

富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
二〇二一年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国工商银行股份有限公司

送出日期： 2022 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

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

1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	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.....	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核报告.....	15
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	17
§5	托管人报告.....	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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 17	
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.....	17
§6	审计报告.....	17
6.1	审计报告基本信息.....	17
6.2	审计报告的基本内容.....	17
§7	年度财务报表.....	20
7.1	资产负债表.....	20
7.2	利润表.....	22
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4	报表附注.....	24
§8	投资组合报告.....	56
8.1	期末基金资产组合情况.....	56
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	56
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.....	58
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	79
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	80

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.....	80
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.....	81
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.....	81
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.....	81
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	81
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	81
8.12	投资组合报告附注.....	82
§9	基金份额持有人信息.....	84
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	84
9.2	期末上市基金前十名持有人.....	84
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	84
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.....	84
§10	开放式基金份额变动.....	85
§11	重大事件揭示.....	85
11.1	基金份额持有人大会决议.....	85
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.....	85
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	85
11.4	基金投资策略的改变.....	85
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	85
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.....	86
11.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	87
11.8	其他重大事件.....	89
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	90
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.....	90
12.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	90
§13	备查文件目录.....	91

§ 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	沪深 800ETF
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，交易型开放式
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	136,526,092.00 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	2021 年	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	21,933,411.12	7,810,058.54
本期利润	18,559,121.50	20,564,960.45
加权平均基金份额本期利润	0.1495	0.2036

本期加权平均净值利润率	10.75%	17.48%
本期基金份额净值增长率	11.34%	30.76%
3.1.2 期末数据和指标	2021年12月31日	2020年12月31日
期末可供分配利润	48,607,532.25	21,566,685.26
期末可供分配基金份额利润	0.3560	0.1760
期末基金资产净值	198,762,344.51	160,220,994.73
期末基金份额净值	1.4559	1.3076
3.1.3 累计期末指标	2021年12月31日	2020年12月31日
基金份额累计净值增长率	45.59%	30.76%

注：

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

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

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

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	2.54%	0.72%	2.01%	0.73%	0.53%	-0.01%
过去六个月	2.87%	0.93%	-2.44%	0.93%	5.31%	0.00%
过去一年	11.34%	1.07%	-0.76%	1.07%	12.10%	0.00%
自基金合同生效起至今	45.59%	1.12%	26.65%	1.16%	18.94%	-0.04%

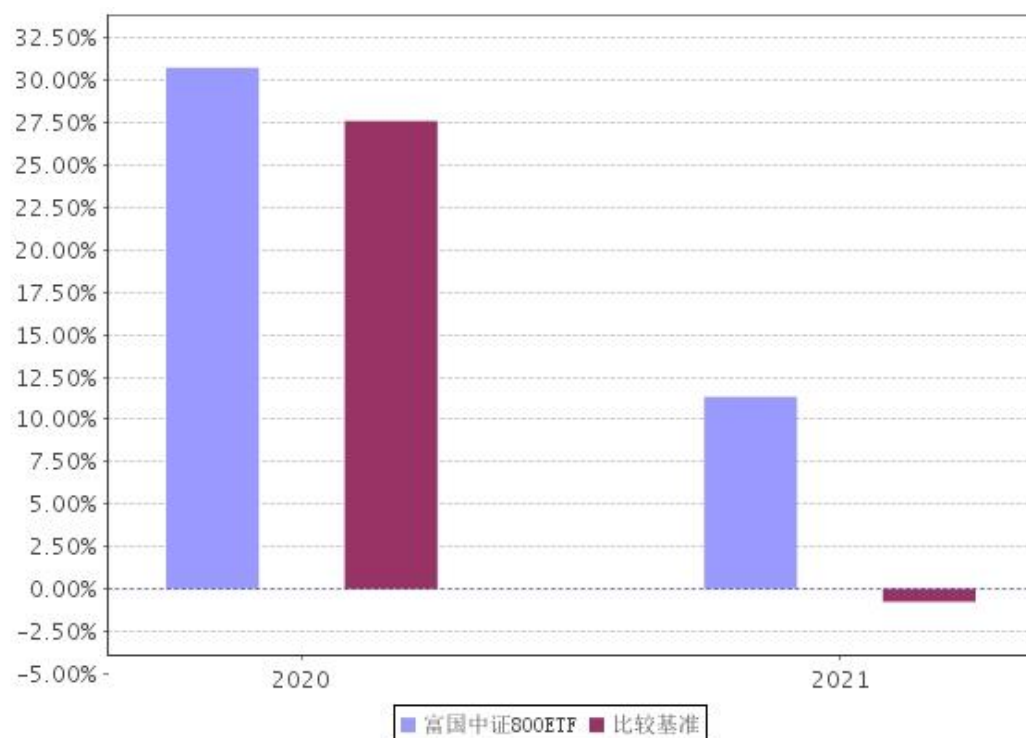
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2021年12月31日。

2、本基金于2020年5月13日成立，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 2021 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 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金(QDII)、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 243 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王乐乐	本基金基金经理	2020-05-13	—	11.6	博士，曾任上海证券有限责任公司研究员，华泰联合证券有限责任公司研究员，华泰证券股份有限公司研究员、创新规划团队负责人；自 2015 年 5 月加入富国基金管理有限公司，历任定量基金经理、量化投资部量化投资总监助理；现任富国基金量化投资部 ETF 投资总监兼高级定量基金经理。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

				<p>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</p>
--	--	--	--	--

					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，2021年5月起任富国中证800银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现3次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年初以来，在国内PMI向好、货币政策不急转弯、美国新一轮财政刺

激落地、国内公募基金发行火爆等消息的推动下，上证指数先后突破 3500、3600 点。随着美国经济复苏预期加强，美国 10 年期国债利率快速突破 1.5%，导致全球投资者对美联储货币政策提前收缩的担忧加大，使得全球股市均出现不同程度的下跌。2 季度，随着国内大宗商品如钢价、煤价迎来调整，通胀预期下降，同时美联储会议并未实质性讨论收紧购债规模，美国 10 年期国债利率进一步走低，市场开启反弹。其中，景气度较高的新能源汽车、光伏、半导体等板块涨幅居前。7 月初，央行宣布下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点，在相对充裕的流动性及靓丽中报业绩的推动下，锂电池产业链、光伏、半导体等板块持续上涨，同时周期板块如有色、化工、煤炭等也表现突出。9 月中旬，随着煤炭等能源价格高企，多部委对煤炭价格重视度提升，周期板块迎来调整。9 月下旬，受个别地产企业信用风险暴露、限电导致经济预期回落、美国财政将触及债务上限、长假效应等因素影响，市场风险偏好大幅降低。11 月中旬，随着公布的金融数据显示新增居民中长贷走强，表明房贷放款边际放松，同时部分银行加强房地产开发贷投放，提振投资者对经济的信心，地产、金融板块迎来大幅反弹。12 月召开的中央经济工作会议进一步释放“稳字当头、稳中求进”的稳增长信号。随着稳增长信号落地，市场迎来休整，各板块轮换加速。

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.4559 元；份额累计净值为 1.4559 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 11.34%，同期业绩比较基准收益率为-0.76%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

几年产业有望迎来爆发的科技板块。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

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

（一）持续推动公司制度建设，优化内部控制体系

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

（二）夯实合规管理架构，强化合规管理职能

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

（三）深入解读新规，持续推进新规落地

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

（四）加强合规培训，全面提升合规意识

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

（五）深入专项审计，抓紧第三道防线

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

（六）立足投资合规监督，系统化助力风控履职

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

（七）持续强化反洗钱工作理念，推动反洗钱工作纵深开展

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

（八）全面加强员工行为管理

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

1、自 2021 年 1 月 21 日至 2021 年 2 月 24 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、本报告期内本基金未出现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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、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本基金 2021 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（2022）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 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附的富国中证 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于富国中证 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	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。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。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。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>	<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>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性</p>

	<p>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。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	蒋燕华 费泽旭
会计师事务所的地址	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
审计报告日期	2022 年 03 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 (2021 年 12 月 31 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
资产：		
银行存款	1,564,937.80	1,483,583.21
结算备付金	22,510.18	14,568.00
存出保证金	7,428.18	35,478.45

交易性金融资产	197,327,090.97	158,869,079.75
其中：股票投资	197,067,741.47	158,740,257.25
基金投资	—	—
债券投资	259,349.50	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	152,028.63	26,916.92
应收利息	195.30	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	199,074,191.06	160,429,806.04
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	(2021年12月31日)	(2020年12月31日)
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	24,937.31	19,336.77
应付托管费	8,312.42	6,445.59
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	38,596.82	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	240,000.00	147,500.00
负债合计	311,846.55	208,811.31
所有者权益：		
实收基金	136,526,092.00	122,526,092.00
未分配利润	62,236,252.51	37,694,902.73
所有者权益合计	198,762,344.51	160,220,994.73
负债和所有者权益总计	199,074,191.06	160,429,806.04

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4559 元，基金份额总额 136,526,092.00 份。

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：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2020 年 5 月 13 日(基 金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日)
一、收入	19,552,796.71	21,655,775.86
1. 利息收入	7,392.82	114,094.19
其中：存款利息收入	7,307.78	114,065.49
债券利息收入	85.04	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）	22,938,301.55	7,946,187.79
其中：股票投资收益	20,064,555.38	7,050,521.60
基金投资收益	—	—
债券投资收益	105,309.80	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	2,768,436.37	858,516.94
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-3,374,289.62	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）	-18,608.04	840,591.97
减：二、费用	993,675.21	1,090,815.41
1. 管理人报酬	259,184.29	111,154.10
2. 托管费	86,394.72	37,051.34
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	187,644.11	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	0.09	0.03
7. 其他费用	460,452.00	313,455.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	18,559,121.50	20,564,960.45
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	18,559,121.50	20,564,960.45

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：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 (2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	122,526,092.00	37,694,902.73	160,220,994.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	18,559,121.50	18,559,121.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	14,000,000.00	5,982,228.28	19,982,228.28
其中：1. 基金申购款	28,000,000.00	11,172,718.79	39,172,718.79
2. 基金赎回款	-14,000,000.00	-5,190,490.51	-19,190,490.51
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）	136,526,092.00	62,236,252.51	198,762,344.51
项目	上年度可比期间(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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人
基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富国中证 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，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2020 年 5 月 13 日正式生效，首次设立募集规模为 248,526,092.00 份基金份额。本基金为契约型，交易型开放式，存续期限不定。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。

本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2021年12月31日的财务状况以及2021年1月1日至2021年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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

允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

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

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

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

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

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

(13) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入；

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
活期存款	1,564,937.80	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	1,564,937.80	1,483,583.21
----	--------------	--------------

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末（2021年12月31日）		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		187,690,478.68	197,067,741.47	9,377,262.79
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	256,000.00	259,349.50	3,349.50
	银行间市场	—	—	—
	合计	256,000.00	259,349.50	3,349.50
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		187,946,478.68	197,327,090.97	9,380,612.29
项目		上年度末（2020年12月31日）		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		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	7,522.50
	银行间市场	—	—	—
	合计	121,300.00	128,822.50	7,522.50
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：本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末(2021年12月31日)	上年度末(2020年12月31日)
应收活期存款利息	171.28	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	11.11	7.26
应收债券利息	9.28	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	3.63	17.49
合计	195.30	179.71

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末(2021年12月31日)	上年度末(2020年12月31日)
交易所市场应付交易费用	38,596.82	35,528.75
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	38,596.82	35,528.75

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末(2021年12月31日)	上年度末(2020年12月31日)
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	—	—
应付证券出借违约金	—	—
IOPV 计算发布费	20,000.00	—
应付指数使用费	70,000.00	35,000.00
预提审计费	30,000.00	50,000.00
预提信息披露费	120,000.00	62,500.00
合计	240,000.00	147,500.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	122,526,092.00	122,526,092.00

本期申购	28,000,000.00	28,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-14,000,000.00	-14,000,000.00
本期末	136,526,092.00	136,526,092.00

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
上年度末	21,566,685.26	16,128,217.47	37,694,902.73
本期利润	21,933,411.12	-3,374,289.62	18,559,121.50
本期基金份额交易产生的变动数	5,107,435.87	874,792.41	5,982,228.28
其中：基金申购款	8,509,234.42	2,663,484.37	11,172,718.79
基金赎回款	-3,401,798.55	-1,788,691.96	-5,190,490.51
本期已分配利润	—	—	—
本期末	48,607,532.25	13,628,720.26	62,236,252.51

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（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	6,409.33	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	768.35	5,718.33
其他	130.10	617.24
合计	7,307.78	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（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（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	19,182,545.44	4,523,878.39
股票投资收益——赎回差价收入	882,009.94	2,526,643.21

股票投资收益——申购差价收入	—	—
合计	20,064,555.38	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(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(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	60,938,604.45	139,907,220.58
减：卖出股票成本总额	41,756,059.01	135,383,342.19
买卖股票差价收入	19,182,545.44	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(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(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	19,190,490.51	268,545,185.21
减：现金支付赎回款总额	8,287,236.51	110,594,882.21
减：赎回股票成本总额	10,021,244.06	155,423,659.79
赎回差价收入	882,009.94	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(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(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	605,796.50	159,468.13
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成	500,400.00	122,300.00

本总额		
减：应收利息总额	86.70	18.88
买卖债券差价收入	105,309.80	37,149.25

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖贵金属交易。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（2020年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	2,768,436.37	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	2,768,436.37	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（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（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	-3,374,289.62	12,754,901.91
股票投资	-3,370,116.62	12,747,379.41
债券投资	-4,173.00	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	-3,374,289.62	12,754,901.91

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年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	-18,608.04	840,591.97
合计	-18,608.04	840,591.97

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年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	187,644.11	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	187,644.11	629,154.48

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年5月13日(基金合同生效日)至2020年12月31日)
审计费用	30,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	62,500.00
证券出借违约金	—	—
其他	170,000.00	112,257.92
银行费用	452.00	236.00
指数使用费	140,000.00	88,461.54
合计	460,452.00	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
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
申万宏源集团股份有限公司	基金管理人的股东的母公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）		上年度可比期间（2020年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（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	11,575,409.68	9.31	51,333,622.94	10.57
申万宏源	22,595,478.84	18.17	133,539,725.00	27.49

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）		上年度可比期间（2020年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（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
海通证券	37,202.70	6.14	47,321.40	29.67
申万宏源	—	—	34,838.10	21.85

7.4.10.1.4 回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	20,591.68	22.01	18,839.67	48.81
海通证券	10,549.09	11.28	8,251.74	21.38
关联方名称	上年度可比期间（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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（2020年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	259,184.29	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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日）	上年度可比期间（2020 年 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	86,394.72	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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末（2021年12月31日）		上期末（2020年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
申万宏源证券有限公司	2,548,200.00	1.87	—	—

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）		上年度可比期间（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	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,564,937.80	6,409.33	1,483,583.21	107,729.92

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2021年01月01日至2021年12月31日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	301039	中集车辆	IPO网下申购	7,912	55,067.52
海通证券股份有限公司	300981	中红医疗	IPO网下申购	1,330	64,624.70
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	300937	药易购	IPO网下申购	2,434	29,816.50

海通证券股份有限公司	688187	时代电气	IPO 网下 申购	2,878	90,763.20
海通证券股份有限公司	688701	卓锦股份	IPO 网下 申购	2,340	17,590.72
海通证券股份有限公司	688217	睿昂基因	IPO 网下 申购	1,040	19,252.58
海通证券股份有限公司	688685	迈信林	IPO 网下 申购	2,612	23,678.04
海通证券股份有限公司	688682	霍莱沃	IPO 网下 申购	883	40,572.61
海通证券股份有限公司	688092	爱科科技	IPO 网下 申购	1,137	21,836.71
海通证券股份有限公司	688626	翔宇医疗	IPO 网下 申购	1,331	38,551.22
海通证券股份有限公司	688329	艾隆科技	IPO 网下 申购	1,846	31,186.42
海通证券股份有限公司	688665	四方光电	IPO 网下 申购	1,518	45,050.67
海通证券股份有限公司	688687	凯因科技	IPO 网下 申购	3,213	61,287.65

金额单位：人民币元

上年度可比期间(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

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

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

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股认购	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	—
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股限售	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	—
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股限售	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	—
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新股限售	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	—
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新股限售	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	—
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新股限售	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	—
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股限售	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	—
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股限售	5.31	13.50	715	3,796.65	9,652.50	—
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	新股限售	14.14	89.87	409	5,783.26	36,756.83	—
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股限售	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	—
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新股限售	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	—
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股限售	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	—
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股限售	22.04	56.28	217	4,782.68	12,212.76	—
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新股限售	23.38	29.93	180	4,208.40	5,387.40	—
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	新股限售	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	—
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股限售	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	—
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新股限售	6.96	12.51	792	5,512.32	9,907.92	—
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股限售	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	—
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股限售	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	—
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新股限售	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	—
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新股限售	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	—
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股限售	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	—
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	新股限售	60.64	234.74	87	5,275.68	20,422.38	—
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	新股限售	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	—
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新股限售	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	—
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股限售	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	—
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股限售	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	—

301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股限售	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	—
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新股限售	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	—
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股限售	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	—
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股限售	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	—
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新股限售	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	—
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新股限售	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	—
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股限售	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	—
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	新股限售	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	—
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	新股限售	33.16	24.67	200	6,632.00	4,934.00	—
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	新股限售	36.50	31.31	227	8,285.50	7,107.37	—
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	新股限售	36.31	35.52	141	5,119.71	5,008.32	—
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	新股限售	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	—
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	新股限售	60.66	96.75	135	8,189.10	13,061.25	—
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	新股限售	66.18	56.62	136	9,000.48	7,700.32	—
688511	天微电子	2021-07-22	2022-02-07	新股限售	28.09	54.52	1,440	40,449.60	78,508.80	—
688707	振华新材	2021-09-06	2022-03-14	新股限售	11.75	47.16	3,794	44,579.50	178,925.04	—

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
110084	贵燃转债	2021-12-28	2022-01-18	认购新发证券	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	—
113052	兴业转债	2021-12-28	2022-01-14	认购新发证券	100.00	100.00	2,360	236,000.00	236,000.00	—
113634	珀莱转债	2021-12-09	2022-01-04	认购新发证券	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	—

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

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	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002683	广东宏大	2021年12月20日	重大事项停牌	30.12	2022年01月04日	31.00	3,100.00	104,106.77	93,372.00	—

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%，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：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
AAA	252,461.20	101,245.40
AAA 以下	6,888.30	27,577.10
未评级	—	—
合计	259,349.50	128,822.50

注：本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的

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

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

本基金本报告期末及上年度末无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、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，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2021年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,564,937.80	—	—	—	—	—	1,564,937.80
结算备付金	22,510.18	—	—	—	—	—	22,510.18
存出保证金	7,428.18	—	—	—	—	—	7,428.18
交易性金融资产	—	—	259,349.50	—	—	197,067,741.47	197,327,090.97
应收证券清算款	—	—	—	—	—	152,028.63	152,028.63
应收利息	—	—	—	—	—	195.30	195.30
资产总计	1,594,876.16	—	259,349.50	—	—	197,219,965.40	199,074,191.06
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	24,937.31	24,937.31
应付托管费	—	—	—	—	—	8,312.42	8,312.42
应付交易费用	—	—	—	—	—	38,596.82	38,596.82
其他负债	—	—	—	—	—	240,000.00	240,000.00
负债总计	—	—	—	—	—	311,846.55	311,846.55
利率敏感度缺口	1,594,876.16	—	259,349.50	—	—	196,908,118.85	198,762,344.51
上年度末（2020年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	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

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

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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（2021年12月31日）		上年度末（2020年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	197,067,741.47	99.15	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	259,349.50	0.13	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	197,327,090.97	99.28	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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	1,972,136.90	1,494,029.13
2. 业绩比较基准减少 1%	-1,972,136.90	-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 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 196,343,225.01 元，属于第二层次的余额为人民币 337,876.49 元，属于第三层次余额为人民币 645,989.47 元（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 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：

上年度末余额人民币 157,847.82 元，2021 年度转入第三层次人民币 0.00 元，转出第三层次人民币 194,503.32 元，当期计入损益的利得或损失总额人民币 459,942.84 元，购买人民币 233,057.18 元，卖出人民币 10,355.05 元，本期末人民币 645,989.47 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 412,932.29 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	197,067,741.47	98.99
	其中：股票	197,067,741.47	98.99
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	259,349.50	0.13
	其中：债券	259,349.50	0.13
	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	1,587,447.98	0.80
8	其他各项资产	159,652.11	0.08
9	合计	199,074,191.06	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	569,911.83	0.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	11,519.99	0.01
F	批发和零售业	27,320.84	0.01

G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
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	31,457.55	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	37,906.44	0.02
S	综合	—	—
	合计	704,076.36	0.35

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	2,154,663.76	1.08
B	采矿业	5,089,147.30	2.56
C	制造业	116,406,946.67	58.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,357,378.30	2.70
E	建筑业	3,404,156.10	1.71
F	批发和零售业	2,402,617.60	1.21
G	交通运输、仓储和邮政业	5,046,615.42	2.54
H	住宿和餐饮业	269,234.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,871,396.70	4.46
J	金融业	34,909,598.46	17.56
K	房地产业	3,846,707.20	1.94
L	租赁和商务服务业	2,578,006.38	1.30
M	科学研究和技术服务业	2,579,223.56	1.30
N	水利、环境和公共设施管理业	412,008.50	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	98,250.00	0.05
Q	卫生和社会工作	1,546,998.36	0.78
R	文化、体育和娱乐业	1,049,058.80	0.53
S	综合	341,658.00	0.17
	合计	196,363,665.11	98.79

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	4,200	8,610,000.00	4.33
2	300750	宁德时代	9,300	5,468,400.00	2.75
3	600036	招商银行	83,600	4,072,156.00	2.05
4	601318	中国平安	73,100	3,684,971.00	1.85
5	000858	五粮液	13,100	2,916,846.00	1.47
6	601012	隆基股份	29,280	2,523,936.00	1.27
7	000333	美的集团	33,000	2,435,730.00	1.23
8	300059	东方财富	55,756	2,069,105.16	1.04
9	601166	兴业银行	98,100	1,867,824.00	0.94
10	600900	长江电力	76,700	1,741,090.00	0.88
11	600887	伊利股份	40,900	1,695,714.00	0.85
12	002594	比亚迪	6,200	1,662,344.00	0.84
13	002415	海康威视	31,500	1,648,080.00	0.83
14	002475	立讯精密	33,320	1,639,344.00	0.82
15	603259	药明康德	13,632	1,616,482.56	0.81
16	600276	恒瑞医药	30,272	1,535,093.12	0.77
17	600030	中信证券	57,500	1,518,575.00	0.76
18	601888	中国中免	6,568	1,441,084.88	0.73
19	000568	泸州老窖	4,900	1,243,963.00	0.63
20	300760	迈瑞医疗	3,200	1,218,560.00	0.61
21	000651	格力电器	31,900	1,181,257.00	0.59
22	601398	工商银行	236,500	1,094,995.00	0.55
23	603501	韦尔股份	3,500	1,087,695.00	0.55
24	600809	山西汾酒	3,440	1,086,283.20	0.55
25	000001	平安银行	65,500	1,079,440.00	0.54
26	600309	万华化学	10,600	1,070,600.00	0.54
27	002142	宁波银行	26,770	1,024,755.60	0.52
28	000725	京东方A	202,400	1,022,120.00	0.51
29	300274	阳光电源	7,000	1,020,600.00	0.51
30	002714	牧原股份	17,746	946,926.56	0.48
31	601899	紫金矿业	97,200	942,840.00	0.47
32	600436	片仔癀	2,100	918,015.00	0.46
33	600031	三一重工	40,100	914,280.00	0.46
34	002352	顺丰控股	13,200	909,744.00	0.46
35	000002	万科A	45,900	906,984.00	0.46
36	300014	亿纬锂能	7,671	906,558.78	0.46

37	002812	恩捷股份	3,600	901,440.00	0.45
38	603288	海天味业	8,460	889,230.60	0.45
39	002241	歌尔股份	16,100	871,010.00	0.44
40	601328	交通银行	185,400	854,694.00	0.43
41	300124	汇川技术	12,250	840,350.00	0.42
42	600438	通威股份	18,300	822,768.00	0.41
43	600837	海通证券	65,200	799,352.00	0.40
44	601919	中远海控	42,750	798,997.50	0.40
45	002460	赣锋锂业	5,400	771,390.00	0.39
46	300015	爱尔眼科	18,237	771,060.36	0.39
47	600690	海尔智家	25,600	765,184.00	0.38
48	600048	保利发展	48,500	758,055.00	0.38
49	600406	国电南瑞	18,700	748,561.00	0.38
50	002466	天齐锂业	6,900	738,300.00	0.37
51	000063	中兴通讯	21,500	720,250.00	0.36
52	603799	华友钴业	6,500	717,015.00	0.36
53	601668	中国建筑	141,600	708,000.00	0.36
54	601288	农业银行	236,800	696,192.00	0.35
55	002304	洋河股份	4,200	691,866.00	0.35
56	688981	中芯国际	12,900	683,571.00	0.34
57	600000	浦发银行	79,300	676,429.00	0.34
58	600111	北方稀土	14,700	673,260.00	0.34
59	300122	智飞生物	5,400	672,840.00	0.34
60	600585	海螺水泥	16,200	652,860.00	0.33
61	600016	民生银行	167,400	652,860.00	0.33
62	002049	紫光国微	2,900	652,500.00	0.33
63	002230	科大讯飞	12,400	651,124.00	0.33
64	600104	上汽集团	31,400	647,782.00	0.33
65	601816	京沪高铁	132,500	639,975.00	0.32
66	002129	中环股份	15,300	638,775.00	0.32
67	603986	兆易创新	3,600	633,060.00	0.32
68	002271	东方雨虹	11,900	626,892.00	0.32
69	601601	中国太保	23,100	626,472.00	0.32
70	002371	北方华创	1,800	624,636.00	0.31
71	600745	闻泰科技	4,800	620,640.00	0.31
72	601688	华泰证券	34,800	618,048.00	0.31
73	000661	长春高新	2,200	597,080.00	0.30
74	300142	沃森生物	10,600	595,720.00	0.30
75	000100	TCL 科技	94,600	583,682.00	0.29
76	300498	温氏股份	30,060	578,955.60	0.29
77	000338	潍柴动力	32,000	572,480.00	0.29

78	600893	航发动力	8,900	564,794.00	0.28
79	002027	分众传媒	68,200	558,558.00	0.28
80	601211	国泰君安	30,400	543,856.00	0.27
81	300450	先导智能	7,300	542,901.00	0.27
82	601088	中国神华	22,300	502,196.00	0.25
83	601766	中国中车	82,000	499,380.00	0.25
84	600050	中国联通	125,400	492,822.00	0.25
85	000776	广发证券	20,000	491,800.00	0.25
86	600570	恒生电子	7,898	490,860.70	0.25
87	601229	上海银行	67,100	478,423.00	0.24
88	600919	江苏银行	79,800	465,234.00	0.23
89	300782	卓胜微	1,400	457,520.00	0.23
90	300347	泰格医药	3,500	447,300.00	0.23
91	002709	天赐材料	3,900	447,135.00	0.22
92	601169	北京银行	99,900	443,556.00	0.22
93	600660	福耀玻璃	9,400	443,116.00	0.22
94	600999	招商证券	24,970	440,720.50	0.22
95	688599	天合光能	5,500	433,950.00	0.22
96	601988	中国银行	142,200	433,710.00	0.22
97	600905	三峡能源	57,700	433,327.00	0.22
98	600019	宝钢股份	60,100	430,316.00	0.22
99	600010	包钢股份	153,800	429,102.00	0.22
100	601669	中国电建	51,600	416,928.00	0.21
101	600958	东方证券	28,200	415,668.00	0.21
102	002311	海大集团	5,600	410,480.00	0.21
103	002410	广联达	6,400	409,472.00	0.21
104	601633	长城汽车	8,300	402,882.00	0.20
105	601390	中国中铁	68,700	397,773.00	0.20
106	600196	复星医药	8,100	396,414.00	0.20
107	600588	用友网络	11,040	396,115.20	0.20
108	601877	正泰电器	7,300	393,397.00	0.20
109	601985	中国核电	47,200	391,760.00	0.20
110	002821	凯莱英	900	391,500.00	0.20
111	000625	长安汽车	25,680	390,079.20	0.20
112	002459	晶澳科技	4,200	389,340.00	0.20
113	000166	申万宏源	76,000	389,120.00	0.20
114	002179	中航光电	3,800	382,128.00	0.19
115	600028	中国石化	90,200	381,546.00	0.19
116	300408	三环集团	8,500	379,100.00	0.19
117	000538	云南白药	3,600	376,740.00	0.19
118	601658	邮储银行	73,400	374,340.00	0.19

119	002493	荣盛石化	20,500	372,280.00	0.19
120	601818	光大银行	111,600	370,512.00	0.19
121	603659	璞泰来	2,300	369,403.00	0.19
122	000895	双汇发展	11,600	365,980.00	0.18
123	601377	兴业证券	36,100	356,668.00	0.18
124	603806	福斯特	2,680	349,874.00	0.18
125	688111	金山办公	1,300	344,500.00	0.17
126	000768	中航西飞	9,300	339,450.00	0.17
127	601628	中国人寿	11,200	337,008.00	0.17
128	002340	格林美	32,200	333,270.00	0.17
129	600346	恒力石化	14,300	328,471.00	0.17
130	002001	新和成	10,420	324,270.40	0.16
131	601989	中国重工	76,800	324,096.00	0.16
132	601600	中国铝业	52,900	322,161.00	0.16
133	601857	中国石油	65,600	322,096.00	0.16
134	601225	陕西煤业	26,200	319,640.00	0.16
135	600763	通策医疗	1,600	318,400.00	0.16
136	601138	工业富联	26,700	318,264.00	0.16
137	600426	华鲁恒升	10,030	313,939.00	0.16
138	002008	大族激光	5,700	307,800.00	0.15
139	002050	三花智控	12,130	306,889.00	0.15
140	002202	金风科技	18,600	306,342.00	0.15
141	300433	蓝思科技	13,300	305,634.00	0.15
142	600009	上海机场	6,500	303,485.00	0.15
143	601009	南京银行	33,800	302,848.00	0.15
144	600741	华域汽车	10,700	302,810.00	0.15
145	600150	中国船舶	12,100	299,959.00	0.15
146	300316	晶盛机电	4,300	298,850.00	0.15
147	000733	振华科技	2,400	298,272.00	0.15
148	600176	中国巨石	16,202	294,876.40	0.15
149	600011	华能国际	29,700	287,793.00	0.14
150	300413	芒果超媒	5,000	286,100.00	0.14
151	300601	康泰生物	2,900	285,766.00	0.14
152	601100	恒立液压	3,492	285,645.60	0.14
153	001979	招商蛇口	21,400	285,476.00	0.14
154	002236	大华股份	12,100	284,108.00	0.14
155	600522	中天科技	16,600	281,536.00	0.14
156	000723	美锦能源	17,100	277,533.00	0.14
157	601615	明阳智能	10,500	274,050.00	0.14
158	600157	永泰能源	149,700	272,454.00	0.14
159	600760	中航沈飞	3,940	268,077.60	0.13

160	300896	爱美客	500	268,055.00	0.13
161	688036	传音控股	1,700	266,730.00	0.13
162	603993	洛阳钼业	47,600	265,608.00	0.13
163	601939	建设银行	45,300	265,458.00	0.13
164	600399	抚顺特钢	10,600	262,562.00	0.13
165	600885	宏发股份	3,500	261,240.00	0.13
166	600584	长电科技	8,400	260,568.00	0.13
167	600989	宝丰能源	14,900	258,664.00	0.13
168	600132	重庆啤酒	1,700	257,244.00	0.13
169	600884	杉杉股份	7,840	256,916.80	0.13
170	601006	大秦铁路	40,100	256,640.00	0.13
171	600926	杭州银行	20,000	256,400.00	0.13
172	002602	世纪华通	30,080	252,371.20	0.13
173	688008	澜起科技	3,000	251,610.00	0.13
174	601066	中信建投	8,600	251,550.00	0.13
175	000009	中国宝安	17,400	251,082.00	0.13
176	003816	中国广核	79,700	249,461.00	0.13
177	002384	东山精密	9,200	249,320.00	0.13
178	000977	浪潮信息	6,900	247,227.00	0.12
179	000786	北新建材	6,900	247,227.00	0.12
180	601117	中国化学	20,500	246,000.00	0.12
181	601360	三六零	19,200	244,224.00	0.12
182	601186	中国铁建	31,000	241,800.00	0.12
183	603486	科沃斯	1,600	241,520.00	0.12
184	000963	华东医药	6,000	241,200.00	0.12
185	002555	三七互娱	8,900	240,478.00	0.12
186	000157	中联重科	33,400	239,478.00	0.12
187	601868	中国能建	87,600	239,148.00	0.12
188	002013	中航机电	13,100	238,158.00	0.12
189	600600	青岛啤酒	2,400	237,600.00	0.12
190	300037	新宙邦	2,100	237,300.00	0.12
191	002385	大北农	22,400	234,976.00	0.12
192	601555	东吴证券	26,520	234,967.20	0.12
193	600015	华夏银行	41,600	232,960.00	0.12
194	600029	南方航空	34,200	232,902.00	0.12
195	600563	法拉电子	1,000	232,400.00	0.12
196	000876	新希望	15,200	231,192.00	0.12
197	300285	国瓷材料	5,400	229,878.00	0.12
198	002268	卫士通	4,100	229,354.00	0.12
199	600547	山东黄金	12,160	228,851.20	0.12
200	002601	龙佰集团	8,000	228,720.00	0.12

201	603369	今世缘	4,200	228,480.00	0.11
202	300759	康龙化成	1,600	226,032.00	0.11
203	002736	国信证券	19,500	223,860.00	0.11
204	601238	广汽集团	14,700	223,293.00	0.11
205	600352	浙江龙盛	17,600	222,288.00	0.11
206	000425	徐工机械	36,900	221,031.00	0.11
207	300088	长信科技	16,500	219,120.00	0.11
208	000938	紫光股份	9,580	218,903.00	0.11
209	601901	方正证券	27,800	217,952.00	0.11
210	601336	新华保险	5,600	217,728.00	0.11
211	300033	同花顺	1,500	216,870.00	0.11
212	600886	国投电力	18,800	215,636.00	0.11
213	002007	华兰生物	7,400	215,636.00	0.11
214	688012	中微公司	1,700	215,220.00	0.11
215	603019	中科曙光	7,700	212,289.00	0.11
216	603882	金城医学	1,900	211,603.00	0.11
217	600085	同仁堂	4,600	206,908.00	0.10
218	002028	思源电气	4,200	206,682.00	0.10
219	601799	星宇股份	1,000	204,250.00	0.10
220	601800	中国交建	23,800	204,204.00	0.10
221	605358	立昂微	1,700	204,017.00	0.10
222	600256	广汇能源	30,900	202,086.00	0.10
223	600765	中航重机	4,000	201,960.00	0.10
224	002180	纳思达	4,200	200,592.00	0.10
225	002938	鹏鼎控股	4,700	199,421.00	0.10
226	600298	安琪酵母	3,300	199,188.00	0.10
227	300595	欧普康视	3,460	198,500.20	0.10
228	601916	浙商银行	56,400	197,400.00	0.10
229	600383	金地集团	15,200	197,144.00	0.10
230	000783	长江证券	26,100	196,794.00	0.10
231	688005	容百科技	1,700	196,486.00	0.10
232	601788	光大证券	13,100	195,583.00	0.10
233	300628	亿联网络	2,400	195,480.00	0.10
234	688099	晶晨股份	1,500	195,300.00	0.10
235	000596	古井贡酒	800	195,200.00	0.10
236	000069	华侨城A	27,700	195,008.00	0.10
237	300253	卫宁健康	11,600	194,416.00	0.10
238	600141	兴发集团	5,100	193,188.00	0.10
239	600862	中航高科	5,400	193,104.00	0.10
240	300003	乐普医疗	8,500	192,355.00	0.10
241	002185	华天科技	15,100	191,921.00	0.10

242	601865	福莱特	3,300	191,202.00	0.10
243	600795	国电电力	60,100	190,517.00	0.10
244	600487	亨通光电	12,600	190,512.00	0.10
245	600115	中国东航	36,900	190,404.00	0.10
246	000988	华工科技	6,800	189,448.00	0.10
247	603833	欧派家居	1,280	188,800.00	0.09
248	601108	财通证券	16,900	187,928.00	0.09
249	300363	博腾股份	2,100	187,845.00	0.09
250	000301	东方盛虹	9,700	187,598.00	0.09
251	002841	视源股份	2,300	187,220.00	0.09
252	600918	中泰证券	18,700	186,439.00	0.09
253	601636	旗滨集团	10,900	186,390.00	0.09
254	603456	九洲药业	3,300	185,658.00	0.09
255	002252	上海莱士	27,200	185,504.00	0.09
256	600109	国金证券	16,300	184,679.00	0.09
257	601618	中国中冶	48,100	184,223.00	0.09
258	600183	生益科技	7,800	183,690.00	0.09
259	601111	中国国航	20,100	183,513.00	0.09
260	300999	金龙鱼	2,900	182,497.00	0.09
261	600392	盛和资源	9,200	180,504.00	0.09
262	300058	蓝色光标	16,700	179,191.00	0.09
263	601155	新城控股	6,100	177,693.00	0.09
264	600418	江淮汽车	10,200	177,480.00	0.09
265	300699	光威复材	2,100	177,408.00	0.09
266	603589	口子窖	2,500	177,175.00	0.09
267	601838	成都银行	14,600	175,200.00	0.09
268	601168	西部矿业	12,800	174,208.00	0.09
269	300223	北京君正	1,300	174,200.00	0.09
270	000630	铜陵有色	49,700	172,956.00	0.09
271	603160	汇顶科技	1,600	172,432.00	0.09
272	600486	扬农化工	1,300	170,560.00	0.09
273	600754	锦江酒店	2,900	169,940.00	0.09
274	600038	中直股份	2,100	168,630.00	0.08
275	000066	中国长城	11,900	168,504.00	0.08
276	300474	景嘉微	1,100	167,420.00	0.08
277	300136	信维通信	6,600	167,112.00	0.08
278	600516	方大炭素	15,440	167,060.80	0.08
279	002797	第一创业	22,700	166,164.00	0.08
280	300529	健帆生物	3,100	165,230.00	0.08
281	000998	隆平高科	7,100	165,146.00	0.08
282	601966	玲珑轮胎	4,500	164,475.00	0.08

283	601689	拓普集团	3,100	164,300.00	0.08
284	603893	瑞芯微	1,200	164,280.00	0.08
285	002138	顺络电子	4,300	164,174.00	0.08
286	603517	绝味食品	2,400	163,992.00	0.08
287	688169	石头科技	200	162,600.00	0.08
288	300308	中际旭创	3,800	161,500.00	0.08
289	603899	晨光文具	2,500	161,275.00	0.08
290	603613	国联股份	1,500	161,250.00	0.08
291	601077	渝农商行	41,800	160,930.00	0.08
292	600332	白云山	4,700	160,740.00	0.08
293	600875	东方电气	7,500	160,650.00	0.08
294	600489	中金黄金	19,500	160,485.00	0.08
295	002624	完美世界	7,900	160,449.00	0.08
296	002120	韵达股份	7,840	160,406.40	0.08
297	002353	杰瑞股份	4,000	160,000.00	0.08
298	002916	深南电路	1,300	158,366.00	0.08
299	000728	国元证券	20,550	158,235.00	0.08
300	000703	恒逸石化	14,880	158,025.60	0.08
301	002080	中材科技	4,600	156,492.00	0.08
302	600362	江西铜业	7,000	156,310.00	0.08
303	601607	上海医药	7,800	154,986.00	0.08
304	002223	鱼跃医疗	4,100	154,980.00	0.08
305	002409	雅克科技	1,900	154,223.00	0.08
306	002414	高德红外	6,364	154,072.44	0.08
307	300146	汤臣倍健	5,700	153,672.00	0.08
308	688536	思瑞浦	200	153,600.00	0.08
309	002212	天融信	8,000	153,360.00	0.08
310	300144	宋城演艺	10,640	152,364.80	0.08
311	600143	金发科技	12,100	152,218.00	0.08
312	600233	圆通速递	9,100	151,788.00	0.08
313	603392	万泰生物	680	150,620.00	0.08
314	002568	百润股份	2,500	149,575.00	0.08
315	688561	奇安信	1,700	149,464.00	0.08
316	600079	人福医药	6,600	148,632.00	0.07
317	300724	捷佳伟创	1,300	148,590.00	0.07
318	300418	昆仑万维	6,400	148,160.00	0.07
319	600872	中炬高新	3,900	148,083.00	0.07
320	000519	中兵红箭	5,500	146,685.00	0.07
321	601990	南京证券	14,800	146,668.00	0.07
322	000636	风华高科	4,900	146,020.00	0.07
323	600733	北汽蓝谷	14,500	145,290.00	0.07

324	002673	西部证券	18,000	145,260.00	0.07
325	002044	美年健康	18,500	145,225.00	0.07
326	603260	合盛硅业	1,100	145,167.00	0.07
327	600845	宝信软件	2,380	144,775.40	0.07
328	000739	普洛药业	4,100	143,869.00	0.07
329	000547	航天发展	8,600	143,620.00	0.07
330	603267	鸿远电子	800	143,552.00	0.07
331	600188	兖矿能源	6,100	143,533.00	0.07
332	600705	中航产融	36,100	143,317.00	0.07
333	600061	国投资本	17,356	142,666.32	0.07
334	002439	启明星辰	5,000	142,650.00	0.07
335	000932	华菱钢铁	27,800	142,058.00	0.07
336	601021	春秋航空	2,500	142,000.00	0.07
337	603077	和邦生物	41,600	141,856.00	0.07
338	600482	中国动力	7,200	141,840.00	0.07
339	300677	英科医疗	2,450	141,708.00	0.07
340	300296	利亚德	13,800	141,450.00	0.07
341	000807	云铝股份	12,600	140,742.00	0.07
342	000039	中集集团	8,200	140,712.00	0.07
343	600699	均胜电子	6,400	140,608.00	0.07
344	002600	领益智造	19,100	140,576.00	0.07
345	600739	辽宁成大	7,200	140,544.00	0.07
346	600529	山东药玻	3,200	140,480.00	0.07
347	002444	巨星科技	4,600	140,346.00	0.07
348	002507	涪陵榨菜	3,700	139,860.00	0.07
349	000708	中信特钢	6,800	139,264.00	0.07
350	300763	锦浪科技	600	138,930.00	0.07
351	601878	浙商证券	10,500	138,390.00	0.07
352	603939	益丰药房	2,500	137,775.00	0.07
353	300558	贝达药业	1,700	135,711.00	0.07
354	601728	中国电信	31,300	135,529.00	0.07
355	002465	海格通信	12,400	135,408.00	0.07
356	002557	洽洽食品	2,200	134,992.00	0.07
357	688208	道通科技	1,700	134,980.00	0.07
358	002030	达安基因	6,672	133,840.32	0.07
359	600161	天坛生物	4,620	133,795.20	0.07
360	000738	航发控制	4,400	133,232.00	0.07
361	000960	锡业股份	6,800	132,804.00	0.07
362	601016	节能风电	20,300	132,153.00	0.07
363	600521	华海药业	6,100	132,126.00	0.07
364	300676	华大基因	1,500	131,700.00	0.07

365	603338	浙江鼎力	1,640	131,626.40	0.07
366	600637	东方明珠	13,900	131,355.00	0.07
367	002273	水晶光电	7,500	130,425.00	0.07
368	600988	赤峰黄金	8,700	129,630.00	0.07
369	600177	雅戈尔	18,800	129,532.00	0.07
370	688126	沪硅产业	5,000	129,100.00	0.06
371	688065	凯赛生物	700	128,996.00	0.06
372	600549	厦门钨业	5,700	128,991.00	0.06
373	600018	上港集团	23,500	128,780.00	0.06
374	600732	爱旭股份	5,500	128,480.00	0.06
375	300751	迈为股份	200	128,460.00	0.06
376	002791	坚朗五金	700	127,113.00	0.06
377	601198	东兴证券	10,900	126,767.00	0.06
378	688002	睿创微纳	1,608	126,340.56	0.06
379	002078	太阳纸业	10,900	125,241.00	0.06
380	603605	珀莱雅	600	124,986.00	0.06
381	600704	物产中大	21,000	124,320.00	0.06
382	600201	生物股份	7,600	124,260.00	0.06
383	601696	中银证券	9,200	123,740.00	0.06
384	601128	常熟银行	18,500	122,285.00	0.06
385	300383	光环新网	8,200	121,688.00	0.06
386	600642	申能股份	16,500	121,605.00	0.06
387	600879	航天电子	14,700	121,128.00	0.06
388	002299	圣农发展	5,000	120,850.00	0.06
389	002156	通富微电	6,200	120,466.00	0.06
390	300357	我武生物	2,100	120,330.00	0.06
391	600497	驰宏锌锗	23,900	119,261.00	0.06
392	601216	君正集团	22,800	119,244.00	0.06
393	601162	天风证券	29,300	118,665.00	0.06
394	600369	西南证券	22,400	118,496.00	0.06
395	600027	华电国际	22,000	117,700.00	0.06
396	000830	鲁西化工	7,700	117,502.00	0.06
397	600160	巨化股份	9,100	117,481.00	0.06
398	600372	中航电子	5,200	116,428.00	0.06
399	002092	中泰化学	12,200	116,388.00	0.06
400	000623	吉林敖东	6,300	116,361.00	0.06
401	688521	芯原股份	1,500	116,040.00	0.06
402	600039	四川路桥	9,600	115,584.00	0.06
403	603127	昭衍新药	1,000	115,430.00	0.06
404	002508	老板电器	3,200	115,264.00	0.06
405	000983	山西焦煤	13,910	115,035.70	0.06

406	002739	万达电影	7,400	114,552.00	0.06
407	600580	卧龙电驱	6,200	113,398.00	0.06
408	600316	洪都航空	2,900	113,274.00	0.06
409	002985	北摩高科	940	113,232.40	0.06
410	600606	绿地控股	25,915	112,471.10	0.06
411	000629	攀钢钒钛	28,900	112,421.00	0.06
412	300618	寒锐钴业	1,400	112,252.00	0.06
413	002131	利欧股份	45,600	112,176.00	0.06
414	601997	贵阳银行	17,200	111,972.00	0.06
415	600118	中国卫星	4,100	111,315.00	0.06
416	603198	迎驾贡酒	1,600	111,120.00	0.06
417	002249	大洋电机	12,600	110,754.00	0.06
418	600859	王府井	4,100	110,700.00	0.06
419	002373	千方科技	7,400	110,630.00	0.06
420	300115	长盈精密	5,540	109,913.60	0.06
421	688396	华润微	1,700	109,820.00	0.06
422	300017	网宿科技	16,400	109,716.00	0.06
423	000400	许继电气	4,200	109,620.00	0.06
424	002603	以岭药业	5,580	109,368.00	0.06
425	002936	郑州银行	34,529	109,111.64	0.05
426	000887	中鼎股份	5,000	109,050.00	0.05
427	000825	太钢不锈	15,400	108,416.00	0.05
428	600170	上海建工	30,100	108,360.00	0.05
429	600655	豫园股份	10,500	108,150.00	0.05
430	000050	深天马A	8,300	108,066.00	0.05
431	002422	科伦药业	5,700	107,901.00	0.05
432	300070	碧水源	15,000	107,850.00	0.05
433	600166	福田汽车	31,100	106,984.00	0.05
434	002191	劲嘉股份	7,000	105,910.00	0.05
435	000750	国海证券	25,700	105,627.00	0.05
436	603218	日月股份	3,200	105,440.00	0.05
437	603707	健友股份	2,510	105,420.00	0.05
438	002926	华西证券	10,700	105,395.00	0.05
439	600867	通化东宝	9,600	105,216.00	0.05
440	600153	建发股份	11,600	105,212.00	0.05
441	600536	中国软件	2,100	104,853.00	0.05
442	002372	伟星新材	4,300	104,576.00	0.05
443	000513	丽珠集团	2,600	104,546.00	0.05
444	002506	协鑫集成	27,500	104,500.00	0.05
445	300001	特锐德	4,200	104,454.00	0.05
446	300168	万达信息	8,000	104,160.00	0.05

447	002024	苏宁易购	25,200	103,824.00	0.05
448	600909	华安证券	19,040	103,006.40	0.05
449	601995	中金公司	2,100	102,963.00	0.05
450	000027	深圳能源	12,700	102,870.00	0.05
451	600803	新奥股份	5,600	102,816.00	0.05
452	002266	浙富控股	14,400	102,528.00	0.05
453	300866	安克创新	1,000	102,500.00	0.05
454	002157	正邦科技	10,600	102,396.00	0.05
455	002056	横店东磁	5,400	101,898.00	0.05
456	002002	鸿达兴业	16,800	101,808.00	0.05
457	300009	安科生物	7,772	101,735.48	0.05
458	300251	光线传媒	7,900	101,515.00	0.05
459	600236	桂冠电力	15,800	101,436.00	0.05
460	600008	首创环保	29,730	101,379.30	0.05
461	000021	深科技	6,400	101,376.00	0.05
462	300212	易华录	2,860	101,101.00	0.05
463	300244	迪安诊断	3,000	100,710.00	0.05
464	002065	东华软件	12,900	100,620.00	0.05
465	600271	航天信息	7,500	100,425.00	0.05
466	603195	公牛集团	600	100,380.00	0.05
467	600066	宇通客车	9,100	100,282.00	0.05
468	002152	广电运通	8,400	99,960.00	0.05
469	600258	首旅酒店	3,800	99,294.00	0.05
470	601933	永辉超市	24,500	99,225.00	0.05
471	000975	银泰黄金	11,280	99,038.40	0.05
472	002408	齐翔腾达	9,400	98,700.00	0.05
473	600535	天士力	6,200	98,270.00	0.05
474	002607	中公教育	12,500	98,250.00	0.05
475	002221	东华能源	7,800	98,202.00	0.05
476	002203	海亮股份	7,900	98,197.00	0.05
477	002572	索菲亚	4,400	97,680.00	0.05
478	600171	上海贝岭	3,800	97,508.00	0.05
479	601881	中国银河	8,700	97,353.00	0.05
480	000656	金科股份	21,700	97,216.00	0.05
481	603568	伟明环保	2,650	96,804.50	0.05
482	600848	上海临港	6,460	96,060.20	0.05
483	002064	华峰化学	9,200	96,048.00	0.05
484	000997	新大陆	5,300	96,036.00	0.05
485	603156	养元饮品	3,380	96,025.80	0.05
486	600348	华阳股份	8,100	95,985.00	0.05
487	002500	山西证券	14,540	95,964.00	0.05

488	601998	中信银行	20,600	95,172.00	0.05
489	300026	红日药业	12,100	94,743.00	0.05
490	600998	九州通	6,400	94,208.00	0.05
491	300630	普利制药	1,706	93,898.24	0.05
492	300024	机器人	8,400	93,828.00	0.05
493	601005	重庆钢铁	44,800	93,632.00	0.05
494	002683	广东宏大	3,100	93,372.00	0.05
495	600315	上海家化	2,300	92,943.00	0.05
496	000999	华润三九	2,700	92,448.00	0.05
497	000878	云南铜业	6,900	92,253.00	0.05
498	601699	潞安环能	8,100	91,611.00	0.05
499	000537	广宇发展	3,800	91,580.00	0.05
500	000970	中科三环	5,700	91,485.00	0.05
501	000012	南玻A	9,200	91,356.00	0.05
502	002127	南极电商	13,200	91,080.00	0.05
503	603712	七一二	2,100	90,930.00	0.05
504	002745	木林森	6,000	90,780.00	0.05
505	600801	华新水泥	4,700	90,710.00	0.05
506	600673	东阳光	10,200	90,576.00	0.05
507	300315	掌趣科技	18,600	90,396.00	0.05
508	002195	二三四五	38,600	90,324.00	0.05
509	002250	联化科技	5,000	89,850.00	0.05
510	601319	中国人保	19,100	89,770.00	0.05
511	600415	小商品城	18,500	89,725.00	0.05
512	601872	招商轮船	21,880	89,708.00	0.05
513	002153	石基信息	3,100	89,094.00	0.04
514	603233	大参林	2,100	88,431.00	0.04
515	002019	亿帆医药	5,000	88,100.00	0.04
516	300182	捷成股份	13,900	87,987.00	0.04
517	002511	中顺洁柔	5,200	86,892.00	0.04
518	600970	中材国际	7,600	86,868.00	0.04
519	600863	内蒙华电	22,000	86,680.00	0.04
520	688009	中国通号	17,400	86,652.00	0.04
521	000690	宝新能源	14,600	86,432.00	0.04
522	600208	新湖中宝	29,000	86,420.00	0.04
523	300482	万孚生物	2,190	86,242.20	0.04
524	600511	国药股份	2,700	85,131.00	0.04
525	300463	迈克生物	2,900	84,651.00	0.04
526	600498	烽火通信	4,700	84,506.00	0.04
527	000060	中金岭南	17,200	84,452.00	0.04
528	603444	吉比特	200	84,370.00	0.04

529	603858	步长制药	4,000	84,360.00	0.04
530	002831	裕同科技	2,500	84,225.00	0.04
531	600517	国网英大	11,500	83,835.00	0.04
532	600380	健康元	6,500	83,460.00	0.04
533	601778	晶科科技	9,700	82,741.00	0.04
534	000930	中粮科技	7,600	82,612.00	0.04
535	601866	中远海发	25,400	82,550.00	0.04
536	000686	东北证券	9,400	82,532.00	0.04
537	002505	鹏都农牧	21,500	82,130.00	0.04
538	600839	四川长虹	24,800	82,088.00	0.04
539	002294	信立泰	3,000	81,960.00	0.04
540	600155	华创阳安	8,200	81,672.00	0.04
541	002939	长城证券	6,300	81,585.00	0.04
542	600390	五矿资本	15,200	80,864.00	0.04
543	600667	太极实业	10,000	80,800.00	0.04
544	002701	奥瑞金	11,500	80,500.00	0.04
545	000729	燕京啤酒	9,500	80,465.00	0.04
546	000401	冀东水泥	6,700	80,132.00	0.04
547	600718	东软集团	5,900	80,004.00	0.04
548	601992	金隅集团	28,100	79,804.00	0.04
549	600025	华能水电	12,100	79,739.00	0.04
550	600500	中化国际	9,300	79,608.00	0.04
551	603658	安图生物	1,440	79,286.40	0.04
552	600895	张江高科	5,200	78,312.00	0.04
553	600728	佳都科技	9,400	78,302.00	0.04
554	603638	艾迪精密	2,440	77,884.80	0.04
555	002396	星网锐捷	3,300	77,781.00	0.04
556	002004	华邦健康	10,700	77,468.00	0.04
557	300376	易事特	7,700	77,385.00	0.04
558	002128	电投能源	5,200	77,220.00	0.04
559	601179	中国西电	13,900	77,145.00	0.04
560	688188	柏楚电子	200	77,092.00	0.04
561	600216	浙江医药	4,500	76,860.00	0.04
562	601898	中煤能源	12,200	76,738.00	0.04
563	600282	南钢股份	20,700	76,590.00	0.04
564	002966	苏州银行	11,300	76,501.00	0.04
565	000598	兴蓉环境	12,100	76,472.00	0.04
566	002174	游族网络	5,000	76,200.00	0.04
567	603290	斯达半导	200	76,200.00	0.04
568	603866	桃李面包	2,680	76,112.00	0.04
569	601236	红塔证券	6,380	76,049.60	0.04

570	002532	天山铝业	9,300	75,795.00	0.04
571	603225	新凤鸣	5,100	75,735.00	0.04
572	600158	中体产业	5,000	75,600.00	0.04
573	300072	三聚环保	9,500	75,335.00	0.04
574	688006	杭可科技	700	75,306.00	0.04
575	002430	杭氧股份	2,500	75,025.00	0.04
576	002595	豪迈科技	2,700	74,952.00	0.04
577	002368	太极股份	2,720	74,908.80	0.04
578	600985	淮北矿业	6,700	74,906.00	0.04
579	002670	国盛金控	7,800	74,880.00	0.04
580	000540	中天金融	28,300	74,712.00	0.04
581	002032	苏泊尔	1,200	74,688.00	0.04
582	600528	中铁工业	9,000	73,890.00	0.04
583	002048	宁波华翔	3,400	73,542.00	0.04
584	002925	盈趣科技	2,160	73,504.80	0.04
585	002382	蓝帆医疗	4,500	73,305.00	0.04
586	000581	威孚高科	3,400	73,236.00	0.04
587	600764	中国海防	1,800	73,188.00	0.04
588	600297	广汇汽车	27,400	73,158.00	0.04
589	603885	吉祥航空	4,100	72,775.00	0.04
590	002958	青农商行	18,800	72,568.00	0.04
591	601231	环旭电子	4,500	72,270.00	0.04
592	600409	三友化工	8,300	72,210.00	0.04
593	002010	传化智联	8,300	72,210.00	0.04
594	600755	厦门国贸	10,000	72,100.00	0.04
595	600827	百联股份	5,400	71,982.00	0.04
596	601717	郑煤机	6,200	71,858.00	0.04
597	600567	山鹰国际	21,800	71,722.00	0.04
598	600060	海信视像	5,300	71,285.00	0.04
599	002690	美亚光电	1,900	71,174.00	0.04
600	000709	河钢股份	28,600	70,356.00	0.04
601	603087	甘李药业	1,000	70,340.00	0.04
602	603883	老百姓	1,420	70,119.60	0.04
603	600131	国网信通	3,200	69,920.00	0.04
604	600598	北大荒	4,800	69,888.00	0.04
605	300271	华宇软件	5,500	69,850.00	0.04
606	000778	新兴铸管	16,100	69,713.00	0.04
607	002183	怡亚通	10,500	69,510.00	0.03
608	603927	中科软	2,540	69,494.40	0.03
609	002075	沙钢股份	11,900	69,377.00	0.03
610	000883	湖北能源	13,100	68,644.00	0.03

611	600325	华发股份	11,400	68,628.00	0.03
612	600820	隧道股份	12,700	68,326.00	0.03
613	600967	内蒙一机	5,700	68,115.00	0.03
614	600021	上海电力	5,300	67,946.00	0.03
615	002434	万里扬	4,600	67,804.00	0.03
616	600737	中粮糖业	7,200	67,680.00	0.03
617	600782	新钢股份	12,800	67,584.00	0.03
618	002281	光迅科技	2,900	67,541.00	0.03
619	600507	方大特钢	8,600	67,080.00	0.03
620	000990	诚志股份	4,200	66,444.00	0.03
621	600707	彩虹股份	9,700	66,154.00	0.03
622	600022	山东钢铁	36,900	66,051.00	0.03
623	600329	中新药业	2,100	65,961.00	0.03
624	601456	国联证券	4,700	65,659.00	0.03
625	601880	辽港股份	37,800	65,394.00	0.03
626	600566	济川药业	2,300	65,182.00	0.03
627	600663	陆家嘴	6,000	65,160.00	0.03
628	600435	北方导航	6,100	65,148.00	0.03
629	000800	一汽解放	6,300	64,827.00	0.03
630	601106	中国一重	18,500	64,380.00	0.03
631	000987	越秀金控	7,400	64,380.00	0.03
632	002124	天邦股份	9,940	64,013.60	0.03
633	002146	荣盛发展	14,700	63,945.00	0.03
634	601577	长沙银行	8,100	63,261.00	0.03
635	600572	康恩贝	12,600	63,000.00	0.03
636	688363	华熙生物	400	62,120.00	0.03
637	600446	金证股份	4,300	61,576.00	0.03
638	601118	海南橡胶	11,600	61,248.00	0.03
639	002390	信邦制药	8,200	60,844.00	0.03
640	000898	鞍钢股份	16,200	60,750.00	0.03
641	603650	彤程新材	1,200	60,384.00	0.03
642	600811	东方集团	20,000	60,200.00	0.03
643	601808	中海油服	4,000	60,000.00	0.03
644	000877	天山股份	3,900	59,709.00	0.03
645	600597	光明乳业	4,100	59,532.00	0.03
646	600808	马钢股份	16,100	59,409.00	0.03
647	000488	晨鸣纸业	8,200	59,368.00	0.03
648	002429	兆驰股份	12,200	59,292.00	0.03
649	600259	广晟有色	1,200	59,088.00	0.03
650	001914	招商积余	2,900	58,754.00	0.03
651	002440	闰土股份	6,100	58,499.00	0.03

652	300166	东方国信	5,400	58,320.00	0.03
653	002233	塔牌集团	5,500	58,190.00	0.03
654	002155	湖南黄金	5,600	58,016.00	0.03
655	601200	上海环境	4,600	57,914.00	0.03
656	600037	歌华有线	6,600	57,288.00	0.03
657	688088	虹软科技	1,300	57,278.00	0.03
658	600908	无锡银行	10,100	57,267.00	0.03
659	002085	万丰奥威	10,400	57,096.00	0.03
660	600373	中文传媒	4,600	56,856.00	0.03
661	002705	新宝股份	2,300	56,810.00	0.03
662	000559	万向钱潮	8,900	56,693.00	0.03
663	002110	三钢闽光	8,300	56,440.00	0.03
664	688321	微芯生物	1,600	56,016.00	0.03
665	603228	景旺电子	1,620	55,938.60	0.03
666	600167	联美控股	6,200	55,862.00	0.03
667	600398	海澜之家	8,700	55,767.00	0.03
668	002416	爱施德	4,900	55,762.00	0.03
669	600195	中牧股份	4,239	55,403.73	0.03
670	600064	南京高科	5,900	55,106.00	0.03
671	600026	中远海能	9,300	55,056.00	0.03
672	601000	唐山港	20,000	55,000.00	0.03
673	600906	财达证券	4,300	54,868.00	0.03
674	002081	金螳螂	9,000	54,720.00	0.03
675	600546	山煤国际	6,600	54,186.00	0.03
676	601991	大唐发电	16,700	54,108.00	0.03
677	000528	柳工	7,000	53,970.00	0.03
678	000961	中南建设	12,900	53,406.00	0.03
679	603000	人民网	3,700	53,354.00	0.03
680	002867	周大生	3,000	53,340.00	0.03
681	000685	中山公用	6,000	53,100.00	0.03
682	601718	际华集团	17,800	53,044.00	0.03
683	601611	中国核建	5,300	52,841.00	0.03
684	601608	中信重工	11,700	52,182.00	0.03
685	300133	华策影视	7,700	52,129.00	0.03
686	002387	维信诺	5,600	51,968.00	0.03
687	000158	常山北明	7,500	51,900.00	0.03
688	600120	浙江东方	11,712	51,767.04	0.03
689	000090	天健集团	8,800	51,656.00	0.03
690	000959	首钢股份	9,000	51,570.00	0.03
691	601333	广深铁路	22,900	51,296.00	0.03
692	002038	双鹭药业	4,700	50,807.00	0.03

693	000758	中色股份	9,300	50,778.00	0.03
694	000089	深圳机场	6,900	50,508.00	0.03
695	000671	阳光城	16,600	50,132.00	0.03
696	600376	首开股份	8,700	49,242.00	0.02
697	600582	天地科技	11,200	49,056.00	0.02
698	002242	九阳股份	2,100	48,720.00	0.02
699	000718	苏宁环球	10,300	48,513.00	0.02
700	000415	渤海租赁	16,500	48,015.00	0.02
701	601598	中国外运	10,700	47,936.00	0.02
702	003022	联泓新科	1,300	47,372.00	0.02
703	600556	天下秀	3,800	46,930.00	0.02
704	000967	盈峰环境	6,400	46,912.00	0.02
705	601098	中南传媒	4,900	46,893.00	0.02
706	601975	招商南油	23,300	46,833.00	0.02
707	600062	华润双鹤	3,500	46,795.00	0.02
708	600126	杭钢股份	9,100	46,683.00	0.02
709	600307	酒钢宏兴	21,200	46,640.00	0.02
710	000402	金融街	8,100	45,846.00	0.02
711	002458	益生股份	4,000	45,240.00	0.02
712	601958	金铂股份	6,600	45,210.00	0.02
713	600643	爱建集团	6,600	44,616.00	0.02
714	001965	招商公路	5,800	44,486.00	0.02
715	002399	海普瑞	2,600	44,460.00	0.02
716	600959	江苏有线	13,500	44,415.00	0.02
717	601698	中国卫通	3,000	43,170.00	0.02
718	300741	华宝股份	900	43,065.00	0.02
719	000563	陕国投A	13,300	42,959.00	0.02
720	300257	开山股份	2,700	42,876.00	0.02
721	688029	南微医学	200	42,534.00	0.02
722	600056	中国医药	3,600	42,516.00	0.02
723	003035	南网能源	5,100	42,279.00	0.02
724	601928	凤凰传媒	5,200	42,068.00	0.02
725	002563	森马服饰	5,400	41,742.00	0.02
726	688289	圣湘生物	700	41,300.00	0.02
727	600901	江苏租赁	8,100	41,229.00	0.02
728	300888	稳健医疗	500	41,225.00	0.02
729	601860	紫金银行	12,300	41,205.00	0.02
730	600266	城建发展	9,080	40,860.00	0.02
731	000028	国药一致	1,100	40,678.00	0.02
732	600717	天津港	9,708	40,676.52	0.02
733	002815	崇达技术	2,400	40,440.00	0.02

734	600968	海油发展	13,800	40,434.00	0.02
735	000937	冀中能源	7,200	39,672.00	0.02
736	002244	滨江集团	8,400	39,144.00	0.02
737	000717	韶钢松山	8,200	38,950.00	0.02
738	600928	西安银行	9,000	38,700.00	0.02
739	600095	湘财股份	3,800	38,456.00	0.02
740	000062	深圳华强	2,200	37,906.00	0.02
741	600787	中储股份	6,000	37,440.00	0.02
742	002468	申通快递	4,100	37,269.00	0.02
743	600776	东方通信	3,200	36,832.00	0.02
744	600006	东风汽车	5,400	36,774.00	0.02
745	002424	贵州百灵	4,800	36,480.00	0.02
746	002423	中粮资本	4,500	36,450.00	0.02
747	605499	东鹏饮料	200	36,368.00	0.02
748	600835	上海机电	2,200	35,024.00	0.02
749	600649	城投控股	8,500	34,935.00	0.02
750	601969	海南矿业	2,900	34,829.00	0.02
751	600339	中油工程	11,300	34,804.00	0.02
752	600623	华谊集团	3,800	34,580.00	0.02
753	002375	亚厦股份	4,600	34,454.00	0.02
754	601139	深圳燃气	3,900	34,437.00	0.02
755	600648	外高桥	2,600	34,398.00	0.02
756	600729	重庆百货	1,300	33,826.00	0.02
757	603317	天味食品	1,260	33,780.60	0.02
758	600299	安迪苏	2,700	33,264.00	0.02
759	000156	华数传媒	3,900	32,994.00	0.02
760	000031	大悦城	8,700	32,451.00	0.02
761	000869	张裕A	1,000	31,860.00	0.02
762	600377	宁沪高速	3,500	30,170.00	0.02
763	601869	长飞光纤	900	29,466.00	0.01
764	600639	浦东金桥	2,300	29,371.00	0.01
765	600871	石化油服	13,700	29,318.00	0.01
766	601828	美凯龙	3,250	28,632.50	0.01
767	300869	康泰医学	700	28,385.00	0.01
768	601228	广州港	8,300	27,639.00	0.01
769	002302	西部建设	3,400	27,302.00	0.01
770	002653	海思科	1,300	26,520.00	0.01
771	603379	三美股份	1,160	26,424.80	0.01
772	000046	泛海控股	14,000	26,320.00	0.01
773	601298	青岛港	4,600	26,174.00	0.01
774	002948	青岛银行	5,500	25,465.00	0.01

775	000553	安道麦 A	3,000	25,320.00	0.01
776	603708	家家悦	1,500	24,960.00	0.01
777	600823	世茂股份	7,600	24,928.00	0.01
778	002945	华林证券	1,800	24,588.00	0.01
779	603786	科博达	300	24,090.00	0.01
780	001872	招商港口	1,300	22,035.00	0.01
781	601568	北元集团	2,700	21,951.00	0.01
782	601156	东航物流	1,000	21,880.00	0.01
783	600350	山东高速	4,200	21,672.00	0.01
784	600657	信达地产	5,800	21,634.00	0.01
785	603056	德邦股份	2,100	21,483.00	0.01
786	001203	大中矿业	1,400	21,112.00	0.01
787	603355	莱克电气	700	20,524.00	0.01
788	600466	蓝光发展	9,800	19,992.00	0.01
789	603515	欧普照明	900	18,684.00	0.01
790	600917	重庆燃气	2,200	18,458.00	0.01
791	601665	齐鲁银行	3,300	18,414.00	0.01
792	601003	柳钢股份	3,500	18,270.00	0.01
793	600956	新天绿能	1,000	17,210.00	0.01
794	603719	良品铺子	400	16,988.00	0.01
795	002946	新乳业	1,000	15,940.00	0.01
796	002901	大博医疗	300	15,186.00	0.01
797	601187	厦门银行	2,100	14,490.00	0.01
798	600903	贵州燃气	1,400	13,552.00	0.01
799	603868	飞科电器	300	13,026.00	0.01
800	603983	丸美股份	200	6,374.00	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	688707	振华新材	3,794	178,925.04	0.09
2	688511	天微电子	1,440	78,508.80	0.04
3	301029	怡合达	409	36,756.83	0.02
4	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.01
5	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
6	301050	雷电微力	87	20,422.38	0.01
7	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.01
8	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
9	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.01
10	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.01

11	301155	海力风电	135	13,061.25	0.01
12	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.01
13	301035	润丰股份	217	12,212.76	0.01
14	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.01
15	301039	中集车辆	792	9,907.92	0.00
16	301028	东亚机械	715	9,652.50	0.00
17	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
18	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
19	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
20	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
21	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
22	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
23	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
24	301189	奥尼电子	136	7,700.32	0.00
25	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
26	301091	深城交	227	7,107.37	0.00
27	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
28	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
29	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
30	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
31	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
32	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
33	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
34	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
35	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
36	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
37	301036	双乐股份	180	5,387.40	0.00
38	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
39	301092	争光股份	141	5,008.32	0.00
40	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
41	301088	戎美股份	200	4,934.00	0.00
42	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
43	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
44	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
45	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
46	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
47	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
48	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	5,967,225.00	3.72
2	600519	贵州茅台	2,083,051.00	1.30
3	300760	迈瑞医疗	1,200,314.00	0.75
4	000858	五粮液	954,913.00	0.60
5	002466	天齐锂业	810,611.00	0.51
6	002415	海康威视	779,880.00	0.49
7	000333	美的集团	745,764.06	0.47
8	688981	中芯国际	709,028.16	0.44
9	601816	京沪高铁	579,393.00	0.36
10	000725	京东方 A	555,906.00	0.35
11	300059	东方财富	531,584.00	0.33
12	300782	卓胜微	509,639.00	0.32
13	300450	先导智能	494,095.00	0.31
14	688111	金山办公	484,712.00	0.30
15	002475	立讯精密	482,403.00	0.30
16	002594	比亚迪	478,947.00	0.30
17	000651	格力电器	473,941.00	0.30
18	601318	中国平安	470,723.00	0.29
19	300015	爱尔眼科	443,169.00	0.28
20	688599	天合光能	436,773.80	0.27

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	1,059,923.00	0.66
2	000858	五粮液	870,666.00	0.54
3	600703	三安光电	687,568.00	0.43
4	000333	美的集团	651,931.00	0.41
5	600036	招商银行	630,429.00	0.39
6	600089	特变电工	608,936.00	0.38
7	601318	中国平安	596,066.00	0.37
8	002074	国轩高科	469,343.84	0.29
9	300059	东方财富	447,258.00	0.28
10	688148	芳源股份	428,146.00	0.27

11	000651	格力电器	412,847.00	0.26
12	300207	欣旺达	405,920.00	0.25
13	600460	士兰微	399,831.00	0.25
14	000799	酒鬼酒	389,608.00	0.24
15	688385	复旦微电	374,136.00	0.23
16	300012	华测检测	371,459.00	0.23
17	002594	比亚迪	362,154.00	0.23
18	301029	怡合达	348,940.05	0.22
19	000725	京东方 A	348,269.00	0.22
20	000001	平安银行	340,153.00	0.21

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	72,015,770.91
卖出股票收入（成交）总额	60,938,604.45

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）	259,349.50	0.13
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	259,349.50	0.13

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	2,360	236,000.00	0.12

2	110083	苏租转债	140	16,461.20	0.01
3	113633	科沃转债	30	3,888.30	0.00
4	113634	珀莱转债	20	2,000.00	0.00
5	110084	贵燃转债	10	1,000.00	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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

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：违规办理内保外贷业务；未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料；违反外汇市场交易管理规定；未按规定保存交易通讯记录；违规办理银行卡业务的违法违规事实，国家外汇管理局福建省分局于 2021 年 7 月 21 日对公司做出责令改正、警告、没收违法所得和罚款合计 300.10537 万元人民币的行政处罚（闽汇罚〔2021〕5 号）。“兴业银行”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“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 8 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	7,428.18
2	应收证券清算款	152,028.63
3	应收股利	—
4	应收利息	195.30
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	159,652.11

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	688707	振华新材	178,925.04	0.09	新股限售
2	688511	天微电子	78,508.80	0.04	新股限售
3	301029	怡合达	36,756.83	0.02	新股限售
4	301069	凯盛新材	23,829.19	0.01	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(%)
197	693,025.85	131,784,192.00	96.53	4,741,900.00	3.47

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	110,394,100.00	80.86
2	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	14,295,900.00	10.47
3	华泰证券股份有限公司	3,466,182.00	2.54
4	申万宏源证券有限公司	2,548,200.00	1.87
5	中信证券股份有限公司	1,079,710.00	0.79
6	张晓晖	1,000,000.00	0.73
7	袁洪	1,000,000.00	0.73
8	何宇杰	216,500.00	0.16
9	蓝昶	183,600.00	0.13
10	潘红伟	180,000.00	0.13

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
报告期期初基金份额总额	122,526,092.00
本报告期基金总申购份额	28,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	14,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	136,526,092.00

§ 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

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

本报告期本基金管理人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	2	8,848,713.78	7.12	144,363.32	23.83	—	—	—	—	8,064.14	8.62	—
川财证券	2	458,176.98	0.37	—	—	—	—	—	—	417.53	0.45	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
广发证券	2	4,658,470.66	3.75	102,392.69	16.90	—	—	—	—	4,245.21	4.54	—
国都证券	2	13,901,474.71	11.18	9,286.94	1.53	—	—	—	—	12,668.76	13.54	—
国海证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国元证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	11,575,409.68	9.31	37,202.70	6.14	—	—	—	—	10,549.09	11.28	—
华宝证券	1	2,828,736.35	2.28	17,976.50	2.97	—	—	—	—	2,577.67	2.76	—
华创证券	1	19,797,052.08	15.92	14,267.00	2.36	—	—	—	—	18,041.02	19.29	—
江海证券	2	6,989,138.93	5.62	55,622.85	9.18	—	—	—	—	6,369.69	6.81	—
瑞银证券	2	20,614.62	0.02	—	—	—	—	—	—	18.79	0.02	—
上海证券	2	1,208,745.88	0.97	—	—	—	—	—	—	1,101.49	1.18	—
申万宏源	4	22,595,478.84	18.17	—	—	—	—	—	—	20,591.68	22.01	—

西部证券	2	2,684,058.28	2.16	122,022.60	20.14	—	—	—	—	2,445.94	2.61	—
新时代证券	2	2,519,269.20	2.03	98,968.00	16.34	—	—	—	—	2,295.73	2.45	—
招商证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	3	26,249,882.29	21.11	3,693.90	0.61	—	—	—	—	4,151.64	4.44	—

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金退租券商交易单元：方正证券（391273）。本报告期本基金新增券商交易单元：中泰证券（399028），德邦证券（012562、50402）。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年01月21日
2	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年01月30日
3	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年02月03日
4	富国基金管理有限公司关于富国中证800 交易型开放式指数证券投资基金变更证券简称及基金扩位简称的公告	规定披露媒介	2021年03月04日
5	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年03月13日
6	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年03月17日
7	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年03月24日
8	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同及托管协议的公告	规定披露媒介	2021年03月30日
9	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年04月14日
10	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年04月20日
11	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年05月06日
12	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年05月10日
13	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年07月02日

14	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年08月31日
15	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年09月09日
16	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所上市股票及相关风险提示的公告	规定披露媒介	2021年11月26日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	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	2021-01-01 至 2021-12-31	110,394,100.00	—	—	110,394,100.00	80.86%
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，经向上海证券交易所申请并获得同意，基金管理人决定自 2021 年 3 月 5 日起对富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的证券简称及基金扩位简称进行变更，变更后的证券简称为“沪深 800”，变更后的基金扩位简称为“沪深 800ETF”。具体可参见基金管理人于 2021 年 3 月 4 日发布的《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变更证券简称及基金扩位简称的公告》。

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

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

§ 13 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国中证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，免长途话费）公司网址： http://www.fullgoal.com.cn 。
2、富国中证800交易型开放式指数证券投资基金基金合同		
3、富国中证800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、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 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告		
--	--	--