19,880.00	0.03
522	601068	中铝国际	4,500	19,845.00	0.03
523	688031	星环科技	428	19,743.64	0.03
524	603328	依顿电子	2,000	19,720.00	0.03
525	300779	惠城环保	200	19,520.00	0.03
526	688166	博瑞医药	642	19,388.40	0.03
527	688403	汇成股份	2,155	19,308.80	0.03
528	002043	兔宝宝	1,600	19,008.00	0.03
529	688687	凯因科技	879	18,968.82	0.03
530	300459	汤姆猫	3,300	18,942.00	0.03
531	688281	华秦科技	200	18,620.00	0.03
532	600016	民生银行	4,400	18,172.00	0.02
533	002585	双星新材	3,400	18,156.00	0.02
534	688472	阿特斯	1,432	17,985.92	0.02
535	301217	铜冠铜箔	1,600	17,728.00	0.02
536	002615	哈尔斯	2,200	17,490.00	0.02
537	600183	生益科技	700	16,835.00	0.02
538	002568	百润股份	600	16,806.00	0.02
539	688432	有研硅	1,472	16,633.60	0.02

540	603259	药明康德	300	16,512.00	0.02
541	600675	中华企业	5,800	16,298.00	0.02
542	000990	诚志股份	2,100	16,275.00	0.02
543	688303	大全能源	672	16,222.08	0.02
544	603105	芯能科技	1,800	16,218.00	0.02
545	600006	东风股份	2,200	16,214.00	0.02
546	002922	伊戈尔	900	16,038.00	0.02
547	688080	映翰通	487	16,032.04	0.02
548	603306	华懋科技	500	15,805.00	0.02
549	300979	华利集团	200	15,730.00	0.02
550	300973	立高食品	400	15,612.00	0.02
551	002658	雪迪龙	2,400	15,360.00	0.02
552	301559	中集环科	1,000	15,350.00	0.02
553	301377	鼎泰高科	700	14,805.00	0.02
554	600507	方大特钢	3,600	14,580.00	0.02
555	000970	中科三环	1,400	14,518.00	0.02
556	300738	奥飞数据	1,000	14,500.00	0.02
557	000829	天音控股	1,100	14,498.00	0.02
558	300996	普联软件	800	14,496.00	0.02
559	002913	奥士康	600	14,466.00	0.02
560	002624	完美世界	1,400	14,462.00	0.02
561	688668	鼎通科技	307	14,386.02	0.02
562	002961	瑞达期货	1,000	14,370.00	0.02
563	300109	新开源	900	14,355.00	0.02
564	300253	卫宁健康	2,000	14,320.00	0.02
565	000498	山东路桥	2,400	14,280.00	0.02
566	002096	易普力	1,200	14,256.00	0.02
567	002985	北摩高科	600	14,100.00	0.02
568	000404	长虹华意	1,900	14,060.00	0.02
569	002073	软控股份	1,700	14,042.00	0.02
570	300034	钢研高纳	900	14,040.00	0.02
571	603283	赛腾股份	200	13,832.00	0.02
572	603398	沐邦高科	600	13,806.00	0.02
573	600166	福田汽车	5,500	13,805.00	0.02
574	000875	吉电股份	2,600	13,676.00	0.02
575	600176	中国巨石	1,200	13,668.00	0.02
576	300039	上海凯宝	2,200	13,596.00	0.02
577	300576	容大感光	300	13,554.00	0.02
578	301188	力诺药包	900	13,518.00	0.02
579	300693	盛弘股份	500	13,480.00	0.02
580	300684	中石科技	600	13,458.00	0.02

581	600028	中国石化	2,000	13,360.00	0.02
582	002452	长高电新	1,800	13,356.00	0.02
583	300672	国科微	200	13,350.00	0.02
584	002761	浙江建投	1,500	13,170.00	0.02
585	301363	美好医疗	400	12,968.00	0.02
586	600866	星湖科技	2,000	12,940.00	0.02
587	002154	报喜鸟	2,900	12,789.00	0.02
588	603566	普莱柯	1,000	12,760.00	0.02
589	300776	帝尔激光	200	12,716.00	0.02
590	300080	易成新能	2,900	12,673.00	0.02
591	301367	怡和嘉业	200	12,600.00	0.02
592	300869	康泰医学	900	12,546.00	0.02
593	002315	焦点科技	300	12,504.00	0.02
594	688007	光峰科技	842	12,453.18	0.02
595	002859	洁美科技	600	12,450.00	0.02
596	688107	安路科技	419	12,394.02	0.02
597	603530	神马电力	500	12,355.00	0.02
598	002387	维信诺	1,200	12,336.00	0.02
599	603171	税友股份	400	12,200.00	0.02
600	600338	西藏珠峰	1,100	11,737.00	0.02
601	001283	豪鹏科技	200	11,578.00	0.02
602	001270	铖昌科技	300	11,430.00	0.02
603	688518	联赢激光	718	11,373.12	0.02
604	301511	德福科技	900	11,304.00	0.02
605	600143	金发科技	1,300	11,232.00	0.02
606	300900	广联航空	500	11,000.00	0.01
607	688507	索辰科技	200	10,940.00	0.01
608	300841	康华生物	200	10,904.00	0.01
609	600153	建发股份	1,000	10,520.00	0.01
610	002777	久远银海	600	10,332.00	0.01
611	688409	富创精密	200	10,314.00	0.01
612	600352	浙江龙盛	1,000	10,290.00	0.01
613	600098	广州发展	1,600	10,272.00	0.01
614	000998	隆平高科	900	10,053.00	0.01
615	688772	珠海冠宇	625	10,050.00	0.01
616	600110	诺德股份	2,500	10,000.00	0.01
617	605056	咸亨国际	800	9,992.00	0.01
618	000735	罗牛山	1,500	9,990.00	0.01
619	688322	奥比中光	214	9,951.00	0.01
620	688062	迈威生物	492	9,938.40	0.01
621	600621	华鑫股份	600	9,888.00	0.01

622	603517	绝味食品	600	9,864.00	0.01
623	002326	永太科技	1,100	9,834.00	0.01
624	000061	农产品	1,400	9,814.00	0.01
625	002537	海联金汇	1,700	9,775.00	0.01
626	300188	国投智能	700	9,653.00	0.01
627	688599	天合光能	499	9,630.70	0.01
628	300304	云意电气	1,200	9,600.00	0.01
629	300747	锐科激光	500	9,580.00	0.01
630	600640	国脉文化	800	9,552.00	0.01
631	002163	海南发展	1,000	9,350.00	0.01
632	600657	信达地产	2,200	9,152.00	0.01
633	688711	宏微科技	491	8,484.48	0.01
634	000517	荣安地产	3,600	8,028.00	0.01
635	603296	华勤技术	100	7,095.00	0.01
636	300772	运达股份	500	6,620.00	0.01
637	603985	恒润股份	500	5,840.00	0.01
638	002206	海利得	1,200	5,148.00	0.01
639	000766	通化金马	200	3,140.00	0.00
640	002241	歌尔股份	100	2,581.00	0.00
641	600827	百联股份	200	2,186.00	0.00
642	688108	赛诺医疗	200	1,952.00	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	002456	欧菲光	3,894,710.00	2.33
2	603985	恒润股份	3,037,336.00	1.82
3	002085	万丰奥威	2,905,970.00	1.74
4	000725	京东方 A	2,394,825.00	1.43
5	002130	沃尔核材	2,211,677.00	1.32
6	603019	中科曙光	2,132,968.00	1.28
7	002139	拓邦股份	2,091,663.00	1.25
8	002249	大洋电机	1,949,156.00	1.17
9	300303	聚飞光电	1,922,264.00	1.15
10	601222	林洋能源	1,906,950.00	1.14
11	300573	兴齐眼药	1,792,938.60	1.07
12	300379	东方通	1,760,015.00	1.05
13	000719	中原传媒	1,747,304.00	1.04
14	300182	捷成股份	1,731,698.00	1.04

15	002405	四维图新	1,711,617.00	1.02
16	002498	汉缆股份	1,684,251.00	1.01
17	000685	中山公用	1,659,496.00	0.99
18	000034	神州数码	1,648,540.08	0.99
19	002550	千红制药	1,641,626.00	0.98
20	600064	南京高科	1,628,933.60	0.97

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	002130	沃尔核材	5,423,577.00	3.24
2	002456	欧菲光	4,816,670.00	2.88
3	603985	恒润股份	3,596,573.00	2.15
4	001696	宗申动力	3,367,449.07	2.01
5	000100	TCL 科技	3,255,542.00	1.95
6	601101	昊华能源	3,169,260.00	1.90
7	002467	二六三	3,059,354.00	1.83
8	002085	万丰奥威	3,043,319.00	1.82
9	601328	交通银行	2,924,283.00	1.75
10	000725	京东方 A	2,853,169.00	1.71
11	000650	仁和药业	2,847,736.00	1.70
12	300303	聚飞光电	2,774,208.00	1.66
13	603328	依顿电子	2,747,260.00	1.64
14	000969	安泰科技	2,708,399.00	1.62
15	002003	伟星股份	2,689,689.00	1.61
16	600618	氯碱化工	2,684,493.00	1.61
17	600997	开滦股份	2,457,553.00	1.47
18	300079	数码视讯	2,436,326.00	1.46
19	300887	谱尼测试	2,410,970.00	1.44
20	002091	江苏国泰	2,395,149.00	1.43

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	630,923,971.08
卖出股票收入（成交）总额	713,779,825.31

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交

---

金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### **8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### **8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

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

### **8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

#### **8.11.1 本期国债期货投资政策**

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

#### **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	—
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	3,002,422.65
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,002,422.65

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国中证1000 优选股票 A	1,074	64,386.73	1,261,839.64	1.82	67,889,511.20	98.18
富国中证	238	21,043.44	—	—	5,008,338.46	100.00



1000 优选股票 C						
合计	1,312	56,524.15	1,261,839.64	1.70	72,897,849.66	98.30

## 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	富国中证 1000 优选股票 A	249,586.68	0.3609
	富国中证 1000 优选股票 C	4,679.22	0.0934
	合计	254,265.90	0.3429

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	富国中证 1000 优选股票 A	10~50
	富国中证 1000 优选股票 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	富国中证 1000 优选股票 A	10~50
	富国中证 1000 优选股票 C	0
	合计	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	富国中证 1000 优选股票 A	富国中证 1000 优选股票 C
基金合同生效日(2022 年 11 月 22 日)基金份额总额	203,845,284.65	11,470,791.29
报告期期初基金份额总额	152,119,103.61	19,296,168.04
本报告期基金总申购份额	34,382,869.07	22,505,475.16
减：本报告期基金总赎回份额	117,350,621.84	36,793,304.74
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	69,151,350.84	5,008,338.46

## § 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德勤华永会计师事务所（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 3 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	公司已完成整改。

提出整改意见)	
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（%）	
东方证券	3	1,344,452,946.10	100.00	438,314.94	100.00	—

注：1、我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

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（%）
东方证券	45,410.18	100.00	—	—	—	—

### 11.8 其他重大事件

注：本基金本报告期内无需要披露的其他重大事件。

## § 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

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

## § 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 1000 优选股票型证券投资基金的文件 2、富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金合同 3、富国中证 1000 优选股票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、富国中证 1000 优选股票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： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。