

富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
二〇二一年中期报告

2021 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： 2021 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 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）起至 2021 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.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
§4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8	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.....	12
§5	托管人报告.....	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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 12	
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.....	12
§6	中期财务报表(未经审计).....	12
6.1	资产负债表.....	12
6.2	利润表.....	14
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	15
6.4	报表附注.....	15
§7	投资组合报告.....	41
7.1	期末基金资产组合情况.....	42
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	44
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	60
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	60
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	60
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	60

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12	投资组合报告附注	62
§8	基金份额持有人信息	64
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2	期末上市基金前十名持有人	64
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§9	开放式基金份额变动	65
§10	重大事件揭示	65
10.1	基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4	基金投资策略的改变	65
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
10.8	其他重大事件	68
§11	影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	69
§12	备查文件目录	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	富国中证沪港深 500ETF
场内简称	500ETF 沪港深
基金主代码	517100
交易代码	517100
基金运作方式	契约型，交易型开放式。
基金合同生效日	2021 年 02 月 09 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（单位：份）	607,102,125.00
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	2021 年 3 月 2 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	本基金主要采用复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股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 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的资产配置策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证沪港深 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与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股及备选成份股（均含存托凭证），具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金投资港股通标的股票的，将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	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	010-66594319
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fcid@bankofchina.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	北京市西城区复兴门内大

	区世纪大道 1196 号世纪汇 办公楼二座 27-30 层	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	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披 露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正 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

2.5 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、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	2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
本期已实现收益	-8,532,569.13
本期利润	-34,491,456.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0490
本期加权平均净值利润率	-5.21%
本期基金份额净值增长率	-3.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	-23,674,290.99
期末可供分配基金份额利润	-0.0390
期末基金资产净值	583,427,834.01

期末基金份额净值	0.9610
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-3.90%

注：本基金于2021年2月9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。

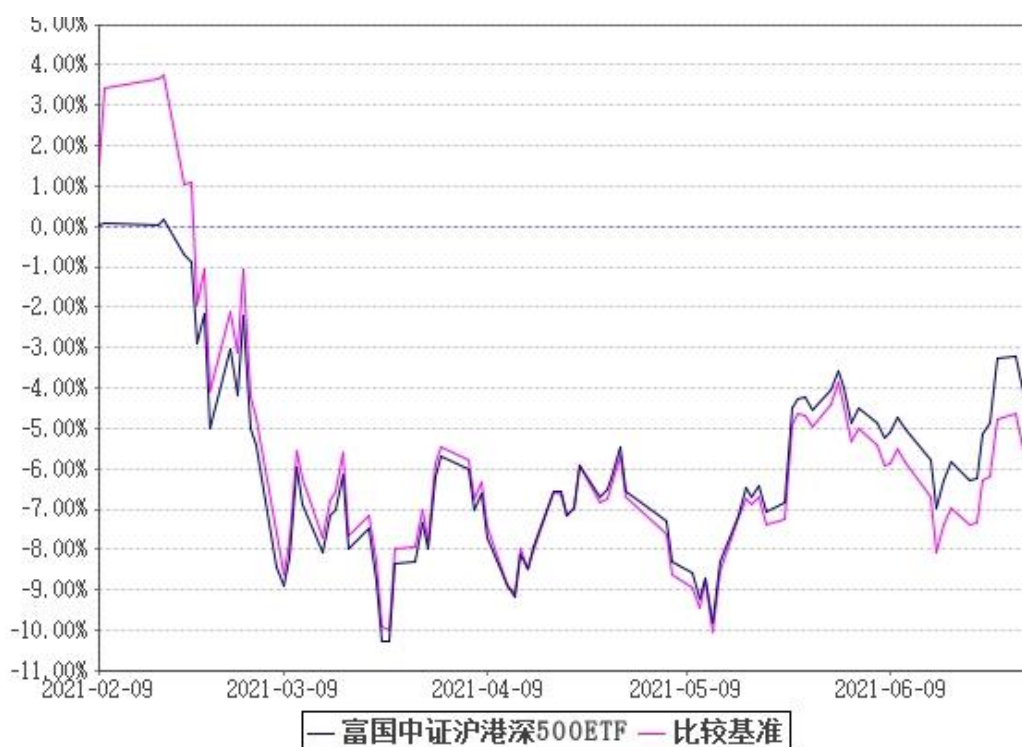
期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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	0.17%	0.71%	-1.02%	0.73%	1.19%	-0.02%
过去三个月	4.42%	0.86%	2.62%	0.89%	1.80%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-3.90%	1.11%	-5.40%	1.23%	1.50%	-0.12%

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



注：1、截止日期为 2021 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2021 年 2 月 9 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 2021 年 2 月 9 日起至 2021 年 8 月 8 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

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至 2021 年 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、富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金等 212 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张圣贤	本基金基金经理	2021-02-09	—	14.0	硕士，曾任上海申银万国证券研究所有限公司研究员；自 2015 年 3 月加入富国基金管理有限公司，历任基金经理助理、量化投资部量化投资总监助理；现任富国基金量化投资部量化投资副总监兼定量基金经理。2015 年 6 月起任富国中证军工指数型证券投资基金（原富国中证军工指数分级证

				<p>券投资基金，于2021年1月1日更名）、富国中证国有企业改革指数型证券投资基金（原富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）、富国中证新能源汽车指数型证券投资基金（原富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）基金经理；自2015年8月起任富国中证工业4.0指数型证券投资基金（原富国中证工业4.0指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）、富国中证体育产业指数型证券投资基金（原富国中证体育产业指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）基金经理，2016年2月起任富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）基金经理，2017年7月至2020年12月任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2017年11月起任富国中证煤炭指数型证券投资基金（原富国中证煤炭指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）基金经理，2020年4月起任富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020年7月起担任富国上海金交易型开放式证券投资基金、富国上海金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理，2020年12月起任富国中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、富国中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021年2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，2021年6月起任富国中证现代物流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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.2 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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现 5 次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初以来，在中欧投资协定达成、PMI 向好、货币政策不急转弯等多重利好因素的刺激下，市场风险偏好大幅提升。在美国新一轮财政刺激落地，国内公募基金发行火爆等消息的推动下，上证指数先后突破 3500、3600 点。随着美国经济复苏预期加强，美国 10 年期国债利率快速突破 1.5%，导致全球投资者对美联储货币政策提前收缩的担忧加大，使得全球股市均出现不同程度的下跌。3 月下旬，随着上市公司年报、季报预告陆续披露，部分估值相对合理的公司开始企稳反弹。同时海外疫情再度爆发，美国 10 年期国债利率升幅放缓，A 股快速杀估值阶段告一段落，前期调整较多的板块陆续迎来反弹。4 月下旬，印度疫情超预期爆发，使得货币政策收紧预期进一步降低，市场持续反弹。5 月初，商品价格再度大幅上涨，螺纹钢、铜等品种创出本轮反弹新高，钢铁、煤炭、有色等周期板块大幅上涨。市场通胀预期大幅提升，成长板块出现明显回调。5 月中旬起，国常会多次开会聚焦大宗商品价格问题，指出要高度重视大宗商品价格攀升带来的不利影响。国内相关大宗商品如钢价、煤价迎来大幅调整。随着通胀预期下降，市场风险偏好再度提升，消费、科技、医药、新能源等板块迎来大幅反弹。6 月中，美联储会议并未实质性讨论收紧购债规模，同时美国 10 年期国债利率进一步走低，因此短期流动性未受到明显影响，市场继续反弹。其中，景气度较高的新能源汽车、光伏、半导体等板块涨幅居前。总体来看，2021 年上半年上证综指上涨 3.4%，沪深 300 上涨 0.24%，创业板指上涨 17.22%，中证 500 指数上涨 6.93%。

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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.9610 元；份额累计净值为 0.9610 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 -3.90%，同期业绩比较基准收益率为 -5.40%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，由于美国非农就业人数仍未明显好转，美联储收紧货币政策仍需等待，因此 3 季度市场仍存在流动性宽松的窗口期。随着中报业绩披露，市场仍存在结构性机会。从行业配置上，随着前期成长板块大幅上涨后，需关注部分公司估值过高的风险，适当均衡配置，关注业绩与估值的匹配情况。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 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”）在富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金（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 中期财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 (2021 年 06 月 30 日)
资产：	
银行存款	6,229,868.66
结算备付金	128,694.97
存出保证金	196,997.93

交易性金融资产	577,253,318.08
其中：股票投资	577,031,155.23
基金投资	—
债券投资	222,162.85
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收证券清算款	456,462.39
应收利息	872.54
应收股利	1,564,349.32
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	585,830,563.89
负债和所有者权益	本期末 (2021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	—
应付证券清算款	1,871,556.75
应付赎回款	—
应付管理人报酬	241,963.07
应付托管费	48,392.61
应付销售服务费	—
应付交易费用	158,052.76
应交税费	—
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	82,764.69
负债合计	2,402,729.88
所有者权益：	
实收基金	607,102,125.00
未分配利润	-23,674,290.99
所有者权益合计	583,427,834.01
负债和所有者权益总计	585,830,563.89

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9610 元，基金份额总额 607,102,125.00 份。本基金合同生效日 2021 年 02 月 09 日。

6.2 利润表

会计主体：富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 02 月 09 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
一、收入	-31,270,052.91
1. 利息收入	389,496.23
其中：存款利息收入	389,394.28
债券利息收入	101.95
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）	-6,006,722.57
其中：股票投资收益	-11,680,122.04
基金投资收益	—
债券投资收益	113,979.94
资产支持证券投资收益	—
贵金属投资收益	—
衍生工具投资收益	—
股利收益	5,559,419.53
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-25,958,887.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	306,061.12
减：二、费用	3,221,403.91
1. 管理人报酬	1,286,541.68
2. 托管费	257,308.34
3. 销售服务费	—
4. 交易费用	1,588,773.10
5. 利息支出	—
其中：卖出回购金融资产支出	—
6. 税金及附加	0.19
7. 其他费用	88,780.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-34,491,456.82
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-34,491,456.82

注：本基金合同生效日为 2021 年 2 月 9 日，无上年度同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 02 月 09 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	787,102,125.00	—	787,102,125.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-34,491,456.82	-34,491,456.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-180,000,000.00	10,817,165.83	-169,182,834.17
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	-180,000,000.00	10,817,165.83	-169,182,834.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	607,102,125.00	-23,674,290.99	583,427,834.01

注：本基金合同生效日为 2021 年 2 月 9 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

富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可（2020）3527 号文《关于准予富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为管理人于 2021 年 1 月 25 日至 2021 年 2 月 3 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2021）验字第 60467606_B08 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2021 年 2 月 9 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 787,102,125.00 元，其中以现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除认

购费后的净认购金额为人民币 783,259,000.00 元，折合基金份额 783,259,000.00 份；其中网上现金认购份额为 783,259,000.00 份，网下现金认购份额为 0.00 份；以股票认购方式按认购期最后一日的均价计算的金额为人民币 3,843,125.00 元，折合 3,843,125.00 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 217,440.68 元，其中通过管理人进行的网下现金认购的有效认购资金在首次募集期间未产生利息；网上现金认购的有效认购资金在首次募集期间产生的利息人民币 217,440.68 元计入基金财产，不折算为投资者基金份额。与首次募集相关的资产总额为人民币 787,319,565.68 元，折合 787,102,125.00 份基金份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票、港股通标的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、金融衍生工具（股指期货、国债期货）、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。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股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不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：中证沪港深 500 指数收益率。

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、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 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》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务

指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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2021年2月9日（基金合同生效日）至2021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分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

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

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的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣

除交易费用入账；

投资者申购本基金时交付的股票于申购日计入股票投资，股票投资成本以申购日该股票收盘价确认的价值入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

投资者赎回本基金时交付的股票于赎回日确认股票差价收入，交付的股票的成本于赎回日采用加权平均法结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 国债期货投资

买入或卖出国债期货投资于成交日确认为国债期货投资。国债期货初始合约价值按成交金额确认；

国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(6) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(7) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

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。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(11) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

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

(13) 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，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，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入。

(14) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

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在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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。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，但应于变更实施日前在规定媒介公告。
- 本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

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。

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

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。

6.4.5 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

1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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

2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（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。

4 企业所得税

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

5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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（2021年06月30日）
活期存款	6,229,868.66
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
合计	6,229,868.66

注：本基金本报告期末未持有定期存款。本基金合同生效日为2021年02月09日。无上年度同期对比数据。

6.4.7.2交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	602,996,705.77	577,031,155.23	-25,965,550.54
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	222,162.85	6,662.85
	银行间市场	—	—
	合计	222,162.85	6,662.85
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	603,212,205.77	577,253,318.08	-25,958,887.69

6.4.7.3衍生金融资产/负债

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应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）
应收活期存款利息	499.87
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	245.77
应收债券利息	16.87
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	110.03
合计	872.54

6.4.7.6其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）
交易所市场应付交易费用	158,052.76
银行间市场应付交易费用	—
合计	158,052.76

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2021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	—
预提信息披露费	50,000.00
预提审计费	26,135.10
IOPV 计算发布费	6,629.59
合计	82,764.69

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日 2021 年 2 月 9 日	787,102,125.00	787,102,125.00
本期申购	—	-
本期赎回（以“-”号填列）	-180,000,000.00	-180,000,000.00
本期末	607,102,125.00	607,102,125.00

注：本基金合同于 2021 年 2 月 9 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 787,102,125.00 元，其中以现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 783,259,000.00 元，折合基金份额 783,259,000.00 份；以股票认购方式按认购期最后一日的均价计算的金额为人民币 3,843,125.00 元，折合 3,843,125.00 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 217,440.68 元，均为网上现金认购的有效认购资金在首次募集期间产生的利息共计人民币 217,440.68 元，计入基金财产，不折算为投资者基金份额。与首次募集相关的资产总额为人民币 787,319,565.68 元，折合 787,102,125.00 份基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合
----	-------	-------	--------

			计
基金合同生效日 2021 年 2 月 9 日	—	—	—
本期利润	-8,532,569.13	-25,958,887.69	-34,491,456.82
本期基金份额交易产生的变动数	1,318,988.22	9,498,177.61	10,817,165.83
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	1,318,988.22	9,498,177.61	10,817,165.83
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-7,213,580.91	-16,460,710.08	-23,674,290.99

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	344,530.08
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	41,292.13
其他	3,572.07
合计	389,394.28

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-7,938,353.93
股票投资收益——赎回差价收入	-3,741,768.11
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	-11,680,122.04

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	243,001,497.32
减：卖出股票成本总额	250,939,851.25
买卖股票差价收入	-7,938,353.93

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日

	月 30 日
赎回基金份额对价总额	169,182,834.17
减：现金支付赎回款总额	114,200,938.17
减：赎回股票成本总额	58,723,664.11
赎回差价收入	-3,741,768.11

6.4.7.12.4 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。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期2021年2月9日(基金合同生效日)至2021年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	610,566.53
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	496,500.00
减：应收利息总额	86.59
买卖债券差价收入	113,979.94

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

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 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021
----	----------------------------------

	年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,559,419.53
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	5,559,419.53

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-25,958,887.69
股票投资	-25,965,550.54
债券投资	6,662.85
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	-25,958,887.69

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	—
替代损益	306,061.12
合计	306,061.12

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日。无上年度同期对比数据。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,588,773.10
银行间市场交易费用	—
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	1,588,773.10

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日。无上年度同期对比数据。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	26,135.10
信息披露费	50,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	5,615.91
其他	7,029.59
合计	88,780.60

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

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、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

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 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
海通证券	519,912,124.40	45.33
申万宏源	12,153,525.74	1.06

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
申万宏源	343,664.51	56.29
海通证券	151,251.80	24.77

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.4 回购交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行回购交易。本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2021年2月9日(基金合同生效日)至2021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 (%)
申万宏源	11,075.74	1.50	3,630.93	2.30
海通证券	281,318.83	38.14	40,747.30	25.78

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。本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 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 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,286,541.68
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% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 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 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	257,308.34

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。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，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 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。本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。本基金合同生效日为2021年02月09日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。本基金合同生效日为2021年02月09日，无上年度末对比数据。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期2021年2月9日(基金合同生效日)至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	6,229,868.66	344,530.08

注：本基金合同生效日为2021年02月09日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期2021年2月9日(基金合同生效日)至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
海通证券股份有限公司	300981	中红医疗	IPO网下申购	5,660	275,019.40
海通证券股份有限公司	688217	睿昂基因	IPO网下申购	1,040	19,252.58
海通证券股份有限公司	688685	迈信林	IPO网下申购	2,612	23,678.04
海通证券股份有限公司	688682	霍莱沃	IPO网下申购	946	43,467.38
海通证券股份有限公司	688092	爱科科技	IPO网下申购	1,137	21,836.71
海通证券股份有限公司	688626	翔宇医疗	IPO网下申购	3,652	105,776.89
海通证券股份有限公司	688329	艾隆科技	IPO网下	1,846	31,186.42

公司			申购		
----	--	--	----	--	--

注：本基金合同生效日为2021年02月09日。无上年度同期对比数据。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 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管理人股东发行的股票海通证券（600837.SH）、基金管理人股东的母公司发行的股票申万宏源（000166.SZ）和基金托管人及其关联方发行的股票中国银行（601988.SH）、中国银行（3988.HK）、中银证券（601696.SH）、中银香港（2388.HK）以及中银航空租赁（2588.HK）。

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（2021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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	—
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股限售	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	—
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	—
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	558	26,410.14	140,593.68	—
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	—
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	—
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	—
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	—
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股限售	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	—
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股限售	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	—
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	—
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股限售	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	—
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	—
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	—

300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	33.22	87.50	897	29,798.34	78,487.50	—
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	566	27,501.94	51,160.74	—
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	—
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	—
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股限售	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	—
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	—
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	—
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	—
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股限售	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	—
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	—
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	—
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股限售	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	—
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	—
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	—
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股认购	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股认购	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	—
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股认购	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	—
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股认购	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	—
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股认购	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	—
688097	博众精工	2021-04-29	2021-11-12	新股限售	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83	—
688109	品茗股份	2021-03-22	2021-09-30	新股限售	50.05	72.10	1,301	65,115.05	93,802.10	—
688217	睿昂基因	2021-05-07	2021-11-17	新股限售	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00	—
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股认购	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	—
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股认购	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	—
688269	凯立新材	2021-06-01	2021-12-09	新股限售	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	—
688468	科美诊断	2021-03-31	2021-10-11	新股限售	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	—
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股认购	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	—
688611	杭州柯林	2021-04-01	2021-10-12	新股限售	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00	—
688663	新风光	2021-04-06	2021-10-13	新股限售	14.48	19.21	3,279	47,479.92	62,989.59	—
688681	科汇股份	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	9.56	14.54	1,899	18,154.44	27,611.46	—

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113049	长汽转债	2021-06-10	2021-07-08	认购新发 证券	100.00	100.00	100	10,000.00	10,000.00	
113050	南银转债	2021-06-15	2021-07-01	认购新发 证券	100.00	100.00	1,630	163,000.00	163,000.00	

123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	认购新发 证券	100.00	100.00	62	6,200.00	6,200.00	
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	认购新发 证券	100.00	100.00	148	14,800.00	14,800.00	

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021-06-16	筹划重大事项	5.59	2021-07-06	6.15	51,300	361,612.71	286,767.00	—

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 2021 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 2021 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。

6.4.13 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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%，但标的指数成分券不受此限。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不在

下表进行列示。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的信用债。本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日。无上年度同期对比数据。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2021 年 06 月 30 日）
AAA	173,000.00
AAA 以下	49,162.85
未评级	—
合计	222,162.85

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日。无上年度同期对比数据。本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日。无上年度同期对比数据。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有同业存单。本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日。无上年度同期对比数据。

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。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在 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基金资产净值的 15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金本报告期末无重大流动性风险。

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、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

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（2021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	6,229,868.66	—	—	—	—	—	6,229,868.66
结算备付金	128,694.97	—	—	—	—	—	128,694.97
存出保证金	196,997.93	—	—	—	—	—	196,997.93
交易性金融资产	—	—	222,162.85	—	—	577,031,155.23	577,253,318.08
应收证券清算款	—	—	—	—	—	456,462.39	456,462.39
应收利息	—	—	—	—	—	872.54	872.54
应收股利	—	—	—	—	—	1,564,349.32	1,564,349.32
资产总计	6,555,561.56	—	222,162.85	—	—	579,052,839.48	585,830,563.89
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	1,871,556.75	1,871,556.75
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	241,963.07	241,963.07
应付托管费	—	—	—	—	—	48,392.61	48,392.61
应付交易费用	—	—	—	—	—	158,052.76	158,052.76
其他负债	—	—	—	—	—	82,764.69	82,764.69
负债总计	—	—	—	—	—	2,402,729.88	2,402,729.88
利率敏感度缺口	6,555,561.56	—	222,162.85	—	—	576,650,109.60	583,427,834.01

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2021年02月09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（2021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					
交易性金融资产	—	273,567,572.50	—	—	273,567,572.50
应收股利	—	1,564,349.32	—	—	1,564,349.32
资产合计	—	275,131,921.82	—	—	275,131,921.82
以外币计价的负债					
负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	—	275,131,921.82	—	—	275,131,921.82

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：元）
		本期末（2021年06月30日）
	港币相对人民币贬值1%	-2,751,319.22
	港币相对人民币升值1%	2,751,319.22

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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股、备选成份股（均含存托凭证）和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票、港股通标的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、金融衍生工具（股指期货、国债期货）、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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不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。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2021年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	577,031,155.23	98.90
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	222,162.85	0.04
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	577,253,318.08	98.94

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。

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：元）
		本期末（2021年06月30日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	5,057,979.62
	2. 业绩比较基准减少 1%	-5,057,979.62

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币575,238,914.45元，属于第二层次的余额为人民币814,213.37元，属于第三层次余额为人民币1,200,190.26元。

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期变动情况如下：

本期变动人民币1,200,190.26元，本期末人民币1,200,190.26元。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	577,031,155.23	98.50
	其中：股票	577,031,155.23	98.50
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	222,162.85	0.04
	其中：债券	222,162.85	0.04
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	6,358,563.63	1.09
8	其他各项资产	2,218,682.18	0.38
9	合计	585,830,563.89	100.00

注：本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 273,567,572.50 元，占资产净值比例为 46.89%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 积极投资按行业分类的股票投资组合：

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,439.50	0.00
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,324,603.02	0.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	55,583.76	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	124,279.74	0.02
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—

N	水利、环境和公共设施管理业	30,146.60	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,598,808.55	0.27

7.2.1.2 指数投资按行业分类的股票投资组合：

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,940,496.00	0.50
B	采矿业	5,600,422.00	0.96
C	制造业	176,683,865.64	30.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,646,427.00	0.80
E	建筑业	3,372,713.00	0.58
F	批发和零售业	1,725,478.80	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	8,079,623.40	1.38
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,355,076.00	2.12
J	金融业	63,247,191.16	10.84
K	房地产业	5,849,853.00	1.00
L	租赁和商务服务业	4,945,198.20	0.85
M	科学研究和技术服务业	4,702,726.80	0.81
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	764,574.00	0.13
Q	卫生和社会工作	5,898,687.18	1.01
R	文化、体育和娱乐业	1,052,442.00	0.18
S	综合	—	—
	合计	301,864,774.18	51.74

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
医疗保健	16,665,558.00	2.86
房地产	19,681,975.00	3.37
金融	75,275,427.00	12.90
能源	5,096,490.00	0.87

原材料	2,214,135.00	0.38
信息技术	16,946,715.00	2.90
日常消费品	10,369,514.00	1.78
非日常生活消费品	48,503,456.00	8.31
工业	12,656,245.00	2.17
公用事业	9,263,961.50	1.59
通信服务	56,894,096.00	9.75
合计	273,567,572.50	46.89

注：1、以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

2、以上行业分类的统计中已包含深港通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	7,500	15,425,250.00	2.64
2	300750	宁德时代	18,100	9,679,880.00	1.66
3	601318	中国平安	130,500	8,388,540.00	1.44
4	600036	招商银行	148,976	8,073,009.44	1.38
5	000858	五粮液	23,400	6,970,626.00	1.19
6	601012	隆基股份	55,140	4,898,637.60	0.84
7	000333	美的集团	59,400	4,239,378.00	0.73
8	002415	海康威视	62,300	4,018,350.00	0.69
9	600276	恒瑞医药	53,860	3,660,864.20	0.63
10	601166	兴业银行	175,100	3,598,305.00	0.62
11	601888	中国中免	11,802	3,541,780.20	0.61
12	603259	药明康德	22,520	3,526,406.80	0.60
13	300760	迈瑞医疗	7,172	3,442,918.60	0.59
14	300059	东方财富	99,460	3,261,293.40	0.56
15	600900	长江电力	152,300	3,143,472.00	0.54
16	000651	格力电器	57,900	3,016,590.00	0.52
17	002475	立讯精密	62,800	2,888,800.00	0.50
18	000725	京东方A	454,200	2,834,208.00	0.49
19	002594	比亚迪	10,900	2,735,900.00	0.47
20	600887	伊利股份	73,300	2,699,639.00	0.46
21	000001	平安银行	116,800	2,642,016.00	0.45
22	300015	爱尔眼科	37,041	2,629,170.18	0.45
23	600030	中信证券	102,500	2,556,350.00	0.44
24	601816	京沪高铁	432,200	2,286,338.00	0.39
25	601398	工商银行	421,800	2,180,706.00	0.37
26	300122	智飞生物	11,500	2,147,395.00	0.37

27	603501	韦尔股份	6,400	2,060,800.00	0.35
28	000568	泸州老窖	8,700	2,052,678.00	0.35
29	600309	万华化学	18,800	2,045,816.00	0.35
30	600031	三一重工	70,000	2,034,900.00	0.35
31	603288	海天味业	15,280	1,970,356.00	0.34
32	000002	万科A	82,000	1,952,420.00	0.33
33	600809	山西汾酒	4,300	1,926,400.00	0.33
34	002714	牧原股份	31,600	1,921,912.00	0.33
35	300782	卓胜微	3,400	1,827,500.00	0.31
36	688111	金山办公	4,600	1,816,080.00	0.31
37	002142	宁波银行	46,300	1,804,311.00	0.31
38	601919	中远海控	58,300	1,780,482.00	0.31
39	600436	片仔癀	3,700	1,658,710.00	0.28
40	601328	交通银行	330,700	1,620,430.00	0.28
41	601899	紫金矿业	166,200	1,610,478.00	0.28
42	600837	海通证券	130,800	1,504,200.00	0.26
43	002352	顺丰控股	21,900	1,482,630.00	0.25
44	002304	洋河股份	7,000	1,450,400.00	0.25
45	002230	科大讯飞	21,400	1,446,212.00	0.25
46	300014	亿纬锂能	13,700	1,423,841.00	0.24
47	300274	阳光电源	12,300	1,415,238.00	0.24
48	600000	浦发银行	141,400	1,414,000.00	0.24
49	600438	通威股份	32,500	1,406,275.00	0.24
50	600050	中国联通	325,200	1,404,864.00	0.24
51	002812	恩捷股份	6,000	1,404,600.00	0.24
52	300124	汇川技术	18,550	1,377,523.00	0.24
53	000661	长春高新	3,500	1,354,500.00	0.23
54	000100	TCL 科技	168,800	1,291,320.00	0.22
55	603799	华友钴业	11,200	1,279,040.00	0.22
56	300347	泰格医药	6,600	1,275,780.00	0.22
57	300595	欧普康视	12,300	1,273,665.00	0.22
58	000063	中兴通讯	38,300	1,272,709.00	0.22
59	300896	爱美客	1,600	1,262,208.00	0.22
60	603986	兆易创新	6,700	1,258,930.00	0.22
61	688036	传音控股	6,000	1,257,000.00	0.22
62	002241	歌尔股份	28,600	1,222,364.00	0.21
63	601601	中国太保	41,100	1,190,667.00	0.20
64	600132	重庆啤酒	6,000	1,187,700.00	0.20
65	600690	海尔智家	45,600	1,181,496.00	0.20
66	600585	海螺水泥	28,700	1,178,135.00	0.20
67	601668	中国建筑	252,500	1,174,125.00	0.20

68	002271	东方雨虹	21,200	1,172,784.00	0.20
69	002027	分众传媒	123,600	1,163,076.00	0.20
70	002460	赣锋锂业	9,600	1,162,464.00	0.20
71	600703	三安光电	36,200	1,160,210.00	0.20
72	300142	沃森生物	18,700	1,153,790.00	0.20
73	600763	通策医疗	2,800	1,150,800.00	0.20
74	600016	民生银行	256,200	1,129,842.00	0.19
75	688012	中微公司	6,600	1,095,072.00	0.19
76	601658	邮储银行	216,100	1,084,822.00	0.19
77	600196	复星医药	14,600	1,053,098.00	0.18
78	601288	农业银行	345,900	1,048,077.00	0.18
79	600048	保利地产	86,300	1,039,052.00	0.18
80	002129	中环股份	26,700	1,030,620.00	0.18
81	000338	潍柴动力	57,200	1,022,164.00	0.18
82	600919	江苏银行	142,300	1,010,330.00	0.17
83	601229	上海银行	119,800	982,360.00	0.17
84	601688	华泰证券	62,100	981,180.00	0.17
85	600660	福耀玻璃	17,000	949,450.00	0.16
86	600570	恒生电子	10,000	932,500.00	0.16
87	600745	闻泰科技	9,600	930,240.00	0.16
88	601211	国泰君安	54,200	928,988.00	0.16
89	600104	上汽集团	42,100	924,937.00	0.16
90	600143	金发科技	44,000	917,840.00	0.16
91	601766	中国中车	146,300	889,504.00	0.15
92	300759	康龙化成	4,000	867,960.00	0.15
93	601169	北京银行	178,000	866,860.00	0.15
94	002371	北方华创	3,100	859,878.00	0.15
95	600999	招商证券	44,600	848,292.00	0.15
96	600019	宝钢股份	107,300	819,772.00	0.14
97	002311	海大集团	10,000	816,000.00	0.14
98	300601	康泰生物	5,400	804,600.00	0.14
99	002049	紫光国微	5,200	801,788.00	0.14
100	601988	中国银行	253,700	781,396.00	0.13
101	002410	广联达	11,400	777,480.00	0.13
102	601088	中国神华	39,800	776,896.00	0.13
103	600406	国电南瑞	33,360	775,286.40	0.13
104	300498	温氏股份	53,600	770,232.00	0.13
105	002607	中公教育	36,600	764,574.00	0.13
106	601799	星宇股份	3,352	756,613.44	0.13
107	601818	光大银行	199,200	752,976.00	0.13
108	300450	先导智能	12,360	743,330.40	0.13

109	000538	云南白药	6,400	740,608.00	0.13
110	000625	长安汽车	27,400	720,072.00	0.12
111	600028	中国石化	161,000	701,960.00	0.12
112	300454	深信服	2,700	700,596.00	0.12
113	688008	澜起科技	11,200	698,656.00	0.12
114	600893	航发动力	12,900	686,151.00	0.12
115	601628	中国人寿	20,000	677,800.00	0.12
116	600079	人福医药	23,900	675,653.00	0.12
117	300677	英科医疗	5,400	673,920.00	0.12
118	002821	凯莱英	1,800	670,680.00	0.11
119	600346	恒力石化	25,500	669,120.00	0.11
120	600588	用友网络	19,600	651,896.00	0.11
121	600009	上海机场	13,500	649,755.00	0.11
122	601633	长城汽车	14,800	645,132.00	0.11
123	601390	中国中铁	122,500	641,900.00	0.11
124	601009	南京银行	60,300	634,356.00	0.11
125	002493	荣盛石化	36,600	632,082.00	0.11
126	688169	石头科技	500	630,500.00	0.11
127	601916	浙商银行	158,600	629,642.00	0.11
128	000895	双汇发展	19,600	623,280.00	0.11
129	688185	康希诺	800	622,216.00	0.11
130	601377	兴业证券	64,400	622,104.00	0.11
131	002791	坚朗五金	3,200	620,960.00	0.11
132	601857	中国石油	117,000	618,930.00	0.11
133	600989	宝丰能源	44,200	604,656.00	0.10
134	601100	恒立液压	7,000	601,440.00	0.10
135	600584	长电科技	15,900	599,112.00	0.10
136	300413	芒果超媒	8,500	583,100.00	0.10
137	601966	玲珑轮胎	13,300	581,742.00	0.10
138	600150	中国船舶	35,100	579,501.00	0.10
139	600089	特变电工	44,700	574,395.00	0.10
140	601225	陕西煤业	48,200	571,170.00	0.10
141	002601	龙佰集团	16,300	563,654.00	0.10
142	601138	工业富联	45,300	562,173.00	0.10
143	300408	三环集团	13,200	559,944.00	0.10
144	600426	华鲁恒升	17,670	546,886.50	0.09
145	002179	中航光电	6,900	545,238.00	0.09
146	600111	北方稀土	26,300	544,410.00	0.09
147	603882	金域医学	3,400	543,218.00	0.09
148	000776	广发证券	35,700	540,498.00	0.09
149	601939	建设银行	80,800	537,320.00	0.09

150	002001	新和成	18,540	531,727.20	0.09
151	300661	圣邦股份	2,100	530,733.00	0.09
152	600926	杭州银行	35,700	526,575.00	0.09
153	300433	蓝思科技	17,800	523,498.00	0.09
154	601238	广汽集团	40,400	523,180.00	0.09
155	002050	三花智控	21,600	517,968.00	0.09
156	002841	视源股份	4,100	509,589.00	0.09
157	600600	青岛啤酒	4,400	508,860.00	0.09
158	000166	申万宏源	108,600	508,248.00	0.09
159	601077	渝农商行	126,800	505,932.00	0.09
160	600958	东方证券	50,400	503,496.00	0.09
161	600741	华域汽车	18,900	496,503.00	0.09
162	300003	乐普医疗	15,300	491,436.00	0.08
163	002064	华峰化学	34,100	484,220.00	0.08
164	002007	华兰生物	13,200	484,176.00	0.08
165	000963	华东医药	10,500	483,105.00	0.08
166	000786	北新建材	12,200	478,850.00	0.08
167	603806	福斯特	4,520	475,187.60	0.08
168	000157	中联重科	51,200	473,088.00	0.08
169	601901	方正证券	49,600	464,256.00	0.08
170	601233	桐昆股份	19,200	462,528.00	0.08
171	600015	华夏银行	74,200	459,298.00	0.08
172	601336	新华保险	10,000	459,100.00	0.08
173	002236	大华股份	21,600	455,760.00	0.08
174	601155	新城控股	10,900	453,440.00	0.08
175	601989	中国重工	109,700	451,964.00	0.08
176	600176	中国巨石	28,790	446,532.90	0.08
177	000768	中航西飞	16,800	441,504.00	0.08
178	603993	洛阳钼业	85,200	439,632.00	0.08
179	601877	正泰电器	13,000	433,940.00	0.07
180	600760	中航沈飞	7,180	432,954.00	0.07
181	300529	健帆生物	5,000	431,800.00	0.07
182	600352	浙江龙盛	31,200	428,688.00	0.07
183	600010	包钢股份	274,300	425,165.00	0.07
184	601788	光大证券	23,500	420,415.00	0.07
185	001979	招商蛇口	38,200	418,290.00	0.07
186	601600	中国铝业	78,700	417,110.00	0.07
187	600547	山东黄金	21,700	417,074.00	0.07
188	300136	信维通信	13,500	416,880.00	0.07
189	002008	大族激光	10,200	411,978.00	0.07
190	601186	中国铁建	55,300	410,879.00	0.07

191	002185	华天科技	26,500	407,835.00	0.07
192	603369	今世缘	7,500	406,200.00	0.07
193	002202	金风科技	33,200	403,712.00	0.07
194	300999	金龙鱼	4,700	399,312.00	0.07
195	000876	新希望	27,200	399,024.00	0.07
196	601995	中金公司	6,400	393,600.00	0.07
197	603899	晨光文具	4,600	388,976.00	0.07
198	002555	三七互娱	16,100	386,722.00	0.07
199	003816	中国广核	142,200	379,674.00	0.07
200	000938	紫光股份	17,100	374,148.00	0.06
201	002736	国信证券	34,700	373,025.00	0.06
202	000069	华侨城A	49,500	368,280.00	0.06
203	600109	国金证券	29,000	368,010.00	0.06
204	601066	中信建投	11,700	367,731.00	0.06
205	603160	汇顶科技	2,800	362,964.00	0.06
206	000425	徐工机械	56,600	360,542.00	0.06
207	688009	中国通号	62,900	357,901.00	0.06
208	601669	中国电建	92,100	356,427.00	0.06
209	688126	沪硅产业	12,200	355,996.00	0.06
210	600298	安琪酵母	6,500	353,470.00	0.06
211	002384	东山精密	16,900	352,196.00	0.06
212	600332	白云山	10,400	352,040.00	0.06
213	603659	璞泰来	2,560	349,696.00	0.06
214	002405	四维图新	23,700	348,390.00	0.06
215	000977	浪潮信息	12,300	345,999.00	0.06
216	000703	恒逸石化	28,700	342,965.00	0.06
217	000783	长江证券	46,600	341,112.00	0.06
218	002624	完美世界	14,100	337,131.00	0.06
219	002252	上海莱士	45,000	337,050.00	0.06
220	603019	中科曙光	12,200	336,842.00	0.06
221	300146	汤臣倍健	10,200	335,580.00	0.06
222	300558	贝达药业	3,100	335,544.00	0.06
223	000596	古井贡酒	1,400	335,300.00	0.06
224	300253	卫宁健康	20,500	333,535.00	0.06
225	601865	福莱特	8,400	332,052.00	0.06
226	601838	成都银行	26,200	331,168.00	0.06
227	601696	中银证券	16,000	329,440.00	0.06
228	600183	生益科技	13,900	325,399.00	0.06
229	600886	国投电力	33,500	321,935.00	0.06
230	603517	绝味食品	3,800	320,302.00	0.05
231	600029	南方航空	53,100	319,662.00	0.05

232	002414	高德红外	11,560	318,824.80	0.05
233	601985	中国核电	62,900	318,274.00	0.05
234	601360	三六零	25,900	316,239.00	0.05
235	600845	宝信软件	6,210	316,089.00	0.05
236	601727	上海电气	74,500	315,880.00	0.05
237	300144	宋城演艺	18,800	315,840.00	0.05
238	601108	财通证券	30,100	315,749.00	0.05
239	002600	领益智造	34,000	312,460.00	0.05
240	603833	欧派家居	2,200	312,312.00	0.05
241	601555	东吴证券	37,400	311,916.00	0.05
242	600219	南山铝业	86,200	310,320.00	0.05
243	000728	国元证券	38,800	309,236.00	0.05
244	300676	华大基因	2,600	308,360.00	0.05
245	000066	中国长城	21,100	308,060.00	0.05
246	600161	天坛生物	8,900	304,825.00	0.05
247	300033	同花顺	2,700	304,506.00	0.05
248	603816	顾家家居	3,900	301,392.00	0.05
249	300308	中际旭创	7,800	300,456.00	0.05
250	002044	美年健康	32,900	299,719.00	0.05
251	603589	口子窖	4,400	297,836.00	0.05
252	002938	鹏鼎控股	8,300	297,804.00	0.05
253	601607	上海医药	14,000	295,820.00	0.05
254	601162	天风证券	60,600	294,516.00	0.05
255	600522	中天科技	29,400	294,000.00	0.05
256	603939	益丰药房	5,240	293,911.60	0.05
257	600872	中炬高新	6,900	289,938.00	0.05
258	002508	老板电器	6,200	288,300.00	0.05
259	002602	世纪华通	44,800	287,616.00	0.05
260	002024	苏宁易购	51,300	286,767.00	0.05
261	002422	科伦药业	14,100	281,295.00	0.05
262	601111	中国国航	36,000	280,080.00	0.05
263	600362	江西铜业	12,500	279,750.00	0.05
264	600383	金地集团	27,300	279,552.00	0.05
265	000860	顺鑫农业	6,600	278,388.00	0.05
266	300628	亿联网络	3,300	276,540.00	0.05
267	601800	中国交建	42,300	274,104.00	0.05
268	002385	大北农	40,300	274,040.00	0.05
269	600115	中国东航	53,800	273,304.00	0.05
270	601990	南京证券	25,700	270,364.00	0.05
271	002916	深南电路	2,400	266,712.00	0.05
272	603444	吉比特	500	265,000.00	0.05

273	600848	上海临港	14,680	262,772.00	0.05
274	600061	国投资本	30,868	262,069.32	0.04
275	601117	中国化学	29,600	259,296.00	0.04
276	601021	春秋航空	4,500	256,050.00	0.04
277	601618	中国中冶	85,900	255,982.00	0.04
278	000708	中信特钢	12,200	254,248.00	0.04
279	002180	纳思达	7,800	251,160.00	0.04
280	600699	均胜电子	9,800	250,096.00	0.04
281	002558	巨人网络	18,800	250,040.00	0.04
282	600705	中航产融	64,300	248,841.00	0.04
283	002299	圣农发展	10,400	248,352.00	0.04
284	601878	浙商证券	18,600	243,288.00	0.04
285	002127	南极电商	24,600	240,342.00	0.04
286	600606	绿地控股	43,900	239,255.00	0.04
287	000050	深天马A	16,700	236,806.00	0.04
288	002013	中航机电	23,400	235,638.00	0.04
289	002456	欧菲光	26,000	230,880.00	0.04
290	002463	沪电股份	14,600	225,862.00	0.04
291	002157	正邦科技	18,800	224,660.00	0.04
292	000656	金科股份	38,700	224,073.00	0.04
293	600011	华能国际	52,800	222,816.00	0.04
294	600177	雅戈尔	33,400	220,106.00	0.04
295	600521	华海药业	10,500	219,240.00	0.04
296	601933	永辉超市	45,800	216,634.00	0.04
297	600118	中国卫星	7,200	210,672.00	0.04
298	600536	中国软件	3,700	210,641.00	0.04
299	002373	千方科技	12,600	210,420.00	0.04
300	601872	招商轮船	45,420	209,840.40	0.04
301	601216	君正集团	40,500	206,145.00	0.04
302	600066	宇通客车	16,500	206,085.00	0.04
303	603392	万泰生物	780	202,160.40	0.03
304	600489	中金黄金	23,300	200,846.00	0.03
305	600018	上港集团	41,700	198,909.00	0.03
306	600369	西南证券	40,100	195,287.00	0.03
307	002926	华西证券	20,200	194,526.00	0.03
308	600038	中直股份	3,600	189,864.00	0.03
309	002120	韵达股份	14,000	189,420.00	0.03
310	601998	中信银行	37,000	188,700.00	0.03
311	300383	光环新网	13,000	187,070.00	0.03
312	601319	中国人保	31,000	183,830.00	0.03
313	601198	东兴证券	16,700	182,531.00	0.03

314	603195	公牛集团	900	181,800.00	0.03
315	002065	东华软件	22,500	178,425.00	0.03
316	002673	西部证券	21,500	177,375.00	0.03
317	000987	越秀金控	13,600	172,176.00	0.03
318	002294	信立泰	5,200	171,080.00	0.03
319	603338	浙江鼎力	2,900	170,201.00	0.03
320	600895	张江高科	9,300	169,911.00	0.03
321	601881	中国银河	15,600	168,168.00	0.03
322	300866	安克创新	1,000	167,470.00	0.03
323	002146	荣盛发展	29,600	166,944.00	0.03
324	603658	安图生物	2,200	166,694.00	0.03
325	600188	兖州煤业	10,700	164,352.00	0.03
326	300251	光线传媒	14,200	153,502.00	0.03
327	600233	圆通速递	15,300	153,153.00	0.03
328	600372	中航电子	9,200	152,260.00	0.03
329	600498	烽火通信	8,100	150,903.00	0.03
330	603233	大参林	2,920	149,241.20	0.03
331	300888	稳健医疗	1,200	148,344.00	0.03
332	688180	君实生物	1,800	146,178.00	0.03
333	603707	健友股份	3,500	146,125.00	0.03
334	603866	桃李面包	4,680	146,016.00	0.03
335	600801	华新水泥	8,100	142,317.00	0.02
336	600340	华夏幸福	27,000	141,480.00	0.02
337	002153	石基信息	5,760	135,417.60	0.02
338	600027	华电国际	39,300	135,192.00	0.02
339	000961	中南建设	22,700	134,384.00	0.02
340	601231	环旭电子	7,900	132,799.00	0.02
341	601577	长沙银行	14,600	130,524.00	0.02
342	002032	苏泊尔	2,000	127,580.00	0.02
343	600025	华能水电	21,600	125,064.00	0.02
344	002939	长城证券	11,200	124,656.00	0.02
345	300832	新产业	2,000	123,200.00	0.02
346	000800	一汽解放	11,200	121,184.00	0.02
347	601236	红塔证券	8,700	117,972.00	0.02
348	601456	国联证券	7,100	109,340.00	0.02
349	002773	康弘药业	4,500	104,085.00	0.02
350	600918	中泰证券	9,200	99,544.00	0.02
351	601808	中海油服	6,900	99,084.00	0.02
352	603087	甘李药业	900	95,922.00	0.02
353	601698	中国卫通	5,400	87,426.00	0.01
354	300869	康泰医学	1,000	70,820.00	0.01

355	600299	安迪苏	5,800	69,368.00	0.01
356	002901	大博医疗	700	51,023.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	104,200	50,633,906.00	8.68
2	03690	美团-W	96,700	25,780,220.00	4.42
3	01299	友邦保险	187,600	15,064,280.00	2.58
4	00005	汇丰控股	325,600	12,151,392.00	2.08
5	00939	建设银行	1,884,000	9,570,720.00	1.64
6	00388	香港交易所	19,900	7,663,291.00	1.31
7	02318	中国平安	117,000	7,403,760.00	1.27
8	01810	小米集团-W	319,000	7,167,930.00	1.23
9	02269	药明生物	53,000	6,275,200.00	1.08
10	01398	工商银行	1,361,000	5,158,190.00	0.88
11	03968	招商银行	73,000	4,024,490.00	0.69
12	00941	中国移动	96,500	3,898,600.00	0.67
13	00669	创科实业	30,000	3,384,900.00	0.58
14	02331	李宁	39,000	3,076,320.00	0.53
15	03988	中国银行	1,316,000	3,053,120.00	0.52
16	01211	比亚迪股份	13,500	2,608,335.00	0.45
17	02382	舜宇光学科 技	12,100	2,470,699.00	0.42
18	06160	百济神州	13,700	2,407,638.00	0.41
19	02313	申洲国际	14,200	2,317,014.00	0.40
20	02020	安踏体育	15,000	2,281,500.00	0.39
21	06098	碧桂园服务	32,000	2,233,920.00	0.38
22	00016	新鸿基地产	22,500	2,166,075.00	0.37
23	00001	长和	42,500	2,139,450.00	0.37
24	00883	中国海洋石 油	281,000	2,065,350.00	0.35
25	00002	中电控股	32,000	2,044,800.00	0.35
26	06618	京东健康	20,800	1,926,288.00	0.33
27	00175	吉利汽车	93,000	1,891,620.00	0.32
28	01113	长实集团	40,500	1,806,300.00	0.31
29	09633	农夫山泉	55,600	1,801,996.00	0.31
30	00003	香港中华煤 气	176,250	1,767,787.50	0.30
31	00027	银河娱乐	34,000	1,758,140.00	0.30

32	02319	蒙牛乳业	44,000	1,719,080.00	0.29
33	01801	信达生物	22,500	1,695,150.00	0.29
34	00011	恒生银行	12,100	1,561,626.00	0.27
35	02688	新奥能源	12,600	1,549,548.00	0.27
36	01109	华润置地	58,000	1,517,860.00	0.26
37	02628	中国人寿	118,000	1,511,580.00	0.26
38	00981	中芯国际	75,000	1,491,750.00	0.26
39	02388	中银香港	67,000	1,469,310.00	0.25
40	01093	石药集团	150,000	1,402,500.00	0.24
41	01928	金沙中国有限公司	50,800	1,382,268.00	0.24
42	01177	中国生物制药	208,000	1,318,720.00	0.23
43	00386	中国石油化工股份	400,000	1,308,000.00	0.22
44	00291	华润啤酒	22,000	1,276,880.00	0.22
45	00268	金蝶国际	57,000	1,250,010.00	0.21
46	03328	交通银行	276,000	1,197,840.00	0.21
47	00968	信义光能	84,000	1,171,800.00	0.20
48	01997	九龙仓置业	29,000	1,089,530.00	0.19
49	01288	农业银行	482,000	1,084,500.00	0.19
50	00868	信义玻璃(一千)	40,000	1,053,600.00	0.18
51	00066	港铁公司	29,000	1,043,710.00	0.18
52	00857	中国石油股份	330,000	1,039,500.00	0.18
53	06969	思摩尔国际	29,000	1,038,780.00	0.18
54	00960	龙湖集团	28,500	1,031,700.00	0.18
55	00688	中国海外发展	69,000	1,012,920.00	0.17
56	02007	碧桂园	139,000	1,006,360.00	0.17
57	06186	中国飞鹤	72,000	1,004,400.00	0.17
58	01918	融创中国	45,000	997,650.00	0.17
59	00267	中信股份	138,000	960,480.00	0.16
60	00006	电能实业	24,000	951,600.00	0.16
61	00241	阿里健康	64,000	917,120.00	0.16
62	02601	中国太保	43,800	890,892.00	0.15
63	09992	泡泡玛特	13,600	871,352.00	0.15
64	00853	微创医疗(一百)	15,000	869,250.00	0.15
65	00992	联想集团	116,000	861,880.00	0.15
66	00017	新世界发展	25,000	839,250.00	0.14

67	06690	海尔智家	36,800	829,840.00	0.14
68	01658	邮储银行	190,000	826,500.00	0.14
69	00586	海螺创业	29,000	789,090.00	0.14
70	01821	ESR	35,200	767,360.00	0.13
71	01833	平安好医生	9,000	724,140.00	0.12
72	00914	海螺水泥	21,000	719,880.00	0.12
73	06666	恒大物业	88,500	717,735.00	0.12
74	00012	恒基地产	23,000	704,260.00	0.12
75	01088	中国神华	54,000	683,640.00	0.12
76	00288	万洲国际	115,000	668,150.00	0.11
77	00384	中国燃气	33,800	666,536.00	0.11
78	00788	中国铁塔	738,000	656,820.00	0.11
79	00881	中升控股	11,500	618,125.00	0.11
80	00004	九龙仓集团	25,000	615,750.00	0.11
81	02328	中国财险	108,000	611,280.00	0.10
82	00083	信和置业	60,000	610,800.00	0.10
83	01066	威高股份	40,000	603,200.00	0.10
84	02202	万科企业	29,700	600,534.00	0.10
85	06030	中信证券	36,000	583,560.00	0.10
86	03888	金山软件	15,000	580,950.00	0.10
87	02018	瑞声科技	12,000	580,080.00	0.10
88	00772	阅文集团	8,000	574,800.00	0.10
89	01876	百威亚太	27,200	554,608.00	0.10
90	00101	恒隆地产	35,000	549,150.00	0.09
91	01193	华润燃气	14,000	542,780.00	0.09
92	01378	中国宏桥	60,500	529,375.00	0.09
93	00728	中国电信	218,000	527,560.00	0.09
94	01691	J S 环球生活	29,000	527,220.00	0.09
95	00909	明源云	16,000	513,280.00	0.09
96	06862	海底捞	15,000	510,450.00	0.09
97	01209	华润万象生活	11,400	504,222.00	0.09
98	01038	长江基建集团	13,000	500,890.00	0.09
99	00998	中信银行	163,000	498,780.00	0.09
100	03323	中国建材	62,000	470,580.00	0.08
101	00522	ASM PACIFIC	5,200	455,156.00	0.08
102	01044	恒安国际	10,500	454,335.00	0.08
103	03692	翰森制药	16,000	452,640.00	0.08

104	00151	中国旺旺	96,000	439,680.00	0.08
105	01114	BRILLIANCE CHI	72,000	437,040.00	0.07
106	00270	粤海投资	46,000	427,340.00	0.07
107	03908	中金公司	24,400	424,316.00	0.07
108	00322	康师傅控股	32,000	412,800.00	0.07
109	00135	昆仑能源	68,000	405,280.00	0.07
110	00285	比亚迪电子	9,500	403,180.00	0.07
111	01516	融创服务	16,000	384,160.00	0.07
112	00656	复星国际	40,000	372,000.00	0.06
113	00425	敏实集团	12,000	368,400.00	0.06
114	01972	太古地产	18,400	354,384.00	0.06
115	00813	世茂集团	22,000	348,480.00	0.06
116	00762	中国联通	98,000	345,940.00	0.06
117	00884	旭辉控股集团	66,000	332,640.00	0.06
118	00019	太古股份公 司A	7,500	328,575.00	0.06
119	06110	滔搏	30,000	317,400.00	0.05
120	00817	中国金茂	142,000	306,720.00	0.05
121	01579	颐海国际	7,000	303,730.00	0.05
122	00345	VITASOY INT'L	12,000	288,120.00	0.05
123	01988	民生银行	92,000	285,200.00	0.05
124	06993	蓝月亮集团	29,000	265,060.00	0.05
125	03380	龙光集团	27,000	261,090.00	0.04
126	01929	周大福	17,400	256,824.00	0.04
127	00880	澳博控股	36,000	254,160.00	0.04
128	03333	中国恒大	30,000	252,600.00	0.04
129	02689	玖龙纸业	30,000	248,700.00	0.04
130	01128	永利澳门	24,400	248,148.00	0.04
131	00008	电讯盈科	73,000	247,470.00	0.04
132	00836	华润电力	28,000	246,960.00	0.04
133	01313	华润水泥控 股	40,000	245,600.00	0.04
134	02282	美高梅中国	24,800	242,792.00	0.04
135	00966	中国太平	22,400	240,800.00	0.04
136	01030	新城发展	34,000	208,080.00	0.04
137	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.03
138	00144	招商局港口	20,000	188,800.00	0.03
139	03808	中国重汽	13,500	186,975.00	0.03

140	03383	雅居乐集团	22,000	184,140.00	0.03
141	02588	中银航空租 赁	3,300	179,850.00	0.03
142	01813	合景泰富集 团	20,000	173,000.00	0.03
143	00392	北京控股	7,000	160,440.00	0.03
144	06808	高鑫零售	29,500	141,895.00	0.02
145	300957	贝泰妮	558	140,593.68	0.02
146	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.02
147	00293	国泰航空	18,000	98,280.00	0.02
148	688109	品茗股份	1,301	93,802.10	0.02
149	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
150	300979	华利集团	897	78,487.50	0.01
151	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
152	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.01
153	688663	新风光	3,279	62,989.59	0.01
154	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.01
155	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.01
156	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
157	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
158	300981	中红医疗	566	51,160.74	0.01
159	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
160	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
161	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
162	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.00
163	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
164	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
165	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
166	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
167	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
168	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
169	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
170	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
171	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
172	00683	嘉里建设	500	10,650.00	0.00
173	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
174	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
175	00753	中国国航	2,000	9,500.00	0.00
176	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
177	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
178	01060	阿里影业	10,000	9,000.00	0.00

179	03311	中国建筑国际	2,000	8,820.00	0.00
180	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
181	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
182	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
183	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
184	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
185	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
186	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
187	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
188	00659	新创建集团	1,000	6,870.00	0.00
189	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
190	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
191	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
192	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
193	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
194	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
195	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
196	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
197	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
198	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	88,862,212.56	15.23
2	03690	美团-W	37,830,525.03	6.48
3	601318	中国平安	17,201,637.63	2.95
3	02318	中国平安	14,474,003.19	2.48
4	600519	贵州茅台	29,392,511.15	5.04
5	01299	友邦保险	24,788,294.49	4.25
6	00005	汇丰控股	19,560,973.85	3.35
7	600036	招商银行	12,794,121.71	2.19
7	03968	招商银行	6,159,010.68	1.06
8	00939	建设银行	15,692,472.86	2.69
8	601939	建设银行	922,901.00	0.16
9	00388	香港交易所	13,887,627.43	2.38
10	01398	工商银行	9,341,661.26	1.60
10	601398	工商银行	3,558,658.00	0.61
11	000858	五粮液	11,250,846.00	1.93

12	01810	小米集团-W	9,891,654.90	1.70
13	300750	宁德时代	8,837,130.00	1.51
14	000333	美的集团	8,582,238.00	1.47
15	02269	药明生物	7,285,766.74	1.25
16	002594	比亚迪	3,855,083.00	0.66
16	01211	比亚迪	3,416,355.38	0.59
17	601166	兴业银行	7,163,558.00	1.23
18	600276	恒瑞医药	7,085,838.97	1.21
19	00941	中国移动	6,832,311.89	1.17
20	601888	中国中免	6,179,513.60	1.06

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	24,437,615.85	4.19
2	01299	友邦保险	8,454,848.27	1.45
3	03690	美团-W	7,127,346.35	1.22
4	00005	汇丰控股	7,012,474.66	1.20
5	02318	中国平安	4,850,315.51	0.83
5	601318	中国平安	1,979,215.00	0.34
6	00939	建设银行	5,830,385.15	1.00
6	601939	建设银行	113,171.00	0.02
7	00388	香港交易所	4,322,774.63	0.74
8	01398	工商银行	3,463,021.04	0.59
8	601398	工商银行	466,892.00	0.08
9	03968	招商银行	2,215,265.74	0.38
9	600036	招商银行	1,639,923.00	0.28
10	000858	五粮液	3,751,143.00	0.64
11	600519	贵州茅台	3,591,178.00	0.62
12	000333	美的集团	2,681,359.00	0.46
13	02269	药明生物	2,512,158.56	0.43
14	300760	迈瑞医疗	2,407,711.00	0.41
15	01810	小米集团-W	2,363,233.31	0.41
16	00941	中国移动	2,317,981.09	0.40
17	300750	宁德时代	2,114,077.00	0.36
18	03988	中国银行	1,843,824.54	0.32
18	601988	中国银行	167,198.00	0.03
19	002594	比亚迪	1,196,685.00	0.21
19	01211	比亚迪	759,380.38	0.13
20	000651	格力电器	1,932,147.65	0.33

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	908,817,096.13
卖出股票收入（成交）总额	243,001,497.32

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	222,162.85	0.04
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	222,162.85	0.04

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113050	南银转债	1,630	163,000.00	0.03
2	127036	三花转债	215	28,162.85	0.00
3	127038	国微转债	148	14,800.00	0.00
4	113049	长汽转债	100	10,000.00	0.00
5	123117	健帆转债	62	6,200.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	—
股指期货投资本期收益(元)	—
股指期货投资本期公允价值变动(元)	—

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，在风险可控的基础上，以套期保值为目的，参与国债期货的投资，以降低跟踪误差。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计（元）	—
国债期货投资本期收益（元）	—
国债期货投资本期公允价值变动（元）	—

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“建设银行”的发行主体中国建设银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在内控管理不到位，支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件；理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及提供土地储备融资；逆流程开展业务操作等 8 项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 7 月 13 日对公司做出罚款合计 3920 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2020〕32 号）。建设银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“腾讯控股”的发行主体腾讯控股有限公司（以下简称“公司”），由于在收购猿辅导（YUAN INC）股权过程中涉嫌违法实施经营者集中的违法违规行为，国家市场监督管理总局于 2021 年 3 月 12 日对公司作出罚款 50 万元的行政处罚（国市监处〔2021〕23 号）。腾讯控股为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“招商银行”的发行主体招商银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；理财产品之间风险隔离不到位；理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准等 27 项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 5 月 17 日对公司做出罚款 7170 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕16 号）。招商银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

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 7 名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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	196,997.93
2	应收证券清算款	456,462.39
3	应收股利	1,564,349.32
4	应收利息	872.54
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,218,682.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688269	凯立新材	195,885.72	0.03	新股限售
2	300957	贝泰妮	140,593.68	0.02	新股限售
3	688097	博众精工	111,563.83	0.02	新股限售
4	688109	品茗股份	93,802.10	0.02	新股限售
5	688499	利元亨	83,488.65	0.01	新股认购

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
11,372	53,385.70	95,136,293.00	15.67	511,965,832.00	84.33	-	-

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	51,850,838	8.54
2	都邦财产保险股份有限公司—自有资金	20,000,000	3.29
3	于炳歧	10,000,000	1.65
4	张剑	5,000,000	0.82
5	北京中洲禾源投资咨询有限公司	4,000,000	0.66
6	中信证券股份有限公司	3,693,243	0.61
7	中信建投证券股份有限公司	3,535,187	0.58
8	徐亚英	3,500,000	0.58
9	薛宏飞	3,500,000	0.58
10	陈琪	3,000,000	0.49

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 (%)
基金管理公司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、基金投资和研发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(2021年02月09日)基金份额总额	787,102,125.00
基金合同生效日2021年2月9日起至报告期期末基金总申购份额	—
减：基金合同生效日2021年2月9日起至报告期期末基金总赎回份额	180,000,000.00
基金合同生效日2021年2月9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	607,102,125.00

§ 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	3	41,717,072.90	3.64	—	—	—	—	—	—	38,016.60	5.15	—
东方证券	2	7,465,143.00	0.65	—	—	—	—	—	—	6,802.94	0.92	—
广发证券	2	106,016,937.81	9.24	—	—	—	—	—	—	87,826.51	11.91	—
国盛证券	2	30,288,826.62	2.64	—	—	—	—	—	—	27,602.36	3.74	—
海通证券	2	519,912,124.40	45.33	151,251.80	24.77	—	—	—	—	281,318.83	38.14	—
华泰证券	2	4,931,796.06	0.43	—	—	—	—	—	—	4,494.28	0.61	—
华西证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申港证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源	2	12,153,525.74	1.06	343,664.51	56.29	—	—	—	—	11,075.74	1.50	—
太平洋证券	2	15,370,552.09	1.34	—	—	—	—	—	—	14,007.28	1.90	—
新时代证券	2	520,926.13	0.05	—	—	—	—	—	—	474.72	0.06	—
银河证券	2	93,905,195.88	8.19	—	—	—	—	—	—	85,576.33	11.60	—
浙商证券	3	130,859,735.52	11.41	—	—	—	—	—	—	13,055.44	1.77	—
中金公司	2	83,225,991.78	7.26	—	—	—	—	—	—	75,842.62	10.28	—
中信建投	2	364,294.06	0.03	115,650.22	18.94	—	—	—	—	332.01	0.05	—

中信证券	2	100,101,625.20	8.73	-	-	-	-	-	-	91,223.15	12.37	-
------	---	----------------	------	---	---	---	---	---	---	-----------	-------	---

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。本基金合同生效日为 2021 年 2 月 9 日，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

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	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	规定披露媒介	2021 年 02 月 10 日
2	关于富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金投资关联方证券的公告	规定披露媒介	2021 年 02 月 19 日
3	富国基金管理有限公司关于富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金投资关联方证券的公告	规定披露媒介	2021 年 02 月 24 日
4	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	规定披露媒介	2021 年 02 月 25 日
5	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金开放申购、赎回业务公告	规定披露媒介	2021 年 02 月 25 日
6	富国基金管理有限公司关于富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	规定披露媒介	2021 年 02 月 25 日
7	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 02 日
8	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金最低定投金额的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 05 日
9	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 13 日
10	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 17 日
11	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 24 日
12	富国基金管理有限公司关于旗下部分	规定披露媒介	2021 年 03 月 30 日

	基金修订基金合同及托管协议的公告		
13	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年04月14日
14	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年04月20日
15	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年05月06日
16	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年05月10日
17	富国基金管理有限公司关于富国中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金临时停牌的公告	规定披露媒介	2021年06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

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定自2021年3月31日起，对本基金的基金合同及托管协议的相应条款进行修订，增加《指数基金指引》规定的相关内容并在本基金投资范围中增加存托凭证。具体可参见基金管理人于2021年3月30日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同及托管协议的公告》及修订后的基金合同、托管协议。

§ 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中证沪港深500交易	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1196号世	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理

<p>型开放式指数证券投资 基金的文件</p> <p>2、富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券 投资基金基金合同</p> <p>3、富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券 投资基金托管协议</p> <p>4、中国证监会批准设立 富国基金管理有限公司 的文件</p> <p>5、富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券 投资基金财务报表及报 表附注</p> <p>6、报告期内在指定报刊 上披露的各项公告</p>	<p>纪汇办公楼二座 27-30 层</p>	<p>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.c om.cn。</p>
--	------------------------	---