

---

# 富安达中证 500 指数增强型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2021年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 中期财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50

8.3 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情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富安达中证500指数增强型证券投资基金
基金简称	富安达中证500指数增强
基金主代码	007943
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年11月19日
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	26,126,785.98份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的的业绩水平</p>
投资策略	<p>本基金股票投资比例范围为基金资产的90%—95%。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。基金以量化评估因子为基础，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>本基金以中证500指数为标的指数，通过量化组合管理方法，从优选个股、风险控制、成本控制等角度优化投资组合，力争在稳定跟踪标的指数外获取超额收益。</p>
业绩比较基准	<p>中证500指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%</p>
风险收益特征	<p>本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成分股及其</p>

	备选成分股，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	富安达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李理想
	联系电话	021-61870999
	电子邮箱	service@fadfunds.com
客户服务电话	400-630-6999	95559
传真	021-61870888	021-62701216
注册地址	上海市浦东新区世纪大道156 8号29楼	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道156 8号29楼	中国（上海）长宁区仙霞路1 8号
邮政编码	200122	200336
法定代表人	张睿	任德奇

## 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fadfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	富安达基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1568号中 建大厦29楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月01日- 2021年06月30日)
本期已实现收益	2,088,919.99
本期利润	3,515,386.04
加权平均基金份额本期利润	0.1085
本期加权平均净值利润率	8.76%
本期基金份额净值增长率	8.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)
期末可供分配利润	8,269,999.44
期末可供分配基金份额利润	0.3165
期末基金资产净值	34,445,467.56
期末基金份额净值	1.3184
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	31.84%

注：

- ①所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- ②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期末可供分配利润为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。

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④

过去一个月	4.46%	0.86%	1.12%	0.69%	3.34%	0.17%
过去三个月	9.99%	0.72%	8.41%	0.65%	1.58%	0.07%
过去六个月	8.51%	1.03%	6.61%	0.94%	1.90%	0.09%
过去一年	19.91%	1.24%	15.35%	1.19%	4.56%	0.05%
自基金合同生效起至今	31.84%	1.30%	37.17%	1.33%	-5.33%	-0.03%

注：

1. 本基金业绩比较基准为：95%×中证500指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后），

2. 本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

$$\text{Return}_t = 95\% \times [\text{中证500指数收益率}_t \div \text{中证500指数收益率}_{(t-1)} - 1] + 5\% \times [\text{商业银行活期存款利率（税后）}_t \div \text{商业银行活期存款利率（税后）}_{(t-1)} - 1]$$

$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times \text{Benchmark}_{(t-1)}$$

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

### 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

富安达中证500指数增强型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年11月19日-2021年06月30日)



## § 4 管理人报告



#### 4.1 基金管理人及基金经理情况

##### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富安达基金管理有限公司由南京证券股份有限公司、江苏交通控股有限公司、南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司三家单位共同发起设立。2021年6月29日，经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】2276号文批准，江苏交通控股有限公司将其持有的本公司股权转让给江苏云杉资本管理有限公司。公司办公地点为上海浦东世纪大道1568号中建大厦，注册资本8.18亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念，以基金持有人利益最大化为首要经营目标，为客户提供卓越的理财服务。

截至2021年06月30日，公司共管理十六只开放式基金：富安达优势成长混合型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金、富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达现金货币市场证券投资基金、富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金、富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金、富安达消费主题灵活配置混合型证券投资基金、富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、富安达富利纯债债券型证券投资基金、富安达中证500指数增强型证券投资基金、富安达科技领航混合型证券投资基金、富安达科技创新混合型发起式证券投资基金、富安长三角区域主题混合型发起式证券投资基金、富安达医药创新混合型证券投资基金。

##### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
纪青	本基金的基金经理、指数与量化投资部副经理（主持工作）	2019-11-19	-	13年	硕士。历任中海基金投研中心金融工程分析师。2013年4月加入富安达基金管理有限公司。2016年12月起担任富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达中证500指数增强型证券投资基金的基金

					经理。
--	--	--	--	--	-----

注：

1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，任职日期为基金合同生效日。
2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《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》及其各项实施准则、《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和其他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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》，并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系，涵盖了所有投资组合，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节，确保公平对待旗下的每一个投资组合。本报告期内，公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截止报告日，公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析，按照特定计算周期，分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异，未发现公平交易异常情形。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金不存在异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年上半年，在全球新冠疫情反复、各国经济恢复节奏不一以及流动性整体延续宽松的背景下，A股市场整体表现出风险偏好较高且结构化差异较大的特征。在经历一季度的回撤后，成长板块在新能源、电子、医药等景气向上的行业带领下持续上涨，大幅跑赢以银行、非银、房地产等为代表的传统低估值板块。本报告期内本基金继续以量化选股策略为核心，立足扎实的基本面选股逻辑，控制组合相对基准的偏离风险，策略

组合在自我迭代的过程中具备较好的加速成长特征，同时相较于基准而言的超额收益波动也相对稳定。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达中证500指数增强基金份额净值为1.3184元，本报告期内，基金份额净值增长率为8.51%，同期业绩比较基准收益率为6.61%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前全球权益市场仍然显示出较高的风险偏好，但波动相比前期显著加大。一方面权益资产近两年的强势表现令成长板块静态估值高企，相应风险溢价处于较低水平；另一方面中国及美国经济数据出现不同程度回落，面对无法回避的通胀压力以及新冠病毒变异所带来的不确定性，各国特别是美联储的货币政策何去何从牵动着全球市场的情绪。目前A股市场的资金热点仍在电动车、光伏等产业景气度较为确定的新兴产业赛道上，相应板块估值不断抬升，后期需紧密跟踪这些板块及内部龙头标的的业绩实现情况，谨防预期差带来的板块风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司总经理担任估值委员会主席，估值委员会成员由基金经理、以及投资研究部、固定收益部、多资产投资部、监察稽核部和基金事务部指定指派人员担任委员组成，公司其他高级管理人员可列席参会。估值委员会负责组织和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但需参加估值小组会议；可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，参与估值程度和估值技术的讨论，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。针对该情形，本基金管理人的解决方案为：稳健运作，做好基金业绩，稳定基金规模；积极沟通，整合资源，有序推进营销工作。上述方案已按《公开募集证券投资基金运作管理办法》要求向中国证监会备案并落实解决措施。

本报告期内，本基金不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。

### § 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，基金托管人富安达中证500指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，富安达基金管理有限公司在富安达中证500指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由富安达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富安达中证500指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：富安达中证500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,783,233.09	3,659,541.02

结算备付金		614,894.95	334,319.15
存出保证金		12,585.89	666,343.62
交易性金融资产	6.4.7.2	32,457,376.73	40,725,854.40
其中：股票投资		32,457,376.73	40,725,854.40
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		128,949.86	-
应收利息	6.4.7.5	917.08	772.24
应收股利		-	-
应收申购款		6,129.55	7,123,121.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		35,004,087.15	52,509,951.68
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		134.00	265,758.59
应付赎回款		361,450.46	58,622.27
应付管理人报酬		22,682.87	27,709.63
应付托管费		4,536.57	5,541.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	66,475.32	77,123.19

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	103,340.37	225,106.46
负债合计		558,619.59	659,862.08
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	26,126,785.98	42,675,767.60
未分配利润	6.4.7.10	8,318,681.58	9,174,322.00
所有者权益合计		34,445,467.56	51,850,089.60
负债和所有者权益总计		35,004,087.15	52,509,951.68

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.3184元，基金份额总额26,126,785.98份。

## 6.2 利润表

会计主体：富安达中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
<b>一、收入</b>		4,145,758.52	7,361,030.75
1. 利息收入		11,134.02	165,242.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,134.02	84,198.90
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	81,043.10
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,655,814.12	4,305,393.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,274,431.07	3,846,695.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	92,427.18	-10,280.00
股利收益	6.4.7.16	288,955.87	468,977.93
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,426,466.05	2,068,298.51
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	52,344.33	822,096.70
<b>减：二、费用</b>		630,372.48	1,705,888.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	149,878.65	395,405.48
2. 托管费	6.4.10.2. 2	29,975.78	79,081.09
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	298,002.05	1,044,040.49
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		332.73	-
7. 其他费用	6.4.7.20	152,183.27	187,361.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,515,386.04	5,655,142.21
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”</b>		3,515,386.04	5,655,142.21

号填列)			
------	--	--	--

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富安达中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	42,675,767.60	9,174,322.00	51,850,089.60
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	3,515,386.04	3,515,386.04
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)	-16,548,981.62	-4,371,026.46	-20,920,008.08
其中：1. 基金申购款	1,069,144.23	266,261.02	1,335,405.25
2. 基金赎回 款	-17,618,125.85	-4,637,287.48	-22,255,413.33
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)	26,126,785.98	8,318,681.58	34,445,467.56
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	297,167,480.72	1,985,282.87	299,152,763.59



二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,655,142.21	5,655,142.21
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)	-252,664,377.27	-3,214,335.62	-255,878,712.89
其中:1.基金申购款	5,019,836.51	113,791.96	5,133,628.47
2.基金赎回款	-257,684,213.78	-3,328,127.58	-261,012,341.36
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)	44,503,103.45	4,426,089.46	48,929,192.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

张睿

孙爱民

孙爱民

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富安达中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予富安达中证500指数增强型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2019]1329号)批准,由富安达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法律法规及《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和《富安达中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》发售,基金合同于2019年11月19日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集规模为297,167,480.72份基金份额。本基金的基金管理人为富安达基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金自2019年10月21日至2019年11月15日止期间公开发售。本基金首次向社会公开发售募集且扣除认购费用后的有效认购资金人民币297,167,480.72元（含孳生利息人民币46,525.33元），折合297,167,480.72份基金份额，划入基金份额持有人账户。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和《富安达中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含主板、中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、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、货币市场工具、衍生工具（股指期货、国债期货等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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：股票投资比例范围为基金资产的90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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〉》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于2021年6月30日，本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并备案解决方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、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》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 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（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
----	--------------------

活期存款	1,783,233.09
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	1,783,233.09

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	29,703,612.46	32,457,376.73	2,753,764.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	29,703,612.46	32,457,376.73	2,753,764.27

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无从买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	427.46
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	82.44
应收债券利息	-
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	402.14
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	5.04
合计	917.08

注：其他为应收存出保证金利息。

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	66,475.32
银行间市场应付交易费用	-
合计	66,475.32

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,272.10
应付证券出借违约金	-
预提费用	52,068.27
其他应付	50,000.00
合计	103,340.37

## 6.4.7.9 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06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,675,767.60	42,675,767.60
本期申购	1,069,144.23	1,069,144.23
本期赎回（以“-”号填列）	-17,618,125.85	-17,618,125.85
本期末	26,126,785.98	26,126,785.98

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,809,321.65	-1,634,999.65	9,174,322.00
本期利润	2,088,919.99	1,426,466.05	3,515,386.04
本期基金份额交易产生的变动数	-4,628,242.20	257,215.74	-4,371,026.46
其中：基金申购款	297,091.68	-30,830.66	266,261.02
基金赎回款	-4,925,333.88	288,046.40	-4,637,287.48

本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,269,999.44	48,682.14	8,318,681.58

#### 6.4.7.11 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06月30日
活期存款利息收入	9,546.47
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	1,163.23
其他	424.32
合计	11,134.02

注：其他为应收申购款利息收入和存出保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 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06月30日
卖出股票成交总额	105,458,354.25
减：卖出股票成本总额	103,183,923.18
买卖股票差价收入	2,274,431.07

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。



## 6.4.7.15 衍生工具收益

## 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无权证投资收益。

## 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2021年01月01日至2021年06月30日
期货投资	92,427.18

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	288,955.87
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	288,955.87

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	1,476,906.05
——股票投资	1,476,906.05
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-50,440.00
——权证投资	-
——期货投资	-50,440.00

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	1,426,466.05

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	52,344.33
合计	52,344.33

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。  
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	297,828.66
银行间市场交易费用	-
期货市场交易费用	173.39
合计	298,002.05

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-

汇划手续费	115.00
指数使用费	100,000.00
合计	152,183.27

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

2021年6月29日，经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】2276号文批准，基金管理人股东江苏交通控股有限公司将其持有的本公司26%股权转让给江苏云杉资本管理有限公司。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富安达基金管理有限公司（“富安达基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
南京证券股份有限公司（“南京证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
富安达资产管理（上海）有限公司（“富安达资管”）	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2021年01月01日至2021年06月30日		2020年01月01日至2020年06月30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
南京证券	39,398,266.23	19.84%	318,353,027.52	44.02%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
南京证券	0.00	0.00%	501,000,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	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
南京证券	36,691.29	21.00%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日			
	当期佣金	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
南京证券	296,482.44	50.04%	15,783.57	8.29%

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 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等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	149,878.65	395,405.48
其中：支付销售机构的客户维护费	17,274.28	59,951.47

注：支付基金管理人富安达基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	29,975.78	79,081.09

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 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
富安达资管	9,999,000.00	38.27%	9,999,000.00	23.43%

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	1,783,233.09	9,546.47	3,189,145.61	34,915.54

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

## 6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	174	5,491.44	5,491.44	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发

行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票  
的减持还需根据交易所相关规定执行。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	因刊登重要事项公告	56.35	2021-07-01	59.49	7,900	185,100.25	445,165.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险



- 流动性风险

- 市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司根据基金管理的业务特点设置内部机构和部门，建立起包含三个层次的严密、全面、有效的风险控制体系：部门和岗位层面上，以部门内控、部门互控、岗位自控和岗位互控等方式构成了第一级风险控制；监察稽核部对各部门、各机构、各岗位、各项业务中的风险控制情况实施监督，构成了第二级风险控制；合规与风险控制委员会、督察长和风险控制委员会作为公司风险控制的领导机构，侧重于对风险的宏观控制，是整个风险控制体系中的第三个层次。

监察稽核部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各部门、各机构、各岗位、各项业务中的风险控制情况实施监督。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金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的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

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模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。

本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦可在证券交易所上市，因此均能以合理价格适时变现。

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投资的公允价值。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》（自2017年10月1日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施

严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

于2021年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。本基金的管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,783,233.09	-	-	-	1,783,233.09
结算备付金	614,894.95	-	-	-	614,894.95
存出保证金	12,585.89	-	-	-	12,585.89
交易性金融资产	-	-	-	32,457,376.73	32,457,376.73

应收证券清算款	-	-	-	128,949.86	128,949.86
应收利息	-	-	-	917.08	917.08
应收申购款	-	-	-	6,129.55	6,129.55
资产总计	2,410,713.93	-	-	32,593,373.22	35,004,087.15
负债					
应付证券清算款	-	-	-	134.00	134.00
应付赎回款	-	-	-	361,450.46	361,450.46
应付管理人报酬	-	-	-	22,682.87	22,682.87
应付托管费	-	-	-	4,536.57	4,536.57
应付交易费用	-	-	-	66,475.32	66,475.32
其他负债	-	-	-	103,340.37	103,340.37
负债总计	-	-	-	558,619.59	558,619.59
利率敏感度缺口	2,410,713.93	-	-	32,034,753.63	34,445,467.56
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,659,541.02	-	-	-	3,659,541.02
结算备付金	334,319.15	-	-	-	334,319.15
存出保证金	666,343.62	-	-	-	666,343.62
交易性金融资产	-	-	-	40,725,854.40	40,725,854.40
应收利息	-	-	-	772.24	772.24

应收申购款	5,023,850.89	-	-	2,099,270.36	7,123,121.25
资产总计	9,684,054.68	-	-	42,825,897.00	52,509,951.68
负债					
应付证券清算款	-	-	-	265,758.59	265,758.59
应付赎回款	-	-	-	58,622.27	58,622.27
应付管理人报酬	-	-	-	27,709.63	27,709.63
应付托管费	-	-	-	5,541.94	5,541.94
应付交易费用	-	-	-	77,123.19	77,123.19
其他负债	-	-	-	225,106.46	225,106.46
负债总计	-	-	-	659,862.08	659,862.08
利率敏感度缺口	9,684,054.68	-	-	42,166,034.92	51,850,089.60

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2020年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020年12月31日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，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其他价格风险，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，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

于2021年6月30日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30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	32,457,376.73	94.23	40,725,854.40	78.55
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	32,457,376.73	94.23	40,725,854.40	78.55

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证500指数以外的其他市场变量保持不变		
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06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 中证500指数上升5%	1,827,350.31	2,112,450.07
	2. 中证500指数下降5%	-1,827,350.31	-2,112,450.07

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 6.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

下文列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为32,451,885.29元，属于第二层次的余额为5,491.44元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次40,718,346.60元，第二层次7,507.80元，无第三层次)。

##### (a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

##### (b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2019年12月31日：无）。

#### 6.4.14.2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	32,457,376.73	92.72
	其中：股票	32,457,376.73	92.72

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	2,398,128.04	6.85
8	其他各项资产	148,582.38	0.42
9	合计	35,004,087.15	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末（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	-	-
B	采矿业	1,256,713.00	3.65
C	制造业	18,383,595.00	53.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	543,099.00	1.58
E	建筑业	587,485.00	1.71
F	批发和零售业	652,459.00	1.89
G	交通运输、仓储和邮政业	1,056,818.00	3.07
H	住宿和餐饮业	33,404.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,799,818.40	5.23
J	金融业	934,852.00	2.71
K	房地产业	735,884.00	2.14
L	租赁和商务服务业	570,115.00	1.66



M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	379,449.00	1.10
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	495,933.00	1.44
S	综合	502,425.00	1.46
	合计	27,932,049.40	81.09

### 7.2.2 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	1,964,364.66	5.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	352,853.64	1.02
E	建筑业	5,491.44	0.02
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	403,736.80	1.17
J	金融业	934,201.59	2.71
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	864,679.20	2.51
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	4,525,327.33	13.14

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通投资股票投资组合。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600089	特变电工	48,600	624,510.00	1.81
2	600884	杉杉股份	24,800	578,336.00	1.68
3	002138	顺络电子	14,400	558,288.00	1.62
4	000009	中国宝安	27,500	502,425.00	1.46
5	300474	景嘉微	5,000	489,600.00	1.42
6	002028	思源电气	15,600	480,324.00	1.39
7	603290	斯达半导	1,500	480,000.00	1.39
8	603444	吉比特	900	477,000.00	1.38
9	002273	水晶光电	31,200	458,328.00	1.33
10	000983	山西焦煤	53,900	447,909.00	1.30
11	600460	士兰微	7,900	445,165.00	1.29
12	600765	中航重机	19,400	439,410.00	1.28
13	600500	中化国际	55,700	437,802.00	1.27
14	002353	杰瑞股份	9,700	433,590.00	1.26
15	002408	齐翔腾达	34,700	430,974.00	1.25

16	002092	中泰化学	41,800	429,286.00	1.25
17	002078	太阳纸业	31,900	425,865.00	1.24
18	601717	郑煤机	35,400	411,702.00	1.20
19	000960	锡业股份	24,900	399,147.00	1.16
20	600642	申能股份	64,900	398,486.00	1.16
21	000738	航发控制	19,100	397,853.00	1.16
22	000887	中鼎股份	32,900	397,432.00	1.15
23	000012	南玻A	38,600	395,264.00	1.15
24	300168	万达信息	27,000	394,200.00	1.14
25	601598	中国外运	77,300	390,365.00	1.13
26	603077	和邦生物	186,900	388,752.00	1.13
27	601200	上海环境	31,700	379,449.00	1.10
28	300058	蓝色光标	62,300	376,915.00	1.09
29	002081	金螳螂	47,200	373,824.00	1.09
30	000825	太钢不锈	49,800	373,002.00	1.08
31	300496	中科创达	2,300	361,238.00	1.05
32	600782	新钢股份	63,800	356,004.00	1.03
33	000681	视觉中国	27,100	350,403.00	1.02
34	300207	欣旺达	10,700	348,392.00	1.01
35	000581	威孚高科	16,700	347,861.00	1.01
36	002340	格林美	37,000	345,950.00	1.00
37	002233	塔牌集团	33,600	345,408.00	1.00
38	000830	鲁西化工	18,400	344,632.00	1.00
39	601233	桐昆股份	14,300	344,487.00	1.00
40	600649	城投控股	72,300	344,148.00	1.00
41	601168	西部矿业	28,800	343,584.00	1.00
42	600643	爱建集团	48,800	340,624.00	0.99
43	601298	青岛港	54,600	337,428.00	0.98
44	300630	普利制药	6,300	330,120.00	0.96
45	600350	山东高速	53,500	329,025.00	0.96
46	300146	汤臣倍健	10,000	329,000.00	0.96

47	000869	张裕A	8,700	323,118.00	0.94
48	600398	海澜之家	44,000	318,560.00	0.92
49	600985	淮北矿业	25,800	315,018.00	0.91
50	002390	信邦制药	29,800	312,304.00	0.91
51	603719	良品铺子	6,939	312,255.00	0.91
52	603338	浙江鼎力	5,200	305,188.00	0.89
53	002926	华西证券	31,100	299,493.00	0.87
54	002985	北摩高科	3,060	298,350.00	0.87
55	002966	苏州银行	40,100	294,735.00	0.86
56	600529	山东药玻	8,500	288,575.00	0.84
57	600426	华鲁恒升	9,200	284,740.00	0.83
58	300274	阳光电源	2,300	264,638.00	0.77
59	000961	中南建设	41,300	244,496.00	0.71
60	002110	三钢闽光	36,200	243,988.00	0.71
61	002048	宁波华翔	12,500	243,750.00	0.71
62	000630	铜陵有色	86,700	235,824.00	0.68
63	688099	晶晨股份	2,072	232,478.40	0.67
64	600201	生物股份	13,200	230,340.00	0.67
65	000807	云铝股份	18,600	221,340.00	0.64
66	600779	水井坊	1,700	214,795.00	0.62
67	600970	中材国际	23,300	213,661.00	0.62
68	000501	鄂武商A	18,200	212,940.00	0.62
69	002156	通富微电	8,300	199,532.00	0.58
70	601828	美凯龙	16,100	193,200.00	0.56
71	603260	合盛硅业	2,500	192,275.00	0.56
72	300223	北京君正	1,900	191,748.00	0.56
73	002152	广电运通	14,700	191,541.00	0.56
74	600409	三友化工	18,400	186,024.00	0.54
75	600728	佳都科技	22,800	168,948.00	0.49
76	300253	卫宁健康	10,200	165,954.00	0.48
77	603198	迎驾贡酒	3,700	163,910.00	0.48

78	000488	晨鸣纸业	19,500	158,730.00	0.46
79	603868	飞科电器	3,700	155,622.00	0.45
80	300009	安科生物	10,100	150,490.00	0.44
81	600338	西藏珠峰	10,600	150,202.00	0.44
82	000031	大悦城	40,900	147,240.00	0.43
83	601098	中南传媒	16,500	145,530.00	0.42
84	000690	宝新能源	28,300	144,613.00	0.42
85	002419	天虹股份	19,400	127,264.00	0.37
86	600388	龙净环保	13,700	116,724.00	0.34
87	603228	景旺电子	4,400	115,280.00	0.33
88	600567	山鹰国际	30,500	105,225.00	0.31
89	600258	首旅酒店	1,400	33,404.00	0.10

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	688133	泰坦科技	1,400	445,018.00	1.29
2	603259	药明康德	2,680	419,661.20	1.22
3	300059	东方财富	12,320	403,972.80	1.17
4	300685	艾德生物	3,700	385,096.00	1.12
5	300760	迈瑞医疗	800	384,040.00	1.11
6	000001	平安银行	16,700	377,754.00	1.10
7	600461	洪城环境	48,326	350,846.76	1.02
8	002129	中环股份	7,300	281,780.00	0.82
9	002410	广联达	3,400	231,880.00	0.67
10	002876	三利谱	3,300	213,510.00	0.62
11	600085	同仁堂	5,100	208,335.00	0.60
12	300122	智飞生物	1,000	186,730.00	0.54
13	300872	天阳科技	4,600	166,980.00	0.48

14	300319	麦捷科技	12,400	149,420.00	0.43
15	000858	五粮液	500	148,945.00	0.43
16	601336	新华保险	3,000	137,730.00	0.40
17	000301	东方盛虹	5,000	104,500.00	0.30
18	601528	瑞丰银行	947	14,744.79	0.04
19	001208	华菱线缆	842	6,508.66	0.02
20	605287	德才股份	174	5,491.44	0.02
21	603171	N税友	254	4,876.80	0.01
22	605011	N杭热	226	2,006.88	0.01

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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	002013	中航机电	1,067,051.04	2.06
2	002092	中泰化学	973,457.00	1.88
3	600985	淮北矿业	940,791.00	1.81
4	000690	宝新能源	939,672.82	1.81
5	002416	爱施德	906,142.00	1.75
6	600642	申能股份	893,681.00	1.72
7	601233	桐昆股份	882,723.00	1.70
8	000598	兴蓉环境	849,895.00	1.64
9	000883	湖北能源	843,122.87	1.63
10	601128	常熟银行	825,849.00	1.59
11	002081	金螳螂	811,807.00	1.57
12	600820	隧道股份	801,165.00	1.55
13	300496	中科创达	793,861.00	1.53
14	601098	中南传媒	777,683.00	1.50
15	601598	中国外运	759,493.00	1.46
16	002683	宏大爆破	757,690.00	1.46

17	600350	山东高速	739,970.00	1.43
18	600497	驰宏锌锗	728,782.00	1.41
19	688088	虹软科技	725,417.42	1.40
20	002568	百润股份	692,823.00	1.34

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	600497	驰宏锌锗	1,099,712.00	2.12
2	002013	中航机电	1,095,755.00	2.11
3	002416	爱施德	1,080,780.00	2.08
4	600039	四川路桥	1,062,235.00	2.05
5	601318	中国平安	1,040,628.00	2.01
6	600642	申能股份	1,015,765.00	1.96
7	000883	湖北能源	1,015,653.00	1.96
8	603613	国联股份	983,378.80	1.90
9	002867	周大生	981,258.00	1.89
10	300274	阳光电源	972,238.00	1.88
11	600073	上海梅林	946,276.00	1.83
12	601098	中南传媒	934,159.00	1.80
13	600426	华鲁恒升	925,109.20	1.78
14	000598	兴蓉环境	903,712.00	1.74
15	000301	东方盛虹	879,445.00	1.70
16	600582	天地科技	868,779.00	1.68
17	300115	长盈精密	836,897.74	1.61
18	600549	厦门钨业	832,350.00	1.61
19	002138	顺络电子	825,313.00	1.59
20	300496	中科创达	820,724.00	1.58

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	93,438,539.46
卖出股票收入（成交）总额	105,458,354.25

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					92,427.18
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-50,440.00

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策



基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	12,585.89
2	应收证券清算款	128,949.86
3	应收股利	-
4	应收利息	917.08
5	应收申购款	6,129.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	148,582.38

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
409	63,879.67	15,784,019.38	60.41%	10,342,766.60	39.59%

#### 8.2 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	7,922.94	0.03%

#### 8.3 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、基金投资和研究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

1、基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为0。

2、本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0。

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年11月19日)基金份额总额	297,167,480.72
本报告期期初基金份额总额	42,675,767.60
本报告期基金总申购份额	1,069,144.23
减:本报告期基金总赎回份额	17,618,125.85
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	26,126,785.98

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内,本基金托管人交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备
----	---	------	-----------	---

名称	易单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	注
安信证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	20,702,740.02	10.42%	15,139.96	8.66%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	2,542,108.01	1.28%	2,367.42	1.35%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金	1	-	-	-	-	-

公司						
中泰 证券	1	-	-	-	-	-
长江 证券	2	30,397,641.43	15.30%	22,229.95	12.72%	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-
东方 财富	2	-	-	-	-	-
东方 证券	2	-	-	-	-	-
东吴 证券	2	-	-	-	-	-
光大 证券	2	18,750,892.65	9.44%	17,462.64	9.99%	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
国金 证券	2	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
华安 证券	2	-	-	-	-	-
华福 证券	2	-	-	-	-	-
华金 证券	2	-	-	-	-	-
华龙 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-

开源 证券	2	-	-	-	-	-
南京 证券	2	39,398,266.23	19.84%	36,691.29	21.00%	-
上海 证券	2	82,505,559.28	41.54%	76,837.53	43.97%	-
申万 宏源	2	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
兴业 证券	2	4,317,062.70	2.17%	4,020.65	2.30%	-
招商 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 证券	3	-	-	-	-	-

注：

1. 为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

（一）财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与公司具有互补性、最近一年内无重大违法违规行为发生；

（二）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（三）能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及其他信息咨询服务；

（四）能根据公司特定要求，提供专门研究报告；

（五）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；能够提供很好的交易执行。

## 2. 券商专用交易单元选择程序:

(一) 券商席位由投资研究部业务人员推荐, 经投资研究部、固定收益部、多资产投资部会议讨论, 形成重点评估的券商备选池, 从中进行甄选。原则上, 备选池中的券商个数不得少于最后选择个数的二倍。

(二) 投资研究部、固定收益部、多资产投资部全体业务人员遵照券商选择标准的规定, 进行主观性评议, 独立的评分, 形成券商排名及专用席位租用意见, 报公司总经理批准。

(三) 公司应与被选择的券商签订书面委托代理协议, 明确双方公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等, 经签章有效。

(四) 若签约券商的服务不能满足要求, 或签约券商违法违规受到国家有关部门的处罚, 公司可以提前终止签署的协议, 并撤销租用的席位。

3. 在上述租用的券商交易单元中, (011542) 华安证券和 (48977) 华安证券为本基金本期新增的交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过交易单元进行债券交易、债券回购交易、权证交易、基金交易。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富安达基金管理有限公司关于旗下部分公募基金投资范围增加存托凭证并修改基金合同和托管协议有关条款的公告	规定媒介	2021-01-15
2	富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同	规定媒介	2021-01-15
3	富安达中证500指数增强型证券投资基金托管协议	规定媒介	2021-01-15
4	富安达中证500指数增强型证券投资基金招募说明书(更新)(二〇二一年第一号)	规定媒介	2021-01-15
5	富安达中证500指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定媒介	2021-01-15

6	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参加国金证券费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-01-16
7	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	规定媒介	2021-01-21
8	富安达中证500指数增强型证券投资基金2020年第四季度报告	规定媒介	2021-01-21
9	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参加农业银行费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-01-29
10	富安达基金管理有限公司关于参加部分基金销售机构费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-02-06
11	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-02-24
12	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-03-01
13	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-03-03
14	富安达基金管理有限公司关于暂停通过建设银行直联办理网上交易部分业务的通知	规定媒介	2021-03-05
15	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加和耕传承为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-03-10
16	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-03-11



17	富安达基金管理有限公司关于富安达中证500指数增强型证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号—指数基金指引》修订基金合同及托管协议部分条款的公告	规定媒介	2021-03-19
18	富安达中证500指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定媒介	2021-03-19
19	富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同	规定媒介	2021-03-19
20	富安达中证500指数增强型证券投资基金托管协议	规定媒介	2021-03-19
21	富安达中证500指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（二〇二一年第二号）	规定媒介	2021-03-19
22	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-03-24
23	富安达基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	规定媒介	2021-03-29
24	富安达中证500指数增强型证券投资基金2020年年度报告	规定媒介	2021-03-29
25	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-04-08
26	富安达中证500指数增强型证券投资基金2021年第1季度报告	规定媒介	2021-04-21
27	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性	规定媒介	2021-04-21

	公告		
28	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加财咨道信息技术有限公司为销售机构并与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-04-26
29	富安达基金管理有限公司关于参加部分基金销售机构费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-04-28
30	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-05-07
31	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加泛华普益为销售机构的公告	规定媒介	2021-05-18
32	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加万得基金为销售机构的公告	规定媒介	2021-05-26
33	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加大连网金基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-04
34	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京钱景基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-07
35	富安达基金管理有限公司关于参加部分基金销售机构费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-07
36	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-06-16
37	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-06-18

38	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海爱建基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-25
----	---	------	------------

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	20210107-20210630	4,215,363.86	4,169,655.52	2,600,000.00	5,785,019.38	22.14%
	2	20210104-20210630	9,999,000.00	0.00	0.00	9,999,000.00	38.27%
产品特有风险							
当持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大的冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予富安达中证500指数增强型证券投资基金注册的文件：
  - 《富安达中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》；
  - 《富安达中证500指数增强型证券投资基金基金合同》；
  - 《富安达中证500指数增强型证券投资基金托管协议》。
- 2、《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 3、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 4、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 5、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.fadfunds.com](http://www.fadfunds.com)）查阅。

富安达基金管理有限公司  
二〇二一年八月三十一日