

富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金

(QDII)

二〇二三年中期报告

2023年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023年08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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 19 日（基金合同生效日）起至 2023 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	6
2.1	基金基本情况	6
2.2	基金产品说明	6
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	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	7
§3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标.....	8
3.2	基金净值表现	8
§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	11
4.3	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	12
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6	中期财务报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	17
6.3	净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4	报表附注	19

§7	投资组合报告	48
7.1	期末基金资产组合情况.....	48
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	48
7.3	期末按行业分类的权益投资组合	48
7.4	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	49
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动.....	53
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	59
7.7	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	59
7.8	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	59
7.9	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	59
7.10	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	59
7.11	投资组合报告附注	59
§8	基金份额持有人信息	62
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	62
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	62
§9	开放式基金份额变动	63
§10	重大事件揭示	64
10.1	基金份额持有人大会决议.....	64
10.2	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	64
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4	基金投资策略的改变	64
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8	其他重大事件	86
§11	影响投资者决策的其他重要信息	87
11.1	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.....	87
§12	备查文件目录	88

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金简称	富国恒生港股通高股息低波动 ETF（QDII）
场内简称	恒生红利 ETF
基金主代码	513950
交易代码	513950
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2023年04月19日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	75,119,000.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023年4月28日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法，即按照标的指数的成份券组成及其权重构建基金证券投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过3%。本基金的资产配置策略、存托凭证投资策略、港股投资策略、可转换债券（含分离交易可转债）及可交换债券投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、股票期权投资策略、境外市场基金投资策略、境外金融衍生品投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	恒生港股通高股息低波动指数收益率（使用估值汇率折算）
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金为投资境外证券的基金，主要投资于香港市场，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、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	许俊

	联系电话	021-20361818	010-66596688
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95566
传真		021-20361616	010-66594942
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		裴长江	葛海蛟

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	—	Citibank, N. A.
	中文	—	花旗银行
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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 中国银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街1号

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	2023年4月19日(基金合同生效日)至2023年6月30日
本期已实现收益	11,536,789.58
本期利润	10,899,539.54
加权平均基金份额本期利润	0.0811
本期加权平均净值利润率	7.94%
本期基金份额净值增长率	2.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年06月30日)
期末可供分配利润	2,022,663.82
期末可供分配基金份额利润	0.0269
期末基金资产净值	77,141,663.82
期末基金份额净值	1.0269
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	2.69%

注：本基金于2023年4月19日成立，自合同生效日起至本报告期末不足半年。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）。

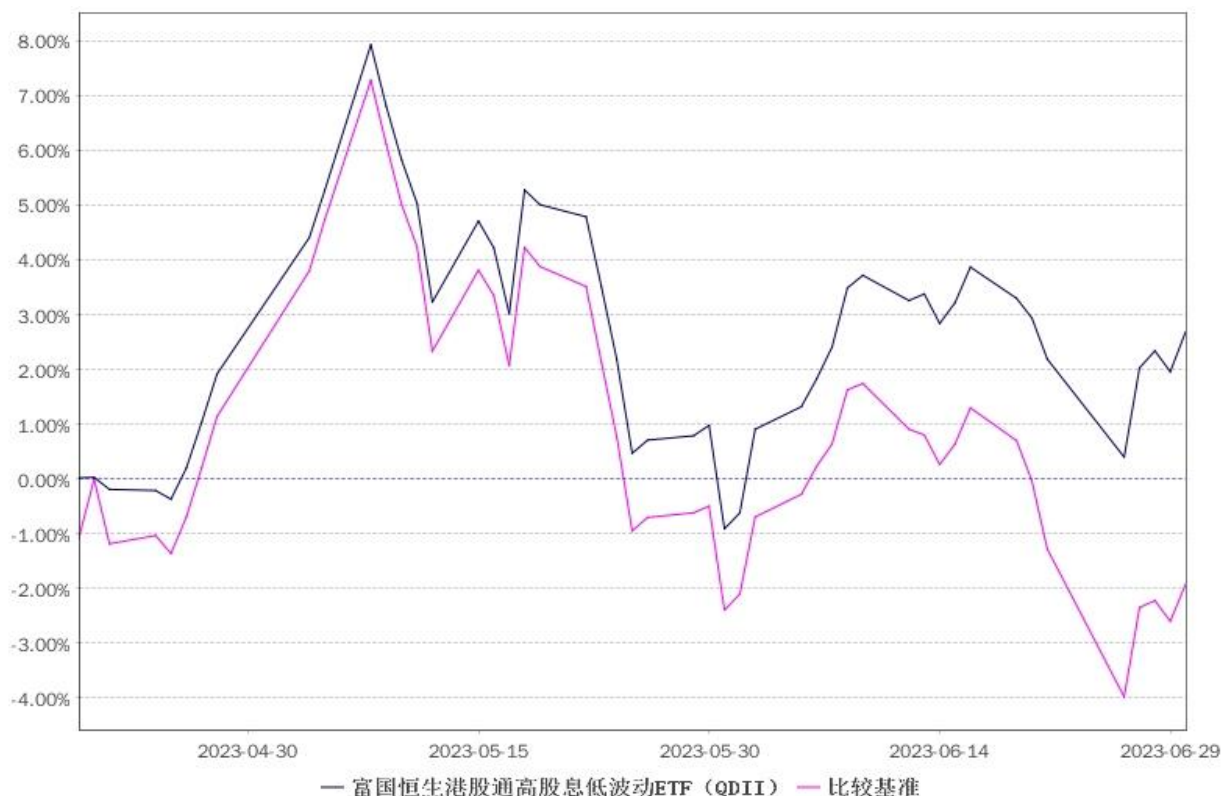
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	3.63%	0.80%	0.49%	0.99%	3.14%	-0.19%
自基金合同生效起至今	2.69%	1.04%	-1.92%	1.16%	4.61%	-0.12%

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2023年6月30日。

2、本基金于2023年4月19日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月，从2023年4月19日起至2023年10月18日，本期末建仓期还未结束。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至 2023 年 6 月 30 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 304 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		
田希蒙	本基金现任基金经理	2023-04-19	—	6	硕士，自 2017 年 5 月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、定量研究员、定量投资经理；现任富国基金量化投资部定量基金经理。自 2023 年 01 月起任富

					<p>国中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2023 年 01 月起任富国中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2023 年 04 月起任富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；自 2023 年 06 月起任富国恒生港股通医疗保健交易型开放式指数证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的涵义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、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恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（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》、《富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（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 公平交易制度的执行情况

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。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。

4.4.2 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未出现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

年初以来，随着主要城市疫情高峰过去，疫情对经济的冲击逐步减小，投资者对 2023 年经济复苏预期变动更加乐观，港股迎来开门红。伴随着稳增长政策

进一步加码，如央行、银保监会出台了个人住房贷款利率的动态调整方案，地产需求侧政策进一步释放，叠加疫情防控政策优化，海外投资者对中国经济复苏也同样充满信心，外资大规模流入，带动市场加速上涨。进入3月，由于两会政府工作报告公布的GDP增速目标低于市场预期，市场迎来一轮快速调整。海外方面，美国公布的2月通胀数据超预期，加息预期再次升温，全球资本市场迎来调整。随着美国部分银行风险暴露，美联储加息预期放缓，全球流动性预期再度宽松，港股迎来阶段性修复行情。进入5月中旬，由于金融、通胀数据均回落，指向经济内生动能不强，复苏斜率放缓压制市场情绪，同时海外银行业危机和债务违约风险持续发酵，引发市场担忧加剧，各板块均迎来快速调整。6月初，虽然国内方面经济数据维持弱势，但结构性政策开始落地，结合外资巨头接连访华为经济注入新动力，提振市场信心。海外方面，美国参议院通过债务上限法案，债务违约风险解除，美联储官员鹰派发言转弱，大概率暂停加息，全球风险偏好提升，港股快速反弹。6月下旬，随着短期宏观政策兑现，投资者选择获利了结，叠加人民币进一步贬值及节前避险情绪升温，港股迎来调整。

总体来看，2023年上半年恒生指数下跌4.37%，恒生国企指数下跌4.18%，恒生科技指数下跌5.27%。

在投资管理上，本基金采取完全复制的被动式指数基金管理策略，采用量化和人工管理相结合的方法，处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至2023年6月30日，本基金份额净值为1.0269元；份额累计净值为1.0269元；本报告期，本基金份额净值增长率为2.69%，同期业绩比较基准收益率为-1.92%。

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年下半年，积极因素正进一步累积，悲观预期将逐步修正。首先，外部的扰动将逐步缓解。当前市场已将7月美联储会议的加息预期较充分地计入，并且后续8月没有美联储议息会议的情况下，市场将阶段性进入鹰派信息的“空窗期”，来自美债利率上行、汇率贬值等外部压力已在缓和。其次，6月份多项经济数据已经止跌企稳、甚至拐头向上，市场对于经济增长的悲观预期仍有望逐步修正。2季度GDP数据虽略不及预期，但6月经济数据已经边际回暖。生

产端，尽管工业增加值、服务业生产指数两年复合增速仍低于疫情前水平，但 5-6 月已出现持续改善。消费端，边际上居民收入改善，5-6 月商品消费加速。投资端，基建、制造业投资维持强势。近期各项经济政策也在密集加码落地，如促进家居消费若干措施、促民营经济、城中村改造等政策密集加码。此外，当前市场本身仍处在一个隐含风险溢价较高、多数行业拥挤度较低的位置，具备整体修复的空间。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 中期财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金(QDII)

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2023年06月30日
资 产：	
银行存款	954,501.55
结算备付金	—
存出保证金	—
交易性金融资产	74,635,351.41
其中：股票投资	74,635,351.41
基金投资	—
债券投资	—
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—
其他投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收清算款	—
应收股利	1,793,433.24
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	414,891.00
资产总计	77,798,177.20
负债和净资产	本期末 2023年06月30日
负 债：	
短期借款	—
交易性金融负债	—
衍生金融负债	—
卖出回购金融资产款	—
应付清算款	536,162.03
应付赎回款	—
应付管理人报酬	36,746.66
应付托管费	7,349.33
应付销售服务费	—
应付投资顾问费	—
应交税费	—
应付利润	—

递延所得税负债	—
其他负债	76,255.36
负债合计	656,513.38
净资产：	
实收基金	75,119,000.00
其他综合收益	—
未分配利润	2,022,663.82
净资产合计	77,141,663.82
负债和净资产总计	77,798,177.20

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0269 元，基金份额总额 75,119,000.00 份。本基金合同生效日 2023 年 04 月 19 日。

6.2 利润表

会计主体：富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金(QDII)

本报告期：2023 年 04 月 19 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2023 年 4 月 19 日 (基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入	11,142,417.02
1.利息收入	60,380.25
其中：存款利息收入	60,380.25
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）	11,465,375.00
其中：股票投资收益	8,232,429.34
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	—
衍生工具收益	—
股利收益	3,232,945.66
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）	-637,250.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	699,410.56
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-445,498.75
减：二、营业总支出	242,877.48

1. 管理人报酬	136,677.11
2. 托管费	27,335.40
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	—
8. 其他费用	78,864.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	10,899,539.54
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	10,899,539.54
五、其他综合收益的税后净额	—
六、综合收益总额	10,899,539.54

注：本基金合同生效日为 2023 年 4 月 19 日，无上年度同期对比数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金(QDII)

本报告期：2023 年 04 月 19 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、本期期初净资产（基金净值）	265,119,000.00	—	265,119,000.00
二、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	—	2,022,663.82	—
（一）、综合收益总额	190,000,000.00	10,899,539.54	187,977,336.18
（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）	—	—	—
其中：1. 基金申购款	190,000,000.00	-8,876,875.72	198,876,875.72
2. 基金赎回款	1,000,000.00	34,915.39	1,034,915.39
	—	-8,911,791.11	—
（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）	191,000,000.00	—	199,911,791.11
（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）	75,119,000.00	2,022,663.82	77,141,663.82

值)			
----	--	--	--

注：本基金合同生效日为 2023 年 4 月 19 日，无上年度同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈 戈

林志松

徐 慧

基金管理人
基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下简称“富国恒生港股通高股息低波动 ETF（QDII）”）系基金管理人富国基金管理有限公司（以下简称“贵公司”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》和其他有关法律法规的规定，以及《富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金基金合同》，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2023 年 2 月 28 日以证监许可【2023】436 号文准予公开募集注册。募集期结束经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具德师报（验）字（23）第 00110 号 验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。本基金为契约型，交易型开放式。基金合同于 2023 年 4 月 19 日正式生效。富国恒生港股通高股息低波动 ETF（QDII）基金份额净有效认购资金金额为人民币 265,119,000.00 元，折算成基金份额计 265,119,000.00 份（其中，网上现金认购净有效认购资金为人民币 265,119,000.00 元，折算成基金份额计 265,119,000.00 份；网下现金认购净有效认购资金为人民币 0.00 元，折算成基金份额计 0.00 份）；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 43,473.29 元（其中，根据注册登记机构的记录，网上现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 43,473.29 元，计入基金财产，不折算成投资者基金份额；网下现金认购有效净认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 0.00 元，折算成基金份额计 0.00 份）。至此，富国恒生港股通高股息低波动 ETF（QDII）募集的实收基金为人民币 265,119,000.00 元，折算成基金份额合计

265,119,000.00 份。本基金的基金管理人富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，中国银行股份有限公司担任基金托管人。花旗银行担任境外资产托管人。

本基金的投资范围主要为标的指数成份券、备选成份券（均含存托凭证）和其他成份券。

为更好地实现投资目标，本基金可以少量投资于境内、境外市场的其他资产，包括但不限于其他非成份券的股票、存托凭证。

针对境内投资，本基金可少量投资于国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、股票期权等）、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（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：

1、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）；

2、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；

3、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；

4、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；

5、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；

6、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；

7、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相关规定）。

在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。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：本基金投资于标的指数成份券和备选成份券（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为恒生港股通高股息低波动指数收益率（使用估值汇率折算）。

6.4.2 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 3 号《半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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 4 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2023年4月19日（基金合同生效日）至2023年6月30日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前

支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

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

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、基金每年收益分配次数没有限制，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率（使用估值汇率折算）。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

3、若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

4、本基金收益分配采用现金方式；

5、法律法规、监管机关、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。

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

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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。

6.4.4.14 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 (2023年06月30日)
活期存款	954,501.55
等于：本金	954,211.23
加：应计利息	290.32
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	954,501.55

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

本基金外币存款余额构成列示如下

币种	2023年6月30日				
	外币本金	外币应计利息	外币总额	折算汇率	总额折合人民币
港币	564,086.60	15.77	564,102.37	0.92198	520,091.10
合计					520,091.10

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2023年06月30日）			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	75,272,601.45	—	74,635,351.41	-637,250.04
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	75,272,601.45	—	74,635,351.41	-637,250.04

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末（2023年06月30日）
应收利息	—
其他应收款	414,891.00
待摊费用	—
合计	414,891.00

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2023年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—

应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	30,000.00
预提审计费	10,793.78
IOPV 计算发布费	3,506.56
预提_注册登记费	31,955.02
合计	76,255.36

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日 2023 年 4 月 19 日	265,119,000.00	265,119,000.00
本期申购	1,000,000.00	1,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-191,000,000.00	-191,000,000.00
本期末	75,119,000.00	75,119,000.00

6.4.7.8 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
基金合同生效日 2023 年 4 月 19 日	—	—	—
本期利润	11,536,789.58	-637,250.04	10,899,539.54
本期基金份额交易产生的变动数	-4,578,626.47	4,298,249.25	-8,876,875.72
其中：基金申购款	58,814.20	-23,898.81	34,915.39
基金赎回款	-4,637,440.67	4,274,350.44	-8,911,791.11
本期已分配利润	—	—	—
本期末	6,958,163.11	4,935,499.29	2,022,663.82

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
----	---

活期存款利息收入	60,380.25
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	—
其他	—
合计	60,380.25

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,232,429.34
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	8,232,429.34

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	180,975,469.38
减：卖出股票成本总额	172,068,976.79
减：交易费用	674,063.25
买卖股票差价收入	8,232,429.34

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	199,911,791.11
减：现金支付赎回款总额	199,911,791.11
减：赎回股票成本总额	—
减：交易费用	—
赎回差价收入	—

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.11 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,232,945.66
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	3,232,945.66

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-637,250.04
股票投资	-637,250.04
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	-637,250.04

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	—
替代损益	-445,498.75
合计	-445,498.75

6.4.7.19 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	10,793.78
信息披露费	30,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	2,209.61
其他	35,861.58
合计	78,864.97

6.4.7.21 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金管理人于 2023 年 8 月 25 日发布的分红公告，本基金向 2023 年 8 月 29 日在本基金注册登记机构登记在册的份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.297 元。

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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人
海通国际证券集团有限公司（“海通香港”）	基金管理人的股东控制的子公司
花旗银行	基金境外资产托管人

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额 的比例 (%)
Haitong International Securities Company Limited	232,506,969.72	54.28

注：本基金合同生效日为 2023 年 04 月 19 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为 2023 年 04 月 19 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金合同生效日为 2023 年 04 月 19 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。本基金合同生效日为2023年04月19日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.5 基金交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。本基金合同生效日为2023年04月19日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2023年4月19日(基金合同生效日)至2023年6月30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(%)
Haitong International Securities Company Limited	46,501.55	57.88	—	—

注：本基金合同生效日为2023年04月19日。无上年度同期对比数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2023年4月19日(基金合同生效日)至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	136,677.11
其中：支付销售机构的客户维护费	—

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

本基金合同生效日为2023年4月19日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	27,335.40

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

本基金合同生效日为 2023 年 4 月 19 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

本基金合同生效日 2023 年 04 月 19 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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：本基金本报告期末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。

6.4.10.4.2 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：本基金本报告期末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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金合同生效日为 2023 年 4 月 19 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末（2023 年 06 月 30 日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
申万宏源证券有限公司	1,058,000.00	1.41

注：本基金合同生效日为 2023 年 04 月 19 日，无上年度末对比数据。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
花旗银行	520,029.79	14.30
中国银行股份有限公司	434,471.76	60,365.95

注：本基金合同生效日为 2023 年 04 月 19 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更紧密地跟踪标的指数，降低跟踪误差，经与基金托管人协商一致，本基金在报告期内根据基金合同约定的投资策略投资于基金托管人发行的股票中国银行（3988.HK）。

本报告期末，本基金持有中国银行 693,000 股，占基金资产净值比例 2.60%。本基金合同生效日为 2023 年 04 月 19 日，无上年度同期对比数据。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 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。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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%。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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 6.4.12 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。本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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

单位：人民币元

本期末（2023年06月30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	954,501.55	—	—	—	—	—	954,501.55
交易性金融资产	—	—	—	—	—	74,635,351.41	74,635,351.41
应收股利	—	—	—	—	—	1,793,433.24	1,793,433.24
其他资产	—	—	—	—	—	414,891.00	414,891.00
资产总计	954,501.55	—	—	—	—	76,843,675.65	77,798,177.20
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	536,162.03	536,162.03
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	36,746.66	36,746.66
应付托管费	—	—	—	—	—	7,349.33	7,349.33
其他负债	—	—	—	—	—	76,255.36	76,255.36
负债总计	—	—	—	—	—	656,513.38	656,513.38
利率敏感度缺口	954,501.55	—	—	—	—	76,187,162.27	77,141,663.82

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末未持有债券资产（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。本基金合同生效日为2023年04月19日，无上年度同期对比数据。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末（2023年06月30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	—	520,091.10	—	—	520,091.10
交易性金融资产	—	74,635,351.41	—	—	74,635,351.41
应收股利	—	1,670,853.24	—	—	1,670,853.24
其他资产	—	414,891.00	—	—	414,891.00
资产合计	—	77,241,186.75	—	—	77,241,186.75
以外币计价的负债					
应付清算款	—	536,162.03	—	—	536,162.03
负债合计	—	536,162.03	—	—	536,162.03
资产负债表外汇风险敞口净额	—	76,705,024.72	—	—	76,705,024.72

6.4.13.4.2.2 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（2023年06月30日）
	港币相对人民币贬值1%	-767,050.25
	港币相对人民币升值1%	767,050.25

6.4.13.4.3 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）。本基金投资于标的指数成份券和备选成份券（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围主要为标的指数成份券、备选成份券（均含存托凭证）和其他成份券。

为更好地实现投资目标，本基金可以少量投资于境内、境外市场的其他资产，包括但不限于其他非成份券的股票、存托凭证。

针对境内投资，本基金可少量投资于国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、股票期权等）、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（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：

1、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）；

2、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；

3、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；

4、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；

5、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；

6、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；

7、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相关规定）。

在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份券和备选成份券（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2023年06月30日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	74,635,351.41	96.75
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	74,635,351.41	96.75

6.4.13.4.3.2 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。基金合同生效日为 2023 年 04 月 19 日。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2023年06月30日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	667,724.25
	2. 业绩比较基准减少 1%	-667,724.25

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 (2023年06月30日)
第一层次	74,635,351.41
第二层次	—
第三层次	—
合计	74,635,351.41

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 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。

6.4.15.2 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	74,635,351.41	95.93
	其中：普通股	74,635,351.41	95.93
	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	954,501.55	1.23
8	其他各项资产	2,208,324.24	2.84
9	合计	77,798,177.20	100.00

7.2 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	74,635,351.41	96.75
合计	74,635,351.41	96.75

7.3 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 (%)
金融	30,220,633.69	39.18
工业	13,451,983.23	17.44
能源	8,423,425.95	10.92
公用事业	6,886,531.39	8.93
房地产	5,498,435.17	7.13
通信服务	3,361,824.89	4.36
非日常生活消费品	3,056,833.91	3.96
信息技术	2,686,008.95	3.48

日常消费品	1,049,674.23	1.36
合计	74,635,351.41	96.75

7.4 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

7.4.1 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 Shenhua Energy Company Limited	中国神华	1088	香港联合交易所	中国香港	120,500.00	2,660,811.23	3.45
2	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石化	386	香港联合交易所	中国香港	602,000.00	2,547,596.70	3.30
3	China Minsheng Banking Corp., Ltd.	中国民生银行	1988	香港联合交易所	中国香港	811,500.00	2,169,741.63	2.81
4	Petrochina Company Limited	中国石油	857	香港联合交易所	中国香港	414,000.00	2,068,812.48	2.68
5	Agricultural Bank of China Limited	中国农业银行	1288	香港联合交易所	中国香港	717,000.00	2,036,063.75	2.64
6	Bank of Communications Co., Ltd.	交通银行	3328	香港联合交易所	中国香港	425,000.00	2,033,657.39	2.64
7	China Citic Bank Corporation Limited	中信银行	998	香港联合交易所	中国香港	597,000.00	2,025,553.18	2.63
8	Bank of China Limited	中国银行	3988	香港联合交易所	中国香港	693,000.00	2,006,246.92	2.60
9	China Galaxy Securities Co., Ltd.	中国银河	6881	香港联合交易所	中国香港	518,500.00	1,998,234.91	2.59
10	New China Life Insurance	新华保险	1336	香港联合交易所	中国香港	103,500.00	1,970,524.80	2.55

	Company Ltd.							
11	China Merchants Port Holdings Company Limited	招商局港口	144	香港联合交易所	中国香港	186,000.00	1,896,660.38	2.46
12	China Construction Bank Corporation	中国建设银行	939	香港联合交易所	中国香港	397,000.00	1,855,752.12	2.41
13	Industrial and Commercial Bank of China Limited	中国工商银行	1398	香港联合交易所	中国香港	481,000.00	1,853,714.55	2.40
14	CITIC Limited	中信股份	267	香港联合交易所	中国香港	207,000.00	1,784,446.19	2.31
15	China Mobile Limited	中国移动	941	香港联合交易所	中国香港	29,000.00	1,712,531.75	2.22
16	China Cinda Asset Management Co., Ltd.	中国信达	1359	香港联合交易所	中国香港	2,266,000.00	1,629,581.21	2.11
17	PICC Property and Casualty Company Limited	中国财险	2328	香港联合交易所	中国香港	198,000.00	1,590,028.27	2.06
18	The People's Insurance Company (Group) of China Limited	中国人保集团	1339	香港联合交易所	中国香港	601,000.00	1,573,672.34	2.04
19	Power Assets Holdings Limited	电能实业	6	香港联合交易所	中国香港	41,500.00	1,570,662.08	2.04
20	Baic Motor Corporation Limited	北京汽车	1958	香港联合交易所	中国香港	874,500.00	1,531,915.87	1.99
21	Dongfeng Motor Group Company Limited	东风集团	489	香港联合交易所	中国香港	462,000.00	1,524,918.04	1.98
22	Zhejiang	浙江沪杭甬	576	香港联合交	中国香港	258,000.00	1,415,331.50	1.83

	Expressway Co., Ltd.			易所				
23	CK Infrastructure Holdings Limited	长江基建集团	1038	香港联合交易所	中国香港	36,500.00	1,394,886.59	1.81
24	Huatai Securities Co., Ltd.	华泰证券	6886	香港联合交易所	中国香港	155,200.00	1,385,123.75	1.80
25	Beijing Enterprises Water Group Limited	北控水务集团	371	香港联合交易所	中国香港	806,000.00	1,382,195.54	1.79
26	CLP Holdings Ltd.	中电控股	2	香港联合交易所	中国香港	24,500.00	1,375,640.26	1.78
27	Lenovo Group Limited	联想集团	992	香港联合交易所	中国香港	180,000.00	1,355,863.79	1.76
28	Kerry Properties Limited	嘉里建设	683	香港联合交易所	中国香港	90,000.00	1,347,565.97	1.75
29	Far East Horizon Limited	远东宏信	3360	香港联合交易所	中国香港	234,000.00	1,337,608.58	1.73
30	ASMPT Limited	ASMPT	522	香港联合交易所	中国香港	18,700.00	1,330,145.16	1.72
31	CK Hutchison Holdings Limited	长和	1	香港联合交易所	中国香港	30,000.00	1,323,502.29	1.72
32	China Securities Co., Ltd.	中信建投证券	6066	香港联合交易所	中国香港	176,500.00	1,314,854.12	1.70
33	Henderson Land Development Co. Ltd.	恒基地产	12	香港联合交易所	中国香港	61,000.00	1,310,410.17	1.70
34	China Communications Services Corporation Limited	中国通信服务	552	香港联合交易所	中国香港	364,000.00	1,295,418.78	1.68
35	China Railway Construction Corporation	中国铁建	1186	香港联合交易所	中国香港	234,000.00	1,242,681.52	1.61

	Limited							
36	Postal Savings Bank of China Co., Ltd.	中国邮政储蓄银行	1658	香港联合交易所	中国香港	267,000.00	1,186,532.94	1.54
37	China Communications Construction Company Limited	中国交建	1800	香港联合交易所	中国香港	298,000.00	1,175,930.17	1.52
38	Beijing Enterprises Holdings Ltd.	北京控股	392	香港联合交易所	中国香港	44,500.00	1,163,146.92	1.51
39	China Life Insurance Company Limited	中国人寿	2628	香港联合交易所	中国香港	96,000.00	1,155,941.64	1.50
40	China Railway Group Limited	中国中铁	390	香港联合交易所	中国香港	241,000.00	1,148,759.42	1.49
41	Cnooc Limited	中国海油	883	香港联合交易所	中国香港	111,000.00	1,146,205.54	1.49
42	CRRC Corporation Limited	中国中车	1766	香港联合交易所	中国香港	282,000.00	1,115,392.96	1.45
43	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	中国太保	2601	香港联合交易所	中国香港	58,800.00	1,097,801.59	1.42
44	China State Construction International Holdings Limited	中国建筑国际	3311	香港联合交易所	中国香港	128,000.00	1,053,860.02	1.37
45	Hengan International Group Company Limited	恒安国际	1044	香港联合交易所	中国香港	34,500.00	1,049,674.23	1.36
46	Sun Hung Kai Properties Ltd.	新鸿基地产	16	香港联合交易所	中国香港	11,000.00	1,000,993.69	1.30
47	China Unicom	中国联通	762	香港联合交	中国香港	202,000.00	964,722.99	1.25

	(Hong Kong) Limited			易所				
48	Hang Lung Properties Ltd.	恒隆地产	101	香港联合交易所	中国香港	83,000.00	925,944.51	1.20
49	Swire Pacific Ltd.	太古股份公司 A	19	香港联合交易所	中国香港	16,500.00	913,520.83	1.18
50	China Telecom Corporation Limited	中国电信	728	香港联合交易所	中国香港	198,000.00	684,570.15	0.89

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	8,951,127.93	11.60
2	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	8,761,832.19	11.36
3	China Citic Bank Corporation Limited	998 HK	7,277,720.70	9.43
4	China Minsheng Banking Corp., Ltd.	1988 HK	6,641,104.86	8.61
5	Petrochina Company Limited	857 HK	6,336,276.08	8.21
6	Bank of China Limited	3988 HK	6,258,628.07	8.11
7	China Merchants Port Holdings Company Limited	144 HK	6,246,094.85	8.10
8	Agricultural Bank of China Limited	1288 HK	6,229,678.18	8.08
9	Bank of Communications Co., Ltd.	3328 HK	6,202,579.52	8.04
10	New China Life Insurance Company Ltd.	1336 HK	6,168,014.63	8.00

11	China Galaxy Securities Co., Ltd.	6881 HK	6,141,808.50	7.96
12	China Cinda Asset Management Co., Ltd.	1359 HK	6,033,191.54	7.82
13	China Construction Bank Corporation	939 HK	5,983,282.55	7.76
14	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	5,843,479.26	7.57
15	CITIC Limited	267 HK	5,695,721.64	7.38
16	China Mobile Limited	941 HK	5,693,814.46	7.38
17	Baic Motor Corporation Limited	1958 HK	5,545,518.26	7.19
18	Power Assets Holdings Limited	6 HK	5,208,819.51	6.75
19	PICC Property and Casualty Company Limited	2328 HK	5,185,940.14	6.72
20	Kerry Properties Limited	683 HK	5,100,524.01	6.61
21	The People's Insurance Company (Group) of China Limited	1339 HK	4,989,688.44	6.47
22	Zhejiang Expressway Co., Ltd.	576 HK	4,935,973.49	6.40
23	Dongfeng Motor Group Company Limited	489 HK	4,798,244.55	6.22
24	Far East Horizon Limited	3360 HK	4,750,743.24	6.16
25	Henderson Land Development Co. Ltd.	12 HK	4,721,235.07	6.12
26	CK Infrastructure Holdings Limited	1038 HK	4,593,085.24	5.95
27	China Railway Construction	1186 HK	4,514,132.99	5.85

	Corporation Limited			
28	Huatai Securities Co., Ltd.	6886 HK	4,509,479.17	5.85
29	CK Hutchison Holdings Limited	1 HK	4,476,419.05	5.80
30	Beijing Enterprises Water Group Limited	371 HK	4,465,684.69	5.79
31	China Communications Construction Company Limited	1800 HK	4,345,732.41	5.63
32	China Communications Services Corporation Limited	552 HK	4,315,867.80	5.59
33	Lenovo Group Limited	992 HK	4,231,611.82	5.49
34	CLP Holdings Ltd.	2 HK	4,092,134.76	5.30
35	CRRC Corporation Limited	1766 HK	4,024,535.90	5.22
36	China Railway Group Limited	390 HK	4,005,928.10	5.19
37	Cnooc Limited	883 HK	3,993,123.88	5.18
38	China Securities Co., Ltd.	6066 HK	3,979,336.27	5.16
39	Beijing Enterprises Holdings Ltd.	392 HK	3,975,420.80	5.15
40	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	2601 HK	3,938,322.11	5.11
41	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	3,909,723.93	5.07
42	Postal Savings Bank of China Co., Ltd.	1658 HK	3,907,985.32	5.07
43	ASMPT Limited	522 HK	3,679,813.23	4.77
44	Hengan International	1044 HK	3,654,745.36	4.74

	Group Company Limited			
45	China Unicom (Hong Kong) Limited	762 HK	3,511,495.11	4.55
46	China State Construction International Holdings Limited	3311 HK	3,481,449.19	4.51
47	Hang Lung Properties Ltd.	101 HK	3,419,934.78	4.43
48	Sun Hung Kai Properties Ltd.	16 HK	3,339,999.40	4.33
49	Swire Pacific Ltd.	19 HK	2,839,703.46	3.68
50	China Telecom Corporation Limited	728 HK	2,434,871.80	3.16

7.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	6,603,968.38	8.56
2	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	6,285,349.25	8.15
3	China Minsheng Banking Corp., Ltd.	1988 HK	5,353,831.56	6.94
4	China Citic Bank Corporation Limited	998 HK	5,315,974.75	6.89
5	New China Life Insurance Company Ltd.	1336 HK	4,881,123.01	6.33
6	China Galaxy Securities Co., Ltd.	6881 HK	4,872,662.90	6.32
7	Bank of Communications Co., Ltd.	3328 HK	4,620,162.97	5.99
8	Petrochina Company Limited	857 HK	4,597,461.20	5.96
9	Bank of China Limited	3988 HK	4,584,042.30	5.94
10	Agricultural Bank of China Limited	1288 HK	4,582,975.29	5.94
11	China Merchants Port	144 HK	4,574,523.13	5.93

	Holdings Company Limited			
12	China Cinda Asset Management Co., Ltd.	1359 HK	4,434,144.05	5.75
13	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	4,315,248.29	5.59
14	China Construction Bank Corporation	939 HK	4,314,311.98	5.59
15	CITIC Limited	267 HK	4,313,057.46	5.59
16	China Mobile Limited	941 HK	4,014,020.55	5.20
17	PICC Property and Casualty Company Limited	2328 HK	4,011,423.65	5.20
18	Baic Motor Corporation Limited	1958 HK	3,974,969.78	5.15
19	The People's Insurance Company (Group) of China Limited	1339 HK	3,895,982.58	5.05
20	Power Assets Holdings Limited	6 HK	3,802,820.73	4.93
21	Dongfeng Motor Group Company Limited	489 HK	3,565,916.66	4.62
22	Kerry Properties Limited	683 HK	3,548,440.87	4.60
23	Henderson Land Development Co. Ltd.	12 HK	3,416,738.77	4.43
24	Zhejiang Expressway Co., Ltd.	576 HK	3,389,370.94	4.39
25	Beijing Enterprises Water Group Limited	371 HK	3,385,726.01	4.39
26	Far East Horizon Limited	3360 HK	3,361,150.94	4.36
27	CK Infrastructure Holdings Limited	1038 HK	3,341,400.37	4.33
28	Huatai Securities Co., Ltd.	6886 HK	3,272,672.66	4.24
29	China Railway Construction Corporation Limited	1186 HK	3,241,524.43	4.20
30	CK Hutchison Holdings Limited	1 HK	3,240,511.66	4.20

31	China Securities Co., Ltd.	6066 HK	3,128,160.41	4.06
32	China Communications Construction Company Limited	1800 HK	3,118,960.06	4.04
33	China Communications Services Corporation Limited	552 HK	3,110,360.82	4.03
34	Beijing Enterprises Holdings Ltd.	392 HK	3,029,424.34	3.93
35	CLP Holdings Ltd.	2 HK	2,952,805.20	3.83
36	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	2,927,662.74	3.80
37	Lenovo Group Limited	992 HK	2,921,588.20	3.79
38	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	2601 HK	2,912,113.93	3.78
39	Postal Savings Bank of China Co., Ltd.	1658 HK	2,866,106.71	3.72
40	CRRC Corporation Limited	1766 HK	2,849,058.53	3.69
41	Cnooc Limited	883 HK	2,833,157.80	3.67
42	China Railway Group Limited	390 HK	2,831,085.26	3.67
43	China State Construction International Holdings Limited	3311 HK	2,561,030.81	3.32
44	China Unicom (Hong Kong) Limited	762 HK	2,535,187.30	3.29
45	ASMPT Limited	522 HK	2,451,452.28	3.18
46	Hengan International Group Company Limited	1044 HK	2,434,015.96	3.16
47	Sun Hung Kai Properties Ltd.	16 HK	2,333,846.59	3.03
48	Hang Lung Properties Ltd.	101 HK	2,308,710.58	2.99
49	Swire Pacific Ltd.	19 HK	2,028,714.70	2.63
50	China Telecom Corporation Limited	728 HK	1,730,520.04	2.24

7.5.3 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	247,341,578.24
卖出收入（成交）总额	180,975,469.38

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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，中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚，在报告期内曾被中国银行间市场交易商协会立案调查。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会

重庆监管局的处罚。

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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	—
2	应收清算款	—
3	应收股利	1,793,433.24
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	414,891.00
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,208,324.24

7.11.4 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。

7.11.5 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。

7.11.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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(%)
1,740	43,171.84	43,351,890.00	57.71	31,767,110.00	42.29

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	BARCLAYS BANK PLC	29,202,500.00	38.87
2	陆家嘴国际信托有限公司	9,180,000.00	12.22
3	薛龙奇	5,877,400.00	7.82
4	中信建投证券股份有限公司	1,832,400.00	2.44
5	招商证券股份有限公司	1,425,990.00	1.90
6	陈更	1,235,800.00	1.65
7	申万宏源证券有限公司	1,058,000.00	1.41
8	苏金龙	1,000,000.00	1.33
9	沈海东	867,800.00	1.16
10	刘相中	696,700.00	0.93

8.3 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	—	—

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2023年04月19日)基金份额总额	265,119,000.00
基金合同生效日2023年4月19日起至报告期期末基金总申购份额	1,000,000.00
减：基金合同生效日2023年4月19日起至报告期期末基金总赎回份额	191,000,000.00
基金合同生效日2023年4月19日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	75,119,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 Company Limited	0	—	—	—	—	—

Australia and New Zealand Banking Group Limited	0	—	—	—	—	—
Bank of America – Merrill Lynch International	0	—	—	—	—	—
BANK OF CHINA (HONG KONG) LIMITED	0	—	—	—	—	—
Bank of China HK Branch	0	—	—	—	—	—
Bank of Montreal	0	—	—	—	—	—
Barclays Bank	0	—	—	—	—	—
Bernstein Bank	0	—	—	—	—	—
BNP PARIBAS Corporate & Institution Banking	0	—	—	—	—	—
BOCI Securities Limited	0	—	—	—	—	—
BOCOM International Holdings Company Limited	0	—	—	—	—	—
Cathay Securities((HK) Limited	0	—	—	—	—	—
CCB International Securities Limited	0	—	—	—	—	—
CEB International Capital Corporation Limited	0	—	—	—	—	—
Central Wealth Securities Investment Limited	0	—	—	—	—	—

CGS-CIMB Securities (HK) Ltd	0	—	—	—	—	—
China CITIC Bank International Limited	0	—	—	—	—	—
China Galaxy International Financial Holdings Limited	0	—	—	—	—	—
China Industrial Securities International Brokerage Limited	0	—	—	—	—	—
China International Capital Corporation HK Securities Ltd	0	53,163,008.69	12.41	5,316.29	6.62	—
China Merchants Securities (HK) Co., Limited	0	—	—	—	—	—
China Renaissance Securities (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
China Securities (International) Brokerage Company Limited	0	—	—	—	—	—
CITIC Futures International Co., Ltd	0	—	—	—	—	—
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
CITIBANK, N. A.	0	—	—	—	—	—

CLSA	0	142,647,069.10	33.30	28,529.46	35.51	—
CMB International Capital Corporation Limited	0	—	—	—	—	—
CMB International Global Markets Limited	0	—	—	—	—	—
CMB Wing Lung Bank Ltd.	0	—	—	—	—	—
CMBC Securities Company Limited	0	—	—	—	—	—
Credit Agricole Corporate and Investment Bank	0	—	—	—	—	—
CREDIT SUISSE (HK) LIMITED	0	—	—	—	—	—
CTI Capital Management Limited	0	—	—	—	—	—
Daiwa Capital Markets (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
DBS Bank Ltd., Hong Kong Branch	0	—	—	—	—	—
DBS Vickers (Hong Kong) Ltd	0	—	—	—	—	—
Deutsche Bank AG, London	0	—	—	—	—	—
DTCC Singapore PTE Ltd	0	—	—	—	—	—
Essence International Securities (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
Everbright Securities Investment Services (HK) Limited	0	—	—	—	—	—

FIL Investment Management (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
First Shanghai Investments Limited	0	—	—	—	—	—
GF Securities Co., Ltd.	0	—	—	—	—	—
Goldman Sachs	0	—	—	—	—	—
Goldman Sachs Gao Hua Securities Company Limited	0	—	—	—	—	—
Guosen Securities (HK) Financial Holdings Co., Ltd	0	—	—	—	—	—
Guotai Junan Securities (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
Haitong Bank, S. A.	0	—	—	—	—	—
Haitong International Securities Company Limited	0	232,506,969.72	54.28	46,501.55	57.88	—
Huatai Financial Holdings (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
ICBC International Securities Limited	0	—	—	—	—	—
Instinet Pacific Ltd.	0	—	—	—	—	—
Jefferies International Limited	0	—	—	—	—	—
JPMorgan Chase Bank, N. A.	0	—	—	—	—	—

Macquarie Group Limited	0	—	—	—	—	—
Mizuho Securities International	0	—	—	—	—	—
Morgan Stanley & Co. International PLC	0	—	—	—	—	—
NatWest Markets Plc	0	—	—	—	—	—
Nomura Singapore Limited	0	—	—	—	—	—
Orient Securities (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
Royal Bank of Canada	0	—	—	—	—	—
Shenwan Hongyuan Securities (H.K.) Limited	0	—	—	—	—	—
Societe Generale Corporate & Investment Banking	0	—	—	—	—	—
Soochow Securities (Hong Kong) Financial Holdings Limited	0	—	—	—	—	—
SPDB International Holdings Limited	0	—	—	—	—	—
Standard Chartered Bank	0	—	—	—	—	—

The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	0	—	—	—	—	—
Toronto-Dominion Bank	0	—	—	—	—	—
UBS Securities Asia Limited	0	—	—	—	—	—
UOB Kay Hian (HK) Limited	0	—	—	—	—	—
Valuable Capital Limited	0	—	—	—	—	—
Zhongtai International Financial Products Limited	0	—	—	—	—	—
Zurcher Kantonalbank	0	—	—	—	—	—
长江证券	3	—	—	—	—	—
诚通证券	2	—	—	—	—	—
东方证券	2	—	—	—	—	—
东吴证券	2	—	—	—	—	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	2	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—
海通证券	2	—	—	—	—	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—
华西证券	2	—	—	—	—	—
民生证券	3	—	—	—	—	—
申港证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	2	—	—	—	—	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	2	—	—	—	—	—
浙商证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—

中信建投	2	—	—	—	—	—
中信证券	2	—	—	—	—	—

10.7.2 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 Company Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Australia and New Zealand Banking Group Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Bank of America Merrill Lynch International	—	—	—	—	—	—	—	—

BANK OF CHINA (HONG KONG) LIMITED	—	—	—	—	—	—	—	—
Bank of China HK Branch	—	—	—	—	—	—	—	—
Bank of Montreal	—	—	—	—	—	—	—	—
Barclays Bank	—	—	—	—	—	—	—	—
Bernstein Bank	—	—	—	—	—	—	—	—
BNP PARIBAS Corporate & Institution Banking	—	—	—	—	—	—	—	—
BOCI Securities Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

BOCOM Intern ationa l Holdin gs Compan y Limite d	—	—	—	—	—	—	—	—
Cathay Securi ties((HK) Limite d	—	—	—	—	—	—	—	—
CCB Intern ationa l Securi ties Limite d	—	—	—	—	—	—	—	—
CEB Intern ationa l Capita l Corpor ation Limite d	—	—	—	—	—	—	—	—
Centra l Wealth Securi ties Invest ment Limite d	—	—	—	—	—	—	—	—

CGS-CIMB Securities (HK) Ltd	—	—	—	—	—	—	—	—
China CITIC Bank International Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
China Galaxy International Financial Holdings Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
China Industrial Securities International Brokerage Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

China International Capital Corporation HK Securities Ltd	—	—	—	—	—	—	—	—
China Merchants Securities (HK) Co., Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
China Renaissance Securities (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
China Securities (International) Brokerage Company Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

CITIC Future s Intern ationa l Co.,Lt d	—	—	—	—	—	—	—	—
CITIC Securi ties Broker age (HK) Limite d	—	—	—	—	—	—	—	—
CITIBA NK, N. A.	—	—	—	—	—	—	—	—
CLSA	—	—	—	—	—	—	—	—
CMB Intern ationa l Capita l Corpor ation Limite d	—	—	—	—	—	—	—	—
CMB Intern ationa l Global Market s Limite d	—	—	—	—	—	—	—	—
CMB Wing Lung Bank Ltd.	—	—	—	—	—	—	—	—

CMBC Securities Company Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Credit Agricole Corporate and Investment Bank	—	—	—	—	—	—	—	—
CREDIT SUISSE (HK) LIMITED	—	—	—	—	—	—	—	—
CTI Capital Management Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Daiwa Capital Markets (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
DBS Bank Ltd., Hong Kong Branch	—	—	—	—	—	—	—	—

DBS Vickers (Hong Kong) Ltd	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsche Bank AG, London	—	—	—	—	—	—	—	—
DTCC Singapore PTE Ltd	—	—	—	—	—	—	—	—
Essence International Securities (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Everbright Securities Investment Services (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

FIL Invest ment Manage ment (HK) Limite d	—	—	—	—	—	—	—	—
First Shangh ai Invest ments Limite d	—	—	—	—	—	—	—	—
GF Securi ties Co., Ltd.	—	—	—	—	—	—	—	—
Goldma n Sachs	—	—	—	—	—	—	—	—
Goldma n Sachs Gao Hua Securi ties Compan y Limite d	—	—	—	—	—	—	—	—
Guosen Securi ties (HK) Financ ial Holdin gs Co., Ltd	—	—	—	—	—	—	—	—

Guotai Junan Securities (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Haitong Bank, S.A.	—	—	—	—	—	—	—	—
Haitong International Securities Company Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Huatai Financial Holdings (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
ICBC International Securities Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Instinet Pacific Ltd.	—	—	—	—	—	—	—	—

Jefferies International Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
JPMorgan Chase Bank, N. A.	—	—	—	—	—	—	—	—
Macquarie Group Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Mizuho Securities International	—	—	—	—	—	—	—	—
Morgan Stanley & Co. International PLC	—	—	—	—	—	—	—	—
NatWest Markets Plc	—	—	—	—	—	—	—	—
Nomura Singapore Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Orient Securities (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

Royal Bank of Canada	—	—	—	—	—	—	—	—
Shenwan Hongyuan Securities (H.K.) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Societe Generale Corporate & Investment Banking	—	—	—	—	—	—	—	—
Soochow Securities (Hong Kong) Financial Holdings Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
SPDB International Holdings Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

Standard Chartered Bank	—	—	—	—	—	—	—	—
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Toronto-Dominion Bank	—	—	—	—	—	—	—	—
UBS Securities Asia Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
UOB Kay Hian (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Valuable Capital Limited	—	—	—	—	—	—	—	—

Zhongtai International Financial Products Limited	—	—	—	—	—	—	—	—
Zurcher Kanton albank	—	—	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—	—	—
诚通证券	—	—	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—	—	—
华西证券	—	—	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—	—	—
申港证券	—	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—	—	—

太平洋 证券	—	—	—	—	—	—	—	—
银河证 券	—	—	—	—	—	—	—	—
浙商证 券	—	—	—	—	—	—	—	—
中金公 司	—	—	—	—	—	—	—	—
中信建 投	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证 券	—	—	—	—	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同生效公告	规定披露媒介	2023年04月20日
2	富国基金管理有限公司关于富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）投资关联方证券的公告	规定披露媒介	2023年04月21日
3	富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）上市交易公告书	规定披露媒介	2023年04月25日
4	富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）开放申购、赎回业务公告	规定披露媒介	2023年04月25日
5	富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）关于2023年境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	规定披露媒介	2023年04月28日
6	富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）上市交易提示性公告	规定披露媒介	2023年04月28日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023-04-28 至 2023-06-30	—	217,372,300.00	188,169,800.00	29,202,500.00	38.87%
个人	1	2023-05-05 至 2023-05-07; 2023-06-02 至 2023-06-04; 2023-06-06 至 2023-06-11	—	119,769,400.00	119,769,400.00	—	—
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							

§ 12 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恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的文件 2、富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同 3、富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（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、富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（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	中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费） 公司 网 址： http://www.fullgoal.com.cn 。