

富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）

二〇二二年年度报告

2022年12月31日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023年03月31日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介 .....	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	7
2.5 信息披露方式.....	7
2.6 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告 .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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 .....	12
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 .....	14
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核报告 .....	14
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 .....	16
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 .....	16
§5 托管人报告 .....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	16
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.....	16
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 .....	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17

§7 年度财务报告 .....	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告 .....	57
8.1 期末基金资产组合情况.....	57
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	58
8.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	58
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 .....	59
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	68
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	73
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 .....	73
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.....	73
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.....	73
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 .....	73
8.11 投资组合报告附注.....	73
§9 基金份额持有人信息 .....	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	75
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 .....	75
§10 开放式基金份额变动 .....	75
§11 重大事件揭示 .....	75
11.1 基金份额持有人大会决议.....	75
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 .....	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	75
11.4 基金投资策略的改变.....	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	76
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 .....	76
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	76
11.8 其他重大事件.....	88
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	88
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	88
§13 备查文件目录 .....	88



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）
基金简称	富国红利精选混合（QDII）
基金主代码	009108
交易代码	009108
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年04月23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	406,684,053.76份
基金合同存续期	不定期

注：富国红利精选混合（QDII）含人民币份额（份额代码：009108）及美元现汇份额（份额代码：009193），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	本基金主要投资高股息股票，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，包括境内市场和境外市场的高股息股票。本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例；本基金所指的红利策略是基金管理人从法律法规或监管机构允许投资的股票中，根据特定的筛选流程并结合管理人主动管理能力，精选高现金分红的上市公司股票构建的投资组合；对于境内发行的存托凭证投资，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资；本基金将进行以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，根据需要适度进行债券投资。本基金的资产支持证券投资策略和金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	恒生高股息率指数收益率（经汇率估值调整）*60%+中证红利指数收益率*30%+中债综合财富指数收益率*10%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 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投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	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 Hongkong 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)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	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	2022年	2021年	2020年4月23日 (基金合同生效日) 至2020年12月 31日
本期已实现收益	-193,210,862.65	28,254,743.34	87,676,651.43
本期利润	-150,409,573.54	-43,652,876.56	133,147,546.28
加权平均基金份额本期利润	-0.3557	-0.0999	0.5519
本期加权平均净值利润率	-25.32%	-5.58%	44.26%
本期基金份额净值增长率	-19.26%	5.57%	56.77%
3.1.2 期末数据和指标	2022年12月31日	2021年12月31日	2020年12月31日
期末可供分配利润	44,302,181.41	270,242,199.49	84,187,306.52
期末可供分配基金份额利润	0.1089	0.5529	0.4016
期末基金资产净值	543,403,596.53	808,967,071.70	328,608,419.29
期末基金份额净值	1.3362	1.6550	1.5677
3.1.3 累计期末指标	2022年12月31日	2021年12月31日	2020年12月31日
基金份额累计净值增长率	33.62%	65.50%	56.77%

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

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	3.38%	1.62%	7.34%	1.22%	-3.96%	0.40%
过去六个月	-10.80%	1.35%	-3.16%	1.05%	-7.64%	0.30%
过去一年	-19.26%	1.48%	-4.48%	1.16%	-14.78%	0.32%
自基金合同生效起至今	33.62%	1.50%	2.54%	1.00%	31.08%	0.50%

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



注：1、截止日期为2022年12月31日。

2、本基金于2020年4月23日成立，建仓期6个月，从2020年4月23日起至2020年10月22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：2020 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 2020 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日未进行利润分配

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、

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

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 287 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
汪孟海	本基金前任基金经理	2020-04-23	2022-12-09	13	博士，曾任中国人保资产管理股份有限公司研究员；自 2014 年 8 月加入富国基金管理有限公司，历任 QDII 基金经理助理、QDII 基金经理、高级 QDII 基金经理、海外权益投资部海外权益投资副总监、资深 QDII 基金经理；现任富国基金海外权益投资部海外权益投资总监兼资深 QDII 基金经理。自 2015 年 10 月起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 2017 年 12 月起任富国沪港深行业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
王菀宜	本基金现任基金经理	2020-09-17	—	10	硕士，曾任工银国际股票研究员，摩根士丹利股票分析师，富国资产管理（香港）有限公司高级研究员；自 2018 年 7 月加入富国基金

					管理有限公司，历任 QDII 投资经理；现任富国基金海外权益投资部 QDII 基金经理。自 2020 年 09 月起任富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）基金经理；自 2021 年 07 月起任富国港股通策略精选混合型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 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红利精选混合型证券投资基金（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》、《富国红利精选混合型证券投资基金（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**

港股市场在国内房地产和疫情政策都调整优化后，由于调整力度和时间点均超市场预期，2022 年 11-12 月的最后两个月出现急速反弹。基于恒生指数估值依然具有较高性价比，美国加息节奏放缓，以及国内经济的复苏，因此我们选择了在 4 季度重点加仓了互联网和消费行业。

### **4.5.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.3362 元；份额累计净值为 1.3362 元；本报告期，本基金份额净值增长率为-19.26%，同期业绩比较基准收益率为-4.48%。

## **4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

展望 2023 年，我们对国内经济恢复增长很有信心。同时，伴随着俄乌战争的进展，原油价格大幅回落，欧美的通胀压力从 2022 年 11 月开始也在逐月缓解，市场预计 2023 年海外加息将大幅放缓。以上两重因素，对港股市场盈利修复和估值扩张是双重利好。我们会继续重点关注消费，互联网，医药，地产物业行业，挖掘成长性较好的个股。

## **4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核报告**

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

### **（一）持续推进制度流程建设，保障业务合规开展**

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

### **（二）深入进行新规学习，扎实推动新规落地**

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

### **（三）夯实合规管理架构，强化合规管理职能**

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

#### （四）多措并举，全面提升员工合规意识

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

#### （五）立足于合规，不断拓展风险管理职能

报告期内，公司持续推进旗下组合的投资合规风控阈值多维度排查梳理和日常投资合规监督工作的规范化管理，进一步根据系统升级迭代情况整合优化历史风控工具。公司持续强化合规风控培训工作，提升各部门主动合规的能力和意识。投资风险管理方面，公司针对各类投资品种开展风险管理系列专项工作，加强日常监测和定期风险评估，持续提升对于各类投资标的的风险管理水平。

#### （六）持续推进合规风控工作的系统化建设

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

#### （七）推动反洗钱工作深入开展

公司高度重视反洗钱工作，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求。除在客户尽职调查、大额和可疑交易报告、客户资料和交易记录保存等反洗钱核心义务方面积极履职外，还通过重点专项工作等方式有序推动反洗钱工作深入开展。报告期内，主要重点工作包括机构洗钱和恐怖融资风险自评估、新产品新业务洗钱风险评估、反洗钱系统建设、多层次立体化文化宣贯等。

#### （八）加强内部审计，发挥第三道防线功能

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

#### （九）全面加强员工行为管理

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

#### **4.8 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（2023）审字第 60467606_B161 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	富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的富国红利精选混合型证券投资基金（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，公允反映了富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 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，我们独立于富国红利精选混合型证券投资基金（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	<p>富国红利精选混合型证券投资基金（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任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估富国红利精选混合型证券投资基金（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红利精选混合型证券投资基金（QDII）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，就可能导致对富国红利精选混合型证券投资基金（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红利精选混合型证券投资基金（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。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	王珊珊	费泽旭
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
审计报告日期	2023 年 03 月 29 日	

## § 7 年度财务报告

### 7.1 资产负债表

会计主体：富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	83,499,029.98	229,340,258.18
结算备付金	132,616.98	869,772.60
存出保证金	91,388.95	168,082.01
交易性金融资产	464,500,060.19	604,137,212.96
其中：股票投资	464,454,519.59	604,084,448.82
基金投资	—	—
债券投资	45,540.60	52,764.14
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	5,093,440.01	—
应收股利	51,602.42	59,799.26
应收申购款	241,671.61	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	2,176.56
资产总计	553,609,810.14	834,577,301.57
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末</b> 2022 年 12 月 31 日	<b>上年度末</b> 2021 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	8,512,961.72	15,678,965.25
应付赎回款	539,607.53	7,920,069.61
应付管理人报酬	698,657.91	1,046,251.01
应付托管费	163,020.19	244,125.22
应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—

应交税费	0.35	0.35
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	291,965.91	720,818.43
负债合计	10,206,213.61	25,610,229.87
<b>净资产：</b>		
实收基金	406,684,053.76	488,801,933.30
其他综合收益	—	—
未分配利润	136,719,542.77	320,165,138.40
净资产合计	543,403,596.53	808,967,071.70
负债和净资产总计	553,609,810.14	834,577,301.57

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3362 元，基金份额总额 406,684,053.76 份。

比较数据已根据本年《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）》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 7.2 利润表

会计主体：富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 12 月 31 日)
<b>一、营业总收入</b>	<b>-139,116,222.91</b>	<b>-15,411,346.90</b>
1.利息收入	265,698.47	133,508.65
其中：存款利息收入	265,698.47	133,462.28
债券利息收入	—	46.37
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）	-193,495,954.13	58,300,067.58
其中：股票投资收益	-202,243,858.14	51,302,819.41
基金投资收益	—	—

债券投资收益	84.87	—
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	8,747,819.14	6,997,248.17
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）	42,801,289.11	-71,907,619.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	11,000,573.16	-3,616,720.92
5.其他收入（损失以“-”号填列）	312,170.48	1,679,417.69
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>11,293,350.63</b>	<b>28,241,529.66</b>
1. 管理人报酬	8,953,241.20	11,707,554.56
2. 托管费	2,089,089.63	2,731,762.78
3. 销售服务费	—	—
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	0.54	0.11
8. 其他费用	251,019.26	13,802,212.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-150,409,573.54</b>	<b>-43,652,876.56</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-150,409,573.54</b>	<b>-43,652,876.56</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>-150,409,573.54</b>	<b>-43,652,876.56</b>

注：比较数据已根据本年《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）》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 (2022 年 01 月 01 日至 2022 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（基金净值）	488,801,933.30	320,165,138.40	808,967,071.70

加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	488,801,933.30	320,165,138.40	808,967,071.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	82,117,879.54	183,445,595.63	265,563,475.17
（一）、综合收益总额	—	150,409,573.54	150,409,573.54
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	82,117,879.54	33,036,022.09	115,153,901.63
其中：1.基金申购款	67,029,364.27	29,751,702.13	96,781,066.40
2.基金赎回款	149,147,243.81	62,787,724.22	211,934,968.03
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
（四）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产（基金净值）	406,684,053.76	136,719,542.77	543,403,596.53
项目	上年度可比期间 (2021年01月01日至2021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（基金净值）	209,612,649.30	118,995,769.99	328,608,419.29
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	209,612,649.30	118,995,769.99	328,608,419.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	279,189,284.00	201,169,368.41	480,358,652.41
（一）、综合收益总额	—	43,652,876.56	43,652,876.56
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	279,189,284.00	244,822,244.97	524,011,528.97
其中：1.基金申购款	615,010,322.93	509,161,807.26	1,124,172,130.19
2.基金赎回款	—	—	—

	335,821,038.93	264,339,562.29	600,160,601.22
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
(四)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产（基金净值）	488,801,933.30	320,165,138.40	808,967,071.70

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

富国红利精选混合型证券投资基金（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[2020]277号《关于准予富国红利精选混合型证券投资基金（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向社会公开募集，基金合同于2020年4月23日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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。

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化投资产品。

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或注册上市的股票）、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）；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 60%-95%，其中投资于本基金界定的红利精选股票及存托凭证的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金投资于境外资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除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的高股息股票，其中主要境外市场有：香港等国家或地区。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：恒生高股息率指数收益率（经汇率估值调整）\*60%+中证红利指数收益率\*30%+中债综合财富指数收益率\*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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和中期报告》》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2022年12月31日的财务状况以及2022年1月1日至2022年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

#### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2022年1月1日至2022年12月31日止。

#### **7.4.4.2 记账本位币**

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

#### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

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

##### **(1) 金融资产分类**

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

##### **(2) 金融负债分类**

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### **7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

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

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

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分

别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

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

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

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

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

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变

动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

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

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 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的净值。

(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) 本基金同一类别的每份份额享有同等分配权。

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，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，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**

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会[2022]14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信



用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币229,340,258.18元，自应收利息转入的重分类金额为人民币1,652.05元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币229,341,910.23元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币869,772.60元，自应收利息转入的重分类金额为人民币430.54元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币870,203.14元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币168,082.01元，自应收利息转入的重分类金额为人民币83.16元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币168,165.17元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币2,176.56元，转出至银行存款的重分类金额为人民币1,652.05元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币430.54元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币83.16元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币10.81元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 604,137,212.96 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 10.81 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 604,137,223.77 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### **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，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；

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 (2022年12月31日)	上年度末 (2021年12月31日)
活期存款	83,499,029.98	229,340,258.18
等于：本金	83,495,386.25	229,340,258.18
加：应计利息	3,643.73	—
减：坏账准备	—	—
定期存款	—	—
等于：本金	—	—
加：应计利息	—	—
减：坏账准备	—	—
其中：存款期限1个月以内	—	—
存款期限1-3个月	—	—

存款期限 3 个月以上	—	—
其他存款	—	—
等于：本金	—	—
加：应计利息	—	—
减：坏账准备	—	—
合计	83,499,029.98	229,340,258.18

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	2022年12月31日				
	外币本金	外币应计利息	外币金额	折算汇率	折合人民币
港币	47,155,448.60	0.00	47,155,448.60	0.8933	42,122,547.57
美元	2,009,679.87	2.00	2,009,681.87	6.9646	13,996,630.35
合计					56,119,177.92
币种	2021年12月31日				
	外币本金	外币应计利息	外币金额	折算汇率	折合人民币
港币	138,061,970.69	0.00	138,061,970.69	0.8176	112,879,467.24
美元	16,426,506.35	0.00	16,426,506.35	6.3757	104,730,476.53
合计					217,609,943.77

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2022年12月31日）				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	448,093,679.91	—	464,454,519.59	16,360,839.68	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	41,800.00	16.22	45,540.60	3,724.38
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	41,800.00	16.22	45,540.60	3,724.38
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	448,135,479.91	16.22	464,500,060.19	16,364,564.06	
项目	上年度末（2021年12月31日）				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	630,532,138.01	—	604,084,448.82	26,447,689.19	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	41,800.00	—	52,764.14	10,964.14
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	41,800.00	—	52,764.14	10,964.14
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	

合计	630,573,938.01	—	604,137,212.96	26,436,725.05
----	----------------	---	----------------	---------------

### 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

单位：人民币元

项目	本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
应收利息	—	2,176.56
其他应收款	—	—
待摊费用	—	—
合计	—	2,176.56

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	999.96	17,805.08
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	127,965.95	533,013.35
其中：交易所市场	127,965.95	533,013.35
银行间市场	—	—
应付利息	—	—
预提审计费	43,000.00	50,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	291,965.91	720,818.43

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	488,801,933.30	488,801,933.30
本期申购	67,029,364.27	67,029,364.27
本期赎回（以“-”号填列）	-149,147,243.81	-149,147,243.81
本期末	406,684,053.76	406,684,053.76

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

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
本期期初	270,242,199.49	49,922,938.91	320,165,138.40
本期利润	193,210,862.65	42,801,289.11	150,409,573.54
本期基金份额交易产生的变动数	-32,729,155.43	-306,866.66	-33,036,022.09
其中：基金申购款	21,341,402.05	8,410,300.08	29,751,702.13
基金赎回款	-54,070,557.48	-8,717,166.74	-62,787,724.22
本期已分配利润	—	—	—
本期末	44,302,181.41	92,417,361.36	136,719,542.77

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
活期存款利息收入	256,828.89	117,441.08
定期存款利息收入	—	—
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	6,529.68	9,256.75
其他	2,339.90	6,764.45
合计	265,698.47	133,462.28

#### 7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
卖出股票成交总额	2,283,629,265.39	4,143,416,826.02
减：卖出股票成本总额	2,478,090,517.90	4,092,114,006.61
减：交易费用	7,782,605.63	—

买卖股票差价收入	-202,243,858.14	51,302,819.41
----------	-----------------	---------------

#### 7.4.7.11 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。

#### 7.4.7.12 债券投资收益

##### 7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
债券投资收益——利息收入	84.87	—
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	—	—
合计	84.87	—

注：本基金上年度可比期间无债券投资收益。

##### 7.4.7.12.2 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。

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.13.1 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。

##### 7.4.7.13.2 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。

#### 7.4.7.14 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。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 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。

##### 7.4.7.15.2 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。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
股票投资产生的股利收益	8,747,819.14	6,997,248.17
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	8,747,819.14	6,997,248.17

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
1. 交易性金融资产	42,801,289.11	-71,907,619.90
股票投资	42,808,528.87	-71,907,222.80
债券投资	-7,239.76	-397.10
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	42,801,289.11	-71,907,619.90

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
----	-----------------------------	----------------------------------



		日)
基金赎回费收入	312,170.48	1,679,417.69
合计	312,170.48	1,679,417.69

#### 7.4.7.19 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
审计费用	43,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
交易费用	—	13,469,629.91
银行费用	48,774.61	67,194.61
其他	39,244.65	95,387.69
合计	251,019.26	13,802,212.21

#### 7.4.7.21 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
山东省国际信托股份有限公司	基金管理人的股东（2022年12月22日前）
山东省金融资产管理股份有限公司	基金管理人的股东（自2022年12月22日起）
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
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

注：（1）根据富国基金管理有限公司股东会决议，并经中国证监会《关于核准富

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

(2) 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2022年01月01日至2022年12月31日)		上年度可比期间(2021年01月01日至2021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	112,886,478.38	2.47	1,237,703,297.02	14.36
申万宏源	159,821,099.59	3.49	344,940,183.95	4.00

##### 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

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 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 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（2022年01月01日至2022年12月31日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	143,143.74	5.31	27,719.10	21.66
HAITONG INTERNATIONAL	56,443.25	2.09	—	0.00
关联方名称	上年度可比期间（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	314,344.11	5.42	100,982.81	18.95
HAITONG INTERNATIONAL	618,851.82	10.68	—	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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	8,953,241.20	11,707,554.56
其中：支付销售机构的客户维护费	3,917,815.62	4,926,989.03

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	2,089,089.63	2,731,762.78

注：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。

#### 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（2022年01月01日至2022年12月31日）		上年度可比期间（2021年01月01日至2021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公司	55,191,625.35	163,259.37	214,536,518.34	1,213.93
招商银行股份有限公司	28,307,404.63	93,569.52	14,803,739.84	116,227.15

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均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（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

###### 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301115	建科股份	2022-08-23	6 个月	新股限售	42.05	24.04	635	26,701.75	15,265.40	—
301152	天力锂能	2022-08-19	6 个月	新股限售	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	—
301269	华大九天	2022-07-21	6 个月	新股限售	32.69	87.94	690	22,556.10	60,678.60	—
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6 个月	新股限售	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	—
301283	聚胶股份	2022-08-26	6 个月	新股限售	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	—
301309	万得凯	2022-09-08	6 个月	新股限售	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	—
301327	华宝新能	2022-09-08	6 个月	新股限售	237.50	176.97	230	54,625.00	40,703.10	—
301349	信德新材	2022-08-30	6 个月	新股限售	138.88	103.52	131	18,193.28	13,561.12	—

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

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## **7.4.13 金融工具风险及管理**

### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有同一机构（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，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。



单位：人民币元

本期末（2022年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	83,499,029.98	—	—	—	—	—	83,499,029.98
结算备付金	132,616.98	—	—	—	—	—	132,616.98
存出保证金	91,388.95	—	—	—	—	—	91,388.95
交易性金融资产	—	—	45,540.60	—	—	464,454,519.59	464,500,060.19
应收清算款	—	—	—	—	—	5,093,440.01	5,093,440.01
应收股利	—	—	—	—	—	51,602.42	51,602.42
应收申购款	2,390.00	—	—	—	—	239,281.61	241,671.61
资产总计	83,725,425.91	—	45,540.60	—	—	469,838,843.63	553,609,810.14
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	8,512,961.72	8,512,961.72
应付赎回款	—	—	—	—	—	539,607.53	539,607.53
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	698,657.91	698,657.91
应付托管费	—	—	—	—	—	163,020.19	163,020.19
应交税费	—	—	—	—	—	0.35	0.35
其他负债	—	—	—	—	—	291,965.91	291,965.91
负债总计	—	—	—	—	—	10,206,213.61	10,206,213.61
利率敏感度缺口	83,725,425.91	—	45,540.60	—	—	459,632,630.02	543,403,596.53
上年度末（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	229,340,258.18	—	—	—	—	—	229,340,258.18
结算备付金	869,772.60	—	—	—	—	—	869,772.60
存出保证金	168,082.01	—	—	—	—	—	168,082.01
交易性金融资产	—	—	52,764.14	—	—	604,084,448.82	604,137,212.96
应收股利	—	—	—	—	—	59,799.26	59,799.26
其他资产	—	—	—	—	—	2,176.56	2,176.56
资产总计	230,378,112.79	—	52,764.14	—	—	604,146,424.64	834,577,301.57
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	15,678,965.25	15,678,965.25
应付赎回款	—	—	—	—	—	7,920,069.61	7,920,069.61
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,046,251.01	1,046,251.01
应付托管费	—	—	—	—	—	244,125.22	244,125.22
应交税费	—	—	—	—	—	0.35	0.35
其他负债	—	—	—	—	—	720,818.43	720,818.43
负债总计	—	—	—	—	—	25,610,229.87	25,610,229.87
利率敏感度缺口	230,378,112.79	—	52,764.14	—	—	578,536,194.77	808,967,071.70

#### 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（2022年12月31日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
银行存款	13,996,630.35	42,122,547.57	—	—	56,119,177.92
交易性金融资产	60,484,052.97	366,941,955.70	—	—	427,426,008.67
应收股利	—	51,602.42	—	—	51,602.42
应收清算款	4,161,730.16	—	—	—	4,161,730.16
应收申购款	73,060.12	—	—	—	73,060.12
资产合计	78,715,473.60	409,116,105.69	—	—	487,831,579.29
以外币计价的负债					
应付清算款	—	8,512,961.72	—	—	8,512,961.72
应付赎回款	40,767.15	—	—	—	40,767.15
其他负债	96.11	—	—	—	96.11
负债合计	40,863.26	8,512,961.72	—	—	8,553,824.98
资产负债表外汇风险敞口净额	78,674,610.34	400,603,143.97	—	—	479,277,754.31
项目	上年度末（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	104,730,476.53	112,879,467.24	—	—	217,609,943.77
交易性金融资产	29,710,062.01	427,454,996.06	—	—	457,165,058.07
应收股利	—	59,799.26	—	—	59,799.26
其他资产	7.78	—	—	—	7.78
资产合计	134,440,546.32	540,394,262.56	—	—	674,834,808.88
以外币计价的负债					
应付清算款	—	14,152,749.60	—	—	14,152,749.60

应付赎回款	306,396.38	—	—	—	306,396.38
其他负债	1,093.94	—	—	—	1,093.94
负债合计	307,490.32	14,152,749.60	—	—	14,460,239.92
资产负债表外汇风险敞口净额	134,133,056.00	526,241,512.96	—	—	660,374,568.96

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化 1%，其他变量不变；(2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币贬值 1%	-4,006,031.44	-5,262,415.13
	港币相对人民币升值 1%	4,006,031.44	5,262,415.13
	美元相对人民币贬值 1%	-786,746.10	-1,341,330.56
	美元相对人民币升值 1%	786,746.10	1,341,330.56

#### 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。本基金的投资范围包括但不限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、金融衍生品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关要求）。

---

#### 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；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化投资产品。

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或注册上市的股票）、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）；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 60%-95%，其中投资于本基金界定的红利精选股票及存托凭证的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金投资于境外资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除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的高股息股票，其中主要境外市场有：香港等国家或地区。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。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2022年12月31日）		上年度末（2021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	464,454,519.59	85.47	604,084,448.82	74.67
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	45,540.60	0.01	52,764.14	0.01
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	0.00
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	464,500,060.19	85.48	604,137,212.96	74.68

#### 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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	4,999,745.02	6,763,947.86

	2. 业绩比较基准减少 1%	-4, 999, 745. 02	-6, 763, 947. 86
--	----------------	------------------	------------------

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 (2022 年 12 月 31 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
第一层次	464, 325, 147. 79	576, 458, 788. 87
第二层次	—	—
第三层次	174, 912. 40	27, 678, 424. 09
合计	464, 500, 060. 19	604, 137, 212. 96

###### 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（2022年01月01日至2022年12月31日）		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	—	27,678,424.09	27,678,424.09
当期购买	—	180,351.26	180,351.26
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	26,451,469.51	26,451,469.51
当期利得或损失总额	—	-1,232,393.44	-1,232,393.44
其中：计入损益的利得或损失	—	-1,232,393.44	-1,232,393.44
期末余额	—	174,912.40	174,912.40
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	—	-5,438.86	-5,438.86
项目	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	—	1,714,383.21	1,714,383.21
当期购买	—	46,150,723.91	46,150,723.91
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	1,239,565.68	1,239,565.68
当期利得或损失总额	—	-18,947,117.35	18,947,117.35
其中：计入损益的利得或损失	—	-18,947,117.35	18,947,117.35
期末余额	—	27,678,424.09	27,678,424.09
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	—	-18,472,299.82	18,472,299.82



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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	174,912.40	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2127-0.6384	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	27,678,424.09	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	0.3548-1.7700	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	464,454,519.59	83.90
	其中：普通股	403,970,466.62	72.97
	存托凭证	60,484,052.97	10.93
	房地产信托凭证	—	0.00
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	45,540.60	0.01
	其中：债券	45,540.60	0.01
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	0.00
	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	83,631,646.96	15.11
8	其他各项资产	5,478,102.99	0.99
9	合计	553,609,810.14	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	366,941,955.70	67.53
美国	60,484,052.97	11.13
中国大陆	37,028,510.92	6.81
合计	464,454,519.59	85.47

## 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 (%)
非日常生活消费品	116,738,752.94	21.48
工业	72,543,476.86	13.35
医疗保健	59,160,032.63	10.89
房地产	50,276,136.66	9.25
日常消费品	48,868,593.36	8.99
通信服务	34,134,777.65	6.28
信息技术	30,267,679.83	5.57
金融	22,347,397.46	4.11
公用事业	20,914,300.23	3.85

原材料	9,203,371.97	1.69
合计	464,454,519.59	85.47

#### 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	Tsingtao Brewery Company Limited	青岛啤酒	168	香港联合交 易所	中国香港	486,000.00	33,471,362.86	6.16
2	China Overseas Property Holdings Limited	中海物业	2669	香港联合交 易所	中国香港	3,210,000.00	23,311,935.17	4.29
3	Morimatsu Internationa l Holdings Company Limited	森松国际	2155	香港联合交 易所	中国香港	2,754,000.00	21,328,768.58	3.93
4	Dongfang Electric Corporation Limited	东方电气	1072	香港联合交 易所	中国香港	984,600.00	11,679,941.17	2.15
			600875	上海证券交 易所	中国大陆	364,500.00	7,661,790.00	1.41
5	Alibaba Group Holding Limited	阿里巴巴-SW	9988	香港联合交 易所	中国香港	198,300.00	15,277,931.79	2.81
			BABA	美国证券交 易所	美国	5,500.00	3,374,313.88	0.62
6	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700	香港联合交 易所	中国香港	60,000.00	17,901,130.80	3.29
7	Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd.	时代电气	3898	香港联合交 易所	中国香港	504,700.00	17,469,793.05	3.21
8	Pinduoduo Inc.	拼多多	PDD	美国证券交 易所	美国	24,499.00	13,914,528.72	2.56
9	China Resources Gas	华润燃气	1193	香港联合交 易所	中国香港	463,300.00	12,125,863.34	2.23

	Group Limited							
10	Shanghai Pharmaceutic als Holding Co.,Ltd	上海医药	2607	香港联合交 易所	中国香港	993,300.00	11,516,960.48	2.12
11	NWS Holdings Ltd.	新创建集团	659	香港联合交 易所	中国香港	1,836,000.00	11,070,295.11	2.04
12	Yuexiu Property Company Limited	越秀地产	123	香港联合交 易所	中国香港	1,302,000.00	10,990,704.75	2.02
13	Carsgen Therapeutics Holdings Limited	科济药业-B	2171	香港联合交 易所	中国香港	807,500.00	10,805,306.56	1.99
14	Flat Glass Group Co., Ltd	福莱特	6865	香港联合交 易所	中国香港	615,000.00	10,371,936.62	1.91
15	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	中国平安	2318	香港联合交 易所	中国香港	214,000.00	9,873,402.64	1.82
16	Galaxy Entertainmen t Group Limited	银河娱乐	27	香港联合交 易所	中国香港	200,000.00	9,218,546.40	1.70
17	Meituan	美团-W	3690	香港联合交 易所	中国香港	56,000.00	8,739,039.06	1.61
18	Dada Nexus Ltd	达达集团	DADA	美国证券交 易所	美国	180,000.00	8,737,787.16	1.61
19	Sands China Ltd.	金沙中国有限公 司	1928	香港联合交 易所	中国香港	377,600.00	8,736,037.68	1.61
20	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	蒙牛乳业	2319	香港联合交 易所	中国香港	263,000.00	8,316,522.35	1.53
21	Hutchmed (China) Limited	和黄医药	13	香港联合交 易所	中国香港	376,500.00	8,071,587.72	1.49
22	China Longyuan Power Group Corporation	龙源电力	916	香港联合交 易所	中国香港	900,000.00	7,669,616.22	1.41

	Limited							
23	Hangzhou Tigermed Consulting Co., Ltd	泰格医药	3347	香港联合交易所	中国香港	91,900.00	7,404,654.47	1.36
24	MINISO Group Holding Ltd	名创优品	MNSO	美国证券交易所	美国	97,537.00	7,288,955.42	1.34
25	China Life Insurance Company Limited	中国人寿	2628	香港联合交易所	中国香港	600,000.00	7,181,890.80	1.32
26	EC Healthcare	医思健康	2138	香港联合交易所	中国香港	996,000.00	7,144,266.27	1.31
27	Tencent Music Entertainment Group	腾讯音乐	TME	美国证券交易所	美国	115,000.00	6,631,692.12	1.22
28	Hello Group Inc.	挚文集团	MOMO	美国证券交易所	美国	105,000.00	6,566,921.34	1.21
29	聚和材料	聚和材料	688503	上海证券交易所	中国大陆	41,090.00	6,126,929.90	1.13
30	Crown Advanced Material Co., Ltd.	明冠新材	688560	上海证券交易所	中国大陆	129,240.00	5,983,812.00	1.10
31	H World Group Limited	华住集团-S	1179	香港联合交易所	中国香港	190,600.00	5,729,156.87	1.05
32	Shenzhen New Industries Biomedical Engineering Co., Ltd.	新产业	300832	深圳证券交易所	中国大陆	104,200.00	5,224,588.00	0.96
33	China Taiping Insurance Holdings Company Limited	中国太平	966	香港联合交易所	中国香港	600,000.00	5,209,550.64	0.96
34	Vipshop Holdings Ltd	唯品会	VIPS	美国证券交易所	美国	52,029.00	4,942,606.41	0.91
35	Fuyao Glass Industry Group Co., Ltd.	福耀玻璃	3606	香港联合交易所	中国香港	157,200.00	4,598,821.94	0.85
36	Luzhou	泸州老窖	000568	深圳证券交易所	中国大陆	20,000.00	4,485,600.00	0.83

	Laojiao Co., Ltd			易所				
37	Poly Property Services Co., Ltd.	保利物业	6049	香港联合交易所	中国香港	106,400.00	4,376,772.88	0.81
38	Yuexiu Services Group Limited	越秀服务	6626	香港联合交易所	中国香港	1,443,000.00	4,266,552.30	0.79
39	SciClone Pharmaceuticals (Holdings) Limited	赛生药业	6600	香港联合交易所	中国香港	550,000.00	4,072,864.57	0.75
40	BYD Electronic (International) Company Limited	比亚迪电子	285	香港联合交易所	中国香港	181,000.00	4,058,214.94	0.75
41	Viva Biotech Holdings	维亚生物	1873	香港联合交易所	中国香港	2,500,000.00	3,908,056.25	0.72
42	Minth Group Limited	敏实集团	425	香港联合交易所	中国香港	188,000.00	3,551,820.17	0.65
43	Shanghai Fudan Microelectronics Group Co., Ltd.	复旦微电子	1385	香港联合交易所	中国香港	132,000.00	3,478,393.38	0.64
44	New Oriental Education & Technology Group Inc.	新东方-S	9901	香港联合交易所	中国香港	600.00	15,274.92	0.00
			EDU	美国证券交易所	美国	14,046.00	3,406,258.55	0.63
45	Semiconductor Manufacturing International Corporation	中芯国际	981	香港联合交易所	中国香港	225,500.00	3,367,949.48	0.62
46	Geely Automobile Holdings Limited	吉利汽车	175	香港联合交易所	中国香港	330,000.00	3,360,481.74	0.62
47	Genscript Biotech	金斯瑞生物科技	1548	香港联合交易所	中国香港	150,000.00	3,329,663.93	0.61

	Corporation							
48	Avic Heavy Machinery Co., Ltd.	中航重机	600765	上海证券交易所	中国大陆	100,000.00	3,109,000.00	0.57
49	KWG Group Holdings Limited	合景泰富集团	1813	香港联合交易所	中国香港	1,854,000.00	3,080,388.00	0.57
50	NetEase, Inc	网易-S	NTES	美国证券交易所	美国	6,000.00	3,035,033.39	0.56
51	Tiangong International Company Limited	天工国际	826	香港联合交易所	中国香港	1,084,000.00	2,788,717.48	0.51
52	China traditional chinese medicine holdings co. Limited	中国中药	570	香港联合交易所	中国香港	720,000.00	2,283,198.12	0.42
53	Bosideng International Holdings Ltd.	波司登	3998	香港联合交易所	中国香港	650,000.00	2,154,120.61	0.40
54	GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	巨子生物	2367	香港联合交易所	中国香港	70,200.00	2,106,973.81	0.39
55	Ke Holdings Inc.	贝壳-W	BEKE	美国证券交易所	美国	20,000.00	1,944,516.32	0.36
56	China Tourism Group Duty Free Corporation Limited	中国中免	601888	上海证券交易所	中国大陆	8,000.00	1,728,240.00	0.32
57	Willfar Information Technology Co., Ltd.	威胜信息	688100	上海证券交易所	中国大陆	63,232.00	1,460,026.88	0.27
58	Melco International Development Ltd.	新濠国际发展	200	香港联合交易所	中国香港	189,000.00	1,428,285.13	0.26
59	Cowell Holdings Inc.	高伟电子	1415	香港联合交易所	中国香港	124,000.00	1,202,913.11	0.22

60	China Resources Power Holdings Co. Ltd.	华润电力	836	香港联合交易所	中国香港	70,000.00	997,961.24	0.18
61	China SCE Group Holdings Limited	中骏集团控股	1966	香港联合交易所	中国香港	1,078,000.00	943,686.16	0.17
62	Chervon Holdings Limited	泉峰控股	2285	香港联合交易所	中国香港	22,200.00	853,707.07	0.16
63	Yum China Holdings, Inc.	百胜中国-S	9987	香港联合交易所	中国香港	1,900.00	745,076.51	0.14
64	Gushengtang Holdings Limited	固生堂	2273	香港联合交易所	中国香港	14,700.00	663,118.98	0.12
65	Zai Lab Limited	再鼎医药-SB	ZLAB	美国证券交易所	美国	3,000.00	641,439.66	0.12
66	Greentown China Holdings Limited	绿城中国	3900	香港联合交易所	中国香港	54,500.00	554,988.65	0.10
67	Pharmaron Beijing Co., Ltd.	康龙化成	3759	香港联合交易所	中国香港	11,200.00	541,750.39	0.10
68	Helens International Holdings Company Limited	海伦司	9869	香港联合交易所	中国香港	40,000.00	529,530.46	0.10
69	Sun Hung Kai Properties Ltd.	新鸿基地产	16	香港联合交易所	中国香港	5,000.00	477,006.18	0.09
70	Maoyan Entertainment	猫眼娱乐	1896	香港联合交易所	中国香港	59,000.00	474,853.40	0.09
71	Shenzhen Hello Energy Co., Ltd	华宝新能	301327	深圳证券交易所	中国大陆	2,296.00	429,627.60	0.08
72	Hygeia	海吉亚医疗	6078	香港联合交	中国香港	8,000.00	400,184.96	0.07



	Healthcare Holdings Co., Limited			易所				
73	Ping An Healthcare And Technology Company Limited	平安好医生	1833	香港联合交易所	中国香港	13,900.00	264,470.45	0.05
74	Shanghai Junshi Biosciences Co., Ltd.	君实生物	1877	香港联合交易所	中国香港	6,000.00	259,941.57	0.05
75	C&D International Investment Group Limited	建发国际集团	1908	香港联合交易所	中国香港	12,000.00	243,862.71	0.04
76	Samsonite International S.A.	新秀丽	1910	香港联合交易所	中国香港	11,400.00	209,266.36	0.04
77	China Yongda Automobiles Services Holdings Limited	永达汽车	3669	香港联合交易所	中国香港	37,000.00	191,695.74	0.04
78	Liaoning Xinde New Material Technology Co., Ltd.	信德新材	301349	深圳证券交易所	中国大陆	1,307.00	143,462.08	0.03
79	China Power International Development Limited	中国电力	2380	香港联合交易所	中国香港	41,000.00	120,859.43	0.02
80	Luoyang Glass Company Limited	洛阳玻璃	1108	香港联合交易所	中国香港	16,000.00	117,197.02	0.02
81	CMOC Group Limited	洛阳钼业	3993	香港联合交易所	中国香港	36,000.00	115,767.79	0.02
82	首创证券	首创证券	601136	上海证券交易所	中国大陆	4,739.00	82,553.38	0.02
83	Beijing Jiaman Dress	嘉曼服饰	301276	深圳证券交易所	中国大陆	3,026.00	70,269.50	0.01

	Co.,Ltd							
84	尚太科技	尚太科技	001301	深圳证券交易 所	中国大陆	1,164.00	68,722.56	0.01
85	Empyrean Technology Co., Ltd.	华大九天	301269	深圳证券交易 所	中国大陆	690.00	60,678.60	0.01
86	Wus Printed Circuit (Kunshan) Co.,Ltd.	沪电股份	002463	深圳证券交易 所	中国大陆	4,800.00	57,120.00	0.01
87	Zhejiang Wandekai Fluid Equipment Technology Co.,Ltd.	万得凯	301309	深圳证券交易 所	中国大陆	2,271.00	56,692.74	0.01
88	Shenzhen Capchem Technology Co.,Ltd.	新宙邦	300037	深圳证券交易 所	中国大陆	1,260.00	54,772.20	0.01
89	Inner Mongolia Ojing Science & Technology Co., Ltd.	欧晶科技	001269	深圳证券交易 所	中国大陆	546.00	54,185.04	0.01
90	China Resources Beer (Holdings) Company Limited	华润啤酒	291	香港联合交 易所	中国香港	1,000.00	48,727.88	0.01
91	Swire Properties Limited	太古地产	1972	香港联合交 易所	中国香港	2,400.00	42,533.94	0.01
92	China Resources Land Limited	华润置地	1109	香港联合交 易所	中国香港	1,000.00	31,934.40	0.01
93	State Power Rixin Tech. Co.,Ltd	国能日新	301162	深圳证券交易 所	中国大陆	334.00	29,331.88	0.01
94	Keymed Biosciences	康诺亚-B	2162	香港联合交 易所	中国香港	500.00	22,778.39	0.00

	Inc.							
95	Xinxiang Tianli Energy Co., Ltd	天力锂电	301152	深圳证券交易所	中国大陆	433.00	20,195.12	0.00
96	Joy Kie Corporation Limited.	久祺股份	300994	深圳证券交易所	中国大陆	1,000.00	19,720.00	0.00
97	Ganzhou Tengyuan Cobalt New Material Co., Ltd.	腾远钴业	301219	深圳证券交易所	中国大陆	223.00	15,371.39	0.00
98	Changzhou Architectural Research Institute Group Co., Ltd	建科股份	301115	深圳证券交易所	中国大陆	635.00	15,265.40	0.00
99	云中马	云中马	603130	上海证券交易所	中国大陆	480.00	13,176.00	0.00
100	炜冈科技	炜冈科技	001256	深圳证券交易所	中国大陆	474.00	12,390.36	0.00
101	光华股份	光华股份	001333	深圳证券交易所	中国大陆	426.00	12,332.70	0.00
102	Focus Hotmelt Company Ltd.	聚胶股份	301283	深圳证券交易所	中国大陆	235.00	12,081.35	0.00
103	Sunac Services Holdings Limited	融创服务	1516	香港联合交易所	中国香港	3,000.00	11,255.20	0.00
104	Zhejiang Zhengte Co., Ltd.	浙江正特	001238	深圳证券交易所	中国大陆	374.00	10,797.38	0.00
105	Shandong Sinoglory Health Food Co., Ltd.	嘉华股份	603182	上海证券交易所	中国大陆	546.00	9,778.86	0.00
106	Ganfeng Lithium Group Co., Ltd.	赣锋锂业	1772	香港联合交易所	中国香港	160.00	8,332.42	0.00
107	Asymchem Laboratories (Tianjin) Co., Ltd.	凯莱英医药集团	6821	香港联合交易所	中国香港	80.00	8,203.79	0.00

108	Jd Health International Inc.	京东健康	6618	香港联合交易所	中国香港	100.00	6,373.48	0.00
109	Zylox-Tonbridge Medical Technology Co., Ltd.	归创通桥-B	2190	香港联合交易所	中国香港	500.00	5,734.79	0.00
110	JD.com, Inc.	京东集团-SW	9618	香港联合交易所	中国香港	17.00	3,343.87	0.00
111	Cimc Vehicles (Group) Co., Ltd.	中集车辆	1839	香港联合交易所	中国香港	500.00	2,148.31	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	China Mobile Limited	941 HK	64,493,000.64	7.97
2	Tencent Holdings Ltd	700 HK	57,585,813.48	7.12
3	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	39,973,740.06	4.94
		BABA US	8,114,061.42	1.00
4	Flat Glass Group Co., Ltd	6865 HK	43,958,233.82	5.43
5	China Resources Power Holdings Co. Ltd.	836 HK	43,935,543.08	5.43
6	Kuaishou Technology	1024 HK	39,746,263.45	4.91
7	Shanghai Junshi Biosciences Co., Ltd.	1877 HK	28,009,838.06	3.46
		688180 SH	5,831,614.27	0.72
8	Contemporary Amperex Technology Co., Ltd.	300750 SZ	33,338,245.83	4.12
9	China Resources Mixc Lifestyle Services Limited	1209 HK	31,799,945.41	3.93
10	China Overseas	2669 HK	30,736,045.98	3.80

	Property Holdings Limited			
11	Li Ning Co. Ltd.	2331 HK	30,121,183.98	3.72
12	BOE Varitronix Limited	710 HK	29,627,649.58	3.66
13	Cowell e Holdings Inc.	1415 HK	28,967,488.08	3.58
14	Tsingtao Brewery Company Limited	168 HK	27,961,552.66	3.46
15	Xinyi Solar Holdings Limited	968 HK	26,772,140.44	3.31
16	Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co., Ltd	002384 SZ	26,415,788.25	3.27
17	Pinduoduo Inc.	PDD US	26,379,562.62	3.26
18	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	2388 HK	25,143,250.88	3.11
19	China Resources Land Limited	1109 HK	24,655,985.08	3.05
20	Sands China Ltd.	1928 HK	24,337,135.99	3.01
21	China Overseas Land & Investment Ltd.	688 HK	24,324,639.53	3.01
22	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	23,763,013.85	2.94
23	China Longyuan Power Group Corporation Limited	916 HK	23,717,943.50	2.93
24	Dongfang Electric Corporation Limited	1072 HK	10,850,107.44	1.34
		600875 SH	12,127,183.00	1.50
25	Pharmaron Beijing Co., Ltd.	3759 HK	22,480,470.54	2.78
26	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	2319 HK	21,841,388.51	2.70
27	Tesla, Inc.	TSLA US	21,548,183.06	2.66
28	China Resources Gas Group Limited	1193 HK	21,445,417.29	2.65
29	AIA Group Limited	1299 HK	21,038,936.91	2.60
30	Poly Property	6049 HK	20,935,988.38	2.59

	Services Co., Ltd.			
31	Minth Group Limited	425 HK	20,539,750.37	2.54
32	BYD Company Limited	1211 HK	20,019,867.90	2.47
33	Luzhou Laojiao Co., Ltd	000568 SZ	19,609,436.00	2.42
34	CIFI Ever Sunshine Services Group Limited	1995 HK	19,533,083.03	2.41
35	China Power International Development Limited	2380 HK	18,384,925.26	2.27
36	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	18,342,694.68	2.27
37	GoodWe Technologies Co., Ltd.	688390 SH	18,311,536.95	2.26
38	Pop Mart International Group Limited	9992 HK	17,957,806.95	2.22
39	MTR Corporation Ltd.	66 HK	17,170,088.88	2.12
40	Power Assets Holdings Limited	6 HK	16,822,366.94	2.08
41	CIFI Holdings (Group) Co. Ltd.	884 HK	16,720,875.79	2.07
42	KWG Group Holdings Limited	1813 HK	16,717,221.33	2.07
43	Great Wall Motor Company Limited	2333 HK	16,663,564.86	2.06
44	Anhui Xinbo Aluminum Co., Ltd.	003038 SZ	16,519,266.00	2.04

### 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	China Mobile Limited	941 HK	66,920,100.49	8.27
2	Tencent Holdings Ltd	700 HK	53,632,831.14	6.63
3	Contemporary Amperex	300750 SZ	52,204,743.71	6.45

	Technology Co., Ltd.			
4	Flat Glass Group Co., Ltd	6865 HK	44,863,512.77	5.55
5	Tsingtao Brewery Company Limited	168 HK	42,517,376.63	5.26
6	Xinyi Solar Holdings Limited	968 HK	42,248,029.04	5.22
7	China Resources Power Holdings Co. Ltd.	836 HK	39,600,093.81	4.90
8	Shanghai Junshi Biosciences Co.,Ltd.	1877 HK	31,744,298.41	3.92
		688180 SH	5,793,884.54	0.72
9	BYD Company Limited	1211 HK	36,917,018.87	4.56
10	Li Ning Co. Ltd.	2331 HK	36,378,707.06	4.50
11	Kuaishou Technology	1024 HK	35,794,305.44	4.42
12	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	2319 HK	31,667,964.46	3.91
13	China Resources Mixc Lifestyle Services Limited	1209 HK	30,901,030.35	3.82
14	Ganfeng Lithium Group Co., Ltd.	1772 HK	30,232,272.10	3.74
15	BOE Varitronix Limited	710 HK	29,194,366.18	3.61
16	Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co.,Ltd	002384 SZ	29,023,329.50	3.59
17	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	25,387,028.03	3.14
		BABA US	3,461,585.67	0.43
18	Pharmaron Beijing Co., Ltd.	3759 HK	28,791,724.83	3.56
19	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	27,563,595.44	3.41
20	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	2388 HK	26,751,847.54	3.31
21	Towngas Smart Energy Company Limited	1083 HK	26,061,133.38	3.22
22	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	25,167,214.45	3.11
23	Cowell e Holdings Inc.	1415 HK	24,981,831.14	3.09
24	Meituan	3690 HK	24,067,614.92	2.98

25	Ja Solar Technology Co., Ltd.	002459 SZ	24,035,130.34	2.97
26	China Overseas Land & Investment Ltd.	688 HK	23,999,484.53	2.97
27	China Resources Land Limited	1109 HK	23,374,665.15	2.89
28	Tesla, Inc.	TSLA US	22,874,780.26	2.83
29	Yunnan Energy New Material Co., Ltd.	002812 SZ	22,724,553.00	2.81
30	AIA Group Limited	1299 HK	22,528,761.73	2.79
31	GoodWe Technologies Co., Ltd.	688390 SH	20,921,006.33	2.59
32	CIFI Ever Sunshine Services Group Limited	1995 HK	20,661,253.22	2.55
33	Trina Solar Co., Ltd.	688599 SH	20,227,846.79	2.50
34	China Overseas Property Holdings Limited	2669 HK	19,647,615.89	2.43
35	Eve Energy Co., Ltd.	300014 SZ	19,073,362.00	2.36
36	Sands China Ltd.	1928 HK	19,015,114.92	2.35
37	Luxshare Precision Industry Co., Ltd.	002475 SZ	17,876,581.54	2.21
38	L.K. Technology Holdings Limited	558 HK	17,752,058.07	2.19
39	Power Assets Holdings Limited	6 HK	17,267,225.43	2.13
40	Pop Mart International Group Limited	9992 HK	17,129,339.39	2.12
41	CIFI Holdings (Group) Co. Ltd.	884 HK	17,009,286.70	2.10
42	Great Wall Motor Company Limited	2333 HK	16,412,859.75	2.03
43	Chaoju Eye Care Holdings Limited	2219 HK	16,351,680.40	2.02
44	MTR Corporation Ltd.	66 HK	16,250,817.46	2.01

### 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	2,295,652,059.80
卖出收入（成交）总额	2,283,629,265.39



## 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
AA+至 AA-	45,540.60	0.01

注：本基金债券投资组合主要采用穆迪、惠誉等国际权威评级机构提供的债券信用评级信息，其中境内债券取自境内第三方评级机构的债项评级。

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128136	立讯转债	418	45,540.60	0.01

## 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

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

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

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

### 8.11.2 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	91,388.95
2	应收清算款	5,093,440.01
3	应收股利	51,602.42
4	应收利息	—
5	应收申购款	241,671.61
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,478,102.99

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128136	立讯转债	45,540.60	0.01

### 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（%）
25,933	15,682.11	3,881,862.32	0.95	402,802,191.44	99.05

## 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（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,627,549.90	0.4002

## 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年04月23日)基金份额总额	399,940,741.74
报告期期初基金份额总额	488,801,933.30
本报告期基金总申购份额	67,029,364.27
减：本报告期基金总赎回份额	149,147,243.81
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	406,684,053.76

## § 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2022年7月15日起，孙乐女士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(特殊普通合伙)的报酬为 4.3 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 20 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

## 11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
ABCI Securities Co. Ltd	0	—	—	—	—	—
ANZ	0	—	—	—	—	—
BARCLAYS	0	—	—	—	—	—
BNP Paribas	0	—	—	—	—	—
BOC HONG KONG BRANCH	0	—	—	—	—	—
BOCI Security Limited	0	—	—	—	—	—
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	252,916,154.08	5.53	127,792.61	4.74	—
CMBC Securities Company Limited	0	—	—	—	—	—
CMFU	0	—	—	—	—	—
CTI Capital Management	0	—	—	—	—	—
Cathay Securities (Hong Kong) Limited	0	—	—	—	—	—
China Everbright Securities (HK)Limited	0	—	—	—	—	—
China Galaxy International Financial Holdings Limited	0	—	—	—	—	—
China Industrial Securities	0	—	—	—	—	—
China International Capital Corp LTD	0	31,821,987.12	0.70	16,595.06	0.62	—
China Merchant International	0	—	—	—	—	—
China Merchants Securities	0	—	—	—	—	—
China Renaissance	0	—	—	—	—	—
China Securities International	0	—	—	—	—	—
Citigroup Global Markets Limited	0	652,072,419.85	14.25	521,657.94	19.34	—
Credit Suisse	0	13,168,641.83	0.29	21,061.01	0.78	—
DBS Vickers	0	—	—	—	—	—
Daiwa Capital Markets (HK) Limited	0	1,379,296,057.81	30.15	413,788.98	15.34	—
Deutsche Bank	0	—	—	—	—	—
Essence International Securities	0	—	—	—	—	—

First Shanghai Securities	0	—	—	—	—	—
GF Securities (HK)	0	—	—	—	—	—
Goldman Sachs	0	300,916,913.64	6.58	127,314.73	4.72	—
Guo Yuan Securities (Hong Kong) Ltd	0	—	—	—	—	—
Guosen Securities HK Finacial Holding CO LTD	0	—	—	—	—	—
Guotai Junan Securities (HK)	0	—	—	—	—	—
HAITONG INTERNATIONAL	0	112,886,478.38	2.47	56,443.25	2.09	—
HSBC	0	—	—	—	—	—
Huatai Financial Holdings	0	575,410.36	0.01	575.41	0.02	—
ICBC International Securities	0	—	—	—	—	—
Instinet Pacific Limited	0	—	—	—	—	—
JPMorgan	0	366,808,242.89	8.02	146,723.27	5.44	—
Jefferies	0	—	—	—	—	—
Macquarie Bank Limited	0	59,960,474.76	1.31	29,980.25	1.11	—
Merrill Lynch	0	—	—	—	—	—
Mizuho Securities International	0	—	—	—	—	—
Morgan Stanley	0	—	—	—	—	—
Nomura International	0	—	—	—	—	—
Orient Securities(HongKong) Limited	0	—	—	—	—	—
Shenwan Hongyuan Securities (H.K.) Limited	0	—	—	—	—	—
Standard Chartered Bank	0	—	—	—	—	—
UBS Securities Asia Limited	0	340,104,647.52	7.43	272,083.74	10.09	—
UOB Kay Hian (Hong kong)Limited	0	—	—	—	—	—

Zhongtai International Securities Limited	0	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—
东方证券	2	145,872,730.84	3.19	133,596.47	4.95	—
国金证券	2	116,726,008.70	2.55	102,059.86	3.78	—
国盛证券	2	51,922,964.88	1.13	47,836.86	1.77	—
国泰君安	1	932,716.00	0.02	672.95	0.02	—
国信证券	1	—	—	—	—	—
华创证券	1	5,858,424.00	0.13	5,397.30	0.20	—
华泰证券	2	47,224,711.49	1.03	43,170.90	1.60	—
申万宏源	1	159,821,099.59	3.49	143,143.74	5.31	—
信达证券	2	72,729,262.05	1.59	66,653.79	2.47	—
野村证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	2	201,636,149.29	4.41	185,247.04	6.87	—
中金财富	1	—	—	—	—	—
中金公司	1	48,480,259.97	1.06	44,453.34	1.65	—
中信建投	2	73,262,269.94	1.60	66,392.49	2.46	—
中信山东	1	—	—	—	—	—
中信证券	2	140,151,070.08	3.06	124,993.74	4.63	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

### 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
ABCI Securities Co. Ltd	—	—	—	—	—	—	—	—

ANZ	—	—	—	—	—	—	—	—
BARCLAYS	—	—	—	—	—	—	—	—
BNP Paribas	—	—	—	—	—	—	—	—
BOC HONG KONG BRANCH	—	—	—	—	—	—	—	—
BOCI Security Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
BOCOM International	—	—	—	—	—	—	—	—
CCB International	—	—	—	—	—	—	—	—
CEB International Capital Corporation Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
CENTRAL WEALTH SECURITIES INVESTMENT LIMITED	—	—	—	—	—	—	—	—



CIMB Securities Ltd	—	—	—	—	—	—	—	—
CITIC BANK	—	—	—	—	—	—	—	—
CITIC Securities	—	—	—	—	—	—	—	—
CLSA	—	—	—	—	—	—	—	—
CMBC Securities Company Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
CMFU	—	—	—	—	—	—	—	—
CTI Capital Management	—	—	—	—	—	—	—	—
Cathay Securities (Hong Kong) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
China Everbright Securities (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

China Galaxy Intern ationa l Financ ial Holdin gs Limite d	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Indust rial Securi ties	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Intern ationa l Capita l Corp LTD	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Mercha nt Intern ationa l	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Mercha nts Securi ties	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Renaiss ance	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Securi ties Intern ationa l	—	—	—	—	—	—	—	—	—

Citigroup Global Markets Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Credit Suisse	—	—	—	—	—	—	—	—
DBS Vickers	—	—	—	—	—	—	—	—
Daiwa Capital Markets (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsche Bank	—	—	—	—	—	—	—	—
Essence International Securities	—	—	—	—	—	—	—	—
First Shanghai Securities	—	—	—	—	—	—	—	—
GF Securities (HK)	—	—	—	—	—	—	—	—
Goldman Sachs	—	—	—	—	—	—	—	—

Guo Yuan Securities (Hong Kong) Ltd	—	—	—	—	—	—	—	—
Guosen Securities HK Financial Holding CO LTD	—	—	—	—	—	—	—	—
Guotai Junan Securities (HK)	—	—	—	—	—	—	—	—
HAITONG INTERNATIONAL	—	—	—	—	—	—	—	—
HSBC	—	—	—	—	—	—	—	—
Huatai Financial Holdings	—	—	—	—	—	—	—	—
ICBC International Securities	—	—	—	—	—	—	—	—
Instinet Pacific Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

JPMorgan	—	—	—	—	—	—	—	—
Jefferies	—	—	—	—	—	—	—	—
Macquarie Bank Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Merrill Lynch	—	—	—	—	—	—	—	—
Mizuho Securities International	—	—	—	—	—	—	—	—
Morgan Stanley	—	—	—	—	—	—	—	—
Nomura International	—	—	—	—	—	—	—	—
Orient Securities (Hong Kong) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Shenwan Hongyuan Securities (H.K.) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

Standard Chartered Bank	—	—	—	—	—	—	—	—
UBS Securities Asia Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
UOB Kay Hian (Hong Kong) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Zhongtai International Securities Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—	—	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—	—	—

申万宏源	—	—	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—	—	—
野村证券	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—	—	—
中金财富	—	—	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—	—	—
中信山东	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—	—	—
中银证券	—	—	—	—	—	—	—	—

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	规定披露媒介	2022年01月01日
2	富国基金管理有限公司关于富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）基金经理变更的公告	规定披露媒介	2022年12月10日
3	富国基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	规定披露媒介	2022年12月28日
4	富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）关于2023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	2022年12月29日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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红利精选混合型证券投资基金（QDII）的文件 2、富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）基金合同 3、富国红利精选混合型证券投资基金（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	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> 。



---

5、富国红利精选混合型证券投资基金(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		
---	--	--