

富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

二 0 二一年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国农业银行股份有限公司

送出日期： 2022 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4	管理人报告.....	12
4.1	基金管理人及基金经理.....	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	16
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核报告.....	17
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
§5	托管人报告.....	19
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	20
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	20
§6	审计报告.....	20
6.1	审计报告基本信息.....	20
6.2	审计报告的基本内容.....	20
§7	年度财务报表.....	23
7.1	资产负债表.....	23
7.2	利润表.....	24
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4	报表附注.....	26
§8	投资组合报告.....	65
8.1	期末基金资产组合情况.....	65
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	65
8.3	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.....	67
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	81
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	94

8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	95
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	95
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	95
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	95
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	95
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	95
8.12	投资组合报告附注 .....	96
§9	基金份额持有人信息 .....	97
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	97
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	97
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	97
9.4	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 .....	98
§10	开放式基金份额变动 .....	98
§11	重大事件揭示 .....	98
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	98
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	99
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	99
11.4	基金投资策略的改变 .....	99
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	99
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	99
11.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	100
11.8	其他重大事件 .....	102
§12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	103
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	103
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	104
§13	备查文件目录 .....	105

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	富国中证 1000 指数增强 (LOF)	
基金主代码	161039	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 05 月 31 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,018,427,188.78 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2018 年 6 月 20 日	
下属分级基金的基金简称	富国中证 1000 指数增强 A	富国中证 1000 指数增强 C
下属分级基金场内简称	1000 增强 LOF	—
下属分级基金的交易代码	161039	013331
报告期末下属分级基金的份额总额	815,445,341.41 份	202,981,847.37 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，主要策略为复制目标指数，即投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础，利用富国定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。本基金在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。本基金的股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略及参与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 1000 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	秦一楠
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街69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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		裴长江	谷澍

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

#### (1) 富国中证 1000 指数增强 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	62,851,979.58	43,325,414.40	26,782,930.77
本期利润	147,647,233.62	40,167,222.50	60,136,041.50
加权平均基金份额本期利润	0.2977	0.3992	0.5632
本期加权平均净值利润率	14.61%	25.85%	54.32%
本期基金份额净值增长率	27.33%	40.18%	41.37%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	680,674,772.84	76,530,102.15	12,352,451.94
期末可供分配基金份额利润	0.8347	0.6477	0.1951
期末基金资产净值	1,739,461,889.47	197,946,294.97	75,675,679.90
期末基金份额净值	2.1331	1.6753	1.1951
3.1.3 累计期末指标	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	113.31%	67.53%	19.51%

#### (2) 富国中证 1000 指数增强 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	7,212,816.68	—	—
本期利润	-5,379,821.17	—	—
加权平均基金份额本期利润	-0.0324	—	—
本期加权平均净值利润率	-1.55%	—	—
本期基金份额净值增长率	3.42%	—	—
3.1.2 期末数据和指标	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	169,127,030.53	—	—
期末可供分配基金份额利润	0.8332	—	—
期末基金资产净值	432,679,564.61	—	—
期末基金份额净值	2.1316	—	—
3.1.3 累计期末指标	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	3.42%	—	—

注：

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

本基金自 2021 年 8 月 19 日起增加 C 类份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### (1) 富国中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.00%	0.99%	7.77%	1.00%	-4.77%	-0.01%
过去六个月	9.89%	1.10%	12.45%	1.19%	-2.56%	-0.09%
过去一年	27.33%	1.11%	19.52%	1.15%	7.81%	-0.04%
过去三年	152.32%	1.37%	76.35%	1.44%	75.97%	-0.07%
自基金合同生效起至今	113.31%	1.33%	27.65%	1.47%	85.66%	-0.14%

##### (2) 富国中证 1000 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.95%	0.99%	7.77%	1.00%	-4.82%	-0.01%
自基金分级生效日起至今	3.42%	1.08%	6.92%	1.14%	-3.50%	-0.06%

注：中证 1000 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%

由于本基金投资标的指数为中证 1000 指数，且每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为中证 1000 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1 日收益率（benchmark）按下列公式计算：

$$\text{benchmark} = 95\% * [\text{中证 1000 指数收益率 } t / (\text{中证 1000 指数收益率 } t-1) - 1] + 5\% * \text{银行人民币活期存款利率（税后）} / 360;$$



其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日；

期间  $T$  日收益率（ $\text{benchmark}_T$ ）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$  表示  $t$  日至  $T$  日的  $(1 + \text{benchmark}_t)$  数学连乘。

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

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



注：1、截止日期为 2021 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2018 年 5 月 31 日成立，建仓期 6 个月，从 2018 年 5 月 31 日起至 2018 年 11 月 29 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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

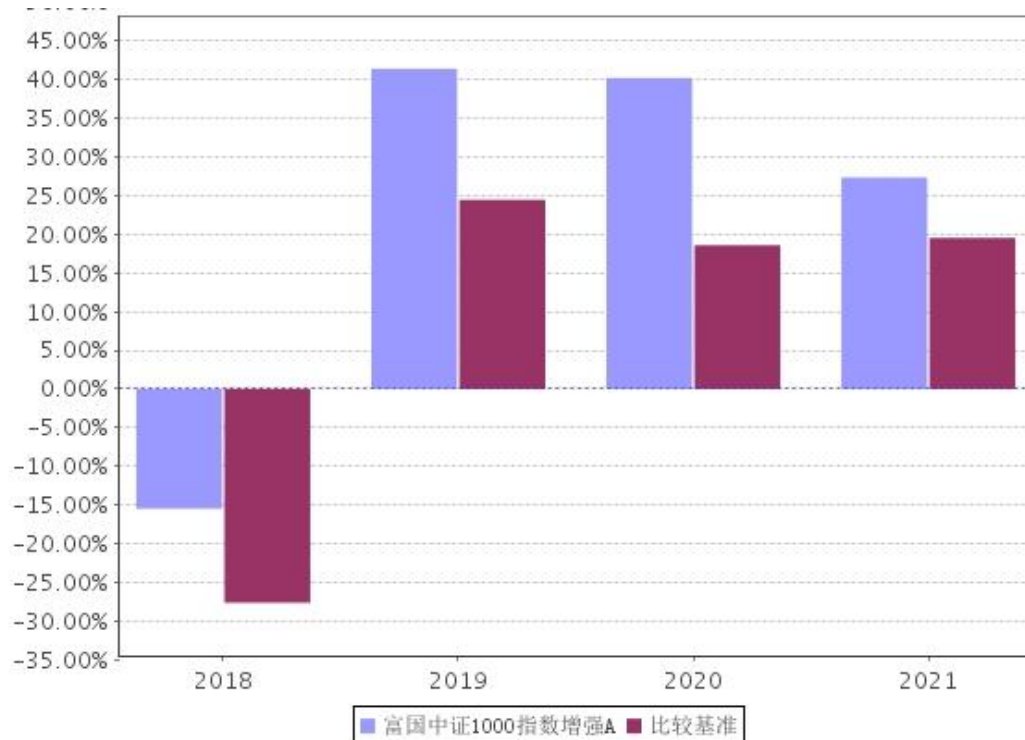


注：1、截止日期为2021年12月31日。

2、本基金自2021年8月19日起增加C类份额，相关数据按实际存续期计算。

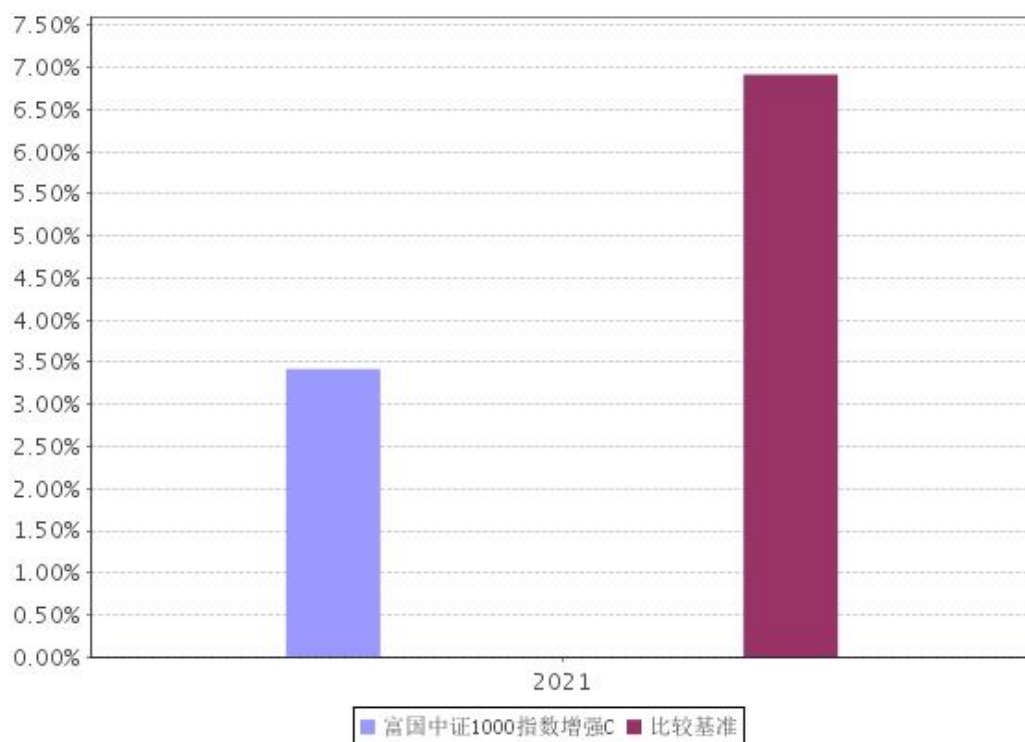
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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



注：2018 年按实际存续期计算。

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



注：C 类份额自 2021 年 8 月 20 日起有基金份额。2021 年按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

(1) 富国中证 1000 指数增强 A

注：过往三年本基金未进行利润分配。

(2) 富国中证 1000 指数增强 C

注：过往三年本基金未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 243 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方旻	本基金基金经理	2018-05-31	—	11.9	<p>硕士，自 2010 年 2 月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、量化投资部量化投资副总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼高级定量基金经理。2014 年 4 月至 2014 年 11 月任富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理助理，2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2015 年 5 月至 2019 年 11 月任富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金及富国中证银行指数型证券投资基金（原富国中证银行指数分级证券投资基金，于 2019 年 5 月 10 日更名）的基金经理，2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2017 年 6 月至 2018 年 12 月任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2017 年 7 月至 2020 年 9 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，2018 年 5 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2018 年 7 月至 2020 年 9 月任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理，2019 年 1 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理，2020</p>

					年2月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
徐幼华	本基金基金经理	2018-05-31	—	16.5	硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资部经理助理；自2006年7月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监，量化与海外投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部副总经理，兼任富国基金量化投资部资深定量基金经理。2011年5月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理，2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2015年6月至2017年12月任富国中证工业4.0指数分级证券投资基金基金经理，2016年11月至2020年1月任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2015年6月至2017年11月任富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理，2017年3月至2020年1月任富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2017年4月至2020年1月任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2018年5月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金、富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2018年7月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理，2018年12月起任富国MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《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**

本报告期内，富国基金管理有限公司作为富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

#### **4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明**

##### **4.3.1 公平交易制度和控制方法**

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平

性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

#### **4.3.2 公平交易制度的执行情况**

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现4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**

2021年初以来，在国内PMI向好、货币政策不急转弯、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。2季度，随着国内大宗商品如钢价、煤价迎来调整，通胀预期下降，同时美联储会议并未实质性讨论收紧购债规模，美国10年期国债利率进一步走低，市场开启反弹。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。7月初，央行宣布下调金融机构存款准备金率0.5个百分点，在相对充裕的流动



性及靓丽中报业绩的推动下，锂电池产业链、光伏、半导体等板块持续上涨，同时周期板块如有色、化工、煤炭等也表现突出。9月中旬，随着煤炭等能源价格高企，多部委对煤炭价格重视度提升，周期板块迎来调整。9月下旬，受个别地产企业信用风险暴露、限电导致经济预期回落、美国财政将触及债务上限、长假效应等因素影响，市场风险偏好大幅降低。11月中旬，随着公布的金融数据显示新增居民中长贷走强，表明房贷放款边际放松，同时部分银行加强房地产开发贷投放，提振投资者对经济的信心，地产、金融板块迎来大幅反弹。12月召开的中央经济工作会议进一步释放“稳字当头、稳中求进”的稳增长信号。随着稳增长信号落地，市场迎来休整，各板块轮换加速。

总体来看，2021年上证综指上涨4.8%，沪深300下跌5.2%，创业板指上涨12.02%，中证500指数上涨15.58%。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极获取超额收益率。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至2021年12月31日，本基金份额净值A级为2.1331元，C级为2.1316元；份额累计净值A级为2.1331元，C级为2.1316元；本报告期，本基金份额净值增长率A级为27.33%，C级为3.42%，同期业绩比较基准收益率A级为19.52%，C级为6.92%

#### **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2022年，由于美联储将迎来加息和缩表周期，全球流动性可能迎来拐点，资本市场波动或将加大。从国内来看，国内“稳增长”政策积极推进，货币政策较海外更为宽松，对股市有一定提振。从行业配置来看，较前两年或需更加均衡，一方面关注低估值、稳增长板块，另一方面关注估值较为合理，同时未来几年产业有望迎来爆发的科技板块。

#### **4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告**

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

（一）持续推动公司制度建设，优化内部控制体系

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

#### （二）夯实合规管理架构，强化合规管理职能

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

#### （三）深入解读新规，持续推进新规落地

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

#### （四）加强合规培训，全面提升合规意识

2021 年为持续提高员工合规意识及应知应会，公司紧跟新规要求、监管动态、行业热点，通过“线上+线下”的模式，公司持续开展新员工合规培训、内幕交易防控培训以及反洗钱专题培训，并结合业务部门实际需求，组织信息披露实务、适当性管理、销售合规实务、互联网直播合规管理等实务类培训。

#### （五）深入专项审计，抓紧第三道防线

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

#### （六）立足投资合规监督，系统化助力风控履职

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

#### （七）持续强化反洗钱工作理念，推动反洗钱工作纵深开展

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

#### （八）全面加强员工行为管理

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

#### 4.7 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协

议的约定,对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人认为,富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2022)审字第 60467606_B109 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富国中证 1000 指数增强型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国中证 1000 指数增强型证券投资基金(LOF)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附的富国中证 1000 指数增强型证券投资基金(LOF)的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了富国中证

	1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF)，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估富国中证 1000 指数增强型证券投资基金</p>

	<p>(LOF) 的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项 (如适用), 并运用持续经营假设, 除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证, 但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致, 如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策, 则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中, 我们运用职业判断, 并保持职业怀疑。同时, 我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险, 设计和实施审计程序以应对这些风险, 并获取充分、适当的审计证据, 作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上, 未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能导致对富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表</p>

	使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	蒋燕华	费泽旭
会计师事务所的地址	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼	
审计报告日期	2022 年 03 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 (2021 年 12 月 31 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
<b>资产：</b>		
银行存款	192,522,031.94	12,645,286.47
结算备付金	5,870,368.08	203,237.74
存出保证金	713,948.29	51,221.38
交易性金融资产	1,990,358,026.60	184,668,378.79
其中：股票投资	1,988,142,481.20	184,583,057.55
基金投资	—	—
债券投资	2,215,545.40	85,321.24
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	—	1,573,689.86

应收利息	57,829.74	2,365.42
应收股利	—	—
应收申购款	2,140,451.29	77,421.76
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	2,191,662,655.94	199,221,601.42
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>(2021年12月31日)</b>	<b>(2020年12月31日)</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	13,740,905.53	735,173.67
应付管理人报酬	1,864,167.74	173,748.48
应付托管费	279,625.18	26,062.27
应付销售服务费	65,310.72	—
应付交易费用	3,207,437.71	163,206.41
应交税费	8.65	0.53
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	363,746.33	177,115.09
负债合计	19,521,201.86	1,275,306.45
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	1,018,427,188.78	118,156,134.78
未分配利润	1,153,714,265.30	79,790,160.19
所有者权益合计	2,172,141,454.08	197,946,294.97
负债和所有者权益总计	2,191,662,655.94	199,221,601.42

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.1328 元，基金份额总额 1,018,427,188.78 份。其中：富国中证 1000 指数增强 A 份额净值 2.1331 元，份额总额 815,445,341.41 份；富国中证 1000 指数增强 C 份额净值 2.1316 元，份额总额 202,981,847.37 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

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

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
-----	----	---------



	(2021年01月01日至2021年12月31日)	(2020年01月01日至2020年12月31日)
<b>一、收入</b>	165,450,806.18	43,231,427.52
1. 利息收入	1,375,165.09	123,091.30
其中：存款利息收入	966,958.40	103,719.20
债券利息收入	1,595.39	18,582.91
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	6,969.87	789.19
证券出借利息收入	399,641.43	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	89,274,474.40	45,986,101.70
其中：股票投资收益	82,207,213.32	44,452,459.17
基金投资收益	—	—
债券投资收益	1,189,806.78	128,210.90
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	5,877,454.30	1,405,431.63
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	72,202,616.19	-3,158,191.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,598,550.50	280,426.42
<b>减：二、费用</b>	23,183,393.73	3,064,205.02
1. 管理人报酬	11,460,798.51	1,537,978.88
2. 托管费	1,719,119.84	230,696.93
3. 销售服务费	268,397.98	—
4. 交易费用	9,195,099.91	906,399.94
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 税金及附加	5.42	0.71
7. 其他费用	539,972.07	389,128.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	142,267,412.45	40,167,222.50
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	142,267,412.45	40,167,222.50

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2021年01月01日至2021年12月31日)
----	---------------------------------

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	118,156,134.78	79,790,160.19	197,946,294.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	142,267,412.45	142,267,412.45
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）	900,271,054.00	931,656,692.66	1,831,927,746.66
其中：1. 基金申购款	2,271,565,456.23	2,390,575,158.47	4,662,140,614.70
2. 基金赎回款	-1,371,294,402.23	-1,458,918,465.81	-2,830,212,868.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	1,018,427,188.78	1,153,714,265.30	2,172,141,454.08
项目	上年度可比期间 (2020年01月01日至2020年12月31日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	63,323,227.96	12,352,451.94	75,675,679.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	40,167,222.50	40,167,222.50
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）	54,832,906.82	27,270,485.75	82,103,392.57
其中：1. 基金申购款	185,303,097.04	89,916,226.10	275,219,323.14
2. 基金赎回款	-130,470,190.22	-62,645,740.35	-193,115,930.57
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）	118,156,134.78	79,790,160.19	197,946,294.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)，

系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]30号文《关于准予富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）注册的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集。基金合同于 2018 年 5 月 31 日正式生效，首次设立募集规模为 512,114,043.76 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人于 2021 年 8 月 17 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自 2021 年 8 月 19 日起，本基金增加 C 类份额。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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 1000 指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与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：本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股的资产（均含存托凭证）不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布

及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和中期报告》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2021年12月31日的财务状况以及2021年1月1日至2021年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

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

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2021年1月1日至2021年12月31日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

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

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

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

###### **(1) 金融资产分类**

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括

股票投资、债券投资和衍生工具等；

## (2) 金融负债分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，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；

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；

#### (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) 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；

#### (6) 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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前



支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

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

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

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

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

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

(7) 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) 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；

(11) 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；

(12) 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。

(13) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务

控制权时确认收入。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额的持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 每一基金份额享有同等分配权；如本基金在未来条件成熟时，增减基金份额类别，则同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、监管部门规定以及基金合同的约定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经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指定媒介公告。

#### **7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

## **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## **7.4.6 税项**

### **1 印花税**

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

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

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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
活期存款	192,522,031.94	12,645,286.47
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	192,522,031.94	12,645,286.47

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

#### 7.4.7.2交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2021年12月31日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,912,301,204.33	1,988,142,481.20	75,841,276.87
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	2,175,000.00	40,545.40
	银行间市场	—	—
	合计	2,175,000.00	40,545.40
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	1,914,476,204.33	1,990,358,026.60	75,881,822.27
项目	上年度末（2020年12月31日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	180,904,472.71	184,583,057.55	3,678,584.84
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	84,700.00	621.24
	银行间市场	—	—
	合计	84,700.00	621.24
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	180,989,172.71	184,668,378.79	3,679,206.08

#### 7.4.7.3衍生金融资产/负债

注：本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购中取得的债券。

#### 7.4.7.5应收利息

单位：人民币元

项目	本期末(2021年12月31日)	上年度末(2020年12月31日)
应收活期存款利息	39,599.51	2,237.23
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	2,905.87	91.50
应收债券利息	61.48	13.69
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	14,909.45	—
其他	353.43	23.00
合计	57,829.74	2,365.42

#### 7.4.7.6其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末(2021年12月31日)	上年度末(2020年12月31日)
交易所市场应付交易费用	3,207,437.71	163,206.41
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	3,207,437.71	163,206.41

#### 7.4.7.8其他负债

单位：人民币元

项目	本期末(2021年12月31日)	上年度末(2020年12月31日)
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	49,326.80	2,115.09
应付证券出借违约金	—	—
应付指数使用费	164,419.53	50,000.00
预提审计费	30,000.00	25,000.00
预提信息披露费	120,000.00	100,000.00
合计	363,746.33	177,115.09

#### 7.4.7.9实收基金

富国中证1000指数增强A:

金额单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	118,156,134.78	118,156,134.78
本期申购	1,635,127,499.97	1,635,127,499.97
本期赎回(以“-”号填列)	-937,838,293.34	-937,838,293.34

本期末	815,445,341.41	815,445,341.41
-----	----------------	----------------

富国中证 1000 指数增强 C:

金额单位：人民币元

项目	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	—	—
本期申购	636,437,956.26	636,437,956.26
本期赎回（以“-”号填列）	-433,456,108.89	-433,456,108.89
本期末	202,981,847.37	202,981,847.37

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

富国中证 1000 指数增强 A:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	76,530,102.15	3,260,058.04	79,790,160.19
本期利润	62,851,979.58	84,795,254.04	147,647,233.62
本期基金份额交易产生的变动数	541,292,691.11	155,286,463.14	696,579,154.25
其中：基金申购款	1,283,431,704.99	403,997,420.89	1,687,429,125.88
基金赎回款	-742,139,013.88	-248,710,957.75	-990,849,971.63
本期已分配利润	—	—	—
本期末	680,674,772.84	243,341,775.22	924,016,548.06

富国中证 1000 指数增强 C:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	7,212,816.68	-12,592,637.85	-5,379,821.17
本期基金份额交易产生的变动数	161,914,213.85	73,163,324.56	235,077,538.41
其中：基金申购款	509,371,419.22	193,774,613.37	703,146,032.59
基金赎回款	-347,457,205.37	-120,611,288.81	-468,068,494.18
本期已分配利润	—	—	—
本期末	169,127,030.53	60,570,686.71	229,697,717.24

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2021 年 01 月 01 日至	上年度可比期间（2020 年
----	----------------------	----------------



	2021年12月31日)	01月01日至2020年12月31日)
活期存款利息收入	752,142.98	93,579.67
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	43,430.59	3,661.86
其他	171,384.83	6,477.67
合计	966,958.40	103,719.20

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
股票投资收益——买卖股票差价收入	82,207,213.32	44,452,459.17
股票投资收益——证券出借差价收入	—	—
合计	82,207,213.32	44,452,459.17

##### 7.4.7.12.2 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01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
卖出股票成交总额	2,505,453,789.40	272,078,580.75
减：卖出股票成本总额	2,423,246,576.08	227,626,121.58
买卖股票差价收入	82,207,213.32	44,452,459.17

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期末及上年度末均无股票投资收益证券出借差价收入。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 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01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
----	-----------------------------	----------------------------------

		月31日)
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,168,799.57	5,994,604.84
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,977,400.00	5,783,260.00
减：应收利息总额	1,592.79	83,133.94
买卖债券差价收入	1,189,806.78	128,210.90

#### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖贵金属交易。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）
股票投资产生的股利收益	5,877,454.30	1,405,431.63
其中：证券出借权益补偿收入	55,314.00	—
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	5,877,454.30	1,405,431.63

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）
1. 交易性金融资产	72,202,616.19	-3,158,191.90
股票投资	72,162,692.03	-3,158,813.14
债券投资	39,924.16	621.24

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	72,202,616.19	-3,158,191.90

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
基金赎回费收入	2,577,729.19	276,276.48
转换费收入	20,821.31	4,149.94
合计	2,598,550.50	280,426.42

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
交易所市场交易费用	9,195,099.91	906,399.94
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	9,195,099.91	906,399.94

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
审计费用	30,000.00	25,000.00
信息披露费	120,000.00	100,000.00
证券出借违约金	—	—
其他	50,000.00	—
上市费	60,000.00	60,000.00
银行费用	15,552.54	4,128.56
指数使用费	264,419.53	200,000.00

合计	539,972.07	389,128.56
----	------------	------------

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
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
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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
山东省国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
申万宏源证券承销保荐有限责任公司（“申万宏源承销保荐”）	基金管理人的股东控制的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）		上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	429,731,287.25	6.47	151,709,149.25	25.04
申万宏源	1,139,369,318.15	17.15	95,603,413.40	15.78

##### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）		上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）	
	成交金额	占当期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（%）
海通证券	2,128,671.22	51.06	—	—
申万宏源	379,905.26	9.11	4,232,130.00	38.02

### 7.4.10.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）		上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
申万宏源	—	—	6,000,000.00	100.00

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行回购交易。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	1,038,965.14	17.15	494,267.37	15.41
海通证券	391,613.08	6.47	341,826.96	10.66
关联方名称	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	87,117.63	15.78	40,317.99	24.70
海通证券	138,253.20	25.04	73,015.05	44.74

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	11,460,798.51	1,537,978.88
其中：支付销售机构的客户维护费	2,465,971.50	387,227.93

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.0%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

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。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	1,719,119.84	230,696.93

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国中证1000指数增强A	富国中证1000指数增强C	合计

富国基金管理有限公司	—	161,203.05	161,203.05
海通证券股份有限公司	—	12.77	12.77
申万宏源证券有限公司	—	1.63	1.63
合计	—	161,217.45	161,217.45

注：自 2021 年 8 月 19 日起，本基金增加收取销售服务费的 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.20% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日）				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
申万宏源	3,884,344.00	2,567.99	—	—

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日）
--

关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位:)	出借期限(单位:)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
申万宏源	2021110300000672	广和通	2021年11月03日	203,532.00	4,200.00	14.00	3.20	253.28	—	—
申万宏源	2021111600000751	华峰测控	2021年11月16日	1,160,000.00	2,000.00	14.00	3.20	1,443.56	—	—

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)		上年度可比期间 (2020年01月01日至2020年12月31日)	
	富国中证1000指数增强A	富国中证1000指数增强C	富国中证1000指数增强A	富国中证1000指数增强C
基金合同生效日(2018年05月31日)持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	8,014,588.01	—	—	—
期间申购/买入总份额	6,836,995.17	485.18	8,014,588.01	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减:期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	14,851,583.18	485.18	8,014,588.01	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.82%	0.00%	6.78%	—

注:本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行,不存在费率优惠的情况。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。



#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)		上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	192,522,031.94	752,142.98	12,645,286.47	93,579.67

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期(2021年01月01日至2021年12月31日)					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
海通证券股份有限公司	301039	中集车辆	IPO网下申购	16,374	113,963.04
海通证券股份有限公司	300981	中红医疗	IPO网下申购	2,016	97,957.44
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	300937	药易购	IPO网下申购	2,434	29,816.50
海通证券股份有限公司	688187	时代电气	IPO网下申购	26,753	843,706.69
海通证券股份有限公司	688701	卓锦股份	IPO网下申购	2,340	17,590.72
海通证券股份有限公司	688217	睿昂基因	IPO网下申购	1,040	19,252.58
海通证券股份有限公司	688685	迈信林	IPO网下申购	2,612	23,678.04
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	2,035	58,941.94
海通证券股份有限公司	688329	艾隆科技	IPO网下申购	1,846	31,186.42
海通证券股份有限公司	688665	四方光电	IPO网下申购	1,687	50,066.20
海通证券股份有限公司	688687	凯因科技	IPO网下申购	3,710	70,767.88

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	300890	翔丰华	IPO网下申购	2,854	41,925.26
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	688585	上纬新材	IPO网下申购	4,922	12,317.06
海通证券股份有限公司	688301	奕瑞科技	IPO网下申购	826	99,283.55
海通证券股份有限公司	688521	芯原股份	IPO网下申购	3,440	133,205.92

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联方交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

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

###### 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000829	天音控股	2021-11-22	2022-05-23	大宗交易限售	20.16	16.21	300,000	6,048,000.00	4,863,000.00	—
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股认购	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	—
002206	海利得	2021-11-30	2022-05-30	大宗交易限售	8.96	8.04	370,000	3,315,200.00	2,974,800.00	—

002312	川发龙蟒	2021-09-22	2022-03-22	大宗交易 限售	16.20	12.33	560,000	9,072,000.00	6,904,800.00	—
002756	永兴材料	2021-09-15	2022-03-15	大宗交易 限售	105.54	138.84	80,000	8,443,200.00	11,107,200.00	—
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股限售	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	—
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股限售	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	—
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新股限售	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	—
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新股限售	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	—
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新股限售	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	—
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股限售	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	—
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股限售	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	—
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	新股限售	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	—
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股限售	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	—
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新股限售	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	—
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股限售	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	—
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股限售	22.04	56.28	621	13,686.84	34,949.88	—
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新股限售	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	—
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	新股限售	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	—
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股限售	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	—
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新股限售	6.96	12.51	1,638	11,400.48	20,491.38	—
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股限售	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	—
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股限售	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	—
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新股限售	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	—
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新股限售	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	—
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股限售	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	—
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	新股限售	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	—
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	新股限售	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	—
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新股限售	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	—
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股限售	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	—
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股限售	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	—
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股限售	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	—
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新股限售	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	—
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股限售	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	—
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股限售	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	—
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新股限售	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	—
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新股限售	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	—
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股限售	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	—
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	新股限售	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	—
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	新股限售	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	—

301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	新股限售	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	—
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	新股限售	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	—
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	新股限售	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	—
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	新股限售	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	—
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	新股限售	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	—
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	新股限售	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	—
600338	西藏珠峰	2021-10-20	2022-04-20	大宗交易 限售	30.57	34.17	240,000	7,336,800.00	8,200,800.00	—
688107	安路科技	2021-11-05	2022-05-12	新股限售	26.00	56.09	7,821	203,346.00	438,679.89	—
688167	炬光科技	2021-12-17	2022-06-24	新股限售	78.69	176.67	2,014	158,481.66	355,813.38	—
688187	时代电气	2021-08-30	2022-03-07	新股限售	31.38	76.65	26,753	839,509.14	2,050,617.45	—
688501	青达环保	2021-07-09	2022-01-17	新股限售	10.57	21.11	1,759	18,592.63	37,132.49	—
688511	天微电子	2021-07-22	2022-02-07	新股限售	28.09	54.52	1,490	41,854.10	81,234.80	—
688697	纽威数控	2021-09-09	2022-03-17	新股限售	7.55	16.03	5,837	44,069.35	93,567.11	—
688701	卓锦股份	2021-09-08	2022-03-16	新股限售	7.48	13.50	2,340	17,503.20	31,590.00	—
688778	厦钨新能	2021-07-29	2022-02-07	新股限售	24.50	100.74	5,075	124,337.50	511,255.50	—
688779	长远锂科	2021-08-03	2022-02-11	新股限售	5.65	22.86	42,378	239,435.70	968,761.08	—
688793	倍轻松	2021-07-07	2022-01-17	新股限售	27.40	101.73	1,454	39,839.60	147,915.42	—

#### 7.4.12.1.2 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
113052	兴业转债	2021-12-29	2022-01-14	认购新发 证券	100.00	100.00	20,700	2,070,000.00	2,070,000.00	—

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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	600565	迪马股份	2022 年 01 月 05 日 -2022 年 01 月 12 日	2.44	428,000	1,044,320.00
2	600502	安徽建工	2022 年 01 月 11 日 -2022 年 01 月 12 日	4.15	346,700	1,438,805.00
3	600531	豫光金铅	2022 年 01 月 11 日	6.03	268,900	1,621,467.00
4	000933	神火股份	2022 年 01 月 03 日	9.09	228,600	2,077,974.00
5	600108	亚盛集团	2022 年 01 月 07 日 -2022 年 01 月 14 日	3.53	201,000	709,530.00
6	000875	吉电股份	2022 年 01 月 11 日	9.09	179,300	1,629,837.00
7	002042	华孚时尚	2022 年 01 月 13 日	4.57	167,300	764,561.00
8	002547	春兴精工	2022 年 01 月 05 日 -2022 年 01 月 14 日	4.54	160,000	726,400.00
9	000793	华闻集团	2022 年 01 月 14 日	2.94	152,000	446,880.00
10	002400	省广集团	2022 年 01 月 04 日 -2022 年 01 月 05 日	5.13	130,000	666,900.00
11	600894	广日股份	2022 年 01 月 12 日 -2022 年 01 月 14 日	7.54	119,100	898,014.00

12	600110	诺德股份	2022年01月06日	15.95	104,300	1,663,585.00
13	600797	浙大网新	2022年01月03日 -2022年01月14日	6.80	101,000	686,800.00
14	601375	中原证券	2022年01月06日	4.91	100,000	491,000.00
15	600742	一汽富维	2022年01月05日 -2022年01月14日	11.96	99,000	1,184,040.00
16	603766	隆鑫通用	2022年01月13日	5.51	94,000	517,940.00
17	600323	瀚蓝环境	2022年01月03日	20.98	92,700	1,944,846.00
18	600063	皖维高新	2022年01月13日	6.13	90,400	554,152.00
19	603128	华贸物流	2022年01月11日 -2022年01月12日	13.68	90,000	1,231,200.00
20	002425	凯撒文化	2022年01月14日	9.64	89,000	857,960.00
21	600100	同方股份	2022年01月12日	6.03	79,000	476,370.00
22	000059	华锦股份	2022年01月06日	7.28	78,300	570,024.00
23	002130	沃尔核材	2022年01月11日 -2022年01月13日	8.25	71,200	587,400.00
24	600480	凌云股份	2022年01月06日	9.91	61,900	613,429.00
25	600499	科达制造	2022年01月04日 -2022年01月05日	24.82	60,000	1,489,200.00
26	300101	振芯科技	2022年01月06日 -2022年01月12日	22.18	55,800	1,237,644.00
27	603599	广信股份	2022年01月03日	39.00	55,200	2,152,800.00

28	600096	云天化	2022年01月11日 -2022年01月14日	19.62	55,000	1,079,100.00
29	601678	滨化股份	2022年01月14日	7.97	50,000	398,500.00
30	000612	焦作万方	2022年01月13日	7.71	50,000	385,500.00
31	688033	天宜上佳	2022年01月03日 -2022年01月14日	33.05	50,000	1,652,500.00
32	000887	中鼎股份	2022年01月03日 -2022年01月06日	21.81	48,200	1,051,242.00
33	300379	东方通	2022年01月13日	29.53	45,400	1,340,662.00
34	002041	登海种业	2022年01月13日	25.79	42,700	1,101,233.00
35	002254	泰和新材	2022年01月12日 -2022年01月13日	19.61	40,200	788,322.00
36	002647	仁东控股	2022年01月04日	9.66	40,000	386,400.00
37	002497	雅化集团	2022年01月05日	28.66	36,000	1,031,760.00
38	300623	捷捷微电	2022年01月03日 -2022年01月14日	31.46	34,000	1,069,640.00
39	300034	钢研高纳	2022年01月04日 -2022年01月07日	57.60	30,800	1,774,080.00
40	300638	广和通	2022年01月03日 -2022年01月12日	54.50	30,300	1,651,350.00
41	601311	骆驼股份	2022年01月13日 -2022年01月14日	15.33	30,300	464,499.00

42	601001	晋控煤业	2022年01月06日 -2022年01月07日	9.61	30,200	290,222.00
43	600596	新安股份	2022年01月03日	24.99	30,000	749,700.00
44	603222	济民医疗	2022年01月13日	18.40	30,000	552,000.00
45	000683	远兴能源	2022年01月03日 -2022年01月04日	7.30	30,000	219,000.00
46	601369	陕鼓动力	2022年01月13日	13.02	23,100	300,762.00
47	603877	太平鸟	2022年01月11日 -2022年01月12日	27.88	20,700	577,116.00
48	300118	东方日升	2022年01月05日 -2022年01月12日	32.47	16,900	548,743.00
49	300748	金力永磁	2022年01月03日 -2022年01月14日	44.89	16,700	749,663.00
50	300012	华测检测	2022年01月12日	26.87	16,400	440,668.00
51	002463	沪电股份	2022年01月14日	16.58	15,400	255,332.00
52	002158	汉钟精机	2022年01月13日	26.63	15,200	404,776.00
53	600285	羚锐制药	2022年01月11日	15.80	12,000	189,600.00
54	300327	中颖电子	2022年01月07日 -2022年01月10日	67.90	12,000	814,800.00
55	002597	金禾实业	2022年01月07日	51.35	12,000	616,200.00
56	000921	海信家电	2022年01月04日	15.15	10,700	162,105.00
57	603678	火炬电子	2022年01月12日	75.65	10,000	756,500.00



58	000555	神州信息	2022年01月06日	12.72	10,000	127,200.00
59	600391	航发科技	2022年01月14日	28.00	10,000	280,000.00
60	300458	全志科技	2022年01月05日	63.28	4,100	259,448.00
61	688298	东方生物	2022年01月11日	230.50	3,600	829,800.00
62	688368	晶丰明源	2022年01月13日	320.10	2,000	640,200.00
63	688366	昊海生科	2022年01月11日	125.89	1,000	125,890.00
64	300726	宏达电子	2022年01月12日	100.06	1,000	100,060.00
合计	-	-	-	-	4,618,600.00	52,447,651.00

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不在下表进行列示。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
AAA	2,070,000.00	—
AAA 以下	145,545.40	85,321.24
未评级	—	—
合计	2,215,545.40	85,321.24

注：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。

#### 7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的

到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末无重大流动性风险。

#### **7.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括其他价格风险、利率风险和外汇风险。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

###### **7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

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

单位：人民币元

本期末（2021年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	192,522,031.94	—	—	—	—	—	192,522,031.94
结算备付金	5,870,368.08	—	—	—	—	—	5,870,368.08
存出保证金	713,948.29	—	—	—	—	—	713,948.29
交易性金融资产	—	—	2,215,545.40	—	—	1,988,142,481.20	1,990,358,026.60
应收利息	—	—	—	—	—	57,829.74	57,829.74
应收申购款	73,209.13	—	—	—	—	2,067,242.16	2,140,451.29
资产总计	199,179,557.44	—	2,215,545.40	—	—	1,990,267,553.10	2,191,662,655.94
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	13,740,905.53	13,740,905.53
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,864,167.74	1,864,167.74
应付托管费	—	—	—	—	—	279,625.18	279,625.18
应付销售服务费	—	—	—	—	—	65,310.72	65,310.72
应付交易费用	—	—	—	—	—	3,207,437.71	3,207,437.71
应付税费	—	—	—	—	—	8.65	8.65
其他负债	—	—	—	—	—	363,746.33	363,746.33
负债总计	—	—	—	—	—	19,521,201.86	19,521,201.86
利率敏感度缺口	199,179,557.44	—	2,215,545.40	—	—	1,970,746,351.24	2,172,141,454.08
上年度末（2020年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

银行存款	12,645,286.47	—	—	—	—	—	12,645,286.47
结算备付金	203,237.74	—	—	—	—	—	203,237.74
存出保证金	51,221.38	—	—	—	—	—	51,221.38
交易性金融资产	—	—	85,321.24	—	—	184,583,057.55	184,668,378.79
应收证券清算款	—	—	—	—	—	1,573,689.86	1,573,689.86
应收利息	—	—	—	—	—	2,365.42	2,365.42
应收申购款	14,059.30	—	—	—	—	63,362.46	77,421.76
资产总计	12,913,804.89	—	85,321.24	—	—	186,222,475.29	199,221,601.42
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	735,173.67	735,173.67
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	173,748.48	173,748.48
应付托管费	—	—	—	—	—	26,062.27	26,062.27
应付交易费用	—	—	—	—	—	163,206.41	163,206.41
应付税费	—	—	—	—	—	0.53	0.53
其他负债	—	—	—	—	—	177,115.09	177,115.09
负债总计	—	—	—	—	—	1,275,306.45	1,275,306.45
利率敏感度缺口	12,913,804.89	—	85,321.24	—	—	184,947,168.84	197,946,294.97

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 1000 指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2021年12月31日）		上年度末（2020年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,988,142,481.20	91.53	184,583,057.55	93.25
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	2,215,545.40	0.10	85,321.24	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	1,990,358,026.60	91.63	184,668,378.79	93.29

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	20,333,098.47	1,877,563.82
	2. 业绩比较基准减少 1%	-20,333,098.47	-1,877,563.82

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金

---

融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 1,948,895,503.86 元，属于第二层次的余额为人民币 2,075,504.49 元，属于第三层次余额为人民币 39,387,018.25 元（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 183,591,304.78 元，属于第二层次的余额为人民币 113,047.48 元，属于第三层次余额为人民币 964,026.53 元）。

##### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

上年度末余额人民币 964,026.53 元，2021 年度转入第三层次人民币 0.00 元，转出第三层次人民币 1,056,270.65 元，当期计入损益的利得或损失总额人民币 3,457,841.91 元，购买人民币 36,246,741.32 元，卖出人民币 225,320.86 元，本期末人民币 39,387,018.25 元，本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动人民币 3,140,276.93 元。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。



#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,988,142,481.20	90.71
	其中：股票	1,988,142,481.20	90.71
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	2,215,545.40	0.10
	其中：债券	2,215,545.40	0.10
	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	198,392,400.02	9.05
8	其他各项资产	2,912,229.32	0.13
9	合计	2,191,662,655.94	100.00

注：本基金通过转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 52,447,651.00 元，占资产净值比例为 2.41%。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

##### 8.2.1.1 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	—	—
B	采矿业	9,732,808.00	0.45
C	制造业	215,660,398.74	9.93

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,762,218.00	0.27
E	建筑业	814,049.99	0.04
F	批发和零售业	3,230,112.02	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	10,559,822.00	0.49
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,162,535.72	1.43
J	金融业	4,677,438.68	0.22
K	房地产业	14,591,232.00	0.67
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	5,359,855.62	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	55,077.71	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	4,265,471.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	1,191,166.44	0.05
S	综合	—	—
	合计	307,066,793.92	14.14

### 8.2.1.2 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	17,136,947.00	0.79
B	采矿业	42,665,522.49	1.96
C	制造业	1,212,524,700.10	55.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,979,552.00	1.01
E	建筑业	35,331,618.00	1.63
F	批发和零售业	27,287,489.00	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	33,888,834.00	1.56
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	161,230,548.27	7.42
J	金融业	25,654,364.00	1.18
K	房地产业	9,369,347.00	0.43
L	租赁和商务服务业	32,002,419.00	1.47
M	科学研究和技术服务业	21,016,279.42	0.97
N	水利、环境和公共设施管理业	29,187,749.00	1.34
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	1,711,482.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	10,088,836.00	0.46

S	综合	—	—
	合计	1,681,075,687.28	77.39

### 8.3 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

#### 8.3.1 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	603008	喜临门	514,588	20,084,369.64	0.92
2	002043	兔宝宝	1,646,200	19,886,096.00	0.92
3	688200	华峰测控	37,658	19,277,130.20	0.89
4	603599	广信股份	455,714	17,772,846.00	0.82
5	002833	弘亚数控	534,640	17,204,715.20	0.79
6	000933	神火股份	1,889,300	17,173,737.00	0.79
7	600882	妙可蓝多	290,100	16,245,600.00	0.75
8	688066	航天宏图	216,811	15,762,159.70	0.73
9	688016	心脉医疗	62,460	15,536,300.40	0.72
10	688508	芯朋微	132,600	15,363,036.00	0.71
11	300327	中颖电子	221,220	15,020,838.00	0.69
12	600502	安徽建工	3,617,800	15,013,870.00	0.69
13	603566	普莱柯	678,568	14,996,352.80	0.69
14	300379	东方通	493,600	14,576,008.00	0.67
15	300829	金丹科技	316,400	14,459,480.00	0.67
16	688368	晶丰明源	45,147	14,451,554.70	0.67
17	300590	移为通信	499,420	14,408,267.00	0.66
18	000507	珠海港	2,202,600	14,228,796.00	0.66
19	000875	吉电股份	1,559,000	14,171,310.00	0.65
20	603236	移远通信	68,770	14,022,203.00	0.65
21	600110	诺德股份	874,900	13,954,655.00	0.64
22	603039	泛微网络	200,000	13,954,000.00	0.64
23	688516	奥特维	56,584	13,903,820.48	0.64
24	601677	明泰铝业	313,789	13,834,957.01	0.64
25	002034	旺能环境	797,600	13,774,552.00	0.63
26	600596	新安股份	549,600	13,734,504.00	0.63
27	002293	罗莱生活	955,100	13,686,583.00	0.63
28	002407	多氟多	303,500	13,654,465.00	0.63
29	300659	中孚信息	300,220	13,614,977.00	0.63
30	300653	正海生物	201,100	13,427,447.00	0.62
31	300390	天华超净	164,400	13,316,400.00	0.61
32	002677	浙江美大	762,700	13,232,845.00	0.61
33	600057	厦门象屿	1,548,900	13,150,161.00	0.61
34	600123	兰花科创	1,402,400	13,140,488.00	0.60

35	688033	天宜上佳	395,630	13,075,571.50	0.60
36	688116	天奈科技	87,234	13,023,163.86	0.60
37	688388	嘉元科技	103,031	12,935,542.05	0.60
38	002611	东方精工	2,292,200	12,790,476.00	0.59
39	300548	博创科技	386,800	12,779,872.00	0.59
40	002254	泰和新材	649,367	12,734,086.87	0.59
41	600323	瀚蓝环境	598,400	12,554,432.00	0.58
42	300034	钢研高纳	213,400	12,291,840.00	0.57
43	600742	一汽富维	1,019,370	12,191,665.20	0.56
44	300696	爱乐达	232,700	12,086,438.00	0.56
45	300638	广和通	217,110	11,832,495.00	0.54
46	002245	蔚蓝锂芯	424,800	11,686,248.00	0.54
47	002497	雅化集团	405,700	11,627,362.00	0.54
48	300171	东富龙	227,335	11,489,510.90	0.53
49	002042	华孚时尚	2,463,100	11,256,367.00	0.52
50	002309	中利集团	1,653,600	11,178,336.00	0.51
51	000403	派林生物	397,900	11,153,137.00	0.51
52	002756	永兴材料	80,000	11,107,200.00	0.51
53	300073	当升科技	124,800	10,841,376.00	0.50
54	600864	哈投股份	1,759,800	10,752,378.00	0.50
55	688122	西部超导	110,438	10,705,859.72	0.49
56	300604	长川科技	186,000	10,695,000.00	0.49
57	002041	登海种业	411,700	10,617,743.00	0.49
58	600499	科达制造	425,000	10,548,500.00	0.49
59	688202	美迪西	21,248	10,317,816.32	0.48
60	300726	宏达电子	102,700	10,276,162.00	0.47
61	300101	振芯科技	460,245	10,208,234.10	0.47
62	600531	豫光金铅	1,692,100	10,203,363.00	0.47
63	300623	捷捷微电	319,470	10,050,526.20	0.46
64	002850	科达利	61,000	9,780,740.00	0.45
65	603678	火炬电子	124,800	9,441,120.00	0.43
66	002158	汉钟精机	335,002	8,921,103.26	0.41
67	000921	海信家电	585,300	8,867,295.00	0.41
68	300755	华致酒行	174,800	8,753,984.00	0.40
69	688298	东方生物	37,707	8,691,463.50	0.40
70	603128	华贸物流	613,700	8,395,416.00	0.39
71	300662	科锐国际	132,900	8,267,709.00	0.38
72	300458	全志科技	130,600	8,264,368.00	0.38
73	002240	盛新锂能	142,200	8,240,490.00	0.38
74	600338	西藏珠峰	240,000	8,200,800.00	0.38
75	300568	星源材质	221,966	8,152,811.18	0.38

76	300397	天和防务	513,600	7,852,944.00	0.36
77	600096	云天化	396,000	7,769,520.00	0.36
78	300627	华测导航	167,200	7,691,200.00	0.35
79	600894	广日股份	1,016,800	7,666,672.00	0.35
80	002425	凯撒文化	793,000	7,644,520.00	0.35
81	300748	金力永磁	166,400	7,469,696.00	0.34
82	601375	中原证券	1,504,300	7,386,113.00	0.34
83	300775	三角防务	149,900	7,328,611.00	0.34
84	300740	水羊股份	454,300	7,218,827.00	0.33
85	603279	景津装备	154,800	7,179,624.00	0.33
86	688301	奕瑞科技	14,300	7,105,670.00	0.33
87	300639	凯普生物	239,017	7,053,391.67	0.32
88	600711	盛屯矿业	655,537	7,033,912.01	0.32
89	002312	川发龙蟒	560,000	6,904,800.00	0.32
90	000498	山东路桥	1,086,800	6,716,424.00	0.31
91	300232	洲明科技	740,000	6,615,600.00	0.30
92	688085	三友医疗	211,973	6,543,606.51	0.30
93	000639	西王食品	1,283,600	6,520,688.00	0.30
94	600108	亚盛集团	1,846,800	6,519,204.00	0.30
95	600480	凌云股份	656,400	6,504,924.00	0.30
96	600565	迪马股份	2,658,800	6,487,472.00	0.30
97	688095	福昕软件	46,885	6,470,598.85	0.30
98	300252	金信诺	717,500	6,400,100.00	0.29
99	600986	浙文互联	754,200	6,357,906.00	0.29
100	603959	百利科技	399,400	6,294,544.00	0.29
101	600100	同方股份	1,041,100	6,277,833.00	0.29
102	600063	皖维高新	1,016,700	6,232,371.00	0.29
103	002777	久远银海	224,660	6,211,849.00	0.29
104	603105	芯能科技	373,500	6,207,570.00	0.29
105	601678	滨化股份	763,900	6,088,283.00	0.28
106	603222	济民医疗	325,400	5,987,360.00	0.28
107	002597	金禾实业	116,200	5,966,870.00	0.27
108	002727	一心堂	153,100	5,895,881.00	0.27
109	605168	三人行	34,800	5,880,852.00	0.27
110	605338	巴比食品	165,900	5,779,956.00	0.27
111	002135	东南网架	497,500	5,751,100.00	0.26
112	600428	中远海特	1,119,900	5,644,296.00	0.26
113	603713	密尔克卫	41,700	5,620,326.00	0.26
114	605111	新洁能	31,400	5,592,340.00	0.26
115	002895	川恒股份	224,100	5,533,029.00	0.25
116	300633	开立医疗	172,800	5,517,504.00	0.25

117	300573	兴齐眼药	38,600	5,280,480.00	0.24
118	603026	石大胜华	26,300	5,207,137.00	0.24
119	002449	国星光电	470,300	5,069,834.00	0.23
120	002539	云图控股	379,600	5,037,292.00	0.23
121	002022	科华生物	337,300	5,005,532.00	0.23
122	600577	精达股份	662,000	4,925,280.00	0.23
123	600331	宏达股份	1,538,900	4,909,091.00	0.23
124	000829	天音控股	300,000	4,863,000.00	0.22
125	300083	创世纪	340,500	4,862,340.00	0.22
126	002106	莱宝高科	421,500	4,851,465.00	0.22
127	002130	沃尔核材	585,100	4,827,075.00	0.22
128	600797	浙大网新	692,600	4,709,680.00	0.22
129	002400	省广集团	916,900	4,703,697.00	0.22
130	300012	华测检测	173,500	4,661,945.00	0.21
131	601001	晋控煤业	481,400	4,626,254.00	0.21
132	603877	太平鸟	164,400	4,583,472.00	0.21
133	000550	江铃汽车	275,700	4,496,667.00	0.21
134	002547	春兴精工	988,700	4,488,698.00	0.21
135	000657	中钨高新	277,300	4,458,984.00	0.21
136	603766	隆鑫通用	800,100	4,408,551.00	0.20
137	000683	远兴能源	603,200	4,403,360.00	0.20
138	300476	胜宏科技	144,300	4,365,075.00	0.20
139	688050	爱博医疗	20,624	4,335,783.52	0.20
140	603896	寿仙谷	74,600	4,326,800.00	0.20
141	002978	安宁股份	101,900	4,308,332.00	0.20
142	002498	汉缆股份	832,800	4,305,576.00	0.20
143	000059	华锦股份	582,000	4,236,960.00	0.20
144	688166	博瑞医药	115,000	4,221,650.00	0.19
145	000793	华闻集团	1,430,500	4,205,670.00	0.19
146	601965	中国汽研	222,600	4,142,586.00	0.19
147	600873	梅花生物	537,400	4,121,858.00	0.19
148	000423	东阿阿胶	83,400	4,065,750.00	0.19
149	300783	三只松鼠	100,900	3,932,073.00	0.18
150	002145	中核钛白	311,000	3,915,490.00	0.18
151	601515	东风股份	474,100	3,854,433.00	0.18
152	300477	合纵科技	472,900	3,806,845.00	0.18
153	300672	国科微	20,400	3,784,200.00	0.17
154	300502	新易盛	96,187	3,768,606.66	0.17
155	600581	八一钢铁	604,400	3,753,324.00	0.17
156	688017	绿的谐波	21,500	3,753,040.00	0.17
157	300432	富临精工	127,100	3,736,740.00	0.17

158	002194	武汉凡谷	343,800	3,726,792.00	0.17
159	300785	值得买	51,600	3,701,784.00	0.17
160	002581	未名医药	169,500	3,618,825.00	0.17
161	601311	骆驼股份	233,300	3,576,489.00	0.16
162	603013	亚普股份	212,500	3,553,000.00	0.16
163	601609	金田铜业	406,500	3,516,225.00	0.16
164	002614	奥佳华	256,948	3,309,490.24	0.15
165	688399	硕世生物	23,300	3,203,750.00	0.15
166	300145	中金环境	977,000	3,185,020.00	0.15
167	000915	华特达因	103,200	3,143,472.00	0.14
168	300613	富瀚微	19,246	3,138,060.30	0.14
169	600308	华泰股份	505,100	3,126,569.00	0.14
170	688318	财富趋势	20,216	3,076,875.20	0.14
171	300118	东方日升	94,600	3,071,662.00	0.14
172	300552	万集科技	75,880	3,057,205.20	0.14
173	000591	太阳能	269,600	3,019,520.00	0.14
174	600360	华微电子	328,400	2,981,872.00	0.14
175	002206	海利得	370,000	2,974,800.00	0.14
176	002545	东方铁塔	318,600	2,905,632.00	0.13
177	600223	鲁商发展	217,500	2,881,875.00	0.13
178	002649	博彦科技	242,600	2,833,568.00	0.13
179	603915	国茂股份	71,000	2,761,900.00	0.13
180	600512	腾达建设	841,300	2,742,638.00	0.13
181	600285	羚锐制药	171,992	2,717,473.60	0.13
182	688158	优刻得	102,408	2,715,860.16	0.13
183	002647	仁东控股	280,800	2,712,528.00	0.12
184	000697	炼石航空	312,100	2,690,302.00	0.12
185	000917	电广传媒	392,900	2,656,004.00	0.12
186	600491	龙元建设	383,700	2,643,693.00	0.12
187	603533	掌阅科技	103,400	2,637,734.00	0.12
188	300208	青岛中程	242,300	2,626,532.00	0.12
189	000612	焦作万方	332,700	2,565,117.00	0.12
190	603043	广州酒家	106,300	2,557,578.00	0.12
191	601949	中国出版	432,800	2,527,552.00	0.12
192	002522	浙江众成	355,900	2,526,890.00	0.12
193	002662	京威股份	580,100	2,471,226.00	0.11
194	600273	嘉化能源	210,000	2,429,700.00	0.11
195	301029	怡合达	26,240	2,416,189.30	0.11
196	600751	海航科技	800,200	2,384,596.00	0.11
197	002332	仙琚制药	178,200	2,352,240.00	0.11
198	603383	顶点软件	65,000	2,333,500.00	0.11

199	000936	华西股份	367,800	2,306,106.00	0.11
200	002326	永太科技	45,000	2,304,450.00	0.11
201	002461	珠江啤酒	252,900	2,301,390.00	0.11
202	002463	沪电股份	137,800	2,284,724.00	0.11
203	603869	新智认知	226,900	2,273,538.00	0.10
204	603906	龙蟠科技	60,900	2,255,736.00	0.10
205	300307	慈星股份	283,300	2,229,571.00	0.10
206	000762	西藏矿业	41,700	2,215,521.00	0.10
207	603612	索通发展	103,900	2,132,028.00	0.10
208	002738	中矿资源	29,700	2,089,692.00	0.10
209	688389	普门科技	89,200	2,051,600.00	0.09
210	300393	中来股份	104,600	1,991,584.00	0.09
211	600391	航发科技	70,100	1,962,800.00	0.09
212	300973	立高食品	14,600	1,928,368.00	0.09
213	601369	陕鼓动力	145,000	1,887,900.00	0.09
214	300068	南都电源	132,900	1,881,864.00	0.09
215	000969	安泰科技	174,900	1,873,179.00	0.09
216	603103	横店影视	139,500	1,842,795.00	0.08
217	300378	鼎捷软件	76,500	1,836,000.00	0.08
218	600621	华鑫股份	132,200	1,829,648.00	0.08
219	600496	精工钢构	417,100	1,776,846.00	0.08
220	002639	雪人股份	117,900	1,753,173.00	0.08
221	300102	乾照光电	194,500	1,748,555.00	0.08
222	603733	仙鹤股份	42,303	1,726,385.43	0.08
223	002218	拓日新能	255,000	1,723,800.00	0.08
224	600452	涪陵电力	85,100	1,713,914.00	0.08
225	000823	超声电子	123,000	1,675,260.00	0.08
226	600210	紫江企业	177,000	1,624,860.00	0.07
227	300080	易成新能	278,400	1,620,288.00	0.07
228	300395	菲利华	24,200	1,590,908.00	0.07
229	300035	中科电气	52,400	1,585,100.00	0.07
230	300725	药石科技	10,900	1,549,653.00	0.07
231	300747	锐科激光	26,200	1,548,682.00	0.07
232	300856	科思股份	24,500	1,547,665.00	0.07
233	600715	文投控股	454,300	1,512,819.00	0.07
234	603588	高能环境	85,500	1,502,235.00	0.07
235	603305	旭升股份	30,000	1,496,400.00	0.07
236	600481	双良节能	148,600	1,494,916.00	0.07
237	603666	亿嘉和	19,700	1,479,864.00	0.07
238	600777	新潮能源	607,841	1,385,877.48	0.06
239	002646	青青稞酒	64,200	1,347,558.00	0.06



240	600771	广誉远	31,200	1,343,472.00	0.06
241	688366	昊海生科	10,383	1,307,115.87	0.06
242	002531	天顺风能	67,400	1,306,886.00	0.06
243	600635	大众公用	343,900	1,303,381.00	0.06
244	300263	隆华科技	126,900	1,294,380.00	0.06
245	600330	天通股份	78,600	1,275,678.00	0.06
246	600686	金龙汽车	202,800	1,273,584.00	0.06
247	002307	北新路桥	296,100	1,264,347.00	0.06
248	002643	万润股份	53,100	1,255,284.00	0.06
249	300119	瑞普生物	52,000	1,254,240.00	0.06
250	300792	壹网壹创	25,300	1,239,700.00	0.06
251	603025	大豪科技	45,500	1,200,745.00	0.06
252	000516	ST国医	101,400	1,118,442.00	0.05
253	600483	福能股份	68,700	1,118,436.00	0.05
254	002832	比音勒芬	42,700	1,086,715.00	0.05
255	002421	达实智能	273,200	1,054,552.00	0.05
256	000555	神州信息	82,500	1,049,400.00	0.05
257	000881	中广核技	108,600	1,045,818.00	0.05
258	600602	云赛智联	154,100	1,001,650.00	0.05
259	300276	三丰智能	224,500	985,555.00	0.05
260	300215	电科院	95,300	955,859.00	0.04
261	300388	节能国祯	119,400	937,290.00	0.04
262	002402	和而泰	34,100	935,363.00	0.04
263	600267	海正药业	64,000	895,360.00	0.04
264	002636	金安国纪	59,000	887,950.00	0.04
265	603887	城地香江	109,320	887,678.40	0.04
266	603610	麒盛科技	33,500	866,310.00	0.04
267	300294	博雅生物	21,100	809,185.00	0.04
268	300572	安车检测	38,900	803,285.00	0.04
269	002541	鸿路钢构	15,000	803,100.00	0.04
270	300685	艾德生物	10,600	800,406.00	0.04
271	300311	任子行	97,600	797,392.00	0.04
272	603801	志邦家居	25,940	789,094.80	0.04
273	688139	海尔生物	8,512	773,059.84	0.04
274	000503	国新健康	44,100	745,290.00	0.03
275	000650	仁和药业	79,700	742,804.00	0.03
276	002139	拓邦股份	39,100	730,779.00	0.03
277	300821	东岳硅材	39,300	718,404.00	0.03
278	000676	智度股份	88,100	684,537.00	0.03
279	603520	司太立	10,300	669,500.00	0.03
280	002446	盛路通信	110,300	667,315.00	0.03

281	300079	数码视讯	75,300	664,899.00	0.03
282	300352	北信源	108,100	659,410.00	0.03
283	688198	佰仁医疗	2,593	659,399.90	0.03
284	601666	平煤股份	78,300	655,371.00	0.03
285	600846	同济科技	80,100	653,616.00	0.03
286	688365	光云科技	46,800	648,648.00	0.03
287	600055	万东医疗	26,700	635,727.00	0.03
288	002204	大连重工	145,800	634,230.00	0.03
289	002035	华帝股份	99,500	632,820.00	0.03
290	000831	五矿稀土	16,000	624,320.00	0.03
291	600587	新华医疗	19,300	621,460.00	0.03
292	300298	三诺生物	20,700	619,137.00	0.03
293	002243	力合科创	54,500	615,305.00	0.03
294	600252	中恒集团	158,900	613,354.00	0.03
295	002675	东诚药业	38,700	610,686.00	0.03
296	300143	盈康生命	42,000	593,040.00	0.03
297	002912	中新赛克	17,600	582,384.00	0.03
298	002807	江阴银行	150,120	577,962.00	0.03
299	000627	天茂集团	168,000	556,080.00	0.03
300	002612	朗姿股份	17,400	551,754.00	0.03
301	300233	金城医药	18,900	549,801.00	0.03
302	002017	东信和平	35,700	541,569.00	0.02
303	300326	凯利泰	50,800	541,528.00	0.02
304	600129	太极集团	23,900	536,794.00	0.02
305	600812	华北制药	44,600	531,632.00	0.02
306	603323	苏农银行	106,900	520,603.00	0.02
307	600993	马应龙	18,000	517,680.00	0.02
308	000566	海南海药	97,700	512,925.00	0.02
309	603068	博通集成	9,500	508,820.00	0.02
310	688266	泽璟制药	8,466	497,800.80	0.02
311	002839	张家港行	86,000	495,360.00	0.02
312	300373	扬杰科技	7,193	483,225.74	0.02
313	300777	中简科技	7,800	482,664.00	0.02
314	002262	恩华药业	30,200	472,630.00	0.02
315	600456	宝钛股份	6,500	466,570.00	0.02
316	002099	海翔药业	56,300	463,912.00	0.02
317	600746	江苏索普	32,600	449,880.00	0.02
318	600682	南京新百	38,200	449,232.00	0.02
319	603881	数据港	12,100	446,732.00	0.02
320	300497	富祥药业	27,000	440,910.00	0.02
321	000544	中原环保	68,100	435,840.00	0.02

322	002484	江海股份	15,800	431,656.00	0.02
323	300158	振东制药	52,700	431,613.00	0.02
324	600073	上海梅林	53,106	429,627.54	0.02
325	300470	中密控股	9,600	428,832.00	0.02
326	000597	东北制药	68,600	426,692.00	0.02
327	300768	迪普科技	10,300	424,875.00	0.02
328	300267	尔康制药	89,400	423,756.00	0.02
329	002891	中宠股份	14,000	423,360.00	0.02
330	000913	钱江摩托	29,700	421,443.00	0.02
331	601827	三峰环境	47,000	419,240.00	0.02
332	002518	科士达	16,700	419,170.00	0.02
333	601011	宝泰隆	79,200	418,968.00	0.02
334	300702	天宇股份	8,600	415,810.00	0.02
335	603920	世运电路	18,500	412,550.00	0.02
336	601222	林洋能源	34,000	412,420.00	0.02
337	603108	润达医疗	30,000	402,300.00	0.02
338	688277	天智航	15,300	401,625.00	0.02
339	300510	金冠股份	61,100	401,427.00	0.02
340	601918	新集能源	84,200	382,268.00	0.02
341	601015	陕西黑猫	57,600	373,248.00	0.02
342	600459	贵研铂业	14,660	373,097.00	0.02
343	300841	康华生物	1,750	372,260.00	0.02
344	300770	新媒股份	6,200	372,000.00	0.02
345	002737	葵花药业	22,300	367,058.00	0.02
346	002182	云海金属	16,000	367,040.00	0.02
347	002773	康弘药业	18,000	366,300.00	0.02
348	603718	海利生物	23,900	365,670.00	0.02
349	600740	山西焦化	58,500	363,285.00	0.02
350	600422	昆药集团	32,400	358,020.00	0.02
351	002215	诺普信	55,100	351,538.00	0.02
352	300149	睿智医药	25,200	348,012.00	0.02
353	300401	花园生物	23,900	343,682.00	0.02
354	603368	柳药股份	18,000	342,720.00	0.02
355	000712	锦龙股份	21,200	333,900.00	0.02
356	600750	江中药业	23,000	332,350.00	0.02
357	603113	金能科技	19,800	322,740.00	0.01
358	300723	一品红	8,800	315,920.00	0.01
359	600557	康缘药业	25,700	314,568.00	0.01
360	002020	京新药业	32,900	312,879.00	0.01
361	600211	西藏药业	5,900	308,924.00	0.01
362	300194	福安药业	60,300	308,736.00	0.01

363	002437	誉衡药业	99,000	288,090.00	0.01
364	600395	盘江股份	39,200	284,984.00	0.01
365	000901	航天科技	27,200	280,976.00	0.01
366	300803	指南针	7,100	280,947.00	0.01
367	002550	千红制药	57,200	276,276.00	0.01
368	600420	国药现代	26,600	275,842.00	0.01
369	000989	九芝堂	25,200	273,672.00	0.01
370	300006	莱美药业	40,100	273,482.00	0.01
371	300406	九强生物	13,500	267,570.00	0.01
372	600997	开滦股份	37,400	266,288.00	0.01
373	002589	瑞康医药	67,100	263,703.00	0.01
374	600169	太原重工	90,500	259,735.00	0.01
375	002955	鸿合科技	11,800	257,476.00	0.01
376	603301	振德医疗	5,000	256,850.00	0.01
377	002283	天润工业	26,700	252,048.00	0.01
378	300287	飞利信	41,100	251,943.00	0.01
379	300109	新开源	11,300	246,340.00	0.01
380	300769	德方纳米	500	245,580.00	0.01
381	600789	鲁抗医药	32,400	242,676.00	0.01
382	603387	基蛋生物	11,800	236,708.00	0.01
383	688520	神州细胞	4,003	233,975.35	0.01
384	600971	恒源煤电	36,000	232,560.00	0.01
385	601890	亚星锚链	24,600	228,534.00	0.01
386	000710	贝瑞基因	11,700	226,980.00	0.01
387	300204	舒泰神	12,900	226,395.00	0.01
388	002558	巨人网络	18,700	223,839.00	0.01
389	300439	美康生物	10,200	217,362.00	0.01
390	603053	成都燃气	20,900	217,151.00	0.01
391	300531	优博讯	10,600	216,558.00	0.01
392	603229	奥翔药业	5,900	214,819.00	0.01
393	300735	光弘科技	14,200	213,994.00	0.01
394	688333	铂力特	1,000	213,000.00	0.01
395	002126	银轮股份	16,800	211,008.00	0.01
396	000567	海德股份	11,700	208,845.00	0.01
397	600850	电科数字	6,100	208,193.00	0.01
398	300981	中红医疗	2,600	207,844.00	0.01
399	000968	蓝焰控股	21,300	199,155.00	0.01
400	300365	恒华科技	18,500	198,875.00	0.01
401	688222	成都先导	7,990	187,685.10	0.01
402	002977	天箭科技	2,300	184,138.00	0.01
403	002537	海联金汇	25,300	179,630.00	0.01

404	688133	泰坦科技	800	174,560.00	0.01
405	688568	中科星图	2,100	165,858.00	0.01
406	002055	得润电子	10,600	154,866.00	0.01
407	603298	杭叉集团	8,900	152,635.00	0.01
408	300598	诚迈科技	2,100	134,379.00	0.01
409	603283	赛腾股份	4,000	117,600.00	0.01
410	002605	姚记科技	3,112	70,735.76	0.00
411	301035	润丰股份	621	34,949.88	0.00
412	002582	好想你	4,000	34,800.00	0.00
413	603129	春风动力	200	34,600.00	0.00
414	300206	理邦仪器	2,200	30,976.00	0.00
415	301039	中集车辆	1,638	20,491.38	0.00
416	603686	福龙马	400	5,744.00	0.00
417	300348	长亮科技	200	3,134.00	0.00
418	002609	捷顺科技	300	2,925.00	0.00
419	002100	天康生物	200	2,140.00	0.00
420	600284	浦东建设	300	1,896.00	0.00
421	601058	赛轮轮胎	100	1,479.00	0.00
422	603018	华设集团	100	836.00	0.00
423	002542	中化岩土	200	590.00	0.00

### 8.3.2 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	603613	国联股份	101,992	10,964,140.00	0.50
2	300196	长海股份	542,800	9,515,284.00	0.44
3	300415	伊之密	407,900	8,663,796.00	0.40
4	300896	爱美客	14,576	7,814,339.36	0.36
5	000887	中鼎股份	348,300	7,596,423.00	0.35
6	002129	中环股份	171,800	7,172,650.00	0.33
7	601872	招商轮船	1,549,100	6,351,310.00	0.29
8	300363	博腾股份	70,700	6,324,115.00	0.29
9	601958	金钼股份	914,000	6,260,900.00	0.29
10	300223	北京君正	46,500	6,231,000.00	0.29
11	000830	鲁西化工	397,300	6,062,798.00	0.28
12	600160	巨化股份	459,900	5,937,309.00	0.27
13	300680	隆盛科技	189,500	5,912,400.00	0.27
14	002244	滨江集团	1,258,100	5,862,746.00	0.27
15	600008	首创环保	1,689,800	5,762,218.00	0.27
16	600141	兴发集团	152,100	5,761,548.00	0.27

17	300825	阿尔特	189,900	5,319,099.00	0.24
18	688357	建龙微纳	27,640	5,305,221.60	0.24
19	600325	华发股份	856,600	5,156,732.00	0.24
20	300593	新雷能	92,640	5,037,763.20	0.23
21	600195	中牧股份	382,200	4,995,354.00	0.23
22	002624	完美世界	242,400	4,923,144.00	0.23
23	300772	运达股份	106,000	4,661,880.00	0.21
24	002709	天赐材料	40,600	4,654,790.00	0.21
25	603456	九洲药业	78,100	4,393,906.00	0.20
26	300382	斯莱克	188,947	4,353,338.88	0.20
27	605336	帅丰电器	125,500	4,279,550.00	0.20
28	603882	金域医学	38,300	4,265,471.00	0.20
29	601598	中国外运	939,400	4,208,512.00	0.19
30	300059	东方财富	111,900	4,152,609.00	0.19
31	000799	酒鬼酒	18,600	3,952,500.00	0.18
32	601636	旗滨集团	216,300	3,698,730.00	0.17
33	002648	卫星化学	91,200	3,650,736.00	0.17
34	000671	阳光城	1,182,700	3,571,754.00	0.16
35	603444	吉比特	8,400	3,543,540.00	0.16
36	600438	通威股份	76,500	3,439,440.00	0.16
37	300750	宁德时代	5,800	3,410,400.00	0.16
38	600089	特变电工	150,000	3,175,500.00	0.15
39	688005	容百科技	27,397	3,166,545.26	0.15
40	300209	天泽信息	399,300	3,166,449.00	0.15
41	603986	兆易创新	17,400	3,059,790.00	0.14
42	001215	千味央厨	51,795	3,014,986.95	0.14
43	002202	金风科技	175,400	2,888,838.00	0.13
44	600760	中航沈飞	41,280	2,808,691.20	0.13
45	000629	攀钢钒钛	717,300	2,790,297.00	0.13
46	000988	华工科技	97,300	2,710,778.00	0.12
47	300655	晶瑞电材	60,800	2,540,224.00	0.12
48	600737	中粮糖业	265,600	2,496,640.00	0.11
49	605358	立昂微	20,400	2,448,204.00	0.11
50	002881	美格智能	51,400	2,204,032.00	0.10
51	000063	中兴通讯	63,200	2,117,200.00	0.10
52	688558	国盛智科	46,600	2,106,320.00	0.10
53	002812	恩捷股份	8,300	2,078,320.00	0.10
54	688187	时代电气	26,753	2,050,617.45	0.09
55	002156	通富微电	105,500	2,049,865.00	0.09
56	688536	思瑞浦	2,600	1,996,800.00	0.09
57	688356	键凯科技	5,800	1,955,354.00	0.09

58	688011	新光光电	59,500	1,952,195.00	0.09
59	688188	柏楚电子	5,031	1,939,249.26	0.09
60	600256	广汇能源	293,500	1,919,490.00	0.09
61	601877	正泰电器	32,900	1,772,981.00	0.08
62	300911	亿田智能	21,500	1,761,280.00	0.08
63	000519	中兵红箭	65,600	1,749,552.00	0.08
64	002308	威创股份	366,800	1,690,948.00	0.08
65	603267	鸿远电子	9,400	1,686,736.00	0.08
66	000636	风华高科	55,600	1,656,880.00	0.08
67	002568	百润股份	27,360	1,636,948.80	0.08
68	002869	金溢科技	104,200	1,619,268.00	0.07
69	300260	新莱应材	33,800	1,594,346.00	0.07
70	002517	恺英网络	270,100	1,571,982.00	0.07
71	002472	双环传动	56,600	1,561,028.00	0.07
72	688369	致远互联	18,890	1,344,023.50	0.06
73	300316	晶盛机电	18,000	1,251,000.00	0.06
74	300751	迈为股份	1,940	1,246,062.00	0.06
75	601238	广汽集团	80,000	1,215,200.00	0.06
76	600782	新钢股份	227,900	1,203,312.00	0.06
77	601898	中煤能源	184,600	1,161,134.00	0.05
78	002739	万达电影	74,500	1,153,260.00	0.05
79	002322	理工环科	84,100	1,008,359.00	0.05
80	688777	中控技术	12,987	985,453.56	0.05
81	688779	长远锂科	42,378	968,761.08	0.04
82	688308	欧科亿	11,527	814,728.36	0.04
83	000932	华菱钢铁	143,100	731,241.00	0.03
84	000733	振华科技	5,500	683,540.00	0.03
85	300687	赛意信息	22,720	662,969.60	0.03
86	300587	天铁股份	32,200	643,034.00	0.03
87	300648	星云股份	10,600	638,014.00	0.03
88	603396	金辰股份	5,000	615,000.00	0.03
89	002405	四维图新	38,300	609,736.00	0.03
90	300168	万达信息	45,000	585,900.00	0.03
91	300496	中科创达	3,900	539,838.00	0.02
92	688233	神工股份	5,980	527,436.00	0.02
93	600388	龙净环保	60,300	519,786.00	0.02
94	688778	厦钨新能	5,075	511,255.50	0.02
95	300218	安利股份	29,500	510,645.00	0.02
96	300300	海峡创新	99,600	473,100.00	0.02
97	688089	嘉必优	7,600	466,944.00	0.02
98	600318	新力金融	36,700	455,080.00	0.02

99	688107	安路科技	7,821	438,679.89	0.02
100	000938	紫光股份	19,100	436,435.00	0.02
101	603901	永创智能	26,900	433,090.00	0.02
102	603809	豪能股份	20,600	423,742.00	0.02
103	000625	长安汽车	26,800	407,092.00	0.02
104	601618	中国中冶	106,200	406,746.00	0.02
105	000711	京蓝科技	143,400	395,784.00	0.02
106	002161	远望谷	77,900	395,732.00	0.02
107	603505	金石资源	10,800	391,284.00	0.02
108	300258	精锻科技	30,400	389,424.00	0.02
109	688167	炬光科技	2,014	355,813.38	0.02
110	600316	洪都航空	8,300	324,198.00	0.01
111	300353	东土科技	28,400	279,740.00	0.01
112	603908	牧高笛	5,500	228,250.00	0.01
113	002233	塔牌集团	20,300	214,774.00	0.01
114	600487	亨通光电	14,200	214,704.00	0.01
115	002946	新乳业	13,200	210,408.00	0.01
116	600066	宇通客车	18,900	208,278.00	0.01
117	603067	振华股份	18,800	207,552.00	0.01
118	688793	倍轻松	1,454	147,915.42	0.01
119	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.00
120	688697	纽威数控	5,837	93,567.11	0.00
121	688511	天微电子	1,490	81,234.80	0.00
122	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.00
123	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
124	688501	青达环保	1,759	37,132.49	0.00
125	688701	卓锦股份	2,340	31,590.00	0.00
126	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.00
127	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
128	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
129	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
130	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
131	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
132	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
133	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
134	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
135	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
136	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
137	300987	川网传媒	301	11,678.80	0.00
138	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
139	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00



140	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
141	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
142	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
143	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
144	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
145	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
146	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
147	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
148	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
149	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
150	300998	宁波方正	201	6,699.33	0.00
151	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
152	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
153	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
154	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
155	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
156	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
157	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
158	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
159	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
160	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
161	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
162	301010	晶雪节能	218	5,227.64	0.00
163	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
164	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
165	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
166	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
167	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
168	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
169	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
170	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
171	600756	浪潮软件	200	2,622.00	0.00
172	002266	浙富控股	300	2,136.00	0.00
173	002064	华峰化学	200	2,088.00	0.00
174	603012	创力集团	300	1,854.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300496	中科创达	43,776,284.70	22.12

2	002833	弘亚数控	41,330,410.69	20.88
3	000933	神火股份	33,430,873.05	16.89
4	002043	兔宝宝	32,957,198.62	16.65
5	000507	珠海港	30,824,624.96	15.57
6	688200	华峰测控	29,326,716.09	14.82
7	002568	百润股份	28,941,794.42	14.62
8	688016	心脉医疗	28,490,716.06	14.39
9	688005	容百科技	28,169,271.59	14.23
10	600531	豫光金铅	28,109,468.80	14.20
11	603599	广信股份	27,625,697.54	13.96
12	600882	妙可蓝多	27,260,408.60	13.77
13	000550	江铃汽车	26,929,510.23	13.60
14	300458	全志科技	26,925,385.41	13.60
15	601827	三峰环境	26,587,308.97	13.43
16	600742	一汽富维	25,983,678.22	13.13
17	603613	国联股份	25,319,397.39	12.79
18	600502	安徽建工	24,741,921.03	12.50
19	002034	旺能环境	24,420,847.37	12.34
20	300696	爱乐达	24,057,694.86	12.15
21	600057	厦门象屿	23,985,077.17	12.12
22	000683	远兴能源	23,666,354.01	11.96
23	600123	兰花科创	23,467,960.00	11.86
24	601677	明泰铝业	23,453,166.43	11.85
25	688368	晶丰明源	22,957,478.69	11.60
26	603566	普莱柯	22,488,506.75	11.36
27	300327	中颖电子	22,484,646.16	11.36
28	603008	喜临门	22,321,053.09	11.28
29	601678	滨化股份	22,149,832.64	11.19
30	002497	雅化集团	22,138,270.00	11.18
31	300379	东方通	21,784,192.35	11.01
32	300639	凯普生物	21,546,840.85	10.89
33	002158	汉钟精机	21,332,675.51	10.78
34	600323	瀚蓝环境	21,032,287.87	10.63
35	688066	航天宏图	20,907,537.13	10.56
36	600325	华发股份	20,671,526.55	10.44
37	600096	云天化	20,445,043.67	10.33
38	300623	捷捷微电	20,329,597.25	10.27
39	300751	迈为股份	20,242,434.26	10.23
40	603026	石大胜华	20,240,953.36	10.23
41	300829	金丹科技	20,229,296.20	10.22
42	300122	智飞生物	20,096,187.00	10.15

43	300785	值得买	19,749,071.00	9.98
44	002135	东南网架	19,696,797.00	9.95
45	000498	山东路桥	19,597,981.75	9.90
46	300171	东富龙	19,301,691.20	9.75
47	002254	泰和新材	19,146,419.91	9.67
48	002611	东方精工	19,018,368.00	9.61
49	603267	鸿远电子	18,758,820.00	9.48
50	688116	天奈科技	18,690,418.72	9.44
51	000725	京东方 A	18,584,651.00	9.39
52	603456	九洲药业	18,453,033.56	9.32
53	000830	鲁西化工	18,341,199.00	9.27
54	002407	多氟多	18,315,414.29	9.25
55	300101	振芯科技	18,171,712.02	9.18
56	601609	金田铜业	17,763,776.00	8.97
57	600063	皖维高新	17,740,949.20	8.96
58	600596	新安股份	17,596,903.50	8.89
59	605111	新洁能	17,434,452.01	8.81
60	688508	芯朋微	17,314,491.37	8.75
61	002245	蔚蓝锂芯	17,183,427.66	8.68
62	601636	旗滨集团	16,667,037.19	8.42
63	300415	伊之密	16,629,251.56	8.40
64	300633	开立医疗	16,615,027.00	8.39
65	603128	华贸物流	16,538,493.85	8.36
66	300548	博创科技	16,356,897.35	8.26
67	603236	移远通信	16,154,341.31	8.16
68	002425	凯撒文化	16,051,862.80	8.11
69	000823	超声电子	15,364,933.62	7.76
70	603713	密尔克卫	15,348,993.80	7.75
71	603039	泛微网络	15,320,686.40	7.74
72	000875	吉电股份	15,216,063.80	7.69
73	688388	嘉元科技	15,197,653.46	7.68
74	000403	派林生物	15,143,019.61	7.65
75	002614	奥佳华	15,104,007.25	7.63
76	688202	美迪西	15,027,886.75	7.59
77	300653	正海生物	14,853,101.87	7.50
78	300659	中孚信息	14,602,854.20	7.38
79	300724	捷佳伟创	14,579,468.00	7.37
80	000733	振华科技	14,178,803.84	7.16
81	300763	锦浪科技	13,983,759.20	7.06
82	002022	科华生物	13,927,425.69	7.04
83	000100	TCL 科技	13,892,256.00	7.02

84	601001	晋控煤业	13,862,667.00	7.00
85	300390	天华超净	13,857,586.55	7.00
86	600110	诺德股份	13,770,514.62	6.96
87	688188	柏楚电子	13,748,201.26	6.95
88	603686	福龙马	13,744,481.48	6.94
89	600565	迪马股份	13,715,362.00	6.93
90	002649	博彦科技	13,703,774.00	6.92
91	002727	一心堂	13,698,178.78	6.92
92	603612	索通发展	13,630,240.60	6.89
93	600577	精达股份	13,561,055.16	6.85
94	300755	华致酒行	13,552,768.00	6.85
95	002895	川恒股份	13,551,273.00	6.85
96	603733	仙鹤股份	13,496,917.44	6.82
97	300373	扬杰科技	13,418,876.72	6.78
98	002293	罗莱生活	13,384,860.48	6.76
99	600366	宁波韵升	13,347,575.20	6.74
100	300348	长亮科技	13,175,995.04	6.66
101	300590	移为通信	13,034,646.54	6.58
102	002042	华孚时尚	12,959,049.00	6.55
103	688516	奥特维	12,918,683.01	6.53
104	002309	中利集团	12,910,849.00	6.52
105	688033	天宜上佳	12,806,435.33	6.47
106	300604	长川科技	12,732,864.70	6.43
107	688298	东方生物	12,595,462.20	6.36
108	603877	太平鸟	12,408,249.69	6.27
109	300119	瑞普生物	12,319,421.00	6.22
110	300748	金力永磁	12,315,454.47	6.22
111	300627	华测导航	12,226,121.29	6.18
112	002677	浙江美大	12,189,408.00	6.16
113	688981	中芯国际	12,017,110.51	6.07
114	002859	洁美科技	11,852,356.41	5.99
115	002709	天赐材料	11,758,852.00	5.94
116	300750	宁德时代	11,735,173.00	5.93
117	600318	新力金融	11,696,356.98	5.91
118	000810	创维数字	11,676,988.73	5.90
119	603337	杰克股份	11,674,915.08	5.90
120	603363	傲农生物	11,447,189.68	5.78
121	002726	龙大美食	11,337,392.50	5.73
122	600483	福能股份	11,306,432.13	5.71
123	300775	三角防务	11,266,148.48	5.69
124	300441	鲍斯股份	11,151,633.20	5.63

125	300363	博腾股份	10,874,776.60	5.49
126	002978	安宁股份	10,860,682.00	5.49
127	600864	哈投股份	10,801,694.00	5.46
128	600499	科达制造	10,751,545.98	5.43
129	002145	中核钛白	10,731,649.00	5.42
130	601898	中煤能源	10,642,331.11	5.38
131	600008	首创环保	10,612,968.70	5.36
132	000921	海信家电	10,553,170.72	5.33
133	601311	骆驼股份	10,466,958.21	5.29
134	002918	蒙娜丽莎	10,456,623.72	5.28
135	300223	北京君正	10,401,337.00	5.25
136	000657	中钨高新	10,380,138.20	5.24
137	600496	精工钢构	10,228,021.00	5.17
138	300196	长海股份	10,091,961.00	5.10
139	688366	昊海生科	10,063,600.99	5.08
140	688122	西部超导	10,050,426.47	5.08
141	000612	焦作万方	10,009,194.20	5.06
142	002041	登海种业	9,978,797.41	5.04
143	300073	当升科技	9,908,051.88	5.01
144	300034	钢研高纳	9,844,147.00	4.97
145	300896	爱美客	9,827,072.20	4.96
146	002129	中环股份	9,562,473.33	4.83
147	603678	火炬电子	9,560,118.03	4.83
148	600894	广日股份	9,543,350.00	4.82
149	300502	新易盛	9,423,634.20	4.76
150	002240	盛新锂能	9,396,985.41	4.75
151	600711	盛屯矿业	9,354,005.13	4.73
152	002402	和而泰	9,088,853.00	4.59
153	002312	川发龙蟒	9,072,000.00	4.58
154	605336	帅丰电器	8,995,510.36	4.54
155	000423	东阿阿胶	8,917,278.00	4.50
156	603180	金牌厨柜	8,882,321.48	4.49
157	600141	兴发集团	8,809,266.00	4.45
158	605006	山东玻纤	8,610,808.00	4.35
159	002139	拓邦股份	8,555,936.50	4.32
160	603801	志邦家居	8,552,602.47	4.32
161	300568	星源材质	8,519,379.90	4.30
162	600480	凌云股份	8,500,655.00	4.29
163	600668	尖峰集团	8,499,943.00	4.29
164	002756	永兴材料	8,443,200.00	4.27
165	000799	酒鬼酒	8,370,712.00	4.23

166	002850	科达利	8,318,718.00	4.20
167	000425	徐工机械	8,280,022.38	4.18
168	300638	广和通	8,260,697.49	4.17
169	300740	水羊股份	8,224,216.90	4.15
170	688039	当虹科技	8,157,061.05	4.12
171	300397	天和防务	8,135,883.24	4.11
172	300031	宝通科技	8,051,165.52	4.07
173	002163	海南发展	7,921,114.12	4.00
174	002531	天顺风能	7,866,729.00	3.97
175	300364	中文在线	7,702,537.31	3.89
176	300726	宏达电子	7,524,946.00	3.80
177	688301	奕瑞科技	7,469,116.73	3.77
178	603105	芯能科技	7,381,698.51	3.73
179	601515	东风股份	7,369,199.40	3.72
180	600338	西藏珠峰	7,336,800.00	3.71
181	600581	八一钢铁	7,276,901.00	3.68
182	601375	中原证券	7,188,396.00	3.63
183	600846	同济科技	7,160,657.00	3.62
184	002064	华峰化学	7,113,498.10	3.59
185	300662	科锐国际	7,105,242.00	3.59
186	002322	理工环科	7,004,993.34	3.54
187	000157	中联重科	6,954,729.37	3.51
188	603606	东方电缆	6,926,664.75	3.50
189	300725	药石科技	6,779,406.45	3.42
190	300232	洲明科技	6,752,429.93	3.41
191	300252	金信诺	6,743,612.00	3.41
192	600740	山西焦化	6,728,366.11	3.40
193	600603	广汇物流	6,722,681.46	3.40
194	300450	先导智能	6,721,221.00	3.40
195	688085	三友医疗	6,593,303.13	3.33
196	688095	福昕软件	6,534,139.49	3.30
197	300593	新雷能	6,520,113.00	3.29
198	603959	百利科技	6,518,632.00	3.29
199	600438	通威股份	6,495,614.59	3.28
200	300102	乾照光电	6,488,538.00	3.28
201	601872	招商轮船	6,425,748.00	3.25
202	601958	金铂股份	6,403,109.00	3.23
203	688139	海尔生物	6,334,344.18	3.20
204	300114	中航电测	6,327,250.28	3.20
205	000639	西王食品	6,299,339.10	3.18
206	000671	阳光城	6,292,954.00	3.18

207	300772	运达股份	6,285,419.00	3.18
208	002156	通富微电	6,268,433.77	3.17
209	600100	同方股份	6,239,799.28	3.15
210	300059	东方财富	6,234,741.42	3.15
211	600089	特变电工	6,214,423.89	3.14
212	600584	长电科技	6,098,584.00	3.08
213	300573	兴齐眼药	6,094,036.00	3.08
214	000829	天音控股	6,048,000.00	3.06
215	600428	中远海特	6,039,728.00	3.05
216	601519	大智慧	6,035,569.00	3.05
217	600331	宏达股份	5,967,845.00	3.01
218	002244	滨江集团	5,920,602.00	2.99
219	600426	华鲁恒升	5,877,371.50	2.97
220	002106	莱宝高科	5,873,948.87	2.97
221	603508	思维列控	5,865,242.60	2.96
222	002027	分众传媒	5,861,078.00	2.96
223	601598	中国外运	5,858,570.00	2.96
224	688357	建龙微纳	5,850,537.23	2.96
225	600160	巨化股份	5,811,103.00	2.94
226	300037	新宙邦	5,748,067.07	2.90
227	600108	亚盛集团	5,721,645.00	2.89
228	603279	景津装备	5,689,225.82	2.87
229	300476	胜宏科技	5,688,911.30	2.87
230	300825	阿尔特	5,629,861.00	2.84
231	605338	巴比食品	5,628,230.40	2.84
232	600461	洪城环境	5,622,793.00	2.84
233	688050	爱博医疗	5,576,587.57	2.82
234	000301	东方盛虹	5,557,640.00	2.81
235	603520	司太立	5,538,516.84	2.80
236	000543	皖能电力	5,531,451.00	2.79
237	688399	硕世生物	5,513,990.13	2.79
238	000887	中鼎股份	5,472,500.00	2.76
239	002597	金禾实业	5,441,174.00	2.75
240	600176	中国巨石	5,421,638.16	2.74
241	605358	立昂微	5,414,538.00	2.74
242	000807	云铝股份	5,392,525.90	2.72
243	002185	华天科技	5,345,850.00	2.70
244	300680	隆盛科技	5,250,405.00	2.65
245	002645	华宏科技	5,235,858.38	2.65
246	603345	安井食品	5,228,127.30	2.64
247	600169	太原重工	5,169,509.00	2.61

248	300209	天泽信息	5,156,738.61	2.61
249	002258	利尔化学	5,151,269.00	2.60
250	300398	飞凯材料	5,141,721.40	2.60
251	002612	朗姿股份	5,138,799.00	2.60
252	002243	力合科创	5,121,726.00	2.59
253	300083	创世纪	5,118,219.00	2.59
254	300529	健帆生物	5,095,872.00	2.57
255	603898	好莱客	5,083,110.14	2.57
256	300792	壹网壹创	5,063,025.00	2.56
257	688011	新光光电	5,029,549.74	2.54
258	603208	江山欧派	5,014,036.54	2.53
259	000915	华特达因	4,997,448.31	2.52
260	002449	国星光电	4,988,302.00	2.52
261	002182	云海金属	4,903,085.00	2.48
262	002539	云图控股	4,865,053.00	2.46
263	600966	博汇纸业	4,804,813.72	2.43
264	002541	鸿路钢构	4,773,042.00	2.41
265	002624	完美世界	4,765,612.00	2.41
266	600746	江苏索普	4,747,729.00	2.40
267	600391	航发科技	4,743,328.00	2.40
268	603222	济民医疗	4,738,621.00	2.39
269	600456	宝钛股份	4,730,750.30	2.39
270	605008	长鸿高科	4,699,718.80	2.37
271	603185	上机数控	4,654,335.00	2.35
272	300012	华测检测	4,652,707.00	2.35
273	600845	宝信软件	4,605,506.40	2.33
274	000917	电广传媒	4,523,116.00	2.29
275	300267	尔康制药	4,520,545.00	2.28
276	300613	富瀚微	4,459,336.20	2.25
277	600986	浙文互联	4,453,722.80	2.25
278	600797	浙大网新	4,357,336.30	2.20
279	688518	联赢激光	4,334,409.15	2.19
280	300672	国科微	4,332,839.00	2.19
281	300019	硅宝科技	4,288,905.00	2.17
282	600360	华微电子	4,279,651.00	2.16
283	002648	卫星化学	4,277,518.00	2.16
284	300382	斯莱克	4,269,645.20	2.16
285	002130	沃尔核材	4,266,479.00	2.16
286	002017	东信和平	4,260,092.72	2.15
287	300477	合纵科技	4,249,045.94	2.15
288	601688	华泰证券	4,243,605.00	2.14



289	002400	省广集团	4,220,950.00	2.13
290	600195	中牧股份	4,202,541.00	2.12
291	688166	博瑞医药	4,180,119.17	2.11
292	002777	久远银海	4,164,295.93	2.10
293	300773	拉卡拉	4,138,687.59	2.09
294	605168	三人行	4,132,337.00	2.09
295	601965	中国汽研	4,108,709.00	2.08
296	603896	寿仙谷	4,105,484.00	2.07
297	002383	合众思壮	4,082,648.25	2.06
298	601995	中金公司	4,063,456.24	2.05
299	300624	万兴科技	4,054,761.12	2.05
300	000059	华锦股份	4,044,867.88	2.04
301	300316	晶盛机电	4,014,352.00	2.03
302	600308	华泰股份	4,014,181.00	2.03
303	688099	晶晨股份	4,002,910.11	2.02
304	000936	华西股份	3,992,498.00	2.02

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300496	中科创达	48,781,632.56	24.64
2	688005	容百科技	28,457,969.42	14.38
3	601827	三峰环境	25,697,332.00	12.98
4	002568	百润股份	22,965,332.80	11.60
5	600742	一汽富维	21,678,061.12	10.95
6	300751	迈为股份	21,285,662.05	10.75
7	603267	鸿远电子	20,230,033.00	10.22
8	000683	远兴能源	20,094,584.11	10.15
9	603613	国联股份	19,493,050.33	9.85
10	002833	弘亚数控	18,855,286.08	9.53
11	600318	新力金融	18,640,422.48	9.42
12	601677	明泰铝业	18,510,160.00	9.35
13	000733	振华科技	18,323,376.16	9.26
14	603456	九洲药业	17,708,998.96	8.95
15	000550	江铃汽车	17,090,808.00	8.63
16	300122	智飞生物	16,996,147.86	8.59
17	300373	扬杰科技	16,369,475.44	8.27
18	300458	全志科技	16,258,319.73	8.21
19	600531	豫光金铅	16,134,650.00	8.15

20	000823	超声电子	16,034,774.00	8.10
21	000725	京东方 A	15,824,226.00	7.99
22	600063	皖维高新	15,625,980.00	7.89
23	000933	神火股份	15,392,799.15	7.78
24	002043	兔宝宝	15,313,554.00	7.74
25	300785	值得买	15,205,443.70	7.68
26	000498	山东路桥	15,050,514.00	7.60
27	300696	爱乐达	14,919,612.40	7.54
28	600325	华发股份	14,792,346.00	7.47
29	601678	滨化股份	14,716,304.00	7.43
30	000507	珠海港	14,597,319.98	7.37
31	300639	凯普生物	14,532,321.96	7.34
32	603686	福龙马	14,263,131.00	7.21
33	002158	汉钟精机	14,167,300.00	7.16
34	002859	洁美科技	14,041,448.40	7.09
35	600483	福能股份	13,967,428.99	7.06
36	603599	广信股份	13,921,051.49	7.03
37	002245	蔚蓝锂芯	13,885,461.00	7.01
38	002135	东南网架	13,778,032.00	6.96
39	300763	锦浪科技	13,701,114.40	6.92
40	603612	索通发展	13,629,754.20	6.89
41	600057	厦门象屿	13,331,754.20	6.74
42	002895	川恒股份	13,151,695.11	6.64
43	002649	博彦科技	12,950,682.00	6.54
44	002726	龙大美食	12,872,516.79	6.50
45	603733	仙鹤股份	12,804,532.00	6.47
46	300724	捷佳伟创	12,649,400.00	6.39
47	601609	金田铜业	12,526,332.28	6.33
48	300031	宝通科技	12,415,330.00	6.27
49	600096	云天化	12,295,798.00	6.21
50	000100	TCL 科技	12,190,810.00	6.16
51	603713	密尔克卫	12,135,446.00	6.13
52	000810	创维数字	12,090,283.00	6.11
53	601636	旗滨集团	12,080,397.79	6.10
54	300119	瑞普生物	12,014,175.00	6.07
55	688066	航天宏图	11,883,412.06	6.00
56	600366	宁波韵升	11,869,355.17	6.00
57	603606	东方电缆	11,752,699.60	5.94
58	688981	中芯国际	11,585,886.47	5.85
59	603026	石大胜华	11,524,678.56	5.82
60	002139	拓邦股份	11,518,735.25	5.82

61	002425	凯撒文化	11,475,965.82	5.80
62	300348	长亮科技	11,467,206.51	5.79
63	300750	宁德时代	11,318,608.00	5.72
64	002497	雅化集团	11,278,072.12	5.70
65	002531	天顺风能	11,170,534.00	5.64
66	601001	晋控煤业	10,815,886.00	5.46
67	603363	傲农生物	10,768,667.83	5.44
68	605111	新洁能	10,701,631.00	5.41
69	300633	开立医疗	10,692,557.74	5.40
70	688188	柏楚电子	10,661,747.89	5.39
71	603008	喜临门	10,502,554.00	5.31
72	600882	妙可蓝多	10,492,659.00	5.30
73	002034	旺能环境	10,370,460.46	5.24
74	002614	奥佳华	10,367,961.00	5.24
75	300415	伊之密	10,335,642.00	5.22
76	300623	捷捷微电	10,191,572.46	5.15
77	688016	心脉医疗	10,109,735.39	5.11
78	600123	兰花科创	10,088,045.00	5.10
79	603337	杰克股份	9,940,743.78	5.02
80	300441	鲍斯股份	9,856,837.52	4.98
81	300755	华致酒行	9,666,463.00	4.88
82	300171	东富龙	9,362,963.00	4.73
83	000157	中联重科	9,357,224.00	4.73
84	600496	精工钢构	9,057,465.00	4.58
85	600668	尖峰集团	8,950,100.05	4.52
86	002918	蒙娜丽莎	8,822,485.13	4.46
87	603128	华贸物流	8,755,792.96	4.42
88	605006	山东玻纤	8,709,898.00	4.40
89	300748	金力永磁	8,694,174.40	4.39
90	600502	安徽建工	8,678,506.00	4.38
91	603185	上机数控	8,652,864.40	4.37
92	603566	普莱柯	8,592,375.81	4.34
93	603180	金牌厨柜	8,557,925.56	4.32
94	300627	华测导航	8,524,086.00	4.31
95	002022	科华生物	8,419,404.60	4.25
96	300363	博腾股份	8,300,790.00	4.19
97	000830	鲁西化工	8,231,351.34	4.16
98	601898	中煤能源	8,104,014.00	4.09
99	002727	一心堂	8,061,310.00	4.07
100	300327	中颖电子	7,996,133.12	4.04
101	002402	和而泰	7,935,043.00	4.01

102	000875	吉电股份	7,865,436.00	3.97
103	601311	骆驼股份	7,781,140.00	3.93
104	603520	司太立	7,395,450.00	3.74
105	603801	志邦家居	7,300,457.82	3.69
106	300364	中文在线	7,276,868.57	3.68
107	300450	先导智能	7,275,378.00	3.68
108	600565	迪马股份	7,239,988.00	3.66
109	300502	新易盛	7,202,542.06	3.64
110	000425	徐工机械	7,184,214.00	3.63
111	002322	理工环科	7,063,529.00	3.57
112	002163	海南发展	7,016,034.00	3.54
113	600323	瀚蓝环境	7,001,745.00	3.54
114	688039	当虹科技	6,928,272.41	3.50
115	000799	酒鬼酒	6,889,592.00	3.48
116	600846	同济科技	6,864,068.00	3.47
117	600490	鹏欣资源	6,792,850.82	3.43
118	688200	华峰测控	6,777,232.50	3.42
119	300725	药石科技	6,724,775.80	3.40
120	002611	东方精工	6,621,896.00	3.35
121	600461	洪城环境	6,597,511.07	3.33
122	000657	中钨高新	6,549,629.00	3.31
123	300037	新宙邦	6,444,510.56	3.26
124	600577	精达股份	6,441,122.00	3.25
125	688139	海尔生物	6,405,436.08	3.24
126	300114	中航电测	6,404,802.00	3.24
127	000543	皖能电力	6,341,555.37	3.20
128	688366	昊海生科	6,279,104.10	3.17
129	300775	三角防务	6,276,470.00	3.17
130	600740	山西焦化	6,274,512.10	3.17
131	000612	焦作万方	6,264,163.00	3.16
132	002645	华宏科技	6,263,747.00	3.16
133	002709	天赐材料	6,255,847.70	3.16
134	300223	北京君正	6,216,599.00	3.14
135	600176	中国巨石	6,195,974.00	3.13
136	600845	宝信软件	6,189,179.00	3.13
137	002145	中核钛白	6,187,312.00	3.13
138	600603	广汇物流	6,075,430.00	3.07
139	002254	泰和新材	6,057,565.00	3.06
140	600456	宝钛股份	5,922,037.00	2.99
141	601519	大智慧	5,904,296.00	2.98
142	002064	华峰化学	5,890,191.00	2.98

143	002027	分众传媒	5,853,926.00	2.96
144	688116	天奈科技	5,834,813.99	2.95
145	002182	云海金属	5,806,627.00	2.93
146	300653	正海生物	5,792,182.84	2.93
147	603508	思维列控	5,789,904.00	2.92
148	300604	长川科技	5,764,472.60	2.91
149	600584	长电科技	5,756,770.67	2.91
150	002015	协鑫能科	5,602,247.00	2.83
151	000423	东阿阿胶	5,451,361.00	2.75
152	002185	华天科技	5,429,372.31	2.74
153	002243	力合科创	5,421,218.30	2.74
154	300398	飞凯材料	5,416,468.00	2.74
155	601126	四方股份	5,415,192.00	2.74
156	603393	新天然气	5,350,193.80	2.70
157	002017	东信和平	5,304,637.00	2.68
158	603345	安井食品	5,273,389.00	2.66
159	603127	昭衍新药	5,229,790.50	2.64
160	600141	兴发集团	5,207,824.92	2.63
161	000301	东方盛虹	5,170,330.00	2.61
162	600426	华鲁恒升	5,169,287.00	2.61
163	300209	天泽信息	5,031,865.00	2.54
164	600169	太原重工	5,026,391.00	2.54
165	002978	安宁股份	5,022,734.00	2.54
166	300019	硅宝科技	4,994,543.32	2.52
167	300379	东方通	4,977,696.00	2.51
168	300059	东方财富	4,957,528.91	2.50
169	300102	乾照光电	4,936,919.00	2.49
170	002258	利尔化学	4,877,847.00	2.46
171	603898	好莱客	4,791,298.55	2.42
172	002541	鸿路钢构	4,756,488.00	2.40
173	002241	歌尔股份	4,747,655.00	2.40
174	605336	帅丰电器	4,746,730.00	2.40
175	002383	合众思壮	4,695,599.00	2.37
176	300624	万兴科技	4,636,804.94	2.34
177	605008	长鸿高科	4,604,382.40	2.33
178	688099	晶晨股份	4,564,669.86	2.31
179	000807	云铝股份	4,513,277.63	2.28
180	300267	尔康制药	4,469,000.00	2.26
181	300829	金丹科技	4,400,146.31	2.22
182	300773	拉卡拉	4,390,517.00	2.22
183	002156	通富微电	4,390,414.00	2.22

184	688368	晶丰明源	4,381,600.41	2.21
185	601058	赛轮轮胎	4,359,699.99	2.20
186	688298	东方生物	4,353,945.06	2.20
187	688518	联赢激光	4,325,651.58	2.19
188	688388	嘉元科技	4,316,667.29	2.18
189	300659	中孚信息	4,307,492.00	2.18
190	300101	振芯科技	4,296,508.85	2.17
191	600008	首创环保	4,262,029.00	2.15
192	603877	太平鸟	4,248,445.00	2.15
193	603208	江山欧派	4,234,527.00	2.14
194	600746	江苏索普	4,231,550.00	2.14
195	002612	朗姿股份	4,158,826.00	2.10
196	002100	天康生物	4,071,324.00	2.06
197	600966	博汇纸业	4,053,509.00	2.05
198	300394	天孚通信	4,049,866.80	2.05
199	600756	浪潮软件	4,046,475.00	2.04

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,154,643,307.70
卖出股票收入（成交）总额	2,505,453,789.40

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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）	2,215,545.40	0.10
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,215,545.40	0.10

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	20,700	2,070,000.00	0.10
2	113635	升21转债	910	127,400.00	0.01
3	113633	科沃转债	140	18,145.40	0.00

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 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	713,948.29
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	57,829.74
5	应收申购款	2,140,451.29
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,912,229.32

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	603599	广信股份	2,152,800.00	0.10	转融通流通受限
2	000933	神火股份	2,077,974.00	0.10	转融通流通受限

#### 8.12.5.2 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	000887	中鼎股份	1,051,242.00	0.05	转融通流通受限
---	--------	------	--------------	------	---------

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国中证 1000 指数增强 A	72,332	11,273.65	450,496,310.15	55.25	364,949,031.26	44.75
富国中证 1000 指数增强 C	4,049	50,131.35	186,804,291.56	92.03	16,177,555.81	7.97
合计	76,381	13,333.51	637,300,601.71	62.58	381,126,587.07	37.42

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

富国中证 1000 指数增强 A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	华宝证券股份有限公司	2,585,088.00	9.98
2	北京新湖巨源投资管理有限公司 —新湖巨源泓湖百世风险平衡 1 号 私募证券投资基金	1,315,640.00	5.08
3	熊振国	573,600.00	2.22
4	陈敏	528,030.00	2.04
5	张秀宽	500,000.00	1.93
6	付小珍	488,448.00	1.89
7	刘树航	411,490.00	1.59
8	上海恒盈投资管理有限公司—恒 盈大钱一号私募证券投资基金	400,055.00	1.54
9	李群	400,023.00	1.54
10	张巍	322,607.00	1.25

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
----	------	-----------	-------------

基金管理公司所有从业人员持有本基金	富国中证1000指数增强A	168,120.33	0.0206
	富国中证1000指数增强C	11,464.29	0.0056
	合计	179,584.62	0.0176

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

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	富国中证1000指数增强A	富国中证1000指数增强C
基金合同生效日(2018年05月31日)基金份额总额	512,114,043.76	—
报告期期初基金份额总额	118,156,134.78	—
本报告期基金总申购份额	1,635,127,499.97	636,437,956.26
减：本报告期基金总赎回份额	937,838,293.34	433,456,108.89
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	815,445,341.41	202,981,847.37

注：本基金自2021年8月19日起增加C类份额，相关数据按实际存续期计算。

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，依据《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》、《富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）基

---

金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）开展转融通证券出借业务并修改基金合同有关事项的议案》。在基金托管人的监督下，本基金管理人对本次大会表决进行了计票，上海市通力律师事务所对计票过程进行了见证，上海市东方公证处对计票过程及结果进行了公证。根据 2021 年 11 月 1 日的计票结果，本次会议议案获得通过，本次大会决议自 2021 年 11 月 1 日起生效，修订后的《富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》自 2021 年 11 月 2 日生效。具体可参见基金管理人于 2021 年 11 月 2 日发布的《富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》及相关提示性公告。

### **11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

2021 年 8 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

本报告期本基金管理人无重大人事变动。

### **11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### **11.4 基金投资策略的改变**

本报告期本基金投资策略无改变。

### **11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为 3 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 19 年。

### **11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	2	198,036,054.41	2.98	—	—	—	—	—	—	180,471.78	2.98	—
德邦证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
第一创业证券	2	77,124,993.66	1.16	31,758.04	0.76	—	—	—	—	70,279.62	1.16	—
东北证券	2	591,624,862.94	8.90	8,502.65	0.20	—	—	—	—	539,144.37	8.90	—
东方证券	2	781,633,525.70	11.76	1,189,329.17	28.53	—	—	—	—	712,297.88	11.76	—
国海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国联证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	429,731,287.25	6.47	2,128,671.22	51.06	—	—	—	—	391,613.08	6.47	—
华菁证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
汇丰前海	2	78,679,211.40	1.18	—	—	—	—	—	—	71,702.11	1.18	—
开源证券	2	689,340,193.48	10.37	181,829.67	4.36	—	—	—	—	628,193.92	10.37	—
申万宏源	4	1,139,369,318.15	17.15	379,905.26	9.11	—	—	—	—	1,038,965.14	17.15	—
兴业证券	2	1,061,564,606.99	15.97	223,911.36	5.37	9,000,000.00	47.37	—	—	967,383.92	15.97	—
浙商证券	1	710,850,477.19	10.70	24,892.20	0.60	—	—	—	—	647,800.43	10.70	—

中泰证券	1	583,607,805.58	8.78	—	—	10,000,000.00	52.63	—	—	531,832.99	8.78	—
中信建投	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	2	303,742,524.51	4.57	—	—	—	—	—	—	276,801.65	4.57	—

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。本报告期本基金新增券商交易单元：德邦证券（50404），中信建投（50588、012789）。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下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01月21日
2	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01月30日
3	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02月03日
4	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
5	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
6	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	规定披露媒介	2021年03月30日
7	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年04月14日
8	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年04月20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05月06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05月10日
11	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年07月02日
12	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年08月31日
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09月09日
14	关于富国中证 1000 指数增强型证券投资	规定披露媒介	2021年09月29日

	资基金（LOF）暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告		
15	富国基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告	规定披露媒介	2021 年 09 月 30 日
16	关于富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）召开基金份额持有人大会期间停复牌的公告	规定披露媒介	2021 年 09 月 30 日
17	富国基金管理有限公司关于召开富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的第一次提示性公告	规定披露媒介	2021 年 10 月 08 日
18	富国基金管理有限公司关于召开富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的第二次提示性公告	规定披露媒介	2021 年 10 月 11 日
19	富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	规定披露媒介	2021 年 11 月 02 日
20	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所上市股票及相关风险提示的公告	规定披露媒介	2021 年 11 月 26 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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	2021-01-01 至 2021-02-25;2021-04-27 至 2021-05-05	24,771,271.87	171,569,140.40	136,259,125.83	60,081,286.44	5.90%
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>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，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，对旗下部分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。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。

二、本报告期内，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》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 8 月 19 日起，增加本基金 C 类基金份额，并对基金合同及托管协议的相应条款进行修订。具体可参见基金管理人于 2021 年 8 月 17 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》及修改后的基金合同、



托管协议。

三、本报告期内，根据深圳证券交易所《关于深圳证券交易所基金增加扩位证券简称有关事项的通知（深证上[2021]764号）》，经向深交所申请，基金管理人自2021年8月23日起新增本基金扩位证券简称“1000增强LOF”。具体可参见基金管理人于2021年8月21日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告》。

四、本报告期内，依据《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》、《富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）开展转融通证券出借业务并修改基金合同有关事项的议案》。在基金托管人的监督下，本基金管理人对本次大会表决进行了计票，上海市通力律师事务所对计票过程进行了见证，上海市东方公证处对计票过程及结果进行了公证。根据2021年11月1日的计票结果，本次会议议案获得通过，本次大会决议自2021年11月1日起生效，修订后的《富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》自2021年11月2日生效。具体可参见基金管理人于2021年11月2日发布的《富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》及相关提示性公告。

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

### § 13 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国	中国（上海）自由贸易试验区	投资者对本报告书如有疑问，

<p>中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的文件</p> <p>2、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同</p> <p>3、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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>世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层</p>	<p>可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688 (全国统一, 免长途话费) 公司网址：<a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a>。</p>
--	------------------------------------	---