

# 上证综指交易型开放式指数证券投资基金

## 二〇二一年第 2 季度报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国工商银行股份有限公司

报告送出日期： 2021 年 07 月 21 日

## § 1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及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责任。

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 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	上证综指 ETF
场内简称	上证指数 ETF
基金主代码	510210
交易代码	510210
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2011 年 01 月 30 日
报告期末基金份额总额 (单位: 份)	473, 192, 565. 00
投资目标	紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的标的指数为上证综合指数。
投资策略	本基金采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托富国量化投资平台, 利用长期稳定的风险模型, 使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合, 从而实现对标的指数的紧密跟踪。在正常市场情况下, 本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0. 1%, 年化跟踪误差不超过 2%。本基金的最优化目标组合的构建、存托凭证的投资策略、其他金融工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	上证综合指数
风险收益特征	本基金属股票型基金, 预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金, 跟踪上证综合指数, 具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期 (2021 年 04 月 01 日-2021 年 06 月 30 日)
1. 本期已实现收益	14, 457, 171. 56
2. 本期利润	17, 180, 851. 54
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0335
4. 期末基金资产净值	464, 324, 102. 41
5. 期末基金份额净值	0. 981

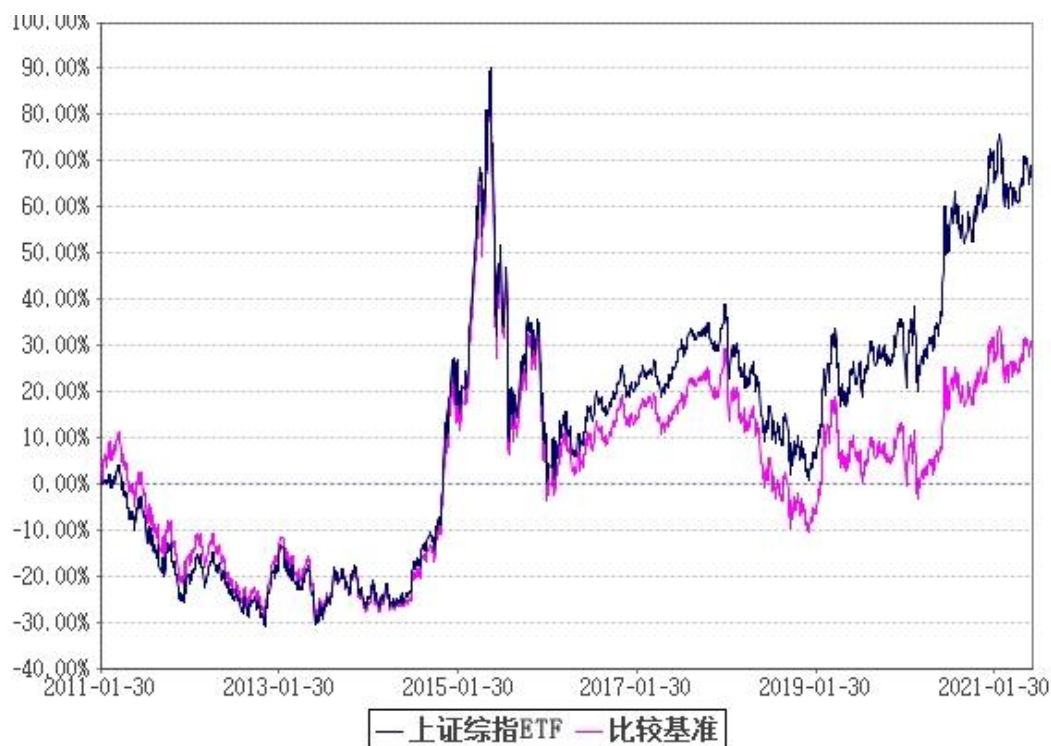
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	2.83%	0.72%	4.34%	0.69%	-1.51%	0.03%
过去六个月	1.62%	0.97%	3.40%	0.94%	-1.78%	0.03%
过去一年	21.80%	1.12%	20.32%	1.11%	1.48%	0.01%
过去三年	47.74%	1.18%	26.12%	1.21%	21.62%	-0.03%
过去五年	51.02%	1.02%	22.58%	1.05%	28.44%	-0.03%
自基金合同生效起至今	67.86%	1.30%	30.46%	1.32%	37.40%	-0.02%

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



注：1、截止日期为2021年6月30日。2、本基金于2011年1月30日成立，建仓期3个月，从2011年1月30日起至2011年4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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 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	2014-11-19	—	11.4	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

				<p>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 年 2 月起任富国量化对冲策略三个月持</p>
--	--	--	--	---

					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。
王保合	本基金基金经理	2011-03-03	—	15.0	<p>博士，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总经理，兼任富国基金量化投资部资深定量基金经理。2011年3月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2013年9月起任富国创业板指数型证券投资基金（原富国创业板指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）基金经理，2014年4月起任富国中证军工指数型证券投资基金（原富国中证军工指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）基金经理，2015年4月起任富国中证移动互联网指数型证券投资基金（原富国中证移动互联网指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）、富国中证国有企业改革指数型证券投资基金（原富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）基金经理，2015年5月起任富国中证全指证券公司指数型证券投资基金（原富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金，于</p>

					2021年1月1日更名)、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)基金经理,2017年9月至2019年10月任富国丰利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。2018年3月至2019年10月任富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年3月至2021年6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11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基金经理,2020年9月起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。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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期,富国基金管理有限公司作为上证综指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》、《上证综指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 公平交易专项说明**

#### **4.3.1 公平交易制度的执行情况**

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间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 报告期内基金的投资策略和运作分析

4月以来,随着公布的1季度GDP数据环比低于季节性,餐饮、制造业投资修复偏慢,投资者对于货币政策收紧预期担忧减弱,市场迎来反弹。4月下旬,印度疫情超预期爆发,使得货币政策收紧预期进一步降低,市场持续反弹。5月初,商品价格再度大幅上涨,螺纹钢、铜等品种创出本轮反弹新高,钢铁、煤炭、有色等周期板块大幅上涨。市场通胀预期大幅提升,成长板块出现明显回调。5月中旬起,国常会多次开会聚焦大宗商品价格问题,指出要高度重视大宗商品价格攀升带来的不利影响。国内相关大宗商品如钢价、煤价迎来大幅调整。随着通胀预期下降,市场风险偏好再度提升,消费、科技、医药、新能源等板块迎来大幅反弹。6月中,美联储会议并未实质性讨论收紧购债规模,同时美国10年期国债利率进一步走低,因此短期流动性未受到明显影响,市场继续反弹。其中,景气度较高的新能源汽车、光伏、半导体等板块涨幅居前。总体来看,2021年2季度上证综指上涨4.34%,沪深300上涨3.48%,创业板指上涨26.05%,中证500指数上涨8.86%。

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

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为2.83%,同期业绩比较基准收益率为4.34%

#### 4.6 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 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	457,685,283.05	98.48
	其中:股票	457,685,283.05	98.48
2	固定收益投资	1,272,000.00	0.27
	其中:债券	1,272,000.00	0.27
	资产支持证券	—	—

3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	5,453,597.70	1.17
7	其他资产	331,930.88	0.07
8	合计	464,742,811.63	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,296,375.90	0.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	—	—
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	12,230.40	0.00
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	95,025.15	0.02
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	1,462,387.38	0.31

### 5.2.2 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,845,352.00	0.40
B	采矿业	37,315,268.90	8.04
C	制造业	196,073,560.69	42.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,165,262.75	4.56
E	建筑业	11,273,023.44	2.43
F	批发和零售业	6,726,078.52	1.45
G	交通运输、仓储和邮政业	14,900,012.23	3.21
H	住宿和餐饮业	1,852,013.20	0.40
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,413,683.83	2.24
J	金融业	120,571,684.35	25.97
K	房地产业	11,350,895.24	2.44
L	租赁和商务服务业	10,863,620.00	2.34
M	科学研究和技术服务业	6,611,804.80	1.42
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	2,028,603.00	0.44
S	综合	3,232,032.72	0.70
	合计	456,222,895.67	98.26

### 5.3 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

#### 5.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	19,193	39,474,243.10	8.50
2	600036	招商银行	308,722	16,729,645.18	3.60
3	601012	隆基股份	139,118	12,359,243.12	2.66
4	601288	农业银行	3,752,439	11,369,890.17	2.45
5	601888	中国中免	36,200	10,863,620.00	2.34
6	601628	中国人寿	302,725	10,259,350.25	2.21
7	601318	中国平安	156,900	10,085,532.00	2.17
8	601857	中国石油	1,831,958	9,691,057.82	2.09

9	601988	中国银行	2,710,270	8,347,631.60	1.80
10	600276	恒瑞医药	119,616	8,130,299.52	1.75

### 5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	688819	天能股份	7,734	337,898.46	0.07
2	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.04
3	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.03
4	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.02
5	688607	XD 康众医	1,890	84,105.00	0.02

### 5.3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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）	1,272,000.00	0.27
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,272,000.00	0.27

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113050	南银转债	9,600	960,000.00	0.21
2	113051	节能转债	2,560	256,000.00	0.06
3	113049	长汽转债	560	56,000.00	0.01

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“农业银行”的发行主体中国农业银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在向关系人发放信用贷款；批量处置不良资产未公告；批量处置不良资产未向监管部门报告等 24 项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 7 月 13 日对公司做出没收违法所得 55.3 万元，罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2020〕36 号）；由于存在收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费）的违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 7 日对公司做出没收违法所得 49.59 万元，罚款 148.77 万元，罚没合计 198.36 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2020〕66 号）；由于存在：（1）发生重要信息系统突发事件未报告；（2）制卡数据违规明文留存；（3）生产网络、分行无线网络互联网络保护不当；（4）数据安全较粗放，存在数据泄露风险；（5）网络信息系统存在较多漏洞；（6）互联网门户网站泄露敏感信息的违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 1 月 19 日对公司做出罚款 420 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕1 号）。农业银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“中国银行”的发行主体中国银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于“原油宝”产品风险事件中存在的相关违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 1 日对公司做出罚款 5050 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2020〕60 号）；由于存在：向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款；违规向关系人发放信用贷款；向无资金缺口企业发放流动资金贷款；存款月末冲时点；为无真实贸易背景企业签发银行承兑汇票等 36 项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 5 月 17 日对公司做出罚没 8761.355 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕11 号）。中

国银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

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

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余 7 名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6,810.73
2	应收证券清算款	324,591.94
3	应收股利	—
4	应收利息	528.21
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	331,930.88

#### 5.11.4 报告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。



### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 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。

#### 5.11.5.2 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	688819	天能股份	337,898.46	0.07	新股限售
2	688079	美迪凯	195,444.80	0.04	新股限售
3	688345	博力威	129,495.96	0.03	新股限售
4	688621	阳光诺和	95,025.15	0.02	新股限售
5	688607	XD 康众医	84,105.00	0.02	新股限售

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	520,692,565.00
报告期期间基金总申购份额	177,500,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	225,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	473,192,565.00

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	—
报告期期间买入/申购总份额	—
报告期期间卖出/赎回总份额	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	—
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	—

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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
富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2021-04-01 至 2021-06-30	231,986,000.00	23,500,000.00	32,401,200.00	223,084,800.00	47.14%
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>							

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立上证综指交易型开放式指数证券投资基金的文件
- 2、上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、上证综指交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 5、上证综指交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 9.2 存放地点

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

### 9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。  
咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址：  
<http://www.fullgoal.com.cn>。

富国基金管理有限公司  
2021 年 07 月 21 日