

富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金  
二 0 二 0 年年度报告

2020 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： 中国工商银行股份有限公司

送出日期： 2021 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2020 年 5 月 13 日（基金合同生效日）起至 2020 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	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.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核报告.....	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5	托管人报告.....	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	15
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.....	15
§6	审计报告.....	15
6.1	审计报告基本信息.....	15
6.2	审计报告的基本内容.....	15
§7	年度财务报表.....	18
7.1	资产负债表.....	18
7.2	利润表.....	19
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4	报表附注.....	21
§8	投资组合报告.....	46
8.1	期末基金资产组合情况.....	46
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	48
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	68
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69

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 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	70
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	70
8.12	投资组合报告附注 .....	71
§9	基金份额持有人信息 .....	73
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	73
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	73
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	74
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 .....	74
§10	开放式基金份额变动 .....	74
§11	重大事件揭示 .....	74
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	74
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 .....	74
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	74
11.4	基金投资策略的改变 .....	74
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	75
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 .....	75
11.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	76
11.8	其他重大事件 .....	78
§12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	78
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 .....	78
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	79
§13	备查文件目录 .....	79

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
场内简称	800ETF 基金
基金简称	富国中证 800ETF
基金主代码	515820
交易代码	515820
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 05 月 13 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	122, 526, 092. 00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 5 月 29 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	郭明
	联系电话	021-20361818	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95588
传真		021-20361616	010—66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验	北京市西城区复兴门内大

	区世纪大道 1196 号世纪汇 办公楼二座 27-30 层	街 55 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 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	裴长江	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披 露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正 文的管理人互联网网 址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地 点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大 街 55 号

## 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 5 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	7,810,058.54
本期利润	20,564,960.45
加权平均基金份额本期利润	0.2036
本期加权平均净值利润率	17.48%
本期基金份额净值增长率	30.76%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	21,566,685.26

期末可供分配基金份额利润	0.1760
期末基金资产净值	160,220,994.73
期末基金份额净值	1.3076
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2020年12月31日</b>
基金份额累计净值增长率	30.76%

注：本基金于2020年5月13日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

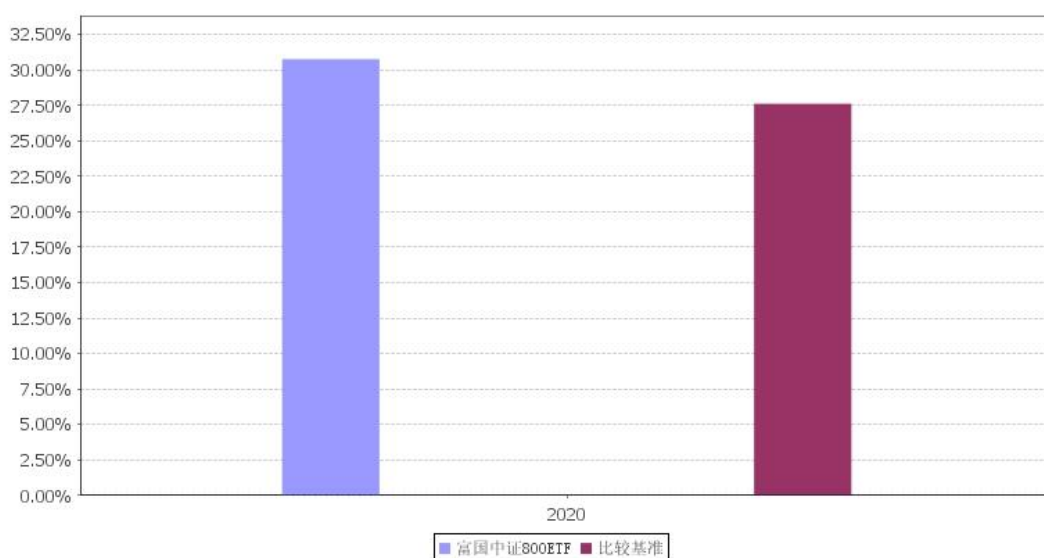
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	11.89%	1.00%	11.00%	1.01%	0.89%	-0.01%
过去六个月	22.03%	1.29%	21.02%	1.35%	1.01%	-0.06%
自基金合同生效起至今	30.76%	1.19%	27.62%	1.27%	3.14%	-0.08%

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



注：1、截止日期为2020年12月31日。  
 2、本基金于2020年5月13日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月，从2020年5月13日起至2020年11月12日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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



注：2020年按实际存续期计算。



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金 2020 年 5 月 13 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日未进行利润分配

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至 2020 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等 187 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		
王乐乐	本基金基金经理	2020-05-13	—	10.6	博士，自 2010 年 6 月至 2011 年 11 月在上海证券有限责任公司任研究员；自 2011 年 11 月至 2012 年 6 月在华泰联合证券有限责任公司任研究员；自 2012 年 7 月至 2015 年 5 月在华泰证券股份有限公司历任研究员、创新规划团队负责人；自 2015 年 5 月加入富国

				<p>基金管理有限公司，2015年8月至2020年1月任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理，2016年10月至2018年7月任富国全球债券证券投资基金基金经理，2017年10月至2020年1月任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，2017年11月至2020年1月任富国中证工业4.0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，2018年11月至2020年5月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018年12月至2020年5月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理，2019年3月至2020年8月任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年6月至2020年8月任富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年7月起任富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年9月起任富国中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年10月起任富国中证消费50交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年11月至2020年12月任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年11月起任富国中证科技50策略交易型开放式指数证券投资基金、富国中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理，2019年12月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理，2020年1月起任富国中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020年2月起任富国中证科</p>
--	--	--	--	---

					技 50 策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020 年 3 月起任富国中证医药 50 交易型开放式指数证券投资基金、富国中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2020 年 5 月起任富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 7 月起任富国上海金交易型开放式证券投资基金、富国上海金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理；兼任量化投资部 ETF 投资总监。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遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

### **4.4 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**

2020年初，受全球疫情加速蔓延的影响，全球资本市场恐慌性下跌，出现流动性枯竭的情况，多国股市因跌幅过大而迎来熔断，原油单日跌幅高达30%以上。3月下旬，各国政府及央行加大救市力度，其中美联储开启不设上限的量化宽松，大幅缓解了市场的流动性压力，市场恐慌情绪得到有效缓解，以内需为主的消费、医药等板块率先反弹。7月初，央行下调再贷款、再贴现利率0.25个百分点，再度释放宽松信号，市场风险偏好明显提升，同时境外资金大幅流入，带动A股出现大幅上涨。同时，市场风格发生扩散，前期涨幅较少的大金融及周期股迎来补涨，带动上证综指接连突破3000至3400点等整数关口。9月起，随着美股因美国大选存在不确定性而出现大幅回调，A股也迎来调整，其中前期涨幅较大的科技、医药、军工等板块跌幅居前。11月初，随着美国大选逐步落地，不确定性逐步消失，同时伴随着疫苗进展出现积极信号，市场风险偏好大幅提升，全球股市均出现较大幅度的上涨。12月下旬起，中央经济工作会议召开，会议要求宏观政策要保持连续性、稳定性、可持续性，打消了市场前期对于货币政策大幅收紧的担忧，同时随着美国新一轮财政刺激政策落地，市场风险偏好再度提升，主要指数创出本轮反弹新高。总体来看，2020年上证综指上涨13.87%，沪深300上涨27.21%，创业板指上涨64.96%，中证500指数上涨20.87%。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.3076 元；份额累计净值为 1.3076 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 30.76%，同期业绩比较基准收益率为 27.62%

#### 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 2021 年，随着美国新一轮财政刺激政策通过，美元有望维持弱势，全球流动性依旧宽松。国内公募基金赚钱效应的提升，使得资金通过新发基金加速流入股票市场，有望在一定程度上对冲国内货币政策边际收紧带来的流动性冲击。随着经济复苏、盈利改善的趋势加强，市场仍存在着结构性机会。从结构上看，过去数年，机构抱团的核心资产因成长确定性获得较高的估值溢价，导致估值风格明显跑输成长风格。随着疫情带来的不确定性消除，宏观流动性在边际收紧，具有一定成长性的低估值板块将有望迎来阶段性行情。

#### 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，2020 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，2020 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

2020 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

2020 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，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

2020 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，持续开展新员工合规培训、内幕交易案例分享以及反洗钱专题培训，针对性的就民法典、新证券法、创业板新政、信息披露管理办法、基金销售新规等法律法规进行专项培训，并结合业务部门实际需求，组织专户以券出资业务、未公开信息管控、非交易过户规则、投顾业务、公募 REITs 业务等实务类培训。

##### （五）深入专项审计，抓紧第三道防线

2020 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，2020 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

2020 年公司制定和采取了一系列措施推动反洗钱工作全面铺开，于公司官网、微信公众号及办公场所开展形式多样的反洗钱宣传活动。为进一步提升反洗钱管理效能，对反洗钱系统进行全面改造，持续强化反洗钱系统的支持力度。

（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，对员工日常行为开展合规监测。2020 年通过新进员工承诺函签署及一对一宣讲、员工基本信息维护完整性检查、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，使申报管理工作常态化。

#### **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**

1、自 2020 年 11 月 10 日至本报告期末（2020 年 12 月 31 日），本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2、自 2020 年 6 月 9 日至 2020 年 8 月 18 日，本基金存在资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况。

## **§ 5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，本基金托管人在对富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基

金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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(2021)审字第 60467606_B163 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 800 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表、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 800 交易型开放式指数证券投资基金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 800 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值

	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 800 交易型开放式指数证券投资基金，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 800 交易型开放式指数证券投资基金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。</p> <p>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 800 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，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 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存



	<p>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 800 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间</p>
--	---

	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	2021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800交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 (2020年12月31日)
<b>资产：</b>	
银行存款	1,483,583.21
结算备付金	14,568.00
存出保证金	35,478.45
交易性金融资产	158,869,079.75
其中：股票投资	158,740,257.25
基金投资	—
债券投资	128,822.50
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	26,916.92
应收利息	179.71
应收股利	—
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	160,429,806.04
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 (2020年12月31日)</b>
<b>负债：</b>	
短期借款	—
交易性金融负债	—

衍生金融负债	—
卖出回购金融资产款	—
应付证券清算款	—
应付赎回款	—
应付管理人报酬	19,336.77
应付托管费	6,445.59
应付销售服务费	—
应付交易费用	35,528.75
应交税费	0.20
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	147,500.00
负债合计	208,811.31
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	122,526,092.00
未分配利润	37,694,902.73
所有者权益合计	160,220,994.73
负债和所有者权益总计	160,429,806.04

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3076 元，基金份额总额 122,526,092.00 份。本基金合同生效日 2020 年 05 月 13 日。

## 7.2 利润表

会计主体：富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 05 月 13 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	21,655,775.86
1. 利息收入	114,094.19
其中：存款利息收入	114,065.49
债券利息收入	28.70
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	—
证券出借利息收入	—
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	7,946,187.79
其中：股票投资收益	7,050,521.60
基金投资收益	—

债券投资收益	37,149.25
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	858,516.94
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	12,754,901.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	840,591.97
<b>减：二、费用</b>	<b>1,090,815.41</b>
1.管理人报酬	111,154.10
2.托管费	37,051.34
3.销售服务费	—
4.交易费用	629,154.48
5.利息支出	—
其中：卖出回购金融资产支出	—
6.税金及附加	0.03
7.其他费用	313,455.46
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>20,564,960.45</b>
减：所得税费用	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>20,564,960.45</b>

注：本基金合同生效日为2020年5月13日，无上年度同期对比数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中证800交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020年05月13日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2020年5月13日(基金合同生效日)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）	248,526,092.00	—	248,526,092.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	20,564,960.45	20,564,960.45
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）	-126,000,000.00	17,129,942.28	-108,870,057.72
其中：1.基金申购款	133,000,000.00	26,675,127.49	159,675,127.49
2.基金赎回款	-259,000,000.00	-9,545,185.21	-268,545,185.21
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）	122,526,092.00	37,694,902.73	160,220,994.73
-----------------	----------------	---------------	----------------

注：本基金合同生效日为 2020 年 5 月 13 日，无上年度同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陈 戈	林志松	徐慧
—————	—————	—————
基金管理公司负责人	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 800 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可(2019)1833 号《关于准予富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准,由富国基金管理有限公司作为管理人自 2020 年 3 月 27 日至 2020 年 4 月 30 日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2020)验字第 60467606\_B19 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2020 年 5 月 13 日生效。本基金为契约型,交易型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 248,517,814.00 元,其中以现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 248,264,000.00 元,折合 248,264,000.00 份基金份额;以股票认购方式按认购期最后一日的均价计算的金额为人民币 253,814.00 元,折合 253,814.00 份基金份额。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 80,346.23 元,其中通过管理人进行的网下现金认购的有效认购资金在首次募集期间产生的利息为人民币 8,278.00 元,折合基金份额 8,278.00 份;网上现金认购的有效认购资金在首次募集期间产生的利息人民币 72,068.23 元计入基金财产,不折算为投资者基金份额。与首次募集相关的资产总额为人民币 248,598,160.23 元,折合 248,526,092.00 份基金份额。

本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股和其他股票。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票)、存托凭证、债券(国家债券、央行票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具(股指期货、国债期货等)、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低

于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率

#### **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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 5 月 13 日（基金合同生效日）至 2020 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 2020 年 5 月 13 日（基金合同生效日）至 2020 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；

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

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

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

##### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

##### (3) 权证投资

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

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

##### (4) 股指期货投资

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

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

(5) 国债期货投资

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

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

(6) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(7) 回购协议

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

#### 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) 股指期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；
- (9) 国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；
- (10) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；
- (11) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；
- (12) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；
- (13) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入。
- (14) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **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、每一基金份额享有同等分配权；
- 2、基金每年收益分配次数没有限制，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；
- 3、若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；
- 4、本基金收益分配采用现金方式；
- 5、法律法规、监管机关、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则进行调整，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（2020 年 12 月 31 日）
活期存款	1,483,583.21
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	1,483,583.21

注:本基金本报告期末未持有定期存款。本基金合同生效日为 2020 年 05 月 13 日。无上年度同期对比数据。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末(2020年12月31日)		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	145,992,877.84	158,740,257.25	12,747,379.41
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	121,300.00	128,822.50
	银行间市场	—	—
	合计	121,300.00	128,822.50
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	146,114,177.84	158,869,079.75	12,754,901.91

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注:本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债,本基金合同生效日为 2020 年 5 月 13 日。

#### 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:本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。本基金合同生效日为 2020 年 05 月 13 日。无上年度同期对比数据。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注:本基金本报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。本基金合同生效日为 2020 年 05 月 13 日。无上年度同期对比数据。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末(2020年12月31日)
应收活期存款利息	144.74
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	7.26
应收债券利息	10.22
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	17.49
合计	179.71

#### 7.4.7.6其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2020年12月31日）
交易所市场应付交易费用	35,528.75
银行间市场应付交易费用	—
合计	35,528.75

#### 7.4.7.8其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2020年12月31日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
预提信息披露费	62,500.00
预提审计费	50,000.00
应付指数使用费	35,000.00
合计	147,500.00

#### 7.4.7.9实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年5月13日(基金合同生效日)至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日2020年5月13日	248,526,092.00	248,526,092.00
本期申购	133,000,000.00	133,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-259,000,000.00	-259,000,000.00
本期末	122,526,092.00	122,526,092.00

注：本基金合同于2020年5月13日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币248,517,814.00元，其中以现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币248,264,000.00元，折合基金份额248,264,000.00份；以股票认购方式按认购期最后一日的均价计算的金额为人民币253,814.00元，折合253,814.00份基金份额；有效认购资金在募集期

间产生的利息为人民币 80,346.23 元,其中通过管理人进行的网下现金认购的有效认购资金在首次募集期间产生的利息为人民币 8,278.00 元,折合基金份额 8,278.00 份;网上现金认购的有效认购资金在首次募集期间产生的利息人民币 72,068.23 元计入基金财产,不折算为投资者基金份额。与首次募集相关的资产总额为人民币 248,598,160.23 元,折合 248,526,092.00 份基金份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日 2020 年 5 月 13 日	—	—	—
本期利润	7,810,058.54	12,754,901.91	20,564,960.45
本期基金份额交易产生的变动数	13,756,626.72	3,373,315.56	17,129,942.28
其中:基金申购款	19,774,833.64	6,900,293.85	26,675,127.49
基金赎回款	-6,018,206.92	-3,526,978.29	-9,545,185.21
本期已分配利润	—	—	—
本期末	21,566,685.26	16,128,217.47	37,694,902.73

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	107,729.92
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	5,718.33
其他	617.24
合计	114,065.49

#### 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 2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,523,878.39

股票投资收益——赎回差价收入	2,526,643.21
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	7,050,521.60

#### 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2020年5月13日(基金合同生效日)至2020年12月31日
卖出股票成交总额	139,907,220.58
减：卖出股票成本总额	135,383,342.19
买卖股票差价收入	4,523,878.39

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期2020年5月13日(基金合同生效日)至2020年12月31日
赎回基金份额对价总额	268,545,185.21
减：现金支付赎回款总额	110,594,882.21
减：赎回股票成本总额	155,423,659.79
赎回差价收入	2,526,643.21

#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

### 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2020年5月13日(基金合同生效日)至2020年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	159,468.13
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	122,300.00



减：应收利息总额	18.88
买卖债券差价收入	37,149.25

#### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 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 2020 年 5 月 13 日 (基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	858,516.94
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	858,516.94

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 5 月 13 日(基 金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	12,754,901.91
股票投资	12,747,379.41
债券投资	7,522.50
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	12,754,901.91

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	—
替代损益	840,591.97
合计	840,591.97

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	629,154.48
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	629,154.48

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	62,500.00
证券出借违约金	—
银行费用	236.00
指数使用费	88,461.54
其他	112,257.92
合计	313,455.46

### 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
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
山东省国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
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 2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
海通证券	51,333,622.94	10.57
申万宏源	133,539,725.00	27.49

注：本基金合同生效日为 2020 年 05 月 13 日，无上年度同期对比数据。

##### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为 2020 年 05 月 13 日，无上年度同期对比数据。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
申万宏源	34,838.10	21.85

海通证券	47,321.40	29.67
------	-----------	-------

注：本基金合同生效日为2020年05月13日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.1.4 回购交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行回购交易。本基金合同生效日为2020年05月13日，无上年度同期对比数据。

#### 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2020年5月13日(基金合同生效日)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	121,689.55	27.49	5,597.99	15.76
海通证券	46,774.87	10.57	7,790.06	21.93

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。本基金合同生效日为2020年05月13日。无上年度同期对比数据。

#### 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2020年5月13日(基金合同生效日)至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	111,154.10
其中：支付销售机构的客户维护费	—

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

本基金合同生效日为2020年05月13日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 5 月 13 日 (基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的 托管费	37,051.34

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

本基金合同生效日为 2020 年 05 月 13 日，无上年度同期对比数据。

#### 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：本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。本基金合同生效日为 2020 年 05 月 13 日，无上年度同期对比数据。

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

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

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。本基金合同生效日为 2020 年 05 月 13 日。无上年度同期对比数据。

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

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用适用市场化期限费率从事证券出借业务。本基金合同生效日为 2020 年 05 月 13 日。无上年度同期对比数据。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期内本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金合同生效日为 2020 年 05 月 13 日，无上年度同期对比数据。

#### 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未投资本基金。本基金合同生效日为 2020 年 05 月 13 日，无上年度同期对比数据。

#### 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 2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,483,583.21	107,729.92

注：本基金合同生效日为 2020 年 05 月 13 日，无上年度同期对比数据。

#### 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 2020 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	688585	上纬新材	IPO 网下申购	4,922	12,317.06

注：本基金合同生效日为 2020 年 05 月 13 日。无上年度同期对比数据。

#### 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

为更紧密地跟踪标的指数，降低跟踪误差，经与基金托管人协商一致，本基金在报告期内根据基金合同约定的投资策略投资于基金管理人股东发行的股票海通证券(600837.SH)、基金管理人股东的母公司发行的股票申万宏源(000166.SZ)、基金托管人发行的股票工商银行(601398.SH)。本基金合同生效日为 2020 年 05 月 13 日，无上年度同期对比数据。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2020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
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股认购	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	—
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股认购	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	—
300898	熊猫乳品	2020-10-09	2021-04-16	新股限售	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	—
300901	中胤时尚	2020-10-19	2021-04-29	新股限售	8.96	15.00	7,631	68,373.76	114,465.00	—
300917	特发服务	2020-12-14	2021-06-21	新股限售	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	—
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	新股限售	24.60	61.51	183	4,501.80	11,256.33	—
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	新股认购	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	—
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	—
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新股认购	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	—
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	—
600919	江苏银行	2020-12-17	2021-01-14	网上配股限售	4.59	5.46	13,500	61,965.00	73,710.00	—
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新股认购	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	—
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-01-07	新股认购	74.46	74.46	635	47,282.10	47,282.10	—

###### 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
113044	大秦转债	2020-12-15	2021-01-15	认购新发证券	100.00	100.00	800	80,000.00	80,000.00	
113616	韦尔转债	2020-12-29	2021-01-22	认购新发证券	100.00	100.00	80	8,000.00	8,000.00	
128142	新乳转债	2020-12-18	2021-01-19	认购新发证券	100.00	100.00	8	800.00	800.00	

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

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	--------------	--------	--------	----

300182	捷成股份	2020-12-30	筹划重大事项	3.23	2021-01-07	3.40	13,000	68,248.98	41,990.00	—
--------	------	------------	--------	------	------------	------	--------	-----------	-----------	---

#### 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 2020 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 2020 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

##### 7.4.13.2 信用风险

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的信用债。本基金合同生效日为 2020 年 05 月 13 日。无上年度同期对比数据。



#### 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（2020年12月31日）
AAA	101,245.40
AAA 以下	27,577.10
未评级	—
合计	128,822.50

注：本基金合同生效日为2020年05月13日。无上年度同期对比数据。本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。本基金合同生效日为2020年05月13日。无上年度同期对比数据。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有同业存单。本基金合同生效日为2020年05月13日。无上年度同期对比数据。

#### 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。  
本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### **7.4.13.4 市场风险**

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

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、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（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	1,483,583.21	—	—	—	—	—	1,483,583.21
结算备付金	14,568.00	—	—	—	—	—	14,568.00
存出保证金	35,478.45	—	—	—	—	—	35,478.45
交易性金融资产	—	—	128,822.50	—	—	158,740,257.25	158,869,079.75
应收证券清算款	—	—	—	—	—	26,916.92	26,916.92
应收利息	—	—	—	—	—	179.71	179.71
资产总计	1,533,629.66	—	128,822.50	—	—	158,767,353.88	160,429,806.04
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	19,336.77	19,336.77
应付托管费	—	—	—	—	—	6,445.59	6,445.59
应付交易费用	—	—	—	—	—	35,528.75	35,528.75
应付税费	—	—	—	—	—	0.20	0.20
其他负债	—	—	—	—	—	147,500.00	147,500.00
负债总计	—	—	—	—	—	208,811.31	208,811.31
利率敏感度缺口	1,533,629.66	—	128,822.50	—	—	158,558,542.57	160,220,994.73

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 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股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围主要为中证 800 指数成份股、备选成份股和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，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（2020 年 12 月 31 日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	158,740,257.25	99.08
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	128,822.50	0.08

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	158,869,079.75	99.16

#### 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（2020年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	1,494,029.13
	2. 业绩比较基准减少 1%	-1,494,029.13

#### 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158,376,902.35元，属于第二层次的余额为人民币334,329.58元，属于第三层次余额为人民币157,847.82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：

当期计入损益的利得或损失总额人民币 67,579.73 元，购买人民币 90,268.09 元，卖出人民币 0.00 元，本期末人民币 157,847.82 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 67,579.73 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	158,740,257.25	98.95
	其中：股票	158,740,257.25	98.95
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	128,822.50	0.08
	其中：债券	128,822.50	0.08
	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	1,498,151.21	0.93
8	其他各项资产	62,575.08	0.04
9	合计	160,429,806.04	100.00

### 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	—	—
C	制造业	182,247.34	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,716.24	0.01
J	金融业	—	—
K	房地产业	8,975.14	0.01
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	114,465.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	324,403.72	0.20

### 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	1,808,765.80	1.13
B	采矿业	3,832,048.40	2.39
C	制造业	87,297,463.53	54.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,868,791.90	1.79
E	建筑业	2,394,967.00	1.49
F	批发和零售业	2,198,848.60	1.37
G	交通运输、仓储和邮政业	3,939,940.20	2.46
H	住宿和餐饮业	173,995.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,478,129.80	4.04
J	金融业	34,705,797.00	21.66

K	房地产业	4,626,310.90	2.89
L	租赁和商务服务业	2,733,144.10	1.71
M	科学研究和技术服务业	1,568,681.20	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	330,952.50	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	174,650.00	0.11
Q	卫生和社会工作	2,232,075.80	1.39
R	文化、体育和娱乐业	881,520.80	0.55
S	综合	169,771.00	0.11
	合计	158,415,853.53	98.87

### 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	600519	贵州茅台	3,200	6,393,600.00	3.99
2	601318	中国平安	68,100	5,923,338.00	3.70
3	000858	五粮液	12,200	3,560,570.00	2.22
4	600036	招商银行	77,700	3,414,915.00	2.13
5	000333	美的集团	30,900	3,041,796.00	1.90
6	600276	恒瑞医药	23,460	2,614,851.60	1.63
7	601166	兴业银行	91,300	1,905,431.00	1.19
8	000651	格力电器	30,300	1,876,782.00	1.17
9	601888	中国中免	6,168	1,742,151.60	1.09
10	600887	伊利股份	38,200	1,694,934.00	1.06
11	601012	隆基股份	16,600	1,530,520.00	0.96
12	600030	中信证券	52,000	1,528,800.00	0.95
13	002475	立讯精密	26,420	1,482,690.40	0.93
14	300059	东方财富	43,380	1,344,780.00	0.84
15	600031	三一重工	37,300	1,304,754.00	0.81
16	000002	万科A	42,700	1,225,490.00	0.76
17	603288	海天味业	6,100	1,223,294.00	0.76
18	000001	平安银行	61,000	1,179,740.00	0.74
19	002415	海康威视	23,500	1,139,985.00	0.71
20	002594	比亚迪	5,700	1,107,510.00	0.69
21	601398	工商银行	220,200	1,098,798.00	0.69
22	600900	长江电力	57,100	1,094,036.00	0.68
23	603259	药明康德	8,060	1,085,843.20	0.68
24	000725	京东方A	170,200	1,021,200.00	0.64
25	000568	泸州老窖	4,500	1,017,720.00	0.64
26	002352	顺丰控股	11,400	1,005,822.00	0.63



27	002714	牧原股份	11,690	901,299.00	0.56
28	600309	万华化学	9,900	901,296.00	0.56
29	002304	洋河股份	3,800	896,762.00	0.56
30	600809	山西汾酒	2,200	825,638.00	0.52
31	601601	中国太保	21,500	825,600.00	0.52
32	000661	长春高新	1,800	808,038.00	0.50
33	601899	紫金矿业	86,400	802,656.00	0.50
34	600585	海螺水泥	15,000	774,300.00	0.48
35	601328	交通银行	172,700	773,696.00	0.48
36	300015	爱尔眼科	10,320	772,864.80	0.48
37	600048	保利地产	45,100	713,482.00	0.45
38	600000	浦发银行	73,700	713,416.00	0.45
39	600016	民生银行	133,700	695,240.00	0.43
40	600690	海尔智家	23,800	695,198.00	0.43
41	601688	华泰证券	37,000	666,370.00	0.42
42	002142	宁波银行	18,800	664,392.00	0.41
43	601668	中国建筑	131,800	655,046.00	0.41
44	600438	通威股份	17,000	653,480.00	0.41
45	002027	分众传媒	64,600	637,602.00	0.40
46	603501	韦尔股份	2,700	623,970.00	0.39
47	000100	TCL 科技	88,100	623,748.00	0.39
48	600837	海通证券	48,500	623,710.00	0.39
49	300124	汇川技术	6,500	606,450.00	0.38
50	300122	智飞生物	4,000	591,640.00	0.37
51	300014	亿纬锂能	7,071	576,286.50	0.36
52	000063	中兴通讯	17,000	572,050.00	0.36
53	601288	农业银行	180,500	566,770.00	0.35
54	600570	恒生电子	5,270	552,823.00	0.35
55	300347	泰格医药	3,400	549,474.00	0.34
56	600999	招商证券	23,370	545,455.80	0.34
57	600104	上汽集团	22,000	537,680.00	0.34
58	002241	歌尔股份	14,300	533,676.00	0.33
59	300498	温氏股份	28,060	511,533.80	0.32
60	600436	片仔癀	1,900	508,269.00	0.32
61	601211	国泰君安	28,300	496,099.00	0.31
62	601229	上海银行	62,500	490,000.00	0.31
63	002460	赣锋锂业	4,800	485,760.00	0.30
64	000338	潍柴动力	30,100	475,279.00	0.30
65	002410	广联达	6,000	472,440.00	0.29
66	300274	阳光电源	6,400	462,592.00	0.29
67	600009	上海机场	6,100	461,526.00	0.29

68	600588	用友网络	10,340	453,615.80	0.28
69	601169	北京银行	93,000	450,120.00	0.28
70	002230	科大讯飞	11,000	449,570.00	0.28
71	600660	福耀玻璃	8,900	427,645.00	0.27
72	601988	中国银行	132,400	421,032.00	0.26
73	603986	兆易创新	2,100	414,750.00	0.26
74	600196	复星医药	7,600	410,324.00	0.26
75	601766	中国中车	76,400	405,684.00	0.25
76	002271	东方雨虹	10,400	403,520.00	0.25
77	601628	中国人寿	10,500	403,095.00	0.25
78	601818	光大银行	100,100	399,399.00	0.25
79	002812	恩捷股份	2,800	396,984.00	0.25
80	600893	航发动力	6,600	391,710.00	0.24
81	600763	通策医疗	1,400	387,128.00	0.24
82	600406	国电南瑞	14,500	385,265.00	0.24
83	300601	康泰生物	2,200	383,900.00	0.24
84	600703	三安光电	14,100	380,841.00	0.24
85	300142	沃森生物	9,700	374,032.00	0.23
86	601088	中国神华	20,700	372,807.00	0.23
87	600346	恒力石化	13,300	372,001.00	0.23
88	601919	中远海控	30,400	371,184.00	0.23
89	000538	云南白药	3,200	363,520.00	0.23
90	002049	紫光国微	2,700	361,287.00	0.23
91	002493	荣盛石化	12,800	353,408.00	0.22
92	603799	华友钴业	4,300	340,990.00	0.21
93	600028	中国石化	84,000	338,520.00	0.21
94	601390	中国中铁	63,900	336,753.00	0.21
95	600019	宝钢股份	56,000	333,200.00	0.21
96	600919	江苏银行	60,700	331,422.00	0.21
97	002311	海大集团	5,000	327,500.00	0.20
98	000768	中航西飞	8,700	319,116.00	0.20
99	300413	芒果超媒	4,400	319,000.00	0.20
100	600745	闻泰科技	3,200	316,800.00	0.20
101	000876	新希望	14,100	315,840.00	0.20
102	000625	长安汽车	14,100	308,508.00	0.19
103	601336	新华保险	5,300	307,241.00	0.19
104	600958	东方证券	26,300	305,869.00	0.19
105	000895	双汇发展	6,500	305,110.00	0.19
106	601009	南京银行	37,700	304,616.00	0.19
107	000776	广发证券	18,600	302,808.00	0.19
108	000166	申万宏源	56,600	298,848.00	0.19

109	600584	长电科技	7,000	297,990.00	0.19
110	601377	兴业证券	33,700	292,516.00	0.18
111	002007	华兰生物	6,900	291,456.00	0.18
112	002129	中环股份	11,300	288,150.00	0.18
113	300012	华测检测	10,500	287,385.00	0.18
114	601633	长城汽车	7,600	287,356.00	0.18
115	600741	华域汽车	9,900	285,318.00	0.18
116	000157	中联重科	28,700	284,130.00	0.18
117	601100	恒立液压	2,492	281,596.00	0.18
118	600926	杭州银行	18,600	277,512.00	0.17
119	603993	洛阳钼业	44,400	277,500.00	0.17
120	002050	三花智控	11,230	276,819.50	0.17
121	600176	中国巨石	13,700	273,452.00	0.17
122	002001	新 和 成	8,100	272,808.00	0.17
123	002371	北方华创	1,500	271,110.00	0.17
124	600547	山东黄金	11,460	270,685.20	0.17
125	601877	正泰电器	6,900	270,204.00	0.17
126	002821	凯莱英	900	269,226.00	0.17
127	601901	方正证券	25,800	267,546.00	0.17
128	002179	中航光电	3,400	266,186.00	0.17
129	601939	建设银行	42,200	265,016.00	0.17
130	600426	华鲁恒升	7,100	264,830.00	0.17
131	001979	招商蛇口	19,900	264,471.00	0.17
132	600050	中国联通	58,500	260,910.00	0.16
133	000786	北新建材	6,400	256,320.00	0.16
134	002074	国轩高科	6,500	254,280.00	0.16
135	601857	中国石油	61,100	253,565.00	0.16
136	300408	三环集团	6,800	253,300.00	0.16
137	300433	蓝思科技	8,200	251,002.00	0.16
138	600109	国金证券	15,200	247,304.00	0.15
139	002555	三七互娱	7,900	246,717.00	0.15
140	000860	顺鑫农业	3,400	246,636.00	0.15
141	002202	金风科技	17,300	246,525.00	0.15
142	002736	国信证券	18,000	245,520.00	0.15
143	601066	中信建投	5,800	243,600.00	0.15
144	600015	华夏银行	38,700	241,875.00	0.15
145	601006	大秦铁路	37,400	241,604.00	0.15
146	002841	视源股份	2,100	241,563.00	0.15
147	601989	中国重工	57,300	240,087.00	0.15
148	600089	特变电工	23,400	237,510.00	0.15
149	601225	陕西煤业	25,100	234,434.00	0.15

150	002601	龙蟠佰利	7,600	233,852.00	0.15
151	600872	中炬高新	3,500	233,275.00	0.15
152	688008	澜起科技	2,800	232,064.00	0.14
153	002008	大族激光	5,400	230,850.00	0.14
154	603882	金城医学	1,800	230,616.00	0.14
155	600079	人福医药	6,800	230,384.00	0.14
156	600600	青岛啤酒	2,300	228,620.00	0.14
157	601186	中国铁建	28,900	228,310.00	0.14
158	601788	光大证券	12,300	227,796.00	0.14
159	002236	大华股份	11,300	224,757.00	0.14
160	603369	今世缘	3,900	223,782.00	0.14
161	600352	浙江龙盛	16,400	223,368.00	0.14
162	300496	中科创达	1,900	222,300.00	0.14
163	000547	航天发展	8,000	220,000.00	0.14
164	603019	中科曙光	6,400	219,072.00	0.14
165	002709	天赐材料	2,100	217,980.00	0.14
166	603160	汇顶科技	1,400	217,770.00	0.14
167	300285	国瓷材料	4,800	216,528.00	0.14
168	002624	完美世界	7,300	215,350.00	0.13
169	300003	乐普医疗	7,900	214,722.00	0.13
170	002938	鹏鼎控股	4,300	213,581.00	0.13
171	603899	晨光文具	2,400	212,544.00	0.13
172	002600	领益智造	17,700	212,223.00	0.13
173	300207	欣旺达	6,900	211,899.00	0.13
174	600760	中航沈飞	2,700	211,086.00	0.13
175	003816	中国广核	74,100	208,962.00	0.13
176	000066	中国长城	11,000	208,890.00	0.13
177	688012	中微公司	1,300	204,867.00	0.13
178	000783	长江证券	24,300	204,120.00	0.13
179	600183	生益科技	7,200	202,752.00	0.13
180	601360	三六零	12,800	201,088.00	0.13
181	601108	财通证券	15,800	199,870.00	0.12
182	601155	新城控股	5,700	198,531.00	0.12
183	002044	美年健康	17,300	196,009.00	0.12
184	002384	东山精密	7,500	195,000.00	0.12
185	600143	金发科技	11,300	193,682.00	0.12
186	601233	桐昆股份	9,400	193,546.00	0.12
187	601985	中国核电	39,100	192,372.00	0.12
188	601555	东吴证券	19,500	192,270.00	0.12
189	600383	金地集团	14,100	190,350.00	0.12
190	002185	华天科技	13,800	187,956.00	0.12

191	600739	辽宁成大	7,700	187,264.00	0.12
192	601669	中国电建	48,100	186,628.00	0.12
193	002797	第一创业	18,500	184,075.00	0.11
194	000938	紫光股份	8,980	183,641.00	0.11
195	000069	华侨城A	25,700	182,213.00	0.11
196	002024	苏宁易购	23,400	180,414.00	0.11
197	600111	北方稀土	13,700	179,333.00	0.11
198	002456	欧菲光	13,600	179,248.00	0.11
199	600885	宏发股份	3,300	178,926.00	0.11
200	600132	重庆啤酒	1,500	178,485.00	0.11
201	002385	大北农	18,400	177,744.00	0.11
202	601099	太平洋	42,800	174,624.00	0.11
203	300144	宋城演艺	9,840	174,364.80	0.11
204	601878	浙商证券	11,300	172,890.00	0.11
205	300136	信维通信	4,800	172,224.00	0.11
206	000977	浪潮信息	6,400	172,032.00	0.11
207	601933	永辉超市	23,900	171,602.00	0.11
208	601138	工业富联	12,500	171,125.00	0.11
209	603806	福斯特	2,000	170,800.00	0.11
210	300529	健帆生物	2,500	169,550.00	0.11
211	002340	格林美	24,100	168,459.00	0.11
212	600010	包钢股份	143,200	167,544.00	0.10
213	002602	世纪华通	23,480	166,942.80	0.10
214	600522	中天科技	15,400	166,936.00	0.10
215	002568	百润股份	1,600	166,864.00	0.10
216	600795	国电电力	74,000	166,500.00	0.10
217	600029	南方航空	27,900	166,284.00	0.10
218	002414	高德红外	3,960	165,330.00	0.10
219	300595	欧普康视	2,000	163,840.00	0.10
220	600161	天坛生物	3,920	163,464.00	0.10
221	000596	古井贡酒	600	163,200.00	0.10
222	300033	同花顺	1,300	161,174.00	0.10
223	601800	中国交建	22,100	160,446.00	0.10
224	601799	星宇股份	800	160,400.00	0.10
225	000425	徐工机械	29,600	158,952.00	0.10
226	603589	口子窖	2,300	158,470.00	0.10
227	300676	华大基因	1,200	154,272.00	0.10
228	600316	洪都航空	2,700	153,549.00	0.10
229	300357	我武生物	2,000	153,400.00	0.10
230	688036	传音控股	1,000	152,140.00	0.09
231	000636	风华高科	4,500	151,650.00	0.09

232	002625	光启技术	6,800	151,300.00	0.09
233	601966	玲珑轮胎	4,300	151,231.00	0.09
234	600886	国投电力	17,500	151,200.00	0.09
235	600529	山东药玻	3,000	150,450.00	0.09
236	601600	中国铝业	41,100	149,193.00	0.09
237	600201	生物股份	7,100	148,319.00	0.09
238	000703	恒逸石化	11,580	148,224.00	0.09
239	002507	涪陵榨菜	3,500	148,050.00	0.09
240	600705	中航资本	33,700	147,606.00	0.09
241	002607	中公教育	4,200	147,546.00	0.09
242	000728	国元证券	16,450	147,392.00	0.09
243	601168	西部矿业	11,900	147,322.00	0.09
244	600061	国投资本	10,600	146,598.00	0.09
245	000963	华东医药	5,500	146,080.00	0.09
246	603833	欧派家居	1,080	145,260.00	0.09
247	600486	扬农化工	1,100	145,200.00	0.09
248	601838	成都银行	13,600	145,112.00	0.09
249	000656	金科股份	20,200	143,218.00	0.09
250	002463	沪电股份	7,600	142,804.00	0.09
251	600219	南山铝业	45,100	142,516.00	0.09
252	300699	光威复材	1,600	142,480.00	0.09
253	002078	太阳纸业	9,800	141,414.00	0.09
254	603816	顾家家居	2,000	141,020.00	0.09
255	002013	中航机电	12,300	140,835.00	0.09
256	000750	国海证券	24,000	140,640.00	0.09
257	600066	宇通客车	8,300	140,436.00	0.09
258	601111	中国国航	18,700	140,063.00	0.09
259	000708	中信特钢	6,400	139,456.00	0.09
260	601607	上海医药	7,200	138,240.00	0.09
261	600511	国药股份	2,800	138,068.00	0.09
262	300088	长信科技	15,300	136,017.00	0.08
263	603345	安井食品	700	135,009.00	0.08
264	002157	正邦科技	7,900	134,616.00	0.08
265	600606	绿地控股	23,000	134,090.00	0.08
266	688002	睿创微纳	1,208	134,088.00	0.08
267	600862	中航高科	4,400	132,440.00	0.08
268	600115	东方航空	28,100	131,508.00	0.08
269	002030	达安基因	3,820	131,026.00	0.08
270	600362	江西铜业	6,500	129,675.00	0.08
271	002916	深南电路	1,200	129,672.00	0.08
272	600699	均胜电子	5,100	129,336.00	0.08

273	601997	贵阳银行	16,200	128,790.00	0.08
274	600884	杉杉股份	7,140	128,734.20	0.08
275	002131	利欧股份	42,400	128,472.00	0.08
276	601162	天风证券	21,000	128,100.00	0.08
277	601021	春秋航空	2,300	127,489.00	0.08
278	600340	华夏幸福	9,850	127,360.50	0.08
279	601128	常熟银行	17,200	126,936.00	0.08
280	002353	杰瑞股份	3,600	126,000.00	0.08
281	600177	雅戈尔	17,500	125,825.00	0.08
282	002252	上海莱士	17,000	125,800.00	0.08
283	002465	海格通信	11,600	125,628.00	0.08
284	300628	亿联网络	1,700	124,304.00	0.08
285	601727	上海电气	23,000	124,200.00	0.08
286	002212	天融信	5,900	123,959.00	0.08
287	603486	科沃斯	1,400	123,886.00	0.08
288	600011	华能国际	27,600	123,648.00	0.08
289	601618	中国中冶	44,900	122,577.00	0.08
290	002422	科伦药业	6,300	122,472.00	0.08
291	002508	老板电器	3,000	122,340.00	0.08
292	601816	京沪高铁	21,600	122,256.00	0.08
293	000009	中国宝安	16,200	121,986.00	0.08
294	002075	沙钢股份	11,100	121,767.00	0.08
295	002500	山西证券	13,540	121,183.00	0.08
296	600867	通化东宝	9,000	120,420.00	0.08
297	300316	晶盛机电	4,000	120,320.00	0.08
298	600487	亨通光电	8,600	120,314.00	0.08
299	600460	士兰微	4,800	120,000.00	0.07
300	600038	中直股份	1,900	119,149.00	0.07
301	600118	中国卫星	3,700	119,066.00	0.07
302	000630	铜陵有色	46,300	118,991.00	0.07
303	002683	宏大爆破	3,300	118,635.00	0.07
304	300146	汤臣倍健	4,900	118,335.00	0.07
305	300463	迈克生物	2,500	116,500.00	0.07
306	603658	安图生物	800	116,144.00	0.07
307	300482	万孚生物	1,300	115,973.00	0.07
308	000988	华工科技	5,000	115,950.00	0.07
309	601198	东兴证券	8,700	115,884.00	0.07
310	603338	浙江鼎力	1,140	115,356.60	0.07
311	600637	东方明珠	12,900	115,326.00	0.07
312	002791	坚朗五金	800	115,200.00	0.07
313	300168	万达信息	5,300	114,957.00	0.07

314	000998	隆平高科	5,800	114,898.00	0.07
315	600733	北汽蓝谷	13,200	114,444.00	0.07
316	601990	南京证券	9,300	114,111.00	0.07
317	600068	葛洲坝	17,300	113,834.00	0.07
318	002120	韵达股份	7,240	113,668.00	0.07
319	600369	西南证券	20,900	112,442.00	0.07
320	300001	特锐德	3,800	111,568.00	0.07
321	002673	西部证券	11,000	111,540.00	0.07
322	002773	康弘药业	2,300	110,745.00	0.07
323	600845	宝信软件	1,600	110,368.00	0.07
324	002250	联化科技	4,600	110,354.00	0.07
325	600909	华安证券	13,700	109,600.00	0.07
326	600754	锦江酒店	2,100	108,213.00	0.07
327	002557	洽洽食品	2,000	107,700.00	0.07
328	600489	中金黄金	12,200	107,482.00	0.07
329	002223	鱼跃医疗	3,800	107,198.00	0.07
330	300070	碧水源	14,000	107,100.00	0.07
331	000021	深科技	5,600	106,456.00	0.07
332	603737	三棵树	700	106,050.00	0.07
333	002156	通富微电	4,200	106,008.00	0.07
334	600498	烽火通信	4,400	105,952.00	0.07
335	002444	巨星科技	3,400	105,774.00	0.07
336	601216	君正集团	21,200	104,940.00	0.07
337	600004	白云机场	7,400	104,562.00	0.07
338	000961	中南建设	11,800	104,194.00	0.07
339	601689	拓普集团	2,700	103,761.00	0.06
340	002572	索菲亚	4,000	103,600.00	0.06
341	002299	圣农发展	3,900	103,506.00	0.06
342	600879	航天电子	13,700	102,476.00	0.06
343	688099	晶晨股份	1,300	102,349.00	0.06
344	002926	华西证券	8,200	102,336.00	0.06
345	600516	方大炭素	14,440	102,090.80	0.06
346	300418	昆仑万维	5,100	101,745.00	0.06
347	600380	健康元	7,300	101,543.00	0.06
348	600418	江淮汽车	8,300	101,509.00	0.06
349	601881	中国银河	8,100	101,331.00	0.06
350	002739	万达电影	5,600	101,248.00	0.06
351	601658	邮储银行	21,100	100,858.00	0.06
352	300223	北京君正	1,100	100,639.00	0.06
353	603866	桃李面包	1,700	100,470.00	0.06
354	000039	中集集团	6,700	100,433.00	0.06



355	002670	国盛金控	7,300	100,375.00	0.06
356	600155	华创阳安	7,600	100,244.00	0.06
357	600018	上港集团	21,800	99,626.00	0.06
358	600779	水井坊	1,200	99,624.00	0.06
359	600332	白云山	3,400	99,450.00	0.06
360	601998	中信银行	19,300	98,623.00	0.06
361	600390	五矿资本	14,100	98,418.00	0.06
362	002138	顺络电子	4,000	98,080.00	0.06
363	300271	华宇软件	4,100	97,867.00	0.06
364	000513	丽珠集团	2,400	97,200.00	0.06
365	000623	吉林敖东	5,900	97,173.00	0.06
366	002603	以岭药业	3,800	96,900.00	0.06
367	300244	迪安诊断	2,800	95,984.00	0.06
368	300024	机器人	7,800	95,940.00	0.06
369	688009	中国通号	16,300	95,518.00	0.06
370	002081	金螳螂	10,100	94,839.00	0.06
371	600372	中航电子	4,800	94,320.00	0.06
372	600415	小商品城	17,100	94,221.00	0.06
373	002373	千方科技	4,900	93,688.00	0.06
374	300115	长盈精密	3,800	93,670.00	0.06
375	000878	云南铜业	6,400	92,608.00	0.06
376	000050	深天马A	6,200	91,388.00	0.06
377	600166	福田汽车	28,900	91,035.00	0.06
378	601117	中国化学	15,500	90,985.00	0.06
379	600233	圆通速递	7,900	90,850.00	0.06
380	000975	银泰黄金	10,480	90,232.80	0.06
381	002080	中材科技	3,700	89,466.00	0.06
382	600549	厦门钨业	5,300	89,305.00	0.06
383	601615	明阳智能	4,700	89,206.00	0.06
384	002958	青农商行	17,500	89,075.00	0.06
385	300009	安科生物	6,060	88,960.80	0.06
386	300315	掌趣科技	17,400	88,914.00	0.06
387	600918	中泰证券	4,800	88,800.00	0.06
388	002064	华峰化学	8,800	88,792.00	0.06
389	002705	新宝股份	2,100	88,725.00	0.06
390	600801	华新水泥	4,300	88,709.00	0.06
391	600153	建发股份	10,800	88,668.00	0.06
392	600271	航天信息	7,000	88,200.00	0.06
393	002273	水晶光电	7,600	88,084.00	0.05
394	601319	中国人保	13,400	88,038.00	0.05
395	600667	太极实业	9,300	87,885.00	0.05

396	600765	中航重机	3,500	87,500.00	0.05
397	000686	东北证券	8,900	87,398.00	0.05
398	002558	巨人网络	5,000	87,150.00	0.05
399	600655	豫园股份	9,800	87,122.00	0.05
400	002019	亿帆医药	4,600	87,078.00	0.05
401	000739	普洛药业	3,700	86,136.00	0.05
402	600563	法拉电子	800	86,040.00	0.05
403	002831	裕同科技	2,800	85,736.00	0.05
404	601916	浙商银行	21,000	85,680.00	0.05
405	002511	中顺洁柔	4,100	85,567.00	0.05
406	000723	美锦能源	12,800	85,504.00	0.05
407	300017	网宿科技	12,400	85,436.00	0.05
408	300618	寒锐钴业	900	85,419.00	0.05
409	600998	九州通	4,700	85,352.00	0.05
410	603444	吉比特	200	85,200.00	0.05
411	000401	冀东水泥	6,000	84,900.00	0.05
412	600598	北大荒	4,400	84,700.00	0.05
413	002124	天邦股份	5,800	84,680.00	0.05
414	600535	天士力	5,700	84,303.00	0.05
415	002920	德赛西威	1,000	84,140.00	0.05
416	600170	上海建工	27,900	83,979.00	0.05
417	688088	虹软科技	1,200	83,904.00	0.05
418	600208	新湖中宝	27,000	83,700.00	0.05
419	601236	红塔证券	4,500	83,655.00	0.05
420	000540	中天金融	26,400	83,160.00	0.05
421	000830	鲁西化工	6,500	83,070.00	0.05
422	603156	养元饮品	3,180	82,171.20	0.05
423	603195	公牛集团	400	82,116.00	0.05
424	600895	张江高科	4,800	81,792.00	0.05
425	002506	协鑫集成	19,200	81,600.00	0.05
426	600859	王府井	2,500	81,450.00	0.05
427	600085	同仁堂	3,400	81,260.00	0.05
428	002152	广电运通	7,600	81,168.00	0.05
429	002195	二三四五	35,900	81,134.00	0.05
430	002648	卫星石化	3,100	80,972.00	0.05
431	603858	步长制药	3,500	80,745.00	0.05
432	002966	苏州银行	10,500	80,640.00	0.05
433	600642	申能股份	15,400	80,388.00	0.05
434	000738	航发控制	3,500	80,255.00	0.05
435	600409	三友化工	7,800	79,950.00	0.05
436	000690	宝新能源	10,900	79,570.00	0.05

437	601231	环旭电子	4,100	79,294.00	0.05
438	600392	盛和资源	8,900	79,121.00	0.05
439	600008	首创股份	27,930	79,041.90	0.05
440	601238	广汽集团	5,900	78,411.00	0.05
441	002281	光迅科技	2,700	78,408.00	0.05
442	002032	苏泊尔	1,000	77,990.00	0.05
443	601992	金隅集团	26,200	77,814.00	0.05
444	002056	横店东磁	5,100	77,469.00	0.05
445	600497	驰宏锌锗	16,000	76,800.00	0.05
446	601456	国联证券	3,600	76,788.00	0.05
447	603883	老百姓	1,220	76,652.60	0.05
448	002294	信立泰	2,700	76,491.00	0.05
449	600580	卧龙电驱	4,900	76,440.00	0.05
450	600315	上海家化	2,200	76,406.00	0.05
451	002028	思源电气	3,800	76,228.00	0.05
452	600848	上海临港	3,800	76,076.00	0.05
453	002939	长城证券	5,900	75,933.00	0.05
454	002382	蓝帆医疗	3,600	75,924.00	0.05
455	603638	艾迪精密	1,100	75,834.00	0.05
456	000729	燕京啤酒	8,900	75,828.00	0.05
457	300058	蓝色光标	12,600	75,600.00	0.05
458	300212	易华录	2,460	75,399.00	0.05
459	002690	美亚光电	1,700	75,276.00	0.05
460	000060	中金岭南	15,600	75,192.00	0.05
461	600150	中国船舶	4,200	74,298.00	0.05
462	000581	威孚高科	3,200	74,208.00	0.05
463	002595	豪迈科技	2,500	74,125.00	0.05
464	601866	中远海发	24,900	73,953.00	0.05
465	000807	云铝股份	9,800	73,794.00	0.05
466	600482	中国动力	4,100	73,472.00	0.05
467	002221	东华能源	7,200	73,008.00	0.05
468	600827	百联股份	5,000	73,000.00	0.05
469	002372	伟星新材	3,900	72,930.00	0.05
470	000983	山西焦煤	12,910	72,812.40	0.05
471	600297	广汇汽车	25,400	72,644.00	0.05
472	600528	中铁工业	8,300	72,542.00	0.05
473	601717	郑煤机	6,600	72,138.00	0.05
474	600256	广汇能源	25,400	71,882.00	0.04
475	601872	招商轮船	12,700	71,755.00	0.04
476	300296	利亚德	11,200	71,232.00	0.04
477	603605	珀莱雅	400	71,200.00	0.04

478	000960	锡业股份	6,300	70,560.00	0.04
479	002146	荣盛发展	10,800	70,524.00	0.04
480	600027	华电国际	20,700	70,380.00	0.04
481	000997	新大陆	4,600	70,288.00	0.04
482	002429	兆驰股份	11,300	70,060.00	0.04
483	600875	东方电气	7,000	69,790.00	0.04
484	600704	物产中大	15,900	69,483.00	0.04
485	600260	凯乐科技	6,300	68,670.00	0.04
486	002368	太极股份	2,620	68,408.20	0.04
487	600160	巨化股份	8,400	68,124.00	0.04
488	600811	东方集团	18,600	67,890.00	0.04
489	000671	阳光城	10,400	67,808.00	0.04
490	600728	佳都科技	8,900	67,551.00	0.04
491	600839	四川长虹	23,200	67,280.00	0.04
492	300630	普利制药	1,606	67,275.34	0.04
493	002745	木林森	4,600	67,114.00	0.04
494	002396	星网锐捷	2,900	66,874.00	0.04
495	002092	中泰化学	10,800	66,420.00	0.04
496	600515	*ST基础	9,800	66,150.00	0.04
497	600167	联美控股	5,800	65,830.00	0.04
498	600325	华发股份	10,600	65,826.00	0.04
499	603317	天味食品	800	65,792.00	0.04
500	600258	首旅酒店	3,100	65,782.00	0.04
501	600967	内蒙一机	5,400	65,664.00	0.04
502	002153	石基信息	2,100	65,289.00	0.04
503	600737	中粮糖业	6,700	64,856.00	0.04
504	000012	南玻A	8,700	64,206.00	0.04
505	603927	中科软	1,600	64,144.00	0.04
506	002242	九阳股份	2,000	64,080.00	0.04
507	600820	隧道股份	11,800	63,838.00	0.04
508	300002	神州泰岳	12,400	63,364.00	0.04
509	600881	亚泰集团	20,400	63,240.00	0.04
510	002085	万丰奥威	9,600	62,976.00	0.04
511	300474	景嘉微	900	62,919.00	0.04
512	000999	华润三九	2,500	62,350.00	0.04
513	002390	信邦制药	7,300	61,904.00	0.04
514	601577	长沙银行	6,500	61,880.00	0.04
515	002268	卫士通	3,700	61,790.00	0.04
516	600597	光明乳业	3,800	61,788.00	0.04
517	600567	山鹰国际	20,400	61,608.00	0.04
518	600446	金证股份	3,800	61,598.00	0.04

519	600410	华胜天成	6,900	61,134.00	0.04
520	000627	天茂集团	12,500	60,875.00	0.04
521	002174	游族网络	4,600	60,536.00	0.04
522	600282	南钢股份	19,400	60,528.00	0.04
523	600804	鹏博士	9,000	60,480.00	0.04
524	000709	河钢股份	26,700	59,808.00	0.04
525	002807	江阴银行	13,900	59,492.00	0.04
526	601179	中国西电	12,900	59,469.00	0.04
527	000629	攀钢钒钛	27,400	59,458.00	0.04
528	600435	北方导航	6,600	59,400.00	0.04
529	603000	人民网	3,500	59,150.00	0.04
530	300166	东方国信	5,400	59,130.00	0.04
531	000877	天山股份	3,900	58,890.00	0.04
532	603712	七一二	1,400	58,310.00	0.04
533	002387	维信诺	5,100	58,140.00	0.04
534	001914	招商积余	2,700	58,131.00	0.04
535	600026	中远海能	8,700	58,116.00	0.04
536	000930	中粮科技	6,900	58,098.00	0.04
537	000301	东方盛虹	6,100	57,828.00	0.04
538	002233	塔牌集团	4,500	57,330.00	0.04
539	600273	嘉化能源	6,200	57,288.00	0.04
540	600718	东软集团	5,500	57,255.00	0.04
541	600216	浙江医药	4,200	57,120.00	0.04
542	600908	无锡银行	9,300	56,544.00	0.04
543	600064	南京高科	5,500	56,485.00	0.04
544	600188	兖州煤业	5,600	56,392.00	0.04
545	600060	海信视像	4,900	56,252.00	0.04
546	600037	歌华有线	6,100	56,120.00	0.04
547	002004	华邦健康	10,000	55,400.00	0.03
548	601696	中银证券	2,000	55,360.00	0.03
549	000778	新兴铸管	15,000	55,200.00	0.03
550	600572	康恩贝	11,700	55,107.00	0.03
551	000932	华菱钢铁	11,500	54,970.00	0.03
552	000400	许继电气	3,800	54,948.00	0.03
553	000027	深圳能源	9,000	54,810.00	0.03
554	600755	厦门国贸	8,200	54,776.00	0.03
555	601005	重庆钢铁	36,900	54,612.00	0.03
556	601975	招商南油	21,700	54,467.00	0.03
557	000887	中鼎股份	4,600	53,866.00	0.03
558	600989	宝丰能源	4,600	53,820.00	0.03
559	000598	兴蓉环境	11,200	53,760.00	0.03

560	600039	四川路桥	11,900	53,669.00	0.03
561	000089	深圳机场	6,500	53,105.00	0.03
562	603087	甘李药业	400	52,888.00	0.03
563	002128	露天煤业	4,800	52,512.00	0.03
564	002701	奥瑞金	10,600	52,364.00	0.03
565	603198	迎驾贡酒	1,500	52,350.00	0.03
566	600398	海澜之家	8,100	52,002.00	0.03
567	002110	三钢闽光	7,700	51,821.00	0.03
568	300026	红日药业	11,300	51,754.00	0.03
569	002191	劲嘉股份	5,600	51,688.00	0.03
570	000825	太钢不锈	14,300	51,623.00	0.03
571	601118	海南橡胶	10,700	51,574.00	0.03
572	600158	中体产业	4,200	51,492.00	0.03
573	002925	盈趣科技	800	51,464.00	0.03
574	601106	中国一重	17,200	51,428.00	0.03
575	000970	中科三环	5,400	51,030.00	0.03
576	601698	中国卫通	2,800	50,792.00	0.03
577	002867	周大生	1,900	50,635.00	0.03
578	300072	三聚环保	8,900	50,552.00	0.03
579	600171	上海贝岭	3,600	50,472.00	0.03
580	600025	华能水电	11,300	50,398.00	0.03
581	002563	森马服饰	5,000	50,100.00	0.03
582	601077	渝农商行	11,100	49,950.00	0.03
583	002048	宁波华翔	3,200	49,824.00	0.03
584	600120	浙江东方	8,340	49,789.80	0.03
585	000488	晨鸣纸业	7,700	49,434.00	0.03
586	600195	中牧股份	3,839	49,177.59	0.03
587	600022	山东钢铁	34,300	49,049.00	0.03
588	002936	郑州银行	10,990	49,015.40	0.03
589	000967	盈峰环境	6,000	48,840.00	0.03
590	601699	潞安环能	7,500	48,750.00	0.03
591	600056	中国医药	3,400	48,722.00	0.03
592	000090	天健集团	8,200	48,708.00	0.03
593	601860	紫金银行	11,500	48,415.00	0.03
594	000402	金融街	7,500	48,375.00	0.03
595	002839	张家港行	7,900	48,190.00	0.03
596	603290	斯达半导	200	48,180.00	0.03
597	603077	和邦生物	33,900	48,138.00	0.03
598	688321	微芯生物	1,300	48,113.00	0.03
599	002217	合力泰	11,700	47,970.00	0.03
600	000528	柳工	6,500	47,840.00	0.03

601	600673	东阳光	9,500	47,785.00	0.03
602	000883	湖北能源	12,300	47,724.00	0.03
603	300133	华策影视	7,700	47,586.00	0.03
604	600376	首开股份	8,100	47,547.00	0.03
605	601808	中海油服	3,700	47,249.00	0.03
606	600006	东风汽车	5,000	47,200.00	0.03
607	600507	方大特钢	6,800	47,192.00	0.03
608	000563	陕国投 A	12,500	47,125.00	0.03
609	600021	上海电力	6,600	46,992.00	0.03
610	601333	广深铁路	21,000	46,620.00	0.03
611	000685	中山公用	5,600	46,480.00	0.03
612	603568	伟明环保	2,450	46,378.50	0.03
613	002266	浙富控股	10,300	46,350.00	0.03
614	000990	诚志股份	3,900	46,254.00	0.03
615	300376	易事特	5,800	46,168.00	0.03
616	600928	西安银行	8,300	46,148.00	0.03
617	601000	唐山港	18,600	46,128.00	0.03
618	600782	新钢股份	10,000	45,900.00	0.03
619	600500	中化国际	8,700	45,849.00	0.03
620	603228	景旺电子	1,520	45,828.00	0.03
621	002203	海亮股份	6,200	45,818.00	0.03
622	601200	上海环境	4,200	45,780.00	0.03
623	000898	鞍钢股份	15,000	45,600.00	0.03
624	300180	华峰超纤	7,700	45,507.00	0.03
625	600970	中材国际	6,600	45,408.00	0.03
626	002317	众生药业	4,100	45,182.00	0.03
627	002155	湖南黄金	5,300	45,103.00	0.03
628	002244	滨江集团	9,800	44,982.00	0.03
629	300113	顺网科技	2,600	44,590.00	0.03
630	600466	蓝光发展	9,600	44,448.00	0.03
631	600126	杭钢股份	8,400	44,436.00	0.03
632	000559	万向钱潮	8,300	44,405.00	0.03
633	601865	福莱特	1,100	43,890.00	0.03
634	000758	中色股份	8,600	43,688.00	0.03
635	601598	中国外运	9,900	43,560.00	0.03
636	601016	节能风电	12,600	43,218.00	0.03
637	601608	中信重工	10,900	43,164.00	0.03
638	000519	中兵红箭	4,300	43,086.00	0.03
639	600266	城建发展	8,480	43,078.40	0.03
640	600649	城投控股	7,900	42,897.00	0.03
641	601098	中南传媒	4,500	42,885.00	0.03

642	600373	中文传媒	4,200	42,378.00	0.03
643	600073	上海梅林	4,100	42,189.00	0.03
644	601718	际华集团	13,900	42,117.00	0.03
645	600348	华阳股份	7,500	42,075.00	0.03
646	603885	吉祥航空	3,700	42,069.00	0.03
647	300182	捷成股份	13,000	41,990.00	0.03
648	300010	豆神教育	4,300	41,968.00	0.03
649	600388	龙净环保	4,700	41,736.00	0.03
650	600959	江苏有线	12,600	41,706.00	0.03
651	600546	山煤国际	4,900	41,699.00	0.03
652	002399	海普瑞	2,400	41,328.00	0.03
653	600901	江苏租赁	7,500	41,325.00	0.03
654	002458	益生股份	3,700	41,255.00	0.03
655	000028	国药一致	900	41,220.00	0.03
656	600645	中源协和	2,100	41,181.00	0.03
657	002183	怡亚通	9,400	40,984.00	0.03
658	000078	海王生物	10,200	40,902.00	0.03
659	600835	上海机电	2,100	40,866.00	0.03
660	600062	华润双鹤	3,400	40,766.00	0.03
661	002505	鹏都农牧	16,100	40,733.00	0.03
662	002249	大洋电机	9,000	40,500.00	0.03
663	603392	万泰生物	200	40,306.00	0.03
664	600094	大名城	10,000	40,200.00	0.03
665	002640	跨境通	7,800	40,092.00	0.03
666	002440	闰土股份	4,300	40,076.00	0.03
667	600808	马钢股份	15,000	39,900.00	0.02
668	600633	浙数文化	4,900	39,886.00	0.02
669	002038	双鹭药业	3,900	39,390.00	0.02
670	000564	*ST大集	15,000	38,850.00	0.02
671	002985	北摩高科	200	38,660.00	0.02
672	600675	中华企业	11,500	38,640.00	0.02
673	002010	传化智联	8,200	38,622.00	0.02
674	601778	晶科科技	5,300	38,478.00	0.02
675	002468	申通快递	3,800	38,304.00	0.02
676	000959	首钢股份	10,000	38,300.00	0.02
677	601958	金铝股份	6,100	37,881.00	0.02
678	000158	常山北明	6,100	37,820.00	0.02
679	601880	辽港股份	19,500	37,635.00	0.02
680	600643	爱建集团	5,000	37,600.00	0.02
681	600863	内蒙华电	14,600	37,522.00	0.02
682	600141	兴发集团	3,400	37,502.00	0.02



683	002434	万里扬	4,200	37,464.00	0.02
684	000415	渤海租赁	15,600	37,440.00	0.02
685	002544	杰赛科技	2,200	36,916.00	0.02
686	688029	南微医学	200	36,802.00	0.02
687	002408	齐翔腾达	4,400	36,784.00	0.02
688	000826	启迪环境	5,400	36,504.00	0.02
689	600312	平高电气	5,100	36,414.00	0.02
690	601611	中国核建	5,000	36,400.00	0.02
691	600717	天津港	7,540	36,041.20	0.02
692	002583	海能达	5,800	35,612.00	0.02
693	600776	东方通信	3,000	35,550.00	0.02
694	000031	大悦城	8,000	35,200.00	0.02
695	000681	视觉中国	2,700	35,100.00	0.02
696	300459	金科文化	11,000	35,090.00	0.02
697	000869	张裕A	800	34,880.00	0.02
698	600729	重庆百货	1,200	34,680.00	0.02
699	002589	瑞康医药	6,600	34,518.00	0.02
700	002635	安洁科技	2,000	34,460.00	0.02
701	002424	贵州百灵	4,400	34,452.00	0.02
702	002002	鸿达兴业	11,400	34,200.00	0.02
703	603650	彤程新材	1,100	34,100.00	0.02
704	000501	鄂武商A	2,900	33,785.00	0.02
705	600648	外高桥	2,400	33,528.00	0.02
706	600329	中新药业	1,900	33,288.00	0.02
707	002815	崇达技术	2,300	33,212.00	0.02
708	600259	广晟有色	1,100	33,187.00	0.02
709	000718	苏宁环球	9,600	32,928.00	0.02
710	600823	世茂股份	7,100	32,731.00	0.02
711	600131	国网信通	2,300	32,729.00	0.02
712	300324	旋极信息	7,700	32,571.00	0.02
713	600307	酒钢宏兴	19,700	32,505.00	0.02
714	000717	韶钢松山	7,600	32,452.00	0.02
715	600566	济川药业	1,600	32,368.00	0.02
716	000046	泛海控股	9,800	32,144.00	0.02
717	600582	天地科技	10,400	32,032.00	0.02
718	600339	中油工程	10,200	31,416.00	0.02
719	600985	淮北矿业	2,800	31,332.00	0.02
720	002375	亚厦股份	4,200	31,248.00	0.02
721	000008	神州高铁	12,300	31,242.00	0.02
722	600968	海油发展	12,800	30,592.00	0.02
723	600338	西藏珠峰	2,900	30,392.00	0.02

724	601928	凤凰传媒	4,800	30,384.00	0.02
725	600664	哈药股份	9,500	30,305.00	0.02
726	002948	青岛银行	5,100	30,243.00	0.02
727	603260	合盛硅业	900	30,096.00	0.02
728	300257	开山股份	2,200	30,030.00	0.02
729	600707	彩虹股份	4,500	29,970.00	0.02
730	000156	华数传媒	3,500	29,960.00	0.02
731	000061	农产品	4,200	29,610.00	0.02
732	600556	天下秀	2,300	29,095.00	0.02
733	002416	爱施德	3,900	29,094.00	0.02
734	000543	皖能电力	6,900	28,842.00	0.02
735	600748	上实发展	5,800	28,478.00	0.02
736	601298	青岛港	4,400	28,292.00	0.02
737	002302	西部建设	3,200	28,096.00	0.02
738	000937	冀中能源	6,700	27,872.00	0.02
739	600639	浦东金桥	2,200	27,280.00	0.02
740	603515	欧普照明	900	27,189.00	0.02
741	600869	远东股份	6,800	27,132.00	0.02
742	603377	东方时尚	1,400	27,104.00	0.02
743	601228	广州港	7,800	26,208.00	0.02
744	002503	搜于特	11,600	25,984.00	0.02
745	600787	中储股份	5,600	25,816.00	0.02
746	600277	亿利洁能	8,600	25,714.00	0.02
747	601127	小康股份	1,500	25,620.00	0.02
748	002945	华林证券	1,700	25,619.00	0.02
749	601139	深圳燃气	3,500	25,340.00	0.02
750	000813	德展健康	5,700	25,251.00	0.02
751	000600	建投能源	4,500	25,245.00	0.02
752	000062	深圳华强	2,000	24,880.00	0.02
753	600545	卓郎智能	7,100	24,850.00	0.02
754	300134	大富科技	2,400	24,792.00	0.02
755	603888	新华网	1,300	24,700.00	0.02
756	600640	号百控股	2,000	24,500.00	0.02
757	601828	美凯龙	2,850	24,196.50	0.02
758	603056	德邦股份	1,900	24,111.00	0.02
759	600350	山东高速	3,900	24,102.00	0.02
760	600517	国网英大	3,900	23,712.00	0.01
761	600575	淮河能源	10,200	23,664.00	0.01
762	603225	新风鸣	1,700	23,630.00	0.01
763	002093	国脉科技	3,200	23,328.00	0.01
764	600871	石化油服	11,900	23,324.00	0.01

765	600291	西水股份	4,100	23,247.00	0.01
766	002419	天虹股份	3,000	22,920.00	0.01
767	000537	广宇发展	3,600	22,572.00	0.01
768	603379	三美股份	1,160	22,156.00	0.01
769	002901	大博医疗	300	22,119.00	0.01
770	002051	中工国际	3,100	21,979.00	0.01
771	000553	安道麦 A	2,800	21,896.00	0.01
772	600657	信达地产	5,400	21,870.00	0.01
773	600299	安迪苏	1,900	21,869.00	0.01
774	600623	华谊集团	3,600	20,880.00	0.01
775	000732	泰禾集团	6,300	20,601.00	0.01
776	603786	科博达	300	20,286.00	0.01
777	603328	依顿电子	2,500	19,875.00	0.01
778	601869	长飞光纤	700	18,928.00	0.01
779	600903	贵州燃气	1,400	17,780.00	0.01
780	002946	新乳业	1,000	17,610.00	0.01
781	002653	海思科	1,000	17,520.00	0.01
782	601801	皖新传媒	3,500	16,625.00	0.01
783	601003	柳钢股份	3,200	16,608.00	0.01
784	600053	九鼎投资	800	15,640.00	0.01
785	603355	莱克电气	500	15,115.00	0.01
786	601969	海南矿业	2,500	14,950.00	0.01
787	603893	瑞芯微	200	14,470.00	0.01
788	603868	飞科电器	300	14,034.00	0.01
789	002941	新疆交建	1,200	13,200.00	0.01
790	002818	富森美	900	12,717.00	0.01
791	603719	良品铺子	200	11,734.00	0.01
792	002423	中粮资本	1,100	10,648.00	0.01
793	603983	丸美股份	200	10,442.00	0.01
794	002957	科瑞技术	500	10,225.00	0.01
795	601512	中新集团	1,000	9,940.00	0.01
796	603256	宏和科技	1,100	9,713.00	0.01
797	001872	招商港口	600	9,552.00	0.01
798	600917	重庆燃气	1,100	7,546.00	0.00
799	601068	中铝国际	2,000	7,120.00	0.00
800	603708	家家悦	300	6,390.00	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	300901	中胤时尚	7,631	114,465.00	0.07
2	688617	惠泰医疗	635	47,282.10	0.03
3	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.02
4	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.02
5	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
6	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
7	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.01
8	300919	中伟股份	183	11,256.33	0.01
9	300917	特发服务	281	8,975.14	0.01
10	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.01
11	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
12	003031	中瓷电子	387	5,909.49	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	11,155,222.00	6.96
2	600519	贵州茅台	9,448,441.88	5.90
3	000858	五粮液	7,675,659.00	4.79
4	000333	美的集团	6,597,001.02	4.12
5	000651	格力电器	5,943,423.49	3.71
6	600036	招商银行	5,393,782.57	3.37
7	600276	恒瑞医药	4,130,370.80	2.58
8	002475	立讯精密	3,717,198.86	2.32
9	000002	万科 A	3,627,134.00	2.26
10	000661	长春高新	3,592,539.00	2.24
11	601166	兴业银行	3,477,990.50	2.17
12	600030	中信证券	3,242,091.00	2.02
13	002714	牧原股份	2,807,537.70	1.75
14	000001	平安银行	2,774,626.00	1.73
15	600887	伊利股份	2,695,842.00	1.68
16	300059	东方财富	2,551,608.40	1.59
17	002415	海康威视	2,513,018.48	1.57
18	000725	京东方 A	2,316,040.00	1.45
19	600900	长江电力	2,186,960.00	1.36
20	300498	温氏股份	2,120,692.00	1.32

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	5,348,805.50	3.34
2	000333	美的集团	4,598,364.15	2.87
3	000651	格力电器	4,332,313.50	2.70
4	000661	长春高新	2,729,913.75	1.70
5	002475	立讯精密	2,505,840.00	1.56
6	000002	万科 A	2,496,063.00	1.56
7	000001	平安银行	1,908,772.00	1.19
8	002714	牧原股份	1,847,633.30	1.15
9	002415	海康威视	1,613,197.57	1.01
10	300059	东方财富	1,551,889.00	0.97
11	000725	京东方 A	1,497,636.00	0.93
12	300498	温氏股份	1,406,271.22	0.88
13	000063	中兴通讯	1,397,917.00	0.87
14	002142	宁波银行	1,271,776.00	0.79
15	300015	爱尔眼科	1,237,268.00	0.77
16	002594	比亚迪	1,146,692.00	0.72
17	000100	TCL 科技	1,115,032.00	0.70
18	000338	潍柴动力	1,022,561.00	0.64
19	002304	洋河股份	940,684.00	0.59
20	000568	泸州老窖	922,368.00	0.58

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	347,648,362.82
卖出股票收入（成交）总额	139,907,220.58

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）	128,822.50	0.08

8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	128,822.50	0.08

### 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(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113044	大秦转债	800	80,000.00	0.05
2	113043	财通转债	180	21,245.40	0.01
3	128136	立讯转债	125	15,897.50	0.01
4	113616	韦尔转债	80	8,000.00	0.00
5	113611	福20转债	20	2,879.60	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

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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

### 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

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，在风险可控的基础上，以套期保值为目的，参与国债期货的投资，以降低跟踪误差。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“兴业银行”的发行主体兴业银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保的违法违规事实，中国银保监会福建监管局于2020年8月31日对公司做出没收违法所得6,361,807.97元，并合计处以罚款15,961,807.97元的行政处罚（闽银保监罚决字〔2020〕24号）；由于存在为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；违反银行卡收单外包管理规定等5项违法违规事实，中国人民银行福州中心支行于2020年9月4日对公司做出警告，没收违法所得10,875,088.15元，并处13,824,431.23元罚款的行政处罚（福银罚字〔2020〕35号）。兴业银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余 9 名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 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	35,478.45
2	应收证券清算款	26,916.92
3	应收股利	—
4	应收利息	179.71
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	62,575.08

#### 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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

##### 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	300901	中胤时尚	114,465.00	0.07	新股限售
2	688617	惠泰医疗	47,282.10	0.03	新股认购



3	300926	博俊科技	34,701.00	0.02	新股认购
4	300927	江天化学	26,056.94	0.02	新股认购
5	300926	博俊科技	3,862.84	0.00	新股限售
6	300927	江天化学	2,905.63	0.00	新股限售

### 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

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 (%)
172	712,361.00	118,266,392.00	96.52	4,259,700.00	3.48

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例 (%)
1	富国基金—北京诚通金控投资有限公司—富国基金—诚通金控 1 号单一资产管理计划	110,394,100	90.10
2	中信证券股份有限公司	6,358,810	5.19
3	华泰证券股份有限公司	1,303,482	1.06
4	袁洪	1,000,000	0.82
5	张晓晖	1,000,000	0.82
6	阮晓春	300,000	0.24
7	刘立新	200,000	0.16
8	深圳市服务贸易协会	200,000	0.16
9	温晓波	100,000	0.08
10	孙娇	100,000	0.08

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年05月13日)基金份额总额	248,526,092.00
基金合同生效日2020年5月13日起至报告期期末基金总申购份额	133,000,000.00
减：基金合同生效日2020年5月13日起至报告期期末基金总赎回份额	259,000,000.00
基金合同生效日2020年5月13日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	122,526,092.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。  
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 5 万元人民币, 其已提供审计服务的连续年限为 18 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 (%)	
长江证券	2	260,684,297.77	53.67	—	—	—	—	—	—	237,554.06	53.67	—
川财证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
方正证券	1	264,099.86	0.05	—	—	—	—	—	—	240.69	0.05	—
广发证券	2	3,839,347.15	0.79	9,429.43	5.91	—	—	—	—	3,498.71	0.79	—
国都证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国海证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国元证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	51,333,622.94	10.57	47,321.40	29.67	—	—	—	—	46,774.87	10.57	—
华宝证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华创证券	1	8,943,191.54	1.84	18,453.60	11.57	—	—	—	—	8,151.14	1.84	—
江海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	662,090.00	0.14	—	—	—	—	—	—	603.34	0.14	—
上海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源	4	133,539,725.00	27.49	34,838.10	21.85	—	—	—	—	121,689.55	27.49	—

西部证券	2	2,216,802.23	0.46	—	—	—	—	—	—	2,020.32	0.46	—
新时代证券	2	14,856,085.56	3.06	—	—	—	—	—	—	13,538.73	3.06	—
招商证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	2	9,384,916.11	1.93	49,425.60	30.99	—	—	—	—	8,552.60	1.93	—

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本基金合同生效日为2020年5月13日，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

## 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	富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	规定披露媒介	2020 年 05 月 14 日
2	富国基金管理有限公司关于富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金投资关联方证券的公告	规定披露媒介	2020 年 05 月 19 日
3	富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	规定披露媒介	2020 年 05 月 26 日
4	富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金开放申购、赎回业务公告	规定披露媒介	2020 年 05 月 27 日
5	富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	规定披露媒介	2020 年 05 月 29 日
6	富国基金管理有限公司关于旗下开放式基金在直销渠道转换业务规则的公告	规定披露媒介	2020 年 09 月 21 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	2020 年 09 月 22 日
8	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	规定披露媒介	2020 年 10 月 14 日
9	富国基金管理有限公司关于终止深圳盈信基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	规定披露媒介	2020 年 12 月 21 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

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

	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020-07-14 至 2020-08-17	-	10,000, 000.00	10,000 ,000.0 0	-	-
	2	2020-07-24 至 2020-07-26;2020 -07-30 至 2020-08-02;2020 -08-04 至 2020-08-17	7,000, 101.00	165,343 ,762.00	171,04 0,381. 00	1,303,482.0 0	1.06%
	3	2020-08-18 至 2020-12-31	-	120,894 ,100.00	10,500 ,000.0 0	110,394,100 .00	90.10%

#### 产品特有风险

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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《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 2020 年 10 月 14 日起，在本基金投资范围中增加存托凭证，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 2020 年 10 月 14 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证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。

## § 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证 800 交易型开放式指数证券投资基金的文件	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，
2、富国中证 800 交易型		

<p>开放式指数证券投资基金基金合同</p> <p>3、富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议</p> <p>4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件</p> <p>5、富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注</p> <p>6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告</p>		<p>免长途话费) 公司网址:  <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a>。</p>
--	--	---