

# 富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）

## 二〇二一年年度报告

2021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：招商银行股份有限公司

送出日期：2022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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5	信息披露方式.....	6
2.6	其他相关资料.....	6
§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.....	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理.....	9
4.2	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	12
4.3	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	14
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.7	管理人内部有关本基金的监察稽核报告.....	15
4.8	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.9	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.10	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.....	17
§5	托管人报告.....	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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 17	
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.....	17
§6	审计报告.....	18
6.1	审计报告基本信息.....	18
6.2	审计报告的基本内容.....	18
§7	年度财务报表.....	20
7.1	资产负债表.....	20
7.2	利润表.....	22
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4	报表附注.....	24
§8	投资组合报告.....	55
8.1	期末基金资产组合情况.....	55
8.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	56
8.3	期末按行业分类的权益投资组合.....	56

8.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细 .....	56
8.5	报告期内权益投资组合的重大变动 .....	72
8.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	82
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	82
8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	82
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	82
8.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	83
8.11	投资组合报告附注 .....	83
§9	基金份额持有人信息 .....	83
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	83
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	84
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 .....	84
§10	开放式基金份额变动 .....	84
§11	重大事件揭示 .....	84
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	84
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 .....	84
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	85
11.4	基金投资策略的改变 .....	85
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	85
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 .....	85
11.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	86
11.8	其他重大事件 .....	89
§12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	91
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 .....	91
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	91
§13	备查文件目录 .....	91

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）
基金简称	富国蓝筹精选股票（QDII）
基金主代码	007455
交易代码	007455
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年08月02日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,072,336,972.94份
基金合同存续期	不定期

注：本基金含人民币份额(份额代码:007455)及美元现汇份额(份额代码:010583)，交易代码仅列示人民币份额代码。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于以 MSCI 中国指数为代表的中国相关蓝筹股，通过精选个股和严格风险控制，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金投资于全球市场，包括境内和境外市场。本基金通过宏观策略研究，对股票、债券、货币市场工具等的预期收益进行动态跟踪，从而决定全球资产配置比例。本基金主要投资于以 MSCI 中国指数为代表的中国相关蓝筹股，上市地点包括美国、香港、台湾、新加坡、欧洲和日本等国家或地区，通过自下而上的积极策略，精选个股。本基金的存托凭证投资策略、债券投资策略、基金投资策略、衍生品投资策略、汇率避险投资策略、中小企业私募债券投资策略和资产支持证券投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	MSCI 中国指数收益率*90%+人民币活期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金，债券型基金和货币市场基金。本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金可通过港股通机制投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	富国基金管理有限公司	招商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	赵瑛	张燕
	联系电话	021-20361818	0755-83199084
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95555
传真		021-20361616	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		裴长江	缪建民

#### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	The Hong Kong and Shanghai Banking Corporation Limited
	中文	-	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		-	-
办公地址		-	-
邮政编码		-	-

#### 2.5 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 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道7088号招商银行大厦

#### 2.6 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)	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-37,545,660.27	160,213,921.42	17,954,035.05
本期利润	-298,406,358.62	350,256,815.40	34,036,785.09
加权平均基金份额本期利润	-0.2549	1.1133	0.1735
本期加权平均净值利润率	-10.62%	59.22%	15.97%
本期基金份额净值增长率	-4.60%	95.41%	17.58%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	685,771,942.96	424,995,425.57	17,495,485.41
期末可供分配基金份额利润	0.6395	0.6621	0.1185
期末基金资产净值	2,350,296,018.89	1,474,927,546.30	173,614,943.46
期末基金份额净值	2.1918	2.2976	1.1758
3.1.3 累计期末指标	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	119.18%	129.76%	17.58%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

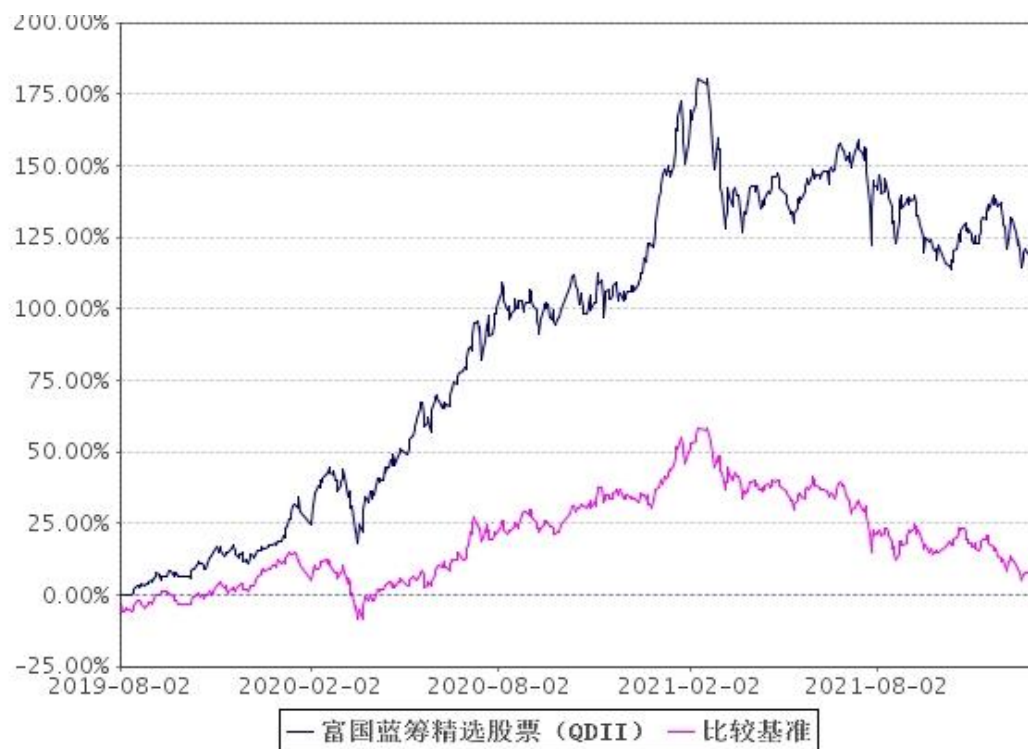
期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.25%	1.25%	-5.48%	1.14%	4.23%	0.11%
过去六个月	-14.27%	1.58%	-21.40%	1.47%	7.13%	0.11%
过去一年	-4.60%	1.62%	-20.53%	1.41%	15.93%	0.21%
自基金合同生效起至今	119.18%	1.60%	8.71%	1.35%	110.47%	0.25%

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



注：1、截止日期为2021年12月31日。

2、本基金于2019年8月2日成立，建仓期6个月，从2019年8月2日起至2020年2月1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



注：2019 年按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金 2019 年 8 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 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

#### 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国际信托股份有限公司。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 2021 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、富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、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 243 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）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		
宁君	本基金基金经理	2019-08-21	—	10.4	硕士，自 2011 年 8 月加入富国基金管理有限公司，历任助理研究员、研究员、基金经理助理、QDII 投资经理、QDII 基金经理、海外权益投资部海外权益投资总监助理；现任富国基金海外权益投资部海外权益投资副总监兼高级 QDII 基金经理。自 2018 年 9 月起任富国沪港深业绩驱动混合型证券投资基金基金经理，2019 年 8 月起任富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）基金经理，2020 年 1 月起任富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）（原富国全球

					<p>顶级消费品股票型证券投资基金，于2015年8月4日更名为富国全球顶级消费品混合型证券投资基金；最终于2018年6月19日更名为富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）基金经理，2020年12月起任富国全球健康生活主题混合型证券投资基金（QDII）基金经理。具有基金从业资格。</p>
张峰	本基金基金经理	2019-08-02	—	20.2	<p>硕士，曾任摩根士丹利股票研究助理，里昂证券分析员，摩根大通执行董事，美林证券执行董事；自2009年7月加入富国基金管理有限公司，历任周期行业负责人、QDII基金经理、量化与海外投资部海外投资副总监、量化与海外投资部海外投资总监；现任富国基金总经理助理，兼任富国基金海外权益投资部总经理、资深QDII基金经理。2011年4月至2012年12月任富国全球债券证券投资基金基金经理，自2011年7月至2018年12月任富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）（原富国全球顶级消费品股票型证券投资基金，于2015年8月4日更名为富国全球顶级消费品混合型证券投资基金；最终于2018年6月19日更名为富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII））基金经理，自2012年9月起任富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金（原富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金，于2015年8月4日更名）基金经理，自2015年6月至2018年7月任富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年5月至2020年6月任富国港股通量化精选股票型证券投资基金基金经理，2018年7月至2019年11月任富国沪港深业绩驱动混合型证券投资基金基金经理，2019年3月至2020</p>

					<p>年6月任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年5月起任富国民裕进取沪港深成长精选混合型证券投资基金基金经理，2019年6月起任富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）（原富国全球顶级消费品股票型证券投资基金，于2015年8月4日更名为富国全球顶级消费品混合型证券投资基金；最终于2018年6月19日更名为富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII））基金经理，2019年8月起任富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）基金经理，2020年12月起任富国全球健康生活主题混合型证券投资基金（QDII）基金经理，2021年3月起任富国沪港深业绩驱动混合型证券投资基金基金经理，2021年7月起任富国全球消费精选混合型证券投资基金（QDII）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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）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》、《富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）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。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 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。

### 4.4.2 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。

#### **4.4.3 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 1 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。

### **4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

#### **4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

本基金以投资成长空间大、竞争壁垒强的优质成长股为主要投资策略。在行业上分散均衡，消费、互联网、医疗、科技、新能源和高端制造都是本基金的重点投资行业。

2021 年开始到 2 月中旬，市场延续了 2020 年的乐观气氛，快速上涨；随着股票短期市值急速扩张和美国十年期国债利率上升，全球股票市场冲顶回落。4 月份开始美国十年国债利率企稳回落，成长股出现分化，医药、电动车、光伏、军工、半导体都出现了阶段性的上涨行情。

2021 年的港股市场比 A 股表现更差，主要是因为港股的核心板块互联网遇到的监管风险，从反垄断和未成年人保护出发的监管政策降低了这些超级平台的利润增速和远期空间，引起资金大幅流出这个互联网和整个港股。而其他一些行业，如教育、医疗、博彩、地产也都遭遇了压力不小的政策和基本面风险。

年初基金规模迅速增大，和一季度市场的大幅波动曾经给组合管理带来了很大的挑战。通过行业和个股选择，基金最后录得明显超过基准的全年表现。本基金完全规避了某些行业（如教育和博彩）的政策风险；在互联网等行业较为提前地降低了仓位，遭受了小幅损失；在消费和新能源行业获得了正收益；在公共事业行业的大幅波动中录得损失。

#### **4.5.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 2.1918 元；份额累计净值为

2.1918 元；本报告期，本基金份额净值增长率为-4.60%，同期业绩比较基准收益率为-20.53%

#### **4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

经过 2020 年的大放水市场普涨行情和 2021 年的资金向少数优秀赛道集中后，整体市场的估值仍然不算便宜。由于美国 CPI 位于高位和美联储的鹰派政策，全球的流动性环境不太乐观。好在中国已经通过提前收缩流动性为后面的放松留出了政策空间，国内的流动性环境对股市有所支撑。预计 2022 年市场波动会比较大，个股的分化也会不小。乐观的方面是，中国具有完整的产业结构，在很多领域依然有很大的国产替代和集中度提升空间，自身成长性好的优质公司一定会穿越宏观和流动性的周期，中国股票市场长期来看依然具备良好的投资价值。

#### **4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核报告**

本基金管理人始终将加强内部控制，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金持有人利益作为己任。在监察稽核基础性工作基础上，2021 年本基金管理人着重开展了如下与监察稽核有关的工作：

##### **（一）持续推动公司制度建设，优化内部控制体系**

制度建设是内部控制的起点，2021 年公司在统筹兼顾监管法规重大调整、公司管理实际需要、公司业务创新发展的基础上，持续督导业务部门开展制度建设。

##### **（二）夯实合规管理架构，强化合规管理职能**

2021 年公司通过落实合规考核机制、专兼职人员会议机制、持续推进合规风控工作的系统化建设等，引导全员主动合规、立足本岗位持续夯实各业务、各环节的内部控制。

##### **（三）深入解读新规，持续推进新规落地**

2021 年度，公司从新规解读、制度建立、系统更新、流程改造等方面持续推进各项重要法规、通知的落地工作，并对新规落地情况开展专项检查。公司将根据持续颁布的新法规不断强化学习与执行力度。

##### **（四）加强合规培训，全面提升合规意识**

2021 年为持续提高员工合规意识及应知应会，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，公司持续开展新员工合规培训、内

幕交易防控培训以及反洗钱专题培训，并结合业务部门实际需求，组织信息披露实务、适当性管理、销售合规实务、互联网直播合规管理等实务类培训。

#### （五）深入专项审计，抓紧第三道防线

2021 年公司在常规季度监察稽核工作外，有针对性地开展专项审计。审计范围覆盖投资研究、市场销售、运营 IT 等前、中、后台业务。在力争专项审计检查全覆盖基础上，将公司主业和监管关注作为专项审计重点。通过专项审计，有效发现现有业务流程中存在的问题缺陷；通过事后改进工作，查漏补缺，持续提高内部控制的有效性和内部风险防控能力。

#### （六）立足投资合规监督，系统化助力风控履职

监督投资组合的合规运作是公司风险管理的基础核心工作，2021 年公司持续推进旗下组合的投资合规风控阈值排查梳理和日常投资合规监督工作的规范化管理，进一步完善了组合合规多重监控工具互相校验、互为备份的机制，同时重点投入资源在公募基金、职业年金、社保业务、ETF 业务的精细化管控上，优化内部工作程序与分工，提升了基础投资监督工作的质量，主动发现问题，消除合规风险隐患。

#### （七）持续强化反洗钱工作理念，推动反洗钱工作纵深开展

公司高度重视反洗钱工作，2021 年认真贯彻落实反洗钱监管要求，牢固树立“风险为本”的反洗钱工作理念，从完善制度体系、提升履职效能、加大科技投入等方面，多措并举，将反洗钱工作推向纵深。为提升反洗钱管理效能和反洗钱工作水平，公司持续推进新一代反洗钱系统建设，提升反洗钱履职的时效性、有效性和精确性。

#### （八）全面加强员工行为管理

公司建立通信管理机制，为规范公司员工执业行为，防范利益冲突和道德风险，公司定期开展专项检查。2021 年通过新进员工承诺函签署、一对一宣讲、专题合规培训、员工基本信息维护完整性检查、季度投资申报及时性检查、投资申报持仓清仓情况跟进、员工上传附件与申报维护情况抽查比对等工作，将日常管理与季度监督相结合。

### 4.8 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。

#### **4.9 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。

#### **4.10 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**

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### **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**

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

#### **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**

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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（2022）审字第 60467606_B139 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	富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）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，公允反映了富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的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，我们独立于富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII），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	富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）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

	<p>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>
<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蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）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蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）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</p>

	<p>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，就可能导致对富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）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蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）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	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	蒋燕华   费泽旭
会计师事务所的地址	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
审计报告日期	2022 年 03 月 25 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）

报告截止日： 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2021 年 12 月 31 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
<b>资 产:</b>		
银行存款	406,963,686.60	178,715,531.40
结算备付金	1,688,315.72	362,354.17
存出保证金	471,297.77	77,840.02
交易性金融资产	1,961,911,701.77	1,376,834,007.26
其中：股票投资	1,961,911,701.77	1,376,834,007.26
基金投资	—	—
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	13,123,716.10	—
应收利息	12,702.03	7,218.18
应收股利	188,703.72	218,279.54
应收申购款	—	8,603,441.86
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	2,384,360,123.71	1,564,818,672.43
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 (2021 年 12 月 31 日)</b>	<b>上年度末 (2020 年 12 月 31 日)</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	22,257,718.58	78,723,653.41
应付赎回款	6,349,287.43	8,481,806.25
应付管理人报酬	3,556,062.25	1,837,288.38
应付托管费	691,456.55	357,250.52
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	1,001,389.94	322,073.91
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	208,190.07	169,053.66
负债合计	34,064,104.82	89,891,126.13
<b>所有者权益:</b>		

实收基金	1,072,336,972.94	641,938,422.39
未分配利润	1,277,959,045.95	832,989,123.91
所有者权益合计	2,350,296,018.89	1,474,927,546.30
负债和所有者权益总计	2,384,360,123.71	1,564,818,672.43

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.1918 元，基金份额总额 1,072,336,972.94 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日)
<b>一、收入</b>	-208,591,852.28	369,175,554.55
1. 利息收入	610,764.99	250,899.37
其中：存款利息收入	610,764.99	250,899.37
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	57,425,983.59	182,440,861.57
其中：股票投资收益	34,511,624.74	180,343,139.97
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	22,914,358.85	2,097,721.60
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-260,860,698.35	190,042,893.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-11,253,571.01	-5,693,437.46
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	5,485,668.50	2,134,337.09
<b>减：二、费用</b>	89,814,506.34	18,918,739.15
1. 管理人报酬	50,685,411.40	10,453,814.12
2. 托管费	9,855,496.66	2,032,686.07
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	28,776,726.92	6,190,020.35
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—

6. 税金及附加	—	—
7. 其他费用	496,871.36	242,218.61
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-298,406,358.62</b>	<b>350,256,815.40</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-298,406,358.62</b>	<b>350,256,815.40</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2021年01月01日至2021年12月31日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	641,938,422.39	832,989,123.91	1,474,927,546.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-298,406,358.62	-298,406,358.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	430,398,550.55	743,376,280.66	1,173,774,831.21
其中：1. 基金申购款	1,289,179,874.65	1,948,417,826.91	3,237,597,701.56
2. 基金赎回款	-858,781,324.10	-1,205,041,546.25	-2,063,822,870.35
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	1,072,336,972.94	1,277,959,045.95	2,350,296,018.89
项目	上年度可比期间 (2020年01月01日至2020年12月31日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	147,652,344.43	25,962,599.03	173,614,943.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	350,256,815.40	350,256,815.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	494,286,077.96	456,769,709.48	951,055,787.44
其中：1. 基金申购款	834,541,874.70	692,217,140.88	1,526,759,015.58
2. 基金赎回款	-340,255,796.74	-235,447,431.40	-575,703,228.14
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	641,938,422.39	832,989,123.91	1,474,927,546.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陈 戈	林志松	徐 慧
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）（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]2078 号文《关于准予富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）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 2019 年 6 月 13 日至 2019 年 7 月 30 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2019）验字第 60467606\_B18 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 2019 年 8 月 2 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 247,643,302.81 元，在募集期间产生的存款利息人民币 42,523.20 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 247,685,826.01 元，折合 247,685,826.01 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

根据基金管理人于 2020 年 11 月 6 日发布的《关于富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）增加美元基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》，自 2020 年 11 月 6 日起，本基金增加美元基金份额。本基金根据申购、赎回所使用货币的不同，将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行申购、赎回的份额类别，称为人民币份额；以美元计价并进行申购、赎回的份额类别，称为美元份额。

本基金投资于境内境外市场。

针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含交易型开放式指数基金 ETF）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的



国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品。

针对境内投资，本基金可投资于国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（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、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、中小企业私募债券等）、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、衍生产品（股指期货、国债期货、权证）；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）。

本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。

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

基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为80%-95%，其中投资于本基金界定的中国相关蓝筹股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除全部需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金投资于全球市场，包括境内市场和境外市场，其中主要境外市场有：美国、香港、台湾、新加坡、欧洲和日本等国家或地区。香港市场可通过合格境内机构投资者境外投资额度和港股通机制进行投资。如果法律法规对上述比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩基准为：MSCI 中国指数收益率\*90%+人民币活期存款利率（税后）\*10%。

#### **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、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了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》、《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》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。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2021年12月31日的财务状况以及2021年1月1日至2021年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### **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2021年1月1日至2021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分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资、基金投资和衍生工具等；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 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的股票、债券、基金等，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；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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。

#### 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。

本基金持有的金融工具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) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 基金投资收益/（损失）于卖出/赎回基金成交日确认，并按卖出/赎回基金成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股指期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 权证收益/（损失）于卖出成交日确认，并按卖出成交金额与其成本的差额入账；

(11) 股票股利收益于除息日确认，并按宣告的分红派息比例计算的金额扣除股票所在地适用的预缴所得税后的净额入账；基金投资在持有期间取得的红利于除息日确认；

(12) 公允价值变动收益/（损失）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；

(13) 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在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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对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；其中，人民币基金份额的现金分红币种为人民币，美元基金份额的现金分红币种为美元；不同类别份额红利再投资适用的净值为该类别基金份额净值；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的人民币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人民币基金份额面值；而对于美元基金份额，由于汇率因素影响，收益分配后美元基金份额净值可能低于对应的美元基金份额面值；

(3) 本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可按监管部门要求履行适当程序后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，但应于变更实施前在指定媒介公告。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
  - (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
  - (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。
- 如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### **7.4.6 税项**

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，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本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。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；

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《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；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
活期存款	406,963,686.60	178,715,531.40
定期存款	—	—
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	—	—
合计	406,963,686.60	178,715,531.40

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

本基金外币存款余额构成列示如下			
币种	2021年12月31日		
	外币金额	折算汇率	折合人民币
港币	273,499,828.75	0.8176	223,613,459.98
美元	4,135,747.60	6.3757	26,368,285.98
合计			249,981,745.96
币种	2020年12月31日		
	外币金额	折算汇率	折合人民币
港币	78,090,018.64	0.8416	65,723,683.28
美元	4,010,200.04	6.5249	26,166,154.24
合计			91,889,837.52

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2021年12月31日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,016,646,756.10	1,961,911,701.77	-54,735,054.33
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	2,016,646,756.10	1,961,911,701.77	-54,735,054.33
项目	上年度末（2020年12月31日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,170,708,363.24	1,376,834,007.26	206,125,644.02
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	1,170,708,363.24	1,376,834,007.26	206,125,644.02

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末(2021年12月31日)	上年度末(2020年12月31日)
应收活期存款利息	11,633.05	7,000.27
应收定期存款利息	—	—
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	835.78	179.41
应收债券利息	—	—
应收资产支持证券利息	—	—
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	—	—
应收黄金合约拆借孳息	—	—
应收出借证券利息	—	—
其他	233.20	38.50
合计	12,702.03	7,218.18

#### 7.4.7.6 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。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末(2021年12月31日)	上年度末(2020年12月31日)
交易所市场应付交易费用	1,001,389.94	322,073.91
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	1,001,389.94	322,073.91

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末(2021年12月31日)	上年度末(2020年12月31日)
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	18,190.07	19,053.66
应付证券出借违约金	—	—

预提审计费	70,000.00	30,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	208,190.07	169,053.66

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	641,938,422.39	641,938,422.39
本期申购	1,289,179,874.65	1,289,179,874.65
本期赎回（以“-”号填列）	-858,781,324.10	-858,781,324.10
本期末	1,072,336,972.94	1,072,336,972.94

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	424,995,425.57	407,993,698.34	832,989,123.91
本期利润	-37,545,660.27	-260,860,698.35	-298,406,358.62
本期基金份额交易产生的变动数	298,322,177.66	445,054,103.00	743,376,280.66
其中：基金申购款	920,802,514.70	1,027,615,312.21	1,948,417,826.91
基金赎回款	-622,480,337.04	-582,561,209.21	-1,205,041,546.25
本期已分配利润	—	—	—
本期末	685,771,942.96	592,187,102.99	1,277,959,045.95

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）
活期存款利息收入	503,261.96	171,427.09
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	25,572.18	13,438.19
其他	81,930.85	66,034.09
合计	610,764.99	250,899.37

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
卖出股票成交总额	9,329,670,040.60	1,916,623,115.09
减：卖出股票成本总额	9,295,158,415.86	1,736,279,975.12
买卖股票差价收入	34,511,624.74	180,343,139.97

#### 7.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖债券差价收入。

##### 7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

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。

#### 7.4.7.15 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。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 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。

##### 7.4.7.16.2 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。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
股票投资产生的股利收益	22,914,358.85	2,097,721.60

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	22,914,358.85	2,097,721.60

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
1. 交易性金融资产	-260,860,698.35	190,042,893.98
股票投资	-260,860,698.35	190,042,893.98
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	-260,860,698.35	190,042,893.98

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
基金赎回费收入	5,485,668.50	2,134,337.09
合计	5,485,668.50	2,134,337.09

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
交易所市场交易费用	28,776,726.92	6,190,020.35
银行间市场交易费用	—	—
交易基金产生的费用	—	—
其中：申购费	—	—
赎回费	—	—
合计	28,776,726.92	6,190,020.35

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）
审计费用	70,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
其他	269,274.99	48,582.81
银行费用	37,596.37	43,635.80
合计	496,871.36	242,218.61

#### 7.4.7.22 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作。

#### 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
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
富国资产管理（上海）有限公司	基金管理人的子公司
山东省国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
香港上海汇丰银行有限公司（“汇丰银行”）	基金境外托管行
海通国际证券有限公司（“海通香港”）	基金管理人的股东控制的子公司
申万宏源证券承销保荐有限责任公司（“申万宏源承销保荐”）	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（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（2020年01月01日至2020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 (%)
HAITONG INTERNATIONAL	3,652,335,932.85	18.77	12,004.39	0.00
申万宏源	804,419,432.40	4.13	138,441,644.55	3.02

#### 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

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债券交易。

#### 7.4.10.1.4 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 基金交易

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基金交易。

#### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
申万宏源	733,068.10	5.82	154,520.24	15.43
HAITONG INTERNATIONAL	1,826,168.12	14.49	—	—
关联方名称	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
申万宏源	126,161.95	4.68	53,909.85	16.74
HAITONG INTERNATIONAL	120.04	0.00	—	—

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



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（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	50,685,411.40	10,453,814.12
其中：支付销售机构的客户维护费	8,924,867.28	2,140,663.15

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.80\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	9,855,496.66	2,032,686.07

注：基金的托管费包含基金托管人的托管费和境外托管人的托管费两部分。

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.35%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 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 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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(2021年01月01日至2021年12月31日)		上年度可比期间(2020年01月01日至2020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
香港上海汇丰银行有限	245,962,478.29	2,485.44	91,889,824.84	3,288.20

公司				
招商银行股份有限公司	161,001,208.31	500,776.52	86,825,706.56	168,138.89

#### 7.4.10.6 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（2021年01月01日至2021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	301039	中集车辆	IPO网下申购	20,640	143,654.40
海通证券股份有限公司	688187	时代电气	IPO网下申购	33,865	1,067,997.12
海通证券股份有限公司	688701	卓锦股份	IPO网下申购	2,340	17,590.72
海通证券股份有限公司	688217	睿昂基因	IPO网下申购	1,040	19,252.58
海通证券股份有限公司	688685	迈信林	IPO网下申购	2,612	23,678.04

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2020年01月01日至2020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	688585	上纬新材	IPO网下申购	4,922	12,317.06
海通证券股份有限公司	688301	奕瑞科技	IPO网下申购	2,427	291,720.55
海通国际证券有限公司	6618 HK	京东健康	IPO申购	200	12,125.36

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联方交易事项。

##### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021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	可流通日	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
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股限售	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	—
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股限售	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	—
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新股限售	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	—
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新股限售	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	—
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新股限售	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	—
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股限售	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	—
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股限售	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	—
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新股限售	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	—
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	新股限售	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	—
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股限售	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	—
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新股限售	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	—
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股限售	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	—
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股限售	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	—
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新股限售	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	—
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股限售	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	—
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股限售	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	—
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新股限售	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	—
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股限售	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	—
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股限售	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	—
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新股限售	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	—
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新股限售	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	—
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股限售	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	—
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	新股限售	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	—
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	新股限售	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	—
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	新股限售	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	—
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	新股限售	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	—
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	新股限售	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	—
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	新股限售	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	—

301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	新股限售	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	—
688032	禾迈股份	2021-12-13	2022-06-20	新股限售	557.80	650.66	1,810	1,009,618.00	1,177,694.60	—
688167	炬光科技	2021-12-17	2022-06-24	新股限售	78.69	176.67	2,014	158,481.66	355,813.38	—
688622	禾信仪器	2021-09-03	2022-03-14	新股限售	17.70	56.93	1,204	21,310.80	68,543.72	—
688697	纽威数控	2021-09-09	2022-03-17	新股限售	7.55	16.03	5,837	44,069.35	93,567.11	—
2219 HK	朝聚眼科	2021-07-01	2022-01-07	基石投资	10.60	5.13	5,491,000	48,505,385.46	28,193,693.25	—

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

表中 2219 HK 的认购价格为港币计价，估值单价、期末成本总额及期末估值总额均为人民币计价。

#### 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 2021 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 2021 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。

#### 7.4.13 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。

本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金净值的 10%，持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品时，要求所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级，并且任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

#### 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合同及法规规定。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银行存款、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（2021年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	406,963,686.60	—	—	—	—	—	406,963,686.60
结算备付金	1,688,315.72	—	—	—	—	—	1,688,315.72
存出保证金	471,297.77	—	—	—	—	—	471,297.77
交易性金融资产	—	—	—	—	—	1,961,911,701.77	1,961,911,701.77
应收证券清算款	—	—	—	—	—	13,123,716.10	13,123,716.10
应收利息	—	—	—	—	—	12,702.03	12,702.03
应收股利	—	—	—	—	—	188,703.72	188,703.72
资产总计	409,123,300.09	—	—	—	—	1,975,236,823.62	2,384,360,123.71
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	22,257,718.58	22,257,718.58
应付赎回款	—	—	—	—	—	6,349,287.43	6,349,287.43
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	3,556,062.25	3,556,062.25
应付托管费	—	—	—	—	—	691,456.55	691,456.55
应付交易费用	—	—	—	—	—	1,001,389.94	1,001,389.94
其他负债	—	—	—	—	—	208,190.07	208,190.07
负债总计	—	—	—	—	—	34,064,104.82	34,064,104.82
利率敏感度缺口	409,123,300.09	—	—	—	—	1,941,172,718.80	2,350,296,018.89
上年度末（2020年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							



银行存款	178,715,531.40	—	—	—	—	—	178,715,531.40
结算备付金	362,354.17	—	—	—	—	—	362,354.17
存出保证金	77,840.02	—	—	—	—	—	77,840.02
交易性金融资产	—	—	—	—	—	1,376,834,007.26	1,376,834,007.26
应收利息	—	—	—	—	—	7,218.18	7,218.18
应收股利	—	—	—	—	—	218,279.54	218,279.54
应收申购款	368,545.99	—	—	—	—	8,234,895.87	8,603,441.86
资产总计	179,524,271.58	—	—	—	—	1,385,294,400.85	1,564,818,672.43
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	78,723,653.41	78,723,653.41
应付赎回款	—	—	—	—	—	8,481,806.25	8,481,806.25
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,837,288.38	1,837,288.38
应付托管费	—	—	—	—	—	357,250.52	357,250.52
应付交易费用	—	—	—	—	—	322,073.91	322,073.91
其他负债	—	—	—	—	—	169,053.66	169,053.66
负债总计	—	—	—	—	—	89,891,126.13	89,891,126.13
利率敏感度缺口	179,524,271.58	—	—	—	—	1,295,403,274.72	1,474,927,546.30

#### 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

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末（2021年12月31日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
银行存款	26,368,285.98	223,613,459.98	—	—	249,981,745.96
交易性金融资产	186,640,503.35	1,061,045,906.25	—	—	1,247,686,409.60
应收股利	—	188,703.72	—	—	188,703.72
应收证券清算款	—	13,123,716.10	—	—	13,123,716.10
应收利息	11.99	—	—	—	11.99
资产合计	213,008,801.32	1,297,971,786.05	—	—	1,510,980,587.37
以外币计价的负债					
应付赎回款	5,632.80	—	—	—	5,632.80
其他负债	14.15	—	—	—	14.15
负债合计	5,646.95	—	—	—	5,646.95
资产负债表外汇风险敞口净额	213,003,154.37	1,297,971,786.05	—	—	1,510,974,940.42
项目	上年度末（2020年12月31日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
银行存款	26,166,154.24	65,723,683.28	—	—	91,889,837.52
交易性金融资产	234,304,260.91	878,004,561.16	—	—	1,112,308,822.07
应收股利	2,279.54	—	—	—	2,279.54
资产合计	260,472,694.69	943,728,244.44	—	—	1,204,200,939.13
以外币计价的负债					

应付证券清算款	12,971,430.73	53,336,845.74	—	—	66,308,276.47
负债合计	12,971,430.73	53,336,845.74	—	—	66,308,276.47
资产负债表外汇风险敞口净额	247,501,263.96	890,391,398.70	—	—	1,137,892,662.66

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化 1%，其他变量不变；(2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2021年12月31日)	上年度末(2020年12月31日)
	港币相对人民币贬值 1%	-12,979,717.86	-8,903,913.99
	港币相对人民币升值 1%	12,979,717.86	8,903,913.99
	美元相对人民币贬值 1%	-2,130,031.54	-2,475,012.64
	美元相对人民币升值 1%	2,130,031.54	2,475,012.64

#### 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。本基金主要投资于在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的股票，在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(含ETF)、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金为股票型基金，股票投资占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金界定的中国相关蓝筹股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除全部

---

需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资于境内境外市场。针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含交易型开放式指数基金 ETF）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品。针对境内投资，本基金可投资于国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（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、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、中小企业私募债券等）、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、衍生产品（股指期货、国债期货、权证）；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）。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。

基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金界定的中国相关蓝筹股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除全部需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、

存出保证金、应收申购款等。本基金投资于全球市场，包括境内市场和境外市场，其中主要境外市场有：美国、香港、台湾、新加坡、欧洲和日本等国家或地区。香港市场可通过合格境内机构投资者境外投资额度和港股通机制进行投资。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（2021年12月31日）		上年度末（2020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	1,961,911,701.77	83.48	1,376,834,007.26	93.35
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	1,961,911,701.77	83.48	1,376,834,007.26	93.35

#### 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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	22,331,986.08	14,958,698.87
	2. 业绩比较基准减少 1%	-22,331,986.08	-14,958,698.87

---

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为人民币 1,931,582,784.73 元，属于第二层次的余额为人民币 0.00 元，属于第三层次余额为人民币 30,328,917.04 元（于 2020 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为人民币 1,376,687,646.14 元，属于第二层次的余额为人民币 146,361.12 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元）。

##### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期变动情况如下：

	交易性金融资产
上年度末	-
转入第三层次	-
转出第三层次	-
当期计入损益的利得或损失总额	-19,665,904.27
购买	49,994,821.31
出售	-
本期末	30,328,917.04
本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动	-19,665,904.27

#### 7.4.14.2 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。

#### 7.4.14.3 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	1,961,911,701.77	82.28
	其中：普通股	1,961,911,701.77	82.28
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-

5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	408,652,002.32	17.14
8	其他各项资产	13,796,419.62	0.58
9	合计	2,384,360,123.71	100.00

## 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	1,061,045,906.25	45.15
中国大陆	714,225,292.17	30.39
美国	186,640,503.35	7.94
合计	1,961,911,701.77	83.48

## 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
日常消费品	372,992,729.22	15.87
信息技术	366,288,737.45	15.58
工业	349,263,387.46	14.86
医疗保健	251,611,115.77	10.71
原材料	179,772,065.30	7.65
非日常生活消费品	170,012,204.77	7.23
房地产	166,037,472.16	7.06
通信服务	79,611,055.08	3.39
金融	22,266,000.00	0.95
公用事业	3,785,209.26	0.16
能源	271,725.30	0.01
合计	1,961,911,701.77	83.48

## 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

### 8.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在证券 市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允 价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	China Overseas Property	中海物业	2669	香港联合交 易所	中国香港	24,410,000.00	165,049,484.32	7.02



	Holdings Limited							
2	Tsingtao Brewery Company Limited	青岛啤酒	168	香港联合交易所	中国香港	1,952,000.00	116,504,729.60	4.96
3	BYD Company Limited	比亚迪	1211	香港联合交易所	中国香港	447,500.00	97,542,541.60	4.15
4	Contemporary Amperex Technology Co., Limited	宁德时代	300750	深圳证券交易所	中国大陆	139,100.00	81,790,800.00	3.48
5	Morimatsu International Holdings Company Limited	森松国际	2155	香港联合交易所	中国香港	10,843,000.00	79,343,869.36	3.38
6	Kweichow Moutai Co., Ltd.	贵州茅台	600519	上海证券交易所	中国大陆	38,256.00	78,424,800.00	3.34
7	SEA LTD-ADR	SEA LTD-ADR	SE	美国证券交易所	美国	52,620.00	75,052,318.91	3.19
8	Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd.	时代电气	3898	香港联合交易所	中国香港	1,799,600.00	66,431,586.14	2.83
			688187	上海证券交易所	中国大陆	33,865.00	2,776,930.00	0.12
9	Chacha Food Company, Limited	洽洽食品	002557	深圳证券交易所	中国大陆	1,068,300.00	65,550,888.00	2.79
10	Shanghai Fudan Microelectronics Group Co., Ltd.	复旦微电子	1385	香港联合交易所	中国香港	3,072,000.00	63,796,346.88	2.71
			688385	上海证券交易所	中国大陆	8,986.00	452,355.24	0.02
11	Shandong Nanshan Aluminium Co., Ltd.	南山铝业	600219	上海证券交易所	中国大陆	13,195,894.00	62,152,660.74	2.64
12	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co., Ltd.	山西汾酒	600809	上海证券交易所	中国大陆	180,000.00	56,840,400.00	2.42

13	Genscript Biotech Corporation	金斯瑞生物科技	1548	香港联合交易所	中国香港	1,976,000.00	55,737,427.20	2.37
14	Zhou Hei Ya International Holdings Company Limited	周黑鸭	1458	香港联合交易所	中国香港	11,270,000.00	54,180,389.76	2.31
15	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	舜宇光学科技	2382	香港联合交易所	中国香港	265,500.00	53,530,152.48	2.28
16	DECKERS OUTDOOR CORP	DECKERS OUTDOOR CORP	DECK	美国证券交易所	美国	20,000.00	46,709,653.34	1.99
17	Pharmaron Beijing Co., Ltd.	康龙化成	3759	香港联合交易所	中国香港	444,700.00	43,739,482.42	1.86
18	iRay Technology Company Limited	奕瑞科技	688301	上海证券交易所	中国大陆	86,000.00	42,733,400.00	1.82
19	STAAR SURGICAL CO	STAAR SURGICAL CO	STAA	美国证券交易所	美国	72,000.00	41,911,301.52	1.78
20	Wuxi Autowell Technology Co., Ltd.	奥特维	688516	上海证券交易所	中国大陆	170,293.00	41,844,395.96	1.78
21	Shenzhen Topband Co., Ltd.	拓邦股份	002139	深圳证券交易所	中国大陆	2,200,000.00	41,118,000.00	1.75
22	Ganfeng Lithium Co., Ltd.	赣锋锂业	1772	香港联合交易所	中国香港	403,200.00	40,448,830.46	1.72
23	Eve Energy Co., Ltd.	亿纬锂能	300014	深圳证券交易所	中国大陆	260,000.00	30,726,800.00	1.31
24	BOE Varitronix Limited	京东方精电	710	香港联合交易所	中国香港	3,552,000.00	29,099,234.30	1.24
25	CHAOJU EYE CARE HOLDINGS LTD	CHAOJU EYE CARE HOLDINGS LTD	2219	香港联合交易所	中国香港	5,491,000.00	28,193,693.25	1.20
26	Shennan Circuits Co.,	深南电路	002916	深圳证券交易所	中国大陆	216,620.00	26,388,648.40	1.12

	Ltd.							
27	Luxshare Precision Industry Co., Ltd.	立讯精密	002475	深圳证券交易所	中国大陆	525,073.00	25,833,591.60	1.10
28	Wuxi Apptec Co., Ltd.	药明康德	2359	香港联合交易所	中国香港	185,080.00	20,428,390.08	0.87
			603259	上海证券交易所	中国大陆	40,000.00	4,743,200.00	0.20
29	Techtronic Industries Co. Ltd.	创科实业	669	香港联合交易所	中国香港	187,000.00	23,728,714.24	1.01
30	East Money Information Co., Ltd.	东方财富	300059	深圳证券交易所	中国大陆	600,000.00	22,266,000.00	0.95
31	WOLFSPEED INC	WOLFSPEED INC	WOLF	美国证券交易所	美国	30,000.00	21,378,359.67	0.91
32	Zhaojin Mining Industry Company Limited	招金矿业	1818	香港联合交易所	中国香港	3,824,000.00	20,822,505.98	0.89
33	Jiangsu Eastern Shenghong Co., Ltd.	东方盛虹	000301	深圳证券交易所	中国大陆	1,061,300.00	20,525,542.00	0.87
34	Hangzhou First Applied Material Co., Ltd.	福斯特	603806	上海证券交易所	中国大陆	140,000.00	18,277,000.00	0.78
35	EC Healthcare	医思健康	2138	香港联合交易所	中国香港	1,851,000.00	16,859,026.46	0.72
36	Trina Solar Co., Ltd.	天合光能	688599	上海证券交易所	中国大陆	200,000.00	15,780,000.00	0.67
37	Sungrow Power Supply Co., Ltd.	阳光电源	300274	深圳证券交易所	中国大陆	101,000.00	14,725,800.00	0.63
38	Jiangsu Cnano Technology Co., Ltd.	天奈科技	688116	上海证券交易所	中国大陆	97,381.00	14,538,009.49	0.62
39	L. K. Technology Holdings	力劲科技	558	香港联合交易所	中国香港	900,000.00	11,788,156.80	0.50

	Limited							
40	Kunshan Dongwei Technology Co., Ltd.	东威科技	688700	上海证券交易所	中国大陆	169,471.00	11,540,975.10	0.49
41	Chinasoft International Ltd.	中国软件国际	354	香港联合交易所	中国香港	1,366,000.00	11,347,110.66	0.48
42	Dongyue Group Limited	东岳集团	189	香港联合交易所	中国香港	1,100,000.00	10,936,217.60	0.47
43	ZTE Corporation	中兴通讯	763	香港联合交易所	中国香港	612,000.00	10,682,925.12	0.45
44	Jiangsu Azure Corporation	蔚蓝锂芯	002245	深圳证券交易所	中国大陆	258,200.00	7,103,082.00	0.30
45	Sunwoda Electronic Co., Ltd	欣旺达	300207	深圳证券交易所	中国大陆	161,200.00	6,796,192.00	0.29
46	Xinxiang Richful Lubricative Co., Ltd.	瑞丰新材	300910	深圳证券交易所	中国大陆	76,300.00	6,092,555.00	0.26
47	Xinyi Energy Holdings Limited	信义能源	3868	香港联合交易所	中国香港	1,078,000.00	3,763,461.86	0.16
48	Ascentage Pharma Group International	亚盛医药-B	6855	香港联合交易所	中国香港	158,800.00	3,661,343.62	0.16
49	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700	香港联合交易所	中国香港	8,800.00	3,286,621.18	0.14
50	Flat Glass Group Co., Ltd	福莱特	6865	香港联合交易所	中国香港	101,000.00	3,270,072.96	0.14
51	S-Enjoy Service Group Co., Limited	新城悦服务	1755	香港联合交易所	中国香港	319,000.00	2,915,904.99	0.12
52	Shanghai Kindly Medical Instruments Co., Ltd.	康德莱医械	1501	香港联合交易所	中国香港	134,400.00	2,527,365.12	0.11
53	Innovent Biologics,	信达生物	1801	香港联合交易所	中国香港	62,000.00	2,445,850.40	0.10

	Inc.							
54	Li Ning Co. Ltd.	李宁	2331	香港联合交易所	中国香港	35,000.00	2,442,375.60	0.10
55	Chervon Holdings Limited	泉峰控股	2285	香港联合交易所	中国香港	47,800.00	2,262,806.11	0.10
56	Meituan	美团-W	3690	香港联合交易所	中国香港	9,800.00	1,806,012.99	0.08
57	Tiangong International Company Limited	天工国际	826	香港联合交易所	中国香港	448,000.00	1,747,178.50	0.07
58	Jiangsu Haili Wind Power Equipment Technology Co., Ltd.	海力风电	301155	深圳证券交易所	中国大陆	10,533.00	1,269,787.30	0.05
59	Asymchem Laboratories (Tianjin) Co., Ltd.	凯莱英	6821	香港联合交易所	中国香港	4,800.00	1,255,833.60	0.05
60	Hoymiles Power Electronics Inc.	禾迈股份	688032	上海证券交易所	中国大陆	1,810.00	1,177,694.60	0.05
61	China Resources Beer (Holdings) Company Limited	华润啤酒	291	香港联合交易所	中国香港	22,000.00	1,148,482.72	0.05
62	Binjiang Service Group Co. Ltd.	滨江服务	3316	香港联合交易所	中国香港	61,000.00	1,092,231.84	0.05
63	Joinn Laboratories (China) Co., Ltd.	昭衍新药	6127	香港联合交易所	中国香港	18,620.00	999,436.69	0.04
64	Sunac Services Holdings Limited	融创服务	1516	香港联合交易所	中国香港	152,000.00	987,987.84	0.04
65	Shanghai	皓元医药	688131	上海证券交易所	中国大陆	3,855.00	958,661.40	0.04

	Haoyuan Chemexpress Co., Ltd.			易所				
66	Changsha Broad Homes Industrial Group Co., Ltd.	远大住工	2163	香港联合交易所	中国香港	92,100.00	902,105.50	0.04
67	CK Hutchison Holdings Limited	长和	1	香港联合交易所	中国香港	21,500.00	884,193.52	0.04
68	Galaxycore Inc.	格科微	688728	上海证券交易所	中国大陆	23,033.00	694,905.61	0.03
69	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	VIPS	美国证券交易所	美国	12,387.00	663,396.69	0.03
70	China Mobile Limited	中国移动	941	香港联合交易所	中国香港	14,500.00	554,823.36	0.02
71	ACM RESEARCH INC-CLASS A	ACM RESEARCH INC-CLASS A	ACMR	美国证券交易所	美国	949.00	515,929.49	0.02
72	Sichuan Chengfei Integration Technology Corp. Ltd	成飞集成	002190	深圳证券交易所	中国大陆	15,200.00	513,304.00	0.02
73	Xd Inc.	心动公司	2400	香港联合交易所	中国香港	14,200.00	458,591.84	0.02
74	Yidu Tech Inc.	医渡科技	2158	香港联合交易所	中国香港	26,100.00	449,193.53	0.02
75	Guangdong Fangyuan Environment Co., Ltd.	芳源股份	688148	上海证券交易所	中国大陆	11,860.00	414,981.40	0.02
76	Guizhou Zhenhua E-Chem Inc.	振华新材	688707	上海证券交易所	中国大陆	8,130.00	409,589.40	0.02
77	Wuhan Dr Laser Technology Corp., Ltd	帝尔激光	300776	深圳证券交易所	中国大陆	1,600.00	409,440.00	0.02
78	CIMC Enric Holdings Limited	中集安瑞科	3899	香港联合交易所	中国香港	44,000.00	407,949.70	0.02

79	Zhongsheng Group Holdings Ltd	中升控股	881	香港联合交易所	中国香港	8,000.00	397,680.64	0.02
80	Shandong Weifang Rainbow Chemical Co., Ltd	润丰股份	301035	深圳证券交易所	中国大陆	6,438.00	372,296.32	0.02
81	Hangzhou Honghua Digital Technology Stock Company LTD.	宏华数科	688789	上海证券交易所	中国大陆	1,400.00	366,534.00	0.02
82	Qingdao Yunlu Advanced Materials Technology Co., Ltd.	云路股份	688190	上海证券交易所	中国大陆	3,026.00	358,520.48	0.02
83	Pop Mart International Group Limited	泡泡玛特	9992	香港联合交易所	中国香港	9,800.00	358,157.86	0.02
84	Focuslight Technologies Inc.	炬光科技	688167	上海证券交易所	中国大陆	2,014.00	355,813.38	0.02
85	Wayz Intelligent Manufacturing Technology Co., Ltd.	中科微至	688211	上海证券交易所	中国大陆	4,501.00	337,575.00	0.01
86	Shenzhen Xinyichang Technology Co., Ltd.	新益昌	688383	上海证券交易所	中国大陆	2,701.00	326,118.74	0.01
87	China Southern Power Grid Technology Co., Ltd.	南网科技	688248	上海证券交易所	中国大陆	11,763.00	271,725.30	0.01
88	Cimc Vehicles (Group) Co., Ltd.	中集车辆	301039	深圳证券交易所	中国大陆	20,640.00	264,150.72	0.01

89	Shandong Kaisheng New Materials Co., Ltd.	凯盛新材	301069	深圳证券交易所	中国大陆	5,386.00	260,217.38	0.01
90	Riyue Heavy Industry Co, Ltd	日月股份	603218	上海证券交易所	中国大陆	7,871.00	259,349.45	0.01
91	Shenzhen Aoni Electronic Co., Ltd	奥尼电子	301189	深圳证券交易所	中国大陆	4,345.00	259,307.90	0.01
92	Shanghai Universal Biotech Co., Ltd	优宁维	301166	深圳证券交易所	中国大陆	2,528.00	258,233.50	0.01
93	Puya Semiconductor (Shanghai) Co., Ltd.	普冉股份	688766	上海证券交易所	中国大陆	704.00	249,645.44	0.01
94	Shandong Intco Recycling Resources Co., Ltd.	英科再生	688087	上海证券交易所	中国大陆	2,469.00	233,221.74	0.01
95	I-MAB-SPONSORED ADR	I-MAB-SPONSORED ADR	IMAB	美国证券交易所	美国	764.00	230,838.34	0.01
96	Wus Printed Circuit (Kunshan) Co., Ltd.	沪电股份	002463	深圳证券交易所	中国大陆	13,500.00	223,830.00	0.01
97	Nari Technology Co., Ltd.	国电南瑞	600406	上海证券交易所	中国大陆	5,268.00	210,878.04	0.01
98	Guangdong Shenling Environmental Systems Co., Ltd.	申菱环境	301018	深圳证券交易所	中国大陆	7,811.00	206,506.84	0.01
99	Jiangsu Sinopep-Allsino Biopharmaceutical Co., Ltd.	诺泰生物	688076	上海证券交易所	中国大陆	4,984.00	205,988.72	0.01



100	Rumere Co., Ltd.	戎美股份	301088	深圳证券交易所	中国大陆	7,036.00	181,366.48	0.01
101	Cansino Biologics Inc.	康希诺	6185	香港联合交易所	中国香港	1,200.00	176,797.82	0.01
102	Jiangsu Gdk Biological Technology Co., Ltd	金迪克	688670	上海证券交易所	中国大陆	2,310.00	174,820.80	0.01
103	Rayitek Hi-Tech Film Company Ltd., Shenzhen	瑞华泰	688323	上海证券交易所	中国大陆	4,513.00	173,885.89	0.01
104	Shenzhen Urban Transport Planning Center Co., Ltd	深城交	301091	深圳证券交易所	中国大陆	5,240.00	171,845.80	0.01
105	YALLA GROUP LTD	YALLA GROUP LTD	YALA	美国证券交易所	美国	3,866.00	165,391.14	0.01
106	Kede Numerical Control Co., Ltd.	科德数控	688305	上海证券交易所	中国大陆	1,496.00	160,072.00	0.01
107	Hangzhou Biotest Biotech Co., Ltd.	博拓生物	688767	上海证券交易所	中国大陆	2,220.00	155,178.00	0.01
108	Shenzhen Breo Technology Co., Ltd	倍轻松	688793	上海证券交易所	中国大陆	1,454.00	151,943.00	0.01
109	Shanghai Supezet Engineering Technology Corp., Ltd.	卓然股份	688121	上海证券交易所	中国大陆	3,681.00	141,534.45	0.01
110	Hygeia Healthcare Holdings Co., Limited	海吉亚医疗	6078	香港联合交易所	中国香港	3,400.00	135,656.19	0.01
111	Hootech Inc.	浩通科技	301026	深圳证券交易所	中国大陆	2,027.00	129,306.03	0.01

112	Zhejiang Zhengguang Industrial Co., Ltd.	争光股份	301092	深圳证券交易所	中国大陆	3,230.00	124,293.63	0.01
113	Gemac Engineering Machinery Co., Ltd.	金鹰重工	301048	深圳证券交易所	中国大陆	8,424.00	114,557.55	0.00
114	Yanker Shop Food Co., Ltd.	盐津铺子	002847	深圳证券交易所	中国大陆	1,300.00	111,280.00	0.00
115	Kunshan Guoli Electronic Technology Co., Ltd.	国力股份	688103	上海证券交易所	中国大陆	1,595.00	111,123.65	0.00
116	Zhejiang Heda Technology Co., Ltd.	和达科技	688296	上海证券交易所	中国大陆	2,173.00	110,388.40	0.00
117	BGT Group Co., Ltd.	倍杰特	300774	深圳证券交易所	中国大陆	4,435.00	97,161.52	0.00
118	Ak Medical Holdings Limited	爱康医疗	1789	香港联合交易所	中国香港	18,000.00	97,130.88	0.00
119	Zhengyuan Geomatics Group Co., Ltd.	正元地信	688509	上海证券交易所	中国大陆	15,433.00	97,073.57	0.00
120	Zhangjiagang Zhonghuan Hailu High-End Equipment Co., Ltd.	中环海陆	301040	深圳证券交易所	中国大陆	2,401.00	95,680.91	0.00
121	Shanghai Ailu Package Co., Ltd.	上海艾录	301062	深圳证券交易所	中国大陆	5,225.00	93,673.29	0.00
122	Neway Cnc Equipment (Suzhou) Co., Ltd.	纽威数控	688697	上海证券交易所	中国大陆	5,837.00	93,567.11	0.00
123	Wave Cyber (Shanghai) Co., Ltd.	唯赛勃	688718	上海证券交易所	中国大陆	3,145.00	89,506.70	0.00
124	Dook Media	读客文化	301025	深圳证券交易所	中国大陆	4,027.00	87,417.84	0.00

	Group Limited			易所				
125	Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co., Ltd	郑煤机	564	香港联合交易所	中国香港	12,800.00	85,815.30	0.00
126	Jinpu Landscape Architecture Co., Ltd.	金埔园林	301098	深圳证券交易所	中国大陆	3,069.00	84,970.79	0.00
127	Zai Lab Limited	再鼎医药-SB	9688	香港联合交易所	中国香港	200.00	82,741.12	0.00
128	New Oriental Education & Technology Group Inc.	新东方-S	9901	香港联合交易所	中国香港	6,200.00	82,423.89	0.00
129	Shenzhen Jove Enterprise Limited	中富电路	300814	深圳证券交易所	中国大陆	3,280.00	80,865.12	0.00
130	Hunan Warrant Pharmaceutical Co., Ltd	华纳药厂	688799	上海证券交易所	中国大陆	1,917.00	78,922.89	0.00
131	Shanghai Rightogene Biotechnology Co., Ltd.	睿昂基因	688217	上海证券交易所	中国大陆	1,040.00	75,628.80	0.00
132	Shanghai W-Ibada High Tech. Group Co., Ltd.	华依科技	688071	上海证券交易所	中国大陆	1,101.00	72,434.79	0.00
133	Guangzhou Hexin Instrument Co., Ltd.	禾信仪器	688622	上海证券交易所	中国大陆	1,204.00	68,543.72	0.00
134	Zhongjie (Jiangsu) Technology Co., Ltd.	中捷精工	301072	深圳证券交易所	中国大陆	1,802.00	67,726.26	0.00
135	Sicher Elevator Co., Ltd.	森赫股份	301056	深圳证券交易所	中国大陆	5,716.00	65,653.80	0.00
136	Shenzhen King Brother	金百泽	301041	深圳证券交易所	中国大陆	2,150.00	63,670.10	0.00

	Electronics Technology Co., Ltd.							
137	Sunlour Pigment Co., Ltd.	欢乐股份	301036	深圳证券交易所	中国大陆	2,047.00	62,445.59	0.00
138	Beijing Fjr Optoelectronic Technology Co., Ltd.	富吉瑞	688272	上海证券交易所	中国大陆	1,263.00	59,651.49	0.00
139	Zhangjiagang Haiguo New Energy Equipment Manufacturing Co., Ltd.	海锅股份	301063	深圳证券交易所	中国大陆	1,524.00	59,268.03	0.00
140	Gad Environmental Technology Co., Ltd.	中兰环保	300854	深圳证券交易所	中国大陆	2,026.00	58,735.01	0.00
141	Shenzhen Water Planning & Design Institute Co., Ltd.	深水规院	301038	深圳证券交易所	中国大陆	2,660.00	55,607.30	0.00
142	Beijing Tongyizhong New Material Technology Corporation	同益中	688722	上海证券交易所	中国大陆	3,687.00	50,475.03	0.00
143	Zhejiang Ssaw Boutique Hotels Co., Ltd	君亭酒店	301073	深圳证券交易所	中国大陆	1,432.00	48,812.16	0.00
144	Hualan Group Co., Ltd.	华蓝集团	301027	深圳证券交易所	中国大陆	2,856.00	48,631.80	0.00
145	Shanghai Baolijia Chemical Co., Ltd.	保立佳	301037	深圳证券交易所	中国大陆	1,923.00	48,157.08	0.00
146	Hangzhou Dadi Haiyang	大地海洋	301068	深圳证券交易所	中国大陆	1,436.00	43,660.68	0.00

	Environmental Protection Co., Ltd.							
147	Zhejiang Huilong New Materials Co., Ltd.	汇隆新材	301057	深圳证券交易所	中国大陆	2,173.00	42,953.11	0.00
148	Keymed Biosciences Inc.	康诺亚-B	2162	香港联合交易所	中国香港	1,500.00	42,310.80	0.00
149	Zhejiang Haiyan Power System Resources Environmental Technology Co., Ltd	力源科技	688565	上海证券交易所	中国大陆	2,464.00	39,916.80	0.00
150	Qingdao Daneng Environmental Protection Equipment Co., Ltd.	青达环保	688501	上海证券交易所	中国大陆	1,759.00	38,557.28	0.00
151	China Baoan Group Co., Ltd.	宝安集团	000009	深圳证券交易所	中国大陆	2,431.00	35,079.33	0.00
152	Guobang Pharma Ltd.	国邦医药	605507	上海证券交易所	中国大陆	1,202.00	34,653.66	0.00
153	Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Company Limited	同仁堂国药	3613	香港联合交易所	中国香港	3,000.00	32,916.58	0.00
154	Zhejiang Zone-King Environmental Sci&Tech Co., Ltd.	卓锦股份	688701	上海证券交易所	中国大陆	2,340.00	32,572.80	0.00
155	San Yang Ma (Chongqing) Logistics Co., Ltd.	三羊马	001317	深圳证券交易所	中国大陆	300.00	25,722.00	0.00

156	China Feihe Limited	中国飞鹤	6186	香港联合交易所	中国香港	3,000.00	25,656.29	0.00
157	Zylox-Tonbridge Medical Technology Co., Ltd.	归创通桥-B	2190	香港联合交易所	中国香港	1,000.00	20,848.80	0.00
158	Mengtian Home Group Inc.	梦天家居	603216	上海证券交易所	中国大陆	772.00	19,523.88	0.00
159	Times Neighborhood Holdings Limited	时代邻里	9928	香港联合交易所	中国香港	7,385.00	17,449.75	0.00
160	Zhengzhou Qianweiyangc hu Food Co., Ltd	千味央厨	001215	深圳证券交易所	中国大陆	295.00	17,171.95	0.00
161	Jiangxi Geto New Materials Corporation Limited	志特新材	300986	深圳证券交易所	中国大陆	264.00	16,898.64	0.00
162	Henan Bccy Environmental Energy Co., Ltd	百川畅银	300614	深圳证券交易所	中国大陆	329.00	15,792.00	0.00
163	Hunan Resun Co., Ltd.	丽臣实业	001218	深圳证券交易所	中国大陆	350.00	15,267.00	0.00
164	Changchun Zhiyuan New Energy Equipment Co., Ltd.	致远新能	300985	深圳证券交易所	中国大陆	295.00	14,460.90	0.00
165	Zhejiang Liming Intelligent Manufacturing Co., Ltd.	浙江黎明	603048	上海证券交易所	中国大陆	464.00	13,456.00	0.00
166	Springsnow Food Group Co., Ltd.	春雪食品	605567	上海证券交易所	中国大陆	629.00	13,397.70	0.00
167	ZTO EXPRESS CAYMAN	ZTO EXPRESS CAYMAN	ZTO	美国证券交易所	美国	74.00	13,314.25	0.00
168	Leedarson Iot Technology	立达信	605365	上海证券交易所	中国大陆	645.00	12,364.65	0.00

	Inc.							
169	Zhongjin Irradiation Incorporated Company	中金辐照	300962	深圳证券交易所	中国大陆	576.00	11,422.08	0.00
170	Sinostone (Guangdong) Co., Ltd.	中旗新材	001212	深圳证券交易所	中国大陆	308.00	9,951.48	0.00
171	Beijing Chunlizhengda Medical Instruments Co., Ltd.	春立医疗	1858	香港联合交易所	中国香港	750.00	9,283.85	0.00
172	Shanghai Geoharbour Construction Group Co., Ltd.	上海港湾	605598	上海证券交易所	中国大陆	553.00	8,809.29	0.00
173	Zhejiang Sunrise Garment Group Co., Ltd	盛泰集团	605138	上海证券交易所	中国大陆	723.00	8,733.84	0.00
174	Qingdao Foods Co., Ltd	青岛食品	001219	深圳证券交易所	中国大陆	272.00	8,323.20	0.00
175	Hynar Water Group Co., Ltd.	深水海纳	300961	深圳证券交易所	中国大陆	394.00	8,017.90	0.00
176	Zhejiang Cayi Vacuum Container Co., Ltd.	嘉益股份	301004	深圳证券交易所	中国大陆	312.00	6,389.76	0.00
177	The Hong Kong and China Gas Co. Ltd.	香港中华煤气	3	香港联合交易所	中国香港	600.00	5,955.40	0.00
178	Kuaishou Technology	快手-W	1024	香港联合交易所	中国香港	100.00	5,890.81	0.00
179	Shenzhen Tongye Technology Co., Ltd.	通业科技	300960	深圳证券交易所	中国大陆	234.00	5,833.62	0.00
180	Haier Smart Home Co., Ltd.	海尔智家	6690	香港联合交易所	中国香港	200.00	5,387.98	0.00

181	Guangdong Kitech New Material Holding Co., Ltd.	奇德新材	300995	深圳证券交易所	中国大陆	191.00	5,292.61	0.00
182	Jiangsu Jingxue Insulation Technology Co., Ltd.	晶雪节能	301010	深圳证券交易所	中国大陆	218.00	5,227.64	0.00
183	Zhejiang Taifu Pump Co., Ltd	泰福泵业	300992	深圳证券交易所	中国大陆	200.00	4,950.00	0.00
184	Huitong Construction Group Co., Ltd.	汇通集团	603176	上海证券交易所	中国大陆	1,924.00	4,713.80	0.00
185	Microport Cardioflow Medtech Corporation	心通医疗-B	2160	香港联合交易所	中国香港	1,000.00	3,164.11	0.00

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holdings Ltd	700 HK	313,502,860.25	21.26
2	Ganfeng Lithium Co., Ltd.	1772 HK	245,822,575.02	16.67
3	Pinduoduo Inc.	PDD US	236,828,603.28	16.06
4	BYD Company Limited	1211 HK	235,115,004.90	15.94
5	Techtronic Industries Co. Ltd.	669 HK	215,439,606.40	14.61
6	China Mobile Limited	941 HK	213,161,145.08	14.45
7	Meituan	3690 HK	209,578,449.37	14.21
8	Sea Ltd	SE US	198,056,947.93	13.43
9	Vipshop Holdings	VIPS US	192,854,377.91	13.08



	Ltd			
10	Dongyue Group Limited	189 HK	191,788,677.16	13.00
11	Cansino Biologics Inc.	6185 HK	176,582,634.81	11.97
12	China Resources Land Limited	1109 HK	171,455,120.60	11.62
13	Genscript Biotech Corporation	1548 HK	167,212,068.98	11.34
14	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	2382 HK	151,131,771.60	10.25
15	Contemporary Amperex Technology Co., Limited	300750 SZ	146,140,955.00	9.91
16	Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd.	3898 HK	144,401,290.33	9.79
		688187 SH	1,062,683.70	0.07
17	China Overseas Property Holdings Limited	2669 HK	141,745,865.48	9.61
18	Hygeia Healthcare Holdings Co., Limited	6078 HK	139,670,349.31	9.47
19	Wuxi Apptec Co., Ltd.	2359 HK	133,713,634.33	9.07
		603259 SH	4,680,000.00	0.32
20	ACM Research, Inc.	ACMR US	135,359,746.60	9.18
21	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	128,571,359.42	8.72
22	Tsingtao Brewery Company Limited	168 HK	125,298,281.10	8.50
23	RLX Technology Inc.	RLX US	124,327,069.02	8.43
24	Baidu, Inc.	BIDU US	121,131,625.20	8.21
25	Smoore International Holdings Limited	6969 HK	118,190,079.49	8.01
26	Zhongsheng Group Holdings Ltd	881 HK	117,898,093.41	7.99
27	Jiangsu Eastern	000301 SZ	112,829,093.00	7.65

	Shenghong Co., Ltd.			
28	Innovent Biologics, Inc.	1801 HK	111,005,843.32	7.53
29	China Longyuan Power Group Corporation Limited	916 HK	107,089,200.70	7.26
30	Futu Holdings Ltd	FUTU US	106,998,741.09	7.25
31	Luxshare Precision Industry Co., Ltd.	002475 SZ	106,409,031.91	7.21
32	Kweichow Moutai Co., Ltd.	600519 SH	101,512,215.00	6.88
33	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	2319 HK	99,100,020.89	6.72
34	Longfor Group Holdings Limited	960 HK	97,651,039.42	6.62
35	Yalla Group Ltd	YALA US	95,779,510.18	6.49
36	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	94,640,095.08	6.42
37	Flat Glass Group Co., Ltd	6865 HK	94,455,424.88	6.40
38	Morimatsu International Holdings Company Limited	2155 HK	90,695,291.81	6.15
39	China Resources Beer (Holdings) Company Limited	291 HK	89,938,452.21	6.10
40	Longi Green Energy Technology Co., Ltd.	601012 SH	88,486,872.45	6.00
41	Li Ning Co. Ltd.	2331 HK	85,311,477.20	5.78
42	Jinke Smart Services Group Co., Ltd.	9666 HK	84,055,162.26	5.70
43	Li Auto Inc.	LI US	83,278,920.36	5.65
44	Staar Surgical Co	STAA US	82,702,172.67	5.61
45	Sunac Services Holdings Limited	1516 HK	80,605,380.97	5.47

46	Riyue Heavy Industry Co, Ltd	603218 SH	79,319,262.44	5.38
47	Zhou Hei Ya International Holdings Company Limited	1458 HK	78,288,145.03	5.31
48	Shanghai Fudan Microelectronics Group Co., Ltd.	1385 HK	77,065,236.18	5.23
		688385 SH	55,982.78	0.00
49	Pharmaron Beijing Co., Ltd.	3759 HK	76,144,995.60	5.16
50	ANTA Sports Products Limited	2020 HK	72,801,755.15	4.94
51	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	2269 HK	72,164,120.26	4.89
52	Luoyang Xinqianglian Slewing Bearing Co., Ltd.	300850 SZ	70,227,370.14	4.76
53	Agora, Inc.	API US	66,783,172.49	4.53
54	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	66,552,186.34	4.51
55	Shenzhen International Group Holdings Ltd.	2313 HK	65,832,133.17	4.46
56	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	002304 SZ	64,563,373.17	4.38
57	Carsgen Therapeutics Holdings Limited	2171 HK	64,041,033.40	4.34
58	Shandong Nanshan Aluminium Co., Ltd.	600219 SH	62,850,284.78	4.26
59	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co., Ltd.	600809 SH	61,823,066.11	4.19
60	Taiwan Semiconductor Manufacturing	TSM US	59,539,454.82	4.04

	Co., Ltd.			
61	I-Mab	IMAB US	54,276,695.33	3.68
62	China Resources Mixc Lifestyle Services Limited	1209 HK	53,296,916.76	3.61
63	XinYi Glass Holdings Limited	868 HK	53,233,961.76	3.61
64	DECKERS OUTDOOR CORP	DECK US	53,167,046.42	3.60
65	Gigadevice Semiconductor (Beijing) Inc.	603986 SH	52,884,657.40	3.59
66	Wuxi Autowell Technology Co., Ltd.	688516 SH	52,814,183.35	3.58
67	SJM Holdings Limited	880 HK	51,038,627.28	3.46
68	Chacha Food Company, Limited	002557 SZ	50,708,071.00	3.44
69	Jiangsu Cnano Technology Co., Ltd.	688116 SH	49,770,389.60	3.37
70	Anhui Kouzi Distillery Co., Ltd.	603589 SH	49,406,851.10	3.35
71	Angelalign Technology Inc.	6699 HK	49,240,176.27	3.34
72	CHAOJU EYE CARE HOLDINGS LTD	2219 HK	48,505,385.46	3.29
73	Haier Smart Home Co., Ltd.	6690 HK	48,115,406.63	3.26
74	Hangzhou First Applied Material Co., Ltd.	603806 SH	47,612,768.29	3.23
75	Nari Technology Co., Ltd.	600406 SH	47,281,954.60	3.21
76	iRay Technology Company Limited	688301 SH	46,807,654.80	3.17
77	Fujian Yongfu Power Engineering Co., Ltd	300712 SZ	46,248,337.52	3.14
78	EC Healthcare	2138 HK	45,944,423.92	3.12
79	Xiamen Faratronic	600563 SH	45,430,178.00	3.08

	Co., Ltd.			
80	Anhui Gujing Distillery Company Limited	000596 SZ	45,381,165.90	3.08
81	Weimob Inc.	2013 HK	43,940,039.07	2.98
82	Zhejiang Chint Electrics Co., Ltd.	601877 SH	43,525,422.52	2.95
83	Shenzhen Topband Co., Ltd.	002139 SZ	42,702,382.60	2.90
84	Xiaomi Corporation	1810 HK	42,316,152.31	2.87
85	Cathay Media And Education Group Inc.	1981 HK	41,155,567.52	2.79
86	Xd Inc.	2400 HK	40,386,027.07	2.74
87	The Hong Kong and China Gas Co. Ltd.	3 HK	39,284,211.38	2.66
88	Chinasoft International Ltd.	354 HK	38,855,549.24	2.63
89	Zijin Mining Group Company Limited	2899 HK	38,212,837.14	2.59
90	Toly Bread Co., Ltd.	603866 SH	38,008,441.39	2.58
91	China Baoan Group Co., Ltd.	000009 SZ	37,908,923.00	2.57
92	Joy Inc.	YY US	36,277,080.33	2.46
93	Eve Energy Co., Ltd.	300014 SZ	36,041,627.00	2.44
94	Albemarle Corp	ALB US	35,574,777.13	2.41
95	Pylon Technologies Co., Ltd.	688063 SH	34,655,611.51	2.35
96	Tesla, Inc.	TSLA US	31,976,156.99	2.17
97	Levima Advanced Materials Corporation	003022 SZ	31,742,705.10	2.15
98	Wuliangye Yibin Co., Ltd	000858 SZ	31,710,342.00	2.15
99	China Hongqiao Group Limited	1378 HK	31,225,580.60	2.12

100	Sungrow Power Supply Co., Ltd.	300274 SZ	30,850,356.00	2.09
101	Raytron Technology Co., Ltd	688002 SH	30,245,435.20	2.05
102	BYD Electronic (International) Company Limited	285 HK	30,229,134.21	2.05
103	Ping An Bank Co., Ltd.	000001 SZ	30,081,278.00	2.04
104	BOE Varitronix Limited	710 HK	29,817,869.42	2.02
105	Sunac China Holdings Limited	1918 HK	29,804,333.74	2.02
106	Tencent Music Entertainment Group	TME US	29,642,892.42	2.01

### 8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holdings Ltd	700 HK	331,791,710.40	22.50
2	Meituan	3690 HK	242,336,724.61	16.43
3	Ganfeng Lithium Co., Ltd.	1772 HK	233,175,554.23	15.81
4	Pinduoduo Inc.	PDD US	228,789,717.49	15.51
5	Techtronic Industries Co. Ltd.	669 HK	221,155,778.66	15.00
6	Vipshop Holdings Ltd	VIPS US	217,660,252.17	14.76
7	Cansino Biologics Inc.	6185 HK	195,491,731.67	13.26
8	Dongyue Group Limited	189 HK	188,485,006.61	12.78
9	China Mobile Limited	941 HK	180,898,615.30	12.27
10	Hygeia Healthcare Holdings Co., Limited	6078 HK	178,357,323.36	12.09
11	BYD Company Limited	1211 HK	159,955,480.85	10.85
12	Sea Ltd	SE US	158,175,006.91	10.72
13	China Resources Land Limited	1109 HK	158,169,238.44	10.72
14	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	2382 HK	155,106,173.93	10.52

15	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	149,199,175.86	10.12
16	Wuxi Apttec Co., Ltd.	2359 HK	147,196,029.72	9.98
17	ACM Research, Inc.	ACMR US	143,017,031.97	9.70
18	ANTA Sports Products Limited	2020 HK	138,999,748.16	9.42
19	Baidu, Inc.	BIDU US	135,393,921.79	9.18
20	Zhongsheng Group Holdings Ltd	881 HK	130,749,416.18	8.87
21	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	124,001,070.96	8.41
22	Genscript Biotech Corporation	1548 HK	117,088,940.76	7.94
23	Jinke Smart Services Group Co., Ltd.	9666 HK	114,254,053.68	7.75
24	Smoore International Holdings Limited	6969 HK	111,333,985.98	7.55
25	Flat Glass Group Co., Ltd	6865 HK	110,287,889.29	7.48
26	RLX Technology Inc.	RLX US	110,052,886.81	7.46
27	China Resources Beer (Holdings) Company Limited	291 HK	107,805,896.49	7.31
28	Riyue Heavy Industry Co, Ltd	603218 SH	103,221,128.00	7.00
29	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	2319 HK	102,450,693.50	6.95
30	Haier Smart Home Co., Ltd.	6690 HK	102,158,379.05	6.93
31	China Resources Mixc Lifestyle Services Limited	1209 HK	95,251,135.28	6.46
32	Contemporary Ampere Technology Co., Limited	300750 SZ	94,988,497.33	6.44
33	Futu Holdings Ltd	FUTU US	94,400,136.86	6.40
34	Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd.	3898 HK	93,227,998.74	6.32
35	Innovent Biologics, Inc.	1801 HK	91,900,291.96	6.23
36	Li Auto Inc.	LI US	91,689,203.60	6.22
37	Li Ning Co. Ltd.	2331 HK	90,163,460.27	6.11

38	Carsgen Therapeutics Holdings Limited	2171 HK	87,942,391.09	5.96
39	Longfor Group Holdings Limited	960 HK	87,157,167.65	5.91
40	Luxshare Precision Industry Co., Ltd.	002475 SZ	86,821,353.94	5.89
41	Longi Green Energy Technology Co., Ltd.	601012 SH	85,626,579.69	5.81
42	XinYi Glass Holdings Limited	868 HK	84,550,763.32	5.73
43	China Longyuan Power Group Corporation Limited	916 HK	83,269,653.53	5.65
44	Joyy Inc.	YY US	82,068,878.73	5.56
45	Luoyang Xinqianglian Slewing Bearing Co., Ltd.	300850 SZ	77,921,127.72	5.28
46	Shenzhen International Group Holdings Ltd.	2313 HK	70,420,651.82	4.77
47	Xiaomi Corporation	1810 HK	67,787,358.50	4.60
48	Albemarle Corp	ALB US	67,118,606.10	4.55
49	Jiangsu Eastern Shenghong Co., Ltd.	000301 SZ	66,404,092.30	4.50
50	Anhui Kouzi Distillery Co., Ltd.	603589 SH	65,832,456.79	4.46
51	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	63,022,593.63	4.27
52	Remegen Co., Ltd.	9995 HK	62,943,203.16	4.27
53	Weimob Inc.	2013 HK	62,650,751.83	4.25
54	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	2269 HK	62,089,616.70	4.21
55	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	TSM US	59,458,858.48	4.03
56	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	002304 SZ	57,244,257.82	3.88
57	Zijin Mining Group Company Limited	2899 HK	55,918,340.05	3.79
58	I-Mab	IMAB US	55,409,513.72	3.76
59	Staar Surgical Co	STAA US	55,000,775.70	3.73
60	Nari Technology Co.,	600406 SH	54,975,432.60	3.73



	Ltd.			
61	Agora, Inc.	API US	54,801,448.40	3.72
62	Pharmaron Beijing Co., Ltd.	3759 HK	54,537,312.55	3.70
63	Yalla Group Ltd	YALA US	51,279,087.74	3.48
64	Sunac Services Holdings Limited	1516 HK	51,024,421.63	3.46
65	Kweichow Moutai Co., Ltd.	600519 SH	47,976,582.38	3.25
66	Raytron Technology Co., Ltd	688002 SH	47,613,823.05	3.23
67	Gigadevice Semiconductor (Beijing) Inc.	603986 SH	46,865,813.74	3.18
68	Xd Inc.	2400 HK	45,151,288.69	3.06
69	DAQO NEW ENERGY CORP.	DQ US	44,200,473.00	3.00
70	SJM Holdings Limited	880 HK	43,581,007.24	2.95
71	Angelalign Technology Inc.	6699 HK	43,072,803.38	2.92
72	The Hong Kong and China Gas Co. Ltd.	3 HK	42,891,102.84	2.91
73	Anhui Gujing Distillery Company Limited	000596 SZ	42,494,948.78	2.88
74	Jiangsu Cnano Technology Co., Ltd.	688116 SH	39,925,751.31	2.71
75	Sungrow Power Supply Co., Ltd.	300274 SZ	39,712,495.18	2.69
76	Zhejiang Chint Electrics Co., Ltd.	601877 SH	38,659,374.90	2.62
77	JD.com, Inc.	9618 HK	30,648,344.94	2.08
		JD US	7,979,179.53	0.54
78	Xiamen Faratronic Co., Ltd.	600563 SH	38,530,217.00	2.61
79	Hangzhou First Applied Material Co., Ltd.	603806 SH	38,442,063.39	2.61
80	Shanghai Fudan Microelectronics Group Co., Ltd.	1385 HK	38,054,959.38	2.58
81	Tesla, Inc.	TSLA US	36,605,971.84	2.48
82	China Tourism Group	601888 SH	36,086,332.70	2.45

	Duty Free Corporation Limited			
83	Eve Energy Co., Ltd.	300014 SZ	35,495,423.30	2.41
84	New Oriental Education & Technology Group Inc.	9901 HK	34,960,155.20	2.37
85	Pop Mart International Group Limited	9992 HK	33,995,170.75	2.31
86	Pylon Technologies Co., Ltd.	688063 SH	33,986,914.58	2.30
87	China Hongqiao Group Limited	1378 HK	31,838,185.27	2.16
88	Changzhou Almaden Co., Ltd.	002623 SZ	31,602,138.00	2.14
89	Levima Advanced Materials Corporation	003022 SZ	30,669,081.30	2.08
90	Cathay Media And Education Group Inc.	1981 HK	30,023,393.57	2.04

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	10,141,096,808.72
卖出收入（成交）总额	9,329,670,040.90

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 申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。

### 8.11.2 申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。

### 8.11.3 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	471,297.77
2	应收证券清算款	13,123,716.10
3	应收股利	188,703.72
4	应收利息	12,702.03
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	13,796,419.62

### 8.11.4 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。

### 8.11.5 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。

### 8.11.6 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

持有人户数(户)	户均持有	持有人结构
----------	------	-------

	的基金份额	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 (%)
183,968	5,828.93	557,701,927.39	52.01	514,635,045.55	47.99

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	2,689,131.08	0.2508

## 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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年08月02日)基金份额总额	247,685,826.01
报告期期初基金份额总额	641,938,422.39
本报告期基金总申购份额	1,289,179,874.65
减：本报告期基金总赎回份额	858,781,324.10
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,072,336,972.94

## § 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

自2021年10月27日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

---

本报告期本基金管理人无重大人事变动。

### **11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### **11.4 基金投资策略的改变**

本报告期本基金投资策略无改变。

### **11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内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的报酬为 7 万元人民币, 其已提供审计服务的连续年限为 19 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**

本报告期内, 基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易		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(%)	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(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
ABCI Securities Co.Ltd	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
ANZ	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
BARCLAYS	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
BNP Paribas	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
BOC HONG KONG BRANCH	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
BOCI Security Limited	0	20,144,099.83	0.10	—	—	—	—	—	—	—	—	20,144.10	0.16	—
BOCOM International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CCB International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CEB International Capital Corporation Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CENTRAL WEALTH SECURITIES INVESTMENT LIMITED	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CIMB Securities Ltd	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CITIC BANK	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CITIC Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CLSA	0	3,324,005.48	0.02	—	—	—	—	—	—	—	—	33,240.05	0.26	—
CMBC Securities Company Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CMFU	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CTI Capital Management	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

Cathay Securities Hong Kong Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Everbright Securities HKLimited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Galaxy International Financial Holdings Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Industrial Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China International Capital Corp LTD	0	242,450,221.48	1.25	—	—	—	—	—	—	—	453,992.49	3.60	—
China Merchant International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Merchants Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Renaissance	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Securities International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Citigroup Global Markets Limited	0	5,376,840,947.23	27.63	—	—	—	—	—	—	—	4,306,200.70	34.17	—
Credit Suisse	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
DBS Vickers	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Daiwa Capital Markets HK Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsche Bank	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Essence International Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
First Shanghai Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
GF Securities HK	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Goldman Sachs	0	5,736,496,020.36	29.48	—	—	—	—	—	—	—	1,508,586.21	11.97	—
Guo Yuan Securities Hong Kong Ltd	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Guosen Securities HK Finacial Holding CO LTD	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

Guotai Junan Securities HK	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
HAITONG INTERNATIONAL	0	3,652,335,932.85	18.77	—	—	—	—	—	—	—	—	1,826,168.12	14.49
HSBC	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Huatai Financial Holdings	0	56,528,216.76	0.29	—	—	—	—	—	—	—	—	493,676.35	3.92
ICBC International Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Instinet Pacific Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
JPMorgan	0	2,482,257.75	0.01	—	—	—	—	—	—	—	—	12,411.29	0.10
Jefferies	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Macquarie Bank Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Merrill Lynch	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Mizuho Securities International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Morgan Stanley	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Nomura International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Orient Securities Hong Kong Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Shenwan Hongyuan Securities H.K. Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Standard Chartered Bank	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
UBS Securities Asia Limited	0	410,860,701.00	2.11	—	—	—	—	—	—	—	—	337,010.37	2.67
UOB Kay Hian Hong Kong Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Zhongtai International Securities Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
长城证券	1	26,583,091.38	0.14	—	—	—	—	—	—	—	—	24,224.83	0.19
德邦证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
东方证券	2	328,278,430.22	1.69	—	—	—	—	—	—	—	—	299,155.60	2.37
国金证券	2	117,139,150.78	0.60	—	—	—	—	—	—	—	—	106,748.88	0.85



国泰君安	1	183,069,160.00	0.94	—	—	—	—	—	—	—	—	166,829.34	1.32	—
国信证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
恒泰证券	2	14,894,634.75	0.08	—	—	—	—	—	—	—	—	13,572.93	0.11	—
华泰证券	2	521,547,859.80	2.68	—	—	—	—	—	—	—	—	475,287.40	3.77	—
申万宏源	1	804,419,432.40	4.13	—	—	—	—	—	—	—	—	733,068.10	5.82	—
信达证券	2	299,421,196.25	1.54	—	—	—	—	—	—	—	—	272,873.26	2.17	—
野村证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	2	561,319,916.91	2.88	—	—	—	—	—	—	—	—	511,531.65	4.06	—
中金财富	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中金公司	1	426,379,399.39	2.19	—	—	—	—	—	—	—	—	388,559.54	3.08	—
中信建投	1	229,663,323.55	1.18	—	—	—	—	—	—	—	—	209,292.13	1.66	—
中信山东	1	12,043,059.30	0.06	—	—	—	—	—	—	—	—	10,975.12	0.09	—
中信证券	2	435,874,224.65	2.24	—	—	—	—	—	—	—	—	397,202.50	3.15	—
中银证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

### 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	富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）关于 2021 年境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定投业务的公告	规定披露媒介	2021 年 01 月 06 日
2	关于富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）暂停大额申购、定投业务的公告	规定披露媒介	2021 年 01 月 14 日
3	关于富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）暂停大额申购、定投业务的公告	规定披露媒介	2021 年 01 月 22 日
4	关于富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）暂停大额申购、定投业务的公告	规定披露媒介	2021 年 01 月 29 日
5	关于富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）暂停大额申购、定投业务的公告	规定披露媒介	2021 年 02 月 06 日

6	关于富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）暂停大额申购、定投业务的公告	规定披露媒介	2021年02月24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	2021年05月06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	2021年05月10日
9	关于富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）暂停大额申购、定投业务的公告	规定披露媒介	2021年06月04日
10	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	2021年07月02日
11	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	2021年07月03日
12	关于富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）暂停大额申购、定投业务的公告	规定披露媒介	2021年08月19日
13	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	2021年08月31日
14	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	2021年09月09日
15	关于富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）暂停大额申购、定投业务的公告	规定披露媒介	2021年10月25日
16	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所上市股票及相关风险提示的公告	规定披露媒介	2021年11月26日
17	富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）关于2021年末及2022年境外	规定披露媒介	2021年12月28日

	主要市场节假日暂停申购、赎回、定投业务的公告		
--	------------------------	--	--

## § 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

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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，根据有关法律法规规定和基金合同的约定，本基金可在符合基金合同约定的投资目标、投资策略、投资范围、资产配置比例和风险收益特征的前提下参与北交所上市股票的投资，但本基金并非必然投资于北交所上市股票。具体可参见基金管理人于 2021 年 11 月 26 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所上市股票及相关风险提示的公告》及基金合同和招募说明书。

## § 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蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）的文件	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。
2、富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）基金合同		
3、富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）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、富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）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		
--------	--	--