

# 富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

二〇二一年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国工商银行股份有限公司

送出日期： 2021 年 08 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。

基金托管人中国工商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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 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.....	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.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
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.....	8
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说明.....	11
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.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6	中期财务报表(未经审计).....	13
6.1	资产负债表.....	13
6.2	利润表.....	14
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	15
6.4	报表附注.....	16
§7	投资组合报告.....	38
7.1	期末基金资产组合情况.....	38
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	40
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	63
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.....	63
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.....	63
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.....	63

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	63
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	63
7.12	投资组合报告附注 .....	64
§8	基金份额持有人信息 .....	66
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	66
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	67
8.4	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 .....	67
§9	开放式基金份额变动 .....	67
§10	重大事件揭示 .....	67
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	67
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 .....	67
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
10.4	基金投资策略的改变 .....	68
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
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 .....	68
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
10.8	其他重大事件 .....	71
§11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	72
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 .....	72
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	72
§12	备查文件目录 .....	72

## § 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
基金简称	富国中证 800ETF
场内简称	沪深 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（单位：份）	119,026,092.00
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

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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

### 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日至2021年06月30日)
本期已实现收益	10,707,777.08
本期利润	13,027,769.34
加权平均基金份额本期利润	0.1094
本期加权平均净值利润率	8.10%
本期基金份额净值增长率	8.24%
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	31,664,483.78
期末可供分配基金份额利润	0.2660
期末基金资产净值	168,453,121.05
期末基金份额净值	1.4153

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	41.53%

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。

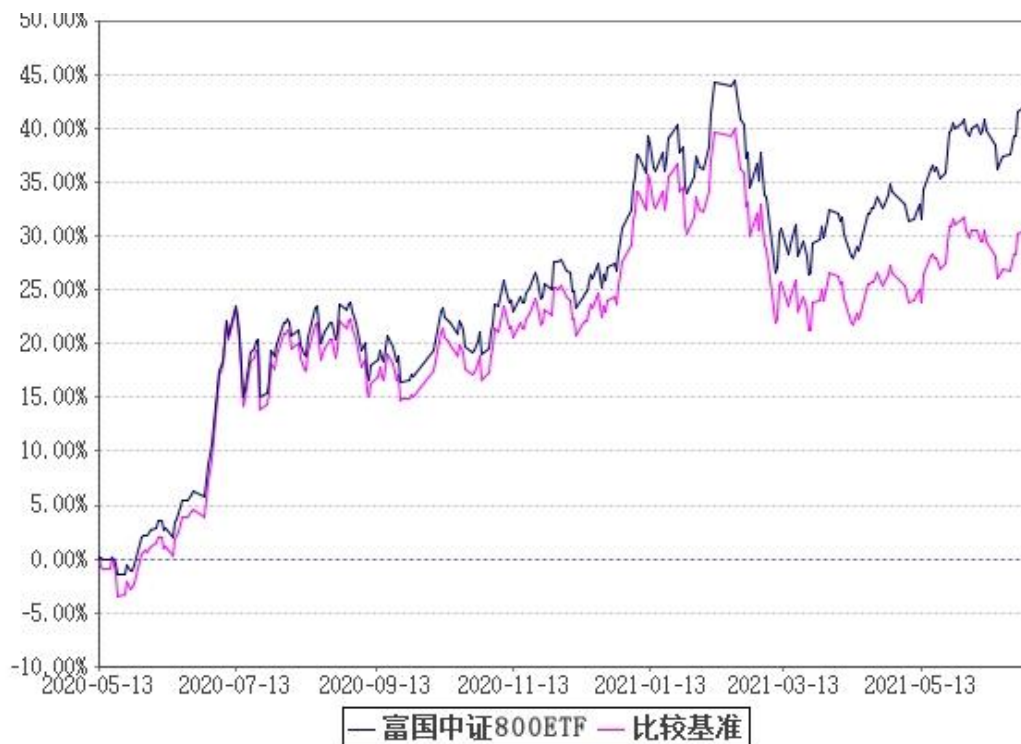
期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 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
过去一个月	0.70%	0.75%	-1.30%	0.77%	2.00%	-0.02%
过去三个月	9.01%	0.87%	4.68%	0.88%	4.33%	-0.01%
过去六个月	8.24%	1.20%	1.72%	1.21%	6.52%	-0.01%
过去一年	32.09%	1.25%	23.10%	1.28%	8.99%	-0.03%
自基金合同生效起至今	41.53%	1.20%	29.82%	1.25%	11.71%	-0.05%

### 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6月30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。

## § 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6月30日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3年国开行债券指数证券投资基金、富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金等212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	—	11.1	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



				<p>基金基金经理，2016年10月至2018年7月任富国全球债券证券投资基金基金经理，2017年10月至2020年1月任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，2017年11月至2020年1月任富国中证工业4.0指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理，2018年11月至2020年5月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018年12月至2020年5月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，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</p>
--	--	--	--	---

					中证医药 50 交易型开放式指数证券投资基金、富国中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2020 年 5 月起任富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 7 月起任富国上海金交易型开放式证券投资基金、富国上海金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理，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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，

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

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，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**

年初以来，在中欧投资协定达成、PMI向好、货币政策不急转弯等多重利好因素的刺激下，市场风险偏好大幅提升。在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。3月下旬，随着上市公司年报、季报预告陆续披露，部分估值相对合理的公司开始企稳反弹。同时海外疫情再度爆发，美国10年期国债利率升幅放缓，A股快速杀估值阶段告一段落，前期调整较多的板块陆续迎来反弹。4月下旬，印度疫情超预期爆发，使得货币政策收紧预期进一步降低，市场持续反弹。5月初，商品价格再度大幅上涨，螺纹钢、铜等品种创出本轮反弹新高，钢铁、煤炭、有色等周期板块大幅上涨。市场通胀预期大幅提升，成长板块出现明显回调。5月中旬起，国常会多次开会聚焦大宗商品价格问题，指出要高度重视大宗商品价格攀升带来的不利影响。国内相关大宗商品如钢价、煤价迎来大幅调整。随着通胀预期下降，市场风险偏好再度提升，消费、科技、医药、新能源等板块迎来大幅反弹。6月中，美联储会议并未实质性讨论收紧购债规模，同时美国10年期国债利率进一步走低，因此短期流动性未受到明显影响，市场继续反弹。其中，景气度较高的新能源汽车、光伏、半导体等板块涨幅居前。总体来看，2021年上半年上证综指上涨3.4%，沪深300上涨0.24%，创业板指上涨17.22%，中证500指数上涨6.93%。

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6月30日，本基金份额净值为1.4153元；份额累计净值为1.4153元；本报告期，本基金份额净值增长率为8.24%，同期业绩比较基准收益率为1.72%

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

展望后市，由于美国非农就业人数仍未明显好转，美联储收紧货币政策仍需

等待，因此 3 季度市场仍存在流动性宽松的窗口期。随着中报业绩披露，市场仍存在结构性机会。从行业配置上，随着前期成长板块大幅上涨后，需关注部分公司估值过高的风险，适当均衡配置，关注业绩与估值的匹配情况。

#### **4.6 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。

#### **4.7 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。

#### **4.8 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**

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，本基金托管人在对富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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 中期财务报表(未经审计)

### 6.1 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 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 (2021 年 06 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
<b>资产：</b>		
银行存款	2,771,895.08	1,483,583.21
结算备付金	17,297.14	14,568.00
存出保证金	4,675.37	35,478.45
交易性金融资产	165,686,204.85	158,869,079.75
其中：股票投资	165,506,041.90	158,740,257.25
基金投资	—	—
债券投资	180,162.95	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	119,163.48	26,916.92
应收利息	269.99	179.71
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	75,616.24	—
资产总计	168,675,122.15	160,429,806.04
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b> <b>(2021 年 06 月 30 日)</b>	<b>上年度末</b> <b>(2020 年 12 月 31 日)</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	20,408.71	19,336.77
应付托管费	6,802.88	6,445.59
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	24,996.13	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	169,793.38	147,500.00
负债合计	222,001.10	208,811.31
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	119,026,092.00	122,526,092.00
未分配利润	49,427,029.05	37,694,902.73
所有者权益合计	168,453,121.05	160,220,994.73
负债和所有者权益总计	168,675,122.15	160,429,806.04

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4153 元，基金份额总额 119,026,092.00 份。

## 6.2 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 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)	上年度可比期间 (2020 年 5 月 13 日(基 金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日)
<b>一、收入</b>	13,497,045.08	5,097,473.06
1. 利息收入	3,680.90	108,645.44
其中：存款利息收入	3,624.35	108,638.50
债券利息收入	56.55	6.94
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）	11,152,109.21	3,003,027.01
其中：股票投资收益	9,846,465.02	2,502,082.46
基金投资收益	—	—
债券投资收益	43,500.56	9,926.69
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	1,262,143.63	491,017.86
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,319,992.26	1,384,625.63
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	21,262.71	601,174.98

<b>减：二、费用</b>	469,275.74	577,244.96
1. 管理人报酬	119,931.48	23,238.88
2. 托管费	39,977.15	7,746.28
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	79,959.88	474,039.41
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	—
7. 其他费用	229,407.14	72,220.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	13,027,769.34	4,520,228.10
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	13,027,769.34	4,520,228.10

### 6.3 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 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）	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）	—	13,027,769.34	13,027,769.34
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）	-3,500,000.00	-1,295,643.02	-4,795,643.02
其中：1. 基金申购款	7,000,000.00	2,403,089.15	9,403,089.15
2. 基金赎回款	-10,500,000.00	-3,698,732.17	-14,198,732.17
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）	119,026,092.00	49,427,029.05	168,453,121.05
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 6 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）	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）	—	4,520,228.10	4,520,228.10
三、本期基金份额交易产生的基金	-217,000,000.00	-2,265,801.96	-219,265,801.96

净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	10,500,000.00	608,301.44	11,108,301.44
2. 基金赎回款	-227,500,000.00	-2,874,103.40	-230,374,103.40
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）	31,526,092.00	2,254,426.14	33,780,518.14

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：

陈 戈	林志松	徐慧
—————	—————	—————
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

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

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票)、存托凭证、债券(国家债券、央行票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资



券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率

#### **6.4.2 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 3 号《半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。

#### **6.4.3 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 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净值变动情况。

#### **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**

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### **6.4.5 会计差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **6.4.6 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。

#### 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	2,771,895.08
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	2,771,895.08

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

##### 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	150,440,610.68	165,506,041.90	15,065,431.22
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	170,700.00	180,162.95
	银行间市场	—	—
	合计	170,700.00	180,162.95
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	150,611,310.68	165,686,204.85	15,074,894.17

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

注：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

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

#### 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	231.58
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	7.80
应收债券利息	28.51
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	2.10
合计	269.99

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）
其他应收款	—
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

#### 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	24,996.13
银行间市场应付交易费用	—
合计	24,996.13

#### 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	—

应付证券出借违约金	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	64,876.39
应付指数使用费	35,000.00
IOPV 计算发布费	9,916.99
合计	169,793.38

#### 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	122,526,092.00	122,526,092.00
本期申购	7,000,000.00	7,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-10,500,000.00	-10,500,000.00
本期末	119,026,092.00	119,026,092.00

#### 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	21,566,685.26	16,128,217.47	37,694,902.73
本期利润	10,707,777.08	2,319,992.26	13,027,769.34
本期基金份额交易产生的变动数	-609,978.56	-685,664.46	-1,295,643.02
其中：基金申购款	1,607,342.16	795,746.99	2,403,089.15
基金赎回款	-2,217,320.72	-1,481,411.45	-3,698,732.17
本期已分配利润	—	—	—
本期末	31,664,483.78	17,762,545.27	49,427,029.05

#### 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	3,237.42
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	308.96
其他	77.97
合计	3,624.35

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 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06月30日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	9,096,015.60
股票投资收益——赎回差价收入	750,449.42
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	9,846,465.02

##### 6.4.7.12.2 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06月30日）
卖出股票成交总额	26,848,111.21
减：卖出股票成本总额	17,752,095.61
买卖股票差价收入	9,096,015.60

##### 6.4.7.12.3 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06月30日）
赎回基金份额对价总额	14,198,732.17
减：现金支付赎回款总额	6,096,013.17
减：赎回股票成本总额	7,352,269.58
赎回差价收入	750,449.42

##### 6.4.7.12.4 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。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 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06月30日）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	301,839.54
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	258,300.00
减：应收利息总额	38.98
买卖债券差价收入	43,500.56

### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

### 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

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

#### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

### 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	1,262,143.63
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	1,262,143.63

### 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	2,319,992.26
股票投资	2,318,051.81
债券投资	1,940.45
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	2,319,992.26

### 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	—

替代损益	21,262.71
合计	21,262.71

#### 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	79,959.88
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	79,959.88

#### 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	14,876.39
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	230.00
指数使用费	70,000.00
其他	84,300.75
合计	229,407.14

### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 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。

### 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

#### 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
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
申万宏源证券承销保荐有限责任公司（“申万宏源承销保荐”）	基金管理人的股东控制的子公司



注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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5月13日(基金合同生效日)至2020年6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(%)
海通证券	413,414.36	0.90	—	—
申万宏源	1,099,795.01	2.39	—	—

##### 6.4.10.1.2 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。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

##### 6.4.10.1.4 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。

##### 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)			
	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
申万宏源	1,002.22	2.88	256.49	1.03
海通证券	376.78	1.08	45.60	0.18
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6月30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	115,285.37	34.36	115,285.37	34.36

海通证券	38,701.00	11.53	38,701.00	11.53
------	-----------	-------	-----------	-------

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。

#### 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5月13日（基金合同生效日）至2020年6月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	119,931.48	23,238.88
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。

##### 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5月13日（基金合同生效日）至2020年6月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	39,977.15	7,746.28

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。

#### 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

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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 6.4.10.5 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06月30日）		上年度可比期间（2020年5月13日（基金合同生效日）至2020年6月30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	2,771,895.08	3,237.42	—	—

#### 6.4.10.6 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06月30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	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	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

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 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）。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

##### 6.4.12.1.1 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
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	—
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股限售	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	—
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	—
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股限售	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	—
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	21.31	49.94	259	5,519.29	12,934.46	—
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	—

300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	—
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	—
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股限售	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	—
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股限售	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	—
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股限售	28.77	99.85	189	5,437.53	18,871.65	—
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股限售	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	—
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	—
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	120	5,679.60	30,235.20	—
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	—
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	—
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	—
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	—
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股限售	6.87	12.07	734	5,042.58	8,859.38	—
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股限售	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	—
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	—
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股限售	28.28	115.71	159	4,496.52	18,397.89	—
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	—
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	—
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	33.22	87.50	213	7,075.86	18,637.50	—
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	133	6,462.47	12,021.87	—
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	24.90	24.81	177	4,407.30	4,391.37	—
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	—
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股限售	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	—
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	—
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	—
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	—
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股限售	4.94	13.05	838	4,139.72	10,935.90	—
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	—
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	—
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股限售	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	—
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	—
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	—
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股认购	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股认购	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	—
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股认购	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	—
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股认购	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	—
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股认购	21.96	21.96	1,802	39,571.92	39,571.92	—
688161	威高骨科	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	36.22	82.27	1,154	41,797.88	94,939.58	—

688201	信安世纪	2021-04-13	2021-10-21	新股限售	26.78	45.41	1,672	44,776.16	75,925.52	—
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股认购	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	—
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股认购	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	—
688269	凯立新材	2021-06-01	2021-12-09	新股限售	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	—
688383	新益昌	2021-04-21	2021-10-28	新股限售	19.58	106.24	2,195	42,978.10	233,196.80	—
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股认购	38.85	38.85	1,323	51,398.55	51,398.55	—
688616	西力科技	2021-03-10	2021-09-22	新股限售	7.35	13.78	3,918	28,797.30	53,990.04	—
688655	迅捷兴	2021-04-28	2021-11-11	新股限售	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91	—
688665	四方光电	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	29.53	129.46	1,518	44,826.54	196,520.28	—
688696	极米科技	2021-02-23	2021-09-03	新股限售	133.73	780.24	429	57,370.17	334,722.96	—

#### 6.4.12.1.2 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
113049	长汽转债	2021-06-11	2021-07-08	认购新发 证券	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.00	
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	认购新发 证券	100.00	100.00	290	29,000.00	29,000.00	
113050	南银转债	2021-06-16	2021-07-01	认购新发 证券	100.00	100.00	610	61,000.00	61,000.00	
113051	节能转债	2021-06-22	2021-07-22	认购新发 证券	100.00	100.00	110	11,000.00	11,000.00	
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	认购新发 证券	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.00	
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	认购新发 证券	100.00	100.00	62	6,200.00	6,200.00	

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。

#### 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021-06-16	筹划重大事项	5.59	2021-07-06	6.15	23,700	228,558.06	132,483.00	—
600460	士兰微	2021-06-30	筹划重大事项	56.35	2021-07-01	59.49	4,800	90,560.57	270,480.00	—
600811	东方集团	2021-06-30	筹划重大事项	3.05	2021-07-14	3.36	18,000	84,421.64	54,900.00	—

### 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

注：截至本报告期末 2021 年 06 月 30 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。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 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。

### 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。

#### 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。

#### 6.4.13.2.1 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。

#### 6.4.13.2.2 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 06 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
AAA	147,518.90	101,245.40

AAA 以下	32,644.05	27,577.10
未评级	—	—
合计	180,162.95	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。

### 6.4.13.2.3 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。

### 6.4.13.2.4 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。

#### 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。

##### 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 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### 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。

#### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

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

单位：人民币元

本期末（2021年06月30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	2,771,895.08	—	—	—	—	—	2,771,895.08
结算备付金	17,297.14	—	—	—	—	—	17,297.14
存出保证金	4,675.37	—	—	—	—	—	4,675.37
交易性金融资产	—	—	180,162.95	—	—	165,506,041.90	165,686,204.85
应收证券清算款	—	—	—	—	—	119,163.48	119,163.48
应收利息	—	—	—	—	—	269.99	269.99
其他资产	—	—	—	—	—	75,616.24	75,616.24
资产总计	2,793,867.59	—	180,162.95	—	—	165,701,091.61	168,675,122.15
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	20,408.71	20,408.71
应付托管费	—	—	—	—	—	6,802.88	6,802.88
应付交易费用	—	—	—	—	—	24,996.13	24,996.13
其他负债	—	—	—	—	—	169,793.38	169,793.38
负债总计	—	—	—	—	—	222,001.10	222,001.10
利率敏感度缺口	2,793,867.59	—	180,162.95	—	—	165,479,090.51	168,453,121.05
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

#### 6.4.13.4.1.2 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。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

##### 6.4.13.4.3.1 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 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	165,506,041.90	98.25	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	180,162.95	0.11	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	165,686,204.85	98.36	158,869,079.75	99.16

#### 6.4.13.4.3.2 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：元）	
		本期末（2021年06月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	1,674,549.96	1,494,029.13
2. 业绩比较基准减少 1%	-1,674,549.96	-1,494,029.13	

#### 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 公允价值

##### 6.4.14.1.1 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。

##### 6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

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人民币163,207,203.58元，属于第二层次的余额为人民币858,771.95元，属于第三层次余额为人民币1,620,229.32元。

##### 6.4.14.1.2.2 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。

##### 6.4.14.1.2.3 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，本期变动人民币 1,462,381.50 元，本期末人民币 1,620,229.32 元。

#### 6.4.14.2 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。

#### 6.4.14.3 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。

## § 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	165,506,041.90	98.12
	其中：股票	165,506,041.90	98.12
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	180,162.95	0.11
	其中：债券	180,162.95	0.11
	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	2,789,192.22	1.65
8	其他各项资产	199,725.08	0.12
9	合计	168,675,122.15	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

##### 7.2.1.1 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	5,439.50	0.00
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,831,202.16	1.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	11,014.44	0.01

F	批发和零售业	77,638.12	0.05
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	119,337.62	0.07
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	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	30,146.60	0.02
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	2,087,798.83	1.24

### 7.2.1.2 指数投资按行业分类的股票投资组合：

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,718,344.92	1.02
B	采矿业	4,026,102.10	2.39
C	制造业	92,930,392.41	55.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,119,583.30	1.85
E	建筑业	2,256,717.00	1.34
F	批发和零售业	2,165,842.60	1.29
G	交通运输、仓储和邮政业	4,281,716.16	2.54
H	住宿和餐饮业	208,260.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,022,089.30	4.17
J	金融业	32,477,874.44	19.28
K	房地产业	3,856,955.20	2.29
L	租赁和商务服务业	2,868,396.80	1.70
M	科学研究和技术服务业	1,874,375.88	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	317,784.50	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	258,341.20	0.15
Q	卫生和社会工作	2,799,763.26	1.66
R	文化、体育和娱乐业	909,833.00	0.54
S	综合	325,871.00	0.19
	合计	163,418,243.07	97.01

### 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	600519	贵州茅台	3,500	7,198,450.00	4.27
2	601318	中国平安	65,100	4,184,628.00	2.48
3	600036	招商银行	74,400	4,031,736.00	2.39
4	000858	五粮液	11,800	3,515,102.00	2.09
5	601012	隆基股份	24,780	2,201,455.20	1.31
6	000333	美的集团	29,700	2,119,689.00	1.26
7	600276	恒瑞医药	26,972	1,833,286.84	1.09
8	601166	兴业银行	87,400	1,796,070.00	1.07
9	601888	中国中免	5,968	1,790,996.80	1.06
10	002415	海康威视	25,900	1,670,550.00	0.99
11	603259	药明康德	10,432	1,633,546.88	0.97
12	300059	东方财富	49,756	1,631,499.24	0.97
13	000651	格力电器	29,000	1,510,900.00	0.90
14	002594	比亚迪	5,500	1,380,500.00	0.82
15	600900	长江电力	65,500	1,351,920.00	0.80
16	600887	伊利股份	36,300	1,336,929.00	0.79
17	000001	平安银行	58,300	1,318,746.00	0.78
18	002475	立讯精密	28,620	1,316,520.00	0.78
19	600030	中信证券	51,200	1,276,928.00	0.76
20	000725	京东方A	188,600	1,176,864.00	0.70
21	601398	工商银行	210,700	1,089,319.00	0.65
22	300015	爱尔眼科	14,937	1,060,228.26	0.63
23	000568	泸州老窖	4,400	1,038,136.00	0.62
24	600309	万华化学	9,500	1,033,790.00	0.61
25	600031	三一重工	35,100	1,020,357.00	0.61
26	603288	海天味业	7,660	987,757.00	0.59
27	000002	万科A	41,000	976,210.00	0.58
28	002714	牧原股份	15,946	969,835.72	0.58
29	603501	韦尔股份	3,000	966,000.00	0.57
30	600809	山西汾酒	2,100	940,800.00	0.56
31	601919	中远海控	29,200	891,768.00	0.53
32	300122	智飞生物	4,600	858,958.00	0.51
33	002142	宁波银行	20,800	810,576.00	0.48
34	601328	交通银行	165,100	808,990.00	0.48
35	600436	片仔癀	1,800	806,940.00	0.48
36	601899	紫金矿业	83,000	804,270.00	0.48



37	002304	洋河股份	3,700	766,640.00	0.46
38	002352	顺丰控股	11,000	744,700.00	0.44
39	002230	科大讯飞	10,800	729,864.00	0.43
40	300014	亿纬锂能	6,871	714,103.03	0.42
41	300274	阳光电源	6,200	713,372.00	0.42
42	600000	浦发银行	70,600	706,000.00	0.42
43	600438	通威股份	16,300	705,301.00	0.42
44	300124	汇川技术	9,350	694,331.00	0.41
45	002812	恩捷股份	2,900	678,890.00	0.40
46	000661	长春高新	1,700	657,900.00	0.39
47	000100	TCL 科技	84,300	644,895.00	0.38
48	600837	海通证券	55,500	638,250.00	0.38
49	300347	泰格医药	3,300	637,890.00	0.38
50	002241	歌尔股份	14,500	619,730.00	0.37
51	000063	中兴通讯	18,200	604,786.00	0.36
52	600585	海螺水泥	14,600	599,330.00	0.36
53	601601	中国太保	20,600	596,782.00	0.35
54	002460	赣锋锂业	4,900	593,341.00	0.35
55	600690	海尔智家	22,900	593,339.00	0.35
56	002271	东方雨虹	10,700	591,924.00	0.35
57	601668	中国建筑	126,800	589,620.00	0.35
58	300142	沃森生物	9,500	586,150.00	0.35
59	002027	分众传媒	62,200	585,302.00	0.35
60	600763	通策医疗	1,400	575,400.00	0.34
61	603799	华友钴业	5,000	571,000.00	0.34
62	600016	民生银行	128,600	567,126.00	0.34
63	603986	兆易创新	3,000	563,700.00	0.33
64	600196	复星医药	7,300	526,549.00	0.31
65	601288	农业银行	173,700	526,311.00	0.31
66	600048	保利地产	43,400	522,536.00	0.31
67	000338	潍柴动力	28,800	514,656.00	0.31
68	600919	江苏银行	71,300	506,230.00	0.30
69	600703	三安光电	15,600	499,980.00	0.30
70	601229	上海银行	60,200	493,640.00	0.29
71	601688	华泰证券	31,000	489,800.00	0.29
72	002129	中环股份	12,400	478,640.00	0.28
73	601816	京沪高铁	90,200	477,158.00	0.28
74	600660	福耀玻璃	8,500	474,725.00	0.28
75	600570	恒生电子	5,070	472,777.50	0.28
76	601211	国泰君安	27,300	467,922.00	0.28
77	600104	上汽集团	21,200	465,764.00	0.28

78	601766	中国中车	73,500	446,880.00	0.27
79	601169	北京银行	89,500	435,865.00	0.26
80	600999	招商证券	22,470	427,379.40	0.25
81	600050	中国联通	96,700	417,744.00	0.25
82	002311	海大集团	5,100	416,160.00	0.25
83	002371	北方华创	1,500	416,070.00	0.25
84	600019	宝钢股份	53,900	411,796.00	0.24
85	002049	紫光国微	2,600	400,894.00	0.24
86	002410	广联达	5,800	395,560.00	0.23
87	601988	中国银行	127,400	392,392.00	0.23
88	600406	国电南瑞	16,800	390,432.00	0.23
89	601088	中国神华	20,000	390,400.00	0.23
90	300498	温氏股份	26,960	387,415.20	0.23
91	002709	天赐材料	3,600	383,688.00	0.23
92	000538	云南白药	3,300	381,876.00	0.23
93	601818	光大银行	99,600	376,488.00	0.22
94	000625	长安汽车	13,700	360,036.00	0.21
95	600028	中国石化	80,900	352,724.00	0.21
96	600745	闻泰科技	3,600	348,840.00	0.21
97	600893	航发动力	6,500	345,735.00	0.21
98	300601	康泰生物	2,300	342,700.00	0.20
99	601628	中国人寿	10,100	342,289.00	0.20
100	600346	恒力石化	12,800	335,872.00	0.20
101	601633	长城汽车	7,700	335,643.00	0.20
102	002821	凯莱英	900	335,340.00	0.20
103	600588	用友网络	9,940	330,604.40	0.20
104	601658	邮储银行	65,400	328,308.00	0.19
105	601390	中国中铁	61,600	322,784.00	0.19
106	603486	科沃斯	1,400	319,312.00	0.19
107	002493	荣盛石化	18,400	317,768.00	0.19
108	601009	南京银行	30,100	316,652.00	0.19
109	688111	金山办公	800	315,840.00	0.19
110	601377	兴业证券	32,500	313,950.00	0.19
111	601857	中国石油	58,800	311,052.00	0.18
112	300413	芒果超媒	4,500	308,700.00	0.18
113	600132	重庆啤酒	1,500	296,925.00	0.18
114	300595	欧普康视	2,860	296,153.00	0.18
115	600089	特变电工	22,500	289,125.00	0.17
116	601225	陕西煤业	24,200	286,770.00	0.17
117	000009	中国宝安	15,600	285,012.00	0.17
118	600009	上海机场	5,900	283,967.00	0.17

119	002601	龙佰集团	8,200	283,556.00	0.17
120	000799	酒鬼酒	1,100	281,160.00	0.17
121	300408	三环集团	6,600	279,972.00	0.17
122	600426	华鲁恒升	9,030	279,478.50	0.17
123	002179	中航光电	3,500	276,570.00	0.16
124	600111	北方稀土	13,200	273,240.00	0.16
125	000776	广发证券	18,000	272,520.00	0.16
126	603882	金域医学	1,700	271,609.00	0.16
127	600584	长电科技	7,200	271,296.00	0.16
128	600460	士兰微	4,800	270,480.00	0.16
129	002001	新和成	9,420	270,165.60	0.16
130	002074	国轩高科	6,200	270,072.00	0.16
131	601939	建设银行	40,600	269,990.00	0.16
132	300433	蓝思科技	9,100	267,631.00	0.16
133	600926	杭州银行	18,000	265,500.00	0.16
134	002050	三花智控	10,930	262,101.40	0.16
135	300450	先导智能	4,300	258,602.00	0.15
136	002340	格林美	27,500	257,125.00	0.15
137	000166	申万宏源	54,500	255,060.00	0.15
138	600600	青岛啤酒	2,200	254,430.00	0.15
139	600958	东方证券	25,300	252,747.00	0.15
140	688169	石头科技	200	252,200.00	0.15
141	600741	华域汽车	9,600	252,192.00	0.15
142	688036	传音控股	1,200	251,400.00	0.15
143	688012	中微公司	1,500	248,880.00	0.15
144	002841	视源股份	2,000	248,580.00	0.15
145	601100	恒立液压	2,892	248,480.64	0.15
146	000963	华东医药	5,400	248,454.00	0.15
147	000895	双汇发展	7,800	248,040.00	0.15
148	300003	乐普医疗	7,700	247,324.00	0.15
149	002007	华兰生物	6,700	245,756.00	0.15
150	000786	北新建材	6,200	243,350.00	0.14
151	300285	国瓷材料	4,900	238,875.00	0.14
152	000157	中联重科	25,800	238,392.00	0.14
153	601006	大秦铁路	36,000	236,880.00	0.14
154	601336	新华保险	5,100	234,141.00	0.14
155	002607	中公教育	11,200	233,968.00	0.14
156	601233	桐昆股份	9,700	233,673.00	0.14
157	601901	方正证券	24,900	233,064.00	0.14
158	600015	华夏银行	37,200	230,268.00	0.14
159	002236	大华股份	10,900	229,990.00	0.14

160	603806	福斯特	2,180	229,183.40	0.14
161	601155	新城控股	5,500	228,800.00	0.14
162	601989	中国重工	55,200	227,424.00	0.14
163	600143	金发科技	10,900	227,374.00	0.13
164	600176	中国巨石	14,502	224,926.02	0.13
165	000768	中航西飞	8,400	220,752.00	0.13
166	603993	洛阳钼业	42,700	220,332.00	0.13
167	601877	正泰电器	6,600	220,308.00	0.13
168	600760	中航沈飞	3,640	219,492.00	0.13
169	300207	欣旺达	6,700	218,152.00	0.13
170	603369	今世缘	4,000	216,640.00	0.13
171	600352	浙江龙盛	15,700	215,718.00	0.13
172	600010	包钢股份	137,800	213,590.00	0.13
173	601788	光大证券	11,800	211,102.00	0.13
174	600547	山东黄金	10,960	210,651.20	0.13
175	001979	招商蛇口	19,200	210,240.00	0.12
176	002008	大族激光	5,200	210,028.00	0.12
177	601600	中国铝业	39,600	209,880.00	0.12
178	300529	健帆生物	2,400	207,264.00	0.12
179	300316	晶盛机电	4,100	207,050.00	0.12
180	601186	中国铁建	27,800	206,554.00	0.12
181	002185	华天科技	13,300	204,687.00	0.12
182	002202	金风科技	16,700	203,072.00	0.12
183	601138	工业富联	16,300	202,283.00	0.12
184	600885	宏发股份	3,200	200,640.00	0.12
185	601916	浙商银行	50,300	199,691.00	0.12
186	000876	新希望	13,600	199,512.00	0.12
187	002555	三七互娱	8,100	194,562.00	0.12
188	603899	晨光文具	2,300	194,488.00	0.12
189	003816	中国广核	71,300	190,371.00	0.11
190	000938	紫光股份	8,680	189,918.40	0.11
191	002736	国信证券	17,500	188,125.00	0.11
192	601066	中信建投	5,900	185,437.00	0.11
193	600109	国金证券	14,600	185,274.00	0.11
194	000069	华侨城A	24,800	184,512.00	0.11
195	300136	信维通信	5,900	182,192.00	0.11
196	601636	旗滨集团	9,800	181,888.00	0.11
197	603160	汇顶科技	1,400	181,482.00	0.11
198	000425	徐工机械	28,400	180,908.00	0.11
199	601799	星宇股份	800	180,576.00	0.11
200	600150	中国船舶	10,900	179,959.00	0.11

201	600733	北汽蓝谷	13,300	179,284.00	0.11
202	601669	中国电建	46,300	179,181.00	0.11
203	688008	澜起科技	2,800	174,664.00	0.10
204	000977	浪潮信息	6,200	174,406.00	0.10
205	600795	国电电力	71,300	173,259.00	0.10
206	603737	三棵树	980	172,480.00	0.10
207	000783	长江证券	23,400	171,288.00	0.10
208	603019	中科曙光	6,200	171,182.00	0.10
209	300146	汤臣倍健	5,200	171,080.00	0.10
210	300037	新宙邦	1,700	170,170.00	0.10
211	002624	完美世界	7,100	169,761.00	0.10
212	600079	人福医药	6,000	169,620.00	0.10
213	300253	卫宁健康	10,400	169,208.00	0.10
214	601838	成都银行	13,100	165,584.00	0.10
215	002353	杰瑞股份	3,700	165,390.00	0.10
216	002384	东山精密	7,900	164,636.00	0.10
217	002648	卫星石化	4,200	164,598.00	0.10
218	600183	生益科技	7,000	163,870.00	0.10
219	601985	中国核电	32,200	162,932.00	0.10
220	600886	国投电力	16,900	162,409.00	0.10
221	300677	英科医疗	1,300	162,240.00	0.10
222	600884	杉杉股份	6,940	161,840.80	0.10
223	600029	南方航空	26,700	160,734.00	0.10
224	300144	宋城演艺	9,540	160,272.00	0.10
225	603517	绝味食品	1,900	160,151.00	0.10
226	601127	小康股份	2,400	160,008.00	0.09
227	601108	财通证券	15,200	159,448.00	0.09
228	002414	高德红外	5,764	158,971.12	0.09
229	002138	顺络电子	4,100	158,957.00	0.09
230	601360	三六零	13,000	158,730.00	0.09
231	002938	鹏鼎控股	4,400	157,872.00	0.09
232	002600	领益智造	17,100	157,149.00	0.09
233	601555	东吴证券	18,800	156,792.00	0.09
234	600219	南山铝业	43,300	155,880.00	0.09
235	600085	同仁堂	3,800	155,230.00	0.09
236	000066	中国长城	10,600	154,760.00	0.09
237	603833	欧派家居	1,080	153,316.80	0.09
238	002625	光启技术	7,300	151,913.00	0.09
239	600779	水井坊	1,200	151,620.00	0.09
240	002044	美年健康	16,600	151,226.00	0.09
241	000703	恒逸石化	12,580	150,331.00	0.09

242	603589	口子窖	2,200	148,918.00	0.09
243	601077	渝农商行	37,300	148,827.00	0.09
244	002223	鱼跃医疗	3,900	148,707.00	0.09
245	600522	中天科技	14,800	148,000.00	0.09
246	601607	上海医药	7,000	147,910.00	0.09
247	000728	国元证券	18,550	147,843.50	0.09
248	000547	航天发展	7,800	147,186.00	0.09
249	300033	同花顺	1,300	146,614.00	0.09
250	002444	巨星科技	4,300	146,544.00	0.09
251	600989	宝丰能源	10,700	146,376.00	0.09
252	688099	晶晨股份	1,300	145,860.00	0.09
253	600332	白云山	4,300	145,555.00	0.09
254	002602	世纪华通	22,580	144,963.60	0.09
255	600161	天坛生物	4,220	144,535.00	0.09
256	300699	光威复材	1,900	144,305.00	0.09
257	000596	古井贡酒	600	143,700.00	0.09
258	600872	中炬高新	3,400	142,868.00	0.08
259	300628	亿联网络	1,700	142,460.00	0.08
260	601238	广汽集团	11,000	142,450.00	0.08
261	002212	天融信	7,200	142,344.00	0.08
262	300676	华大基因	1,200	142,320.00	0.08
263	600362	江西铜业	6,300	140,994.00	0.08
264	601111	中国国航	18,100	140,818.00	0.08
265	688002	睿创微纳	1,408	140,560.64	0.08
266	600383	金地集团	13,700	140,288.00	0.08
267	601099	太平洋	41,200	139,668.00	0.08
268	002252	上海莱士	18,600	139,314.00	0.08
269	000860	顺鑫农业	3,300	139,194.00	0.08
270	601800	中国交建	21,400	138,672.00	0.08
271	002797	第一创业	19,400	138,516.00	0.08
272	600115	中国东航	27,100	137,668.00	0.08
273	600739	辽宁成大	6,600	137,346.00	0.08
274	601168	西部矿业	11,500	137,195.00	0.08
275	002385	大北农	20,100	136,680.00	0.08
276	600754	锦江酒店	2,400	136,680.00	0.08
277	603659	璞泰来	1,000	136,600.00	0.08
278	600704	物产中大	17,200	135,364.00	0.08
279	002508	老板电器	2,900	134,850.00	0.08
280	300308	中际旭创	3,500	134,820.00	0.08
281	002916	深南电路	1,200	133,356.00	0.08
282	000636	风华高科	4,400	132,968.00	0.08

283	600061	国投资本	15,656	132,919.44	0.08
284	002024	苏宁易购	23,700	132,483.00	0.08
285	600862	中航高科	4,300	132,354.00	0.08
286	600392	盛和资源	7,600	131,936.00	0.08
287	000988	华工科技	5,600	131,712.00	0.08
288	000830	鲁西化工	7,000	131,110.00	0.08
289	002439	启明星辰	4,500	130,545.00	0.08
290	601117	中国化学	14,900	130,524.00	0.08
291	002422	科伦药业	6,500	129,675.00	0.08
292	000708	中信特钢	6,200	129,208.00	0.08
293	601618	中国中冶	43,200	128,736.00	0.08
294	002078	太阳纸业	9,600	128,160.00	0.08
295	002507	涪陵榨菜	3,400	128,044.00	0.08
296	600699	均胜电子	5,000	127,600.00	0.08
297	002030	达安基因	5,972	126,845.28	0.08
298	600563	法拉电子	800	126,688.00	0.08
299	600315	上海家化	2,100	126,294.00	0.07
300	000807	云铝股份	10,600	126,140.00	0.07
301	601878	浙商证券	9,600	125,568.00	0.07
302	002250	联化科技	4,500	125,550.00	0.07
303	600705	中航产融	32,400	125,388.00	0.07
304	601021	春秋航空	2,200	125,180.00	0.07
305	600068	葛洲坝	16,700	125,083.00	0.07
306	600486	扬农化工	1,100	122,947.00	0.07
307	300088	长信科技	14,800	122,248.00	0.07
308	000630	铜陵有色	44,600	121,312.00	0.07
309	600845	宝信软件	2,380	121,142.00	0.07
310	600606	绿地控股	22,100	120,445.00	0.07
311	600201	生物股份	6,900	120,405.00	0.07
312	002028	思源电气	3,900	120,081.00	0.07
313	300558	贝达药业	1,100	119,064.00	0.07
314	002013	中航机电	11,800	118,826.00	0.07
315	000039	中集集团	6,500	118,170.00	0.07
316	601990	南京证券	11,200	117,824.00	0.07
317	601162	天风证券	24,200	117,612.00	0.07
318	002075	沙钢股份	10,700	116,737.00	0.07
319	002127	南极电商	11,900	116,263.00	0.07
320	002456	欧菲光	13,000	115,440.00	0.07
321	000513	丽珠集团	2,300	115,046.00	0.07
322	601727	上海电气	27,000	114,480.00	0.07
323	002157	正邦科技	9,500	113,525.00	0.07

324	002463	沪电股份	7,300	112,931.00	0.07
325	000656	金科股份	19,400	112,326.00	0.07
326	600011	华能国际	26,600	112,252.00	0.07
327	300001	特锐德	3,700	111,407.00	0.07
328	600177	雅戈尔	16,900	111,371.00	0.07
329	300223	北京君正	1,100	111,012.00	0.07
330	601997	贵阳银行	15,500	110,980.00	0.07
331	002511	中顺洁柔	4,000	110,200.00	0.07
332	300482	万孚生物	1,690	109,326.10	0.06
333	601933	永辉超市	23,100	109,263.00	0.06
334	300357	我武生物	1,700	109,004.00	0.06
335	600655	豫园股份	9,400	108,946.00	0.06
336	002273	水晶光电	7,400	108,706.00	0.06
337	600549	厦门钨业	5,200	108,316.00	0.06
338	002603	以岭药业	3,700	107,892.00	0.06
339	601005	重庆钢铁	40,300	107,601.00	0.06
340	002080	中材科技	4,100	107,297.00	0.06
341	000021	深科技	5,600	107,184.00	0.06
342	002092	中泰化学	10,400	106,808.00	0.06
343	600171	上海贝岭	3,500	106,505.00	0.06
344	600988	赤峰黄金	7,100	106,429.00	0.06
345	603444	吉比特	200	106,000.00	0.06
346	002465	海格通信	11,200	105,952.00	0.06
347	000739	普洛药业	3,600	105,840.00	0.06
348	600118	中国卫星	3,600	105,336.00	0.06
349	300168	万达信息	7,200	105,120.00	0.06
350	601696	中银证券	5,100	105,009.00	0.06
351	600066	宇通客车	8,400	104,916.00	0.06
352	601216	君正集团	20,500	104,345.00	0.06
353	300009	安科生物	6,972	103,882.80	0.06
354	601128	常熟银行	16,700	103,540.00	0.06
355	300244	迪安诊断	2,700	103,410.00	0.06
356	000825	太钢不锈	13,800	103,362.00	0.06
357	000983	山西焦煤	12,410	103,127.10	0.06
358	600848	上海临港	5,760	103,104.00	0.06
359	600516	方大炭素	13,840	102,969.60	0.06
360	600867	通化东宝	8,600	102,684.00	0.06
361	000998	隆平高科	6,400	102,656.00	0.06
362	300618	寒锐钴业	1,300	102,492.00	0.06
363	600637	东方明珠	12,400	101,556.00	0.06
364	300463	迈克生物	2,400	101,016.00	0.06



365	600489	中金黄金	11,700	100,854.00	0.06
366	600418	江淮汽车	8,100	100,683.00	0.06
367	600018	上港集团	21,100	100,647.00	0.06
368	002299	圣农发展	4,200	100,296.00	0.06
369	688396	华润微	1,100	100,122.00	0.06
370	600316	洪都航空	2,600	100,048.00	0.06
371	600879	航天电子	13,200	99,264.00	0.06
372	002152	广电运通	7,600	99,028.00	0.06
373	600827	百联股份	4,900	98,735.00	0.06
374	002156	通富微电	4,100	98,564.00	0.06
375	600529	山东药玻	2,900	98,455.00	0.06
376	002558	巨人网络	7,400	98,420.00	0.06
377	601995	中金公司	1,600	98,400.00	0.06
378	000932	华菱钢铁	14,900	98,340.00	0.06
379	600487	亨通光电	8,600	98,040.00	0.06
380	300070	碧水源	13,400	97,954.00	0.06
381	000750	国海证券	23,100	97,944.00	0.06
382	600369	西南证券	20,100	97,887.00	0.06
383	000960	锡业股份	6,100	97,783.00	0.06
384	603893	瑞芯微	700	97,622.00	0.06
385	000723	美锦能源	12,900	97,524.00	0.06
386	600380	健康元	7,100	97,483.00	0.06
387	601689	拓普集团	2,600	97,318.00	0.06
388	002373	千方科技	5,800	96,860.00	0.06
389	300271	华宇软件	5,000	96,250.00	0.06
390	600166	福田汽车	27,800	95,910.00	0.06
391	000975	银泰黄金	10,080	95,860.80	0.06
392	688208	道通科技	1,100	95,689.00	0.06
393	601615	明阳智能	5,900	95,521.00	0.06
394	002131	利欧股份	40,800	95,472.00	0.06
395	600909	华安证券	17,140	95,469.80	0.06
396	002120	韵达股份	7,040	95,251.20	0.06
397	000050	深天马A	6,700	95,006.00	0.06
398	600038	中直股份	1,800	94,932.00	0.06
399	601998	中信银行	18,600	94,860.00	0.06
400	002690	美亚光电	1,700	94,792.00	0.06
401	002572	索菲亚	3,900	94,380.00	0.06
402	002926	华西证券	9,600	92,448.00	0.05
403	601198	东兴证券	8,400	91,812.00	0.05
404	300296	利亚德	11,700	91,494.00	0.05
405	600642	申能股份	14,900	91,486.00	0.05

406	300115	长盈精密	4,440	91,464.00	0.05
407	601872	招商轮船	19,680	90,921.60	0.05
408	002180	纳思达	2,800	90,160.00	0.05
409	601866	中远海发	24,000	90,000.00	0.05
410	601319	中国人保	15,100	89,543.00	0.05
411	300630	普利制药	1,706	89,394.40	0.05
412	002673	西部证券	10,800	89,100.00	0.05
413	688009	中国通号	15,600	88,764.00	0.05
414	600271	航天信息	6,800	88,604.00	0.05
415	000623	吉林敖东	5,700	88,293.00	0.05
416	300474	景嘉微	900	88,128.00	0.05
417	603156	养元饮品	3,080	88,026.40	0.05
418	600998	九州通	5,700	87,609.00	0.05
419	688126	沪硅产业	3,000	87,540.00	0.05
420	002500	山西证券	13,040	87,498.40	0.05
421	002739	万达电影	5,500	86,845.00	0.05
422	601699	潞安环能	7,300	86,213.00	0.05
423	600188	兖州煤业	5,600	86,016.00	0.05
424	600895	张江高科	4,700	85,869.00	0.05
425	002294	信立泰	2,600	85,540.00	0.05
426	600415	小商品城	16,600	85,490.00	0.05
427	000012	南玻A	8,300	84,992.00	0.05
428	600153	建发股份	10,400	84,240.00	0.05
429	603939	益丰药房	1,500	84,135.00	0.05
430	601881	中国银河	7,800	84,084.00	0.05
431	002382	蓝帆医疗	4,000	83,400.00	0.05
432	002372	伟星新材	4,000	82,680.00	0.05
433	600667	太极实业	9,000	81,900.00	0.05
434	300418	昆仑万维	5,000	81,900.00	0.05
435	002557	洽洽食品	1,900	81,890.00	0.05
436	600707	彩虹股份	8,700	81,867.00	0.05
437	600765	中航重机	3,600	81,540.00	0.05
438	600535	天士力	5,500	81,455.00	0.05
439	600390	五矿资本	13,600	81,328.00	0.05
440	600256	广汇能源	24,400	81,252.00	0.05
441	600060	海信视像	4,800	81,120.00	0.05
442	300024	机器人	7,600	81,092.00	0.05
443	002670	国盛金控	7,100	80,869.00	0.05
444	603195	公牛集团	400	80,800.00	0.05
445	600008	首创环保	26,630	80,156.30	0.05
446	000027	深圳能源	8,700	79,779.00	0.05

447	000878	云南铜业	6,200	79,546.00	0.05
448	600511	国药股份	2,400	79,344.00	0.05
449	600155	华创阳安	7,400	79,180.00	0.05
450	600208	新湖中宝	26,000	79,040.00	0.05
451	603658	安图生物	1,040	78,800.80	0.05
452	603858	步长制药	3,500	78,715.00	0.05
453	603605	珀莱雅	400	78,684.00	0.05
454	603338	浙江鼎力	1,340	78,644.60	0.05
455	600498	烽火通信	4,200	78,246.00	0.05
456	600372	中航电子	4,700	77,785.00	0.05
457	002683	宏大爆破	2,800	77,756.00	0.05
458	002019	亿帆医药	4,500	77,625.00	0.05
459	002174	游族网络	4,500	77,265.00	0.05
460	600233	圆通速递	7,700	77,077.00	0.05
461	002221	东华能源	7,000	76,650.00	0.05
462	000718	苏宁环球	9,200	76,268.00	0.05
463	600409	三友化工	7,500	75,825.00	0.05
464	600521	华海药业	3,600	75,168.00	0.04
465	000738	航发控制	3,600	74,988.00	0.04
466	000997	新大陆	4,500	74,655.00	0.04
467	600875	东方电气	6,800	74,596.00	0.04
468	603638	艾迪精密	1,740	74,593.80	0.04
469	002408	齐翔腾达	6,000	74,520.00	0.04
470	002146	荣盛发展	13,200	74,448.00	0.04
471	601717	郑煤机	6,400	74,432.00	0.04
472	002390	信邦制药	7,100	74,408.00	0.04
473	603866	桃李面包	2,380	74,256.00	0.04
474	600170	上海建工	26,900	74,244.00	0.04
475	002966	苏州银行	10,100	74,235.00	0.04
476	600497	驰宏锌锗	17,200	74,132.00	0.04
477	002506	协鑫集成	21,300	74,124.00	0.04
478	000401	冀东水泥	6,000	74,100.00	0.04
479	600801	华新水泥	4,200	73,794.00	0.04
480	300058	蓝色光标	12,100	73,205.00	0.04
481	603392	万泰生物	280	72,570.40	0.04
482	002958	青农商行	16,900	72,332.00	0.04
483	000686	东北证券	8,500	71,825.00	0.04
484	600160	巨化股份	8,100	71,604.00	0.04
485	600258	首旅酒店	3,000	71,580.00	0.04
486	603233	大参林	1,400	71,554.00	0.04
487	600141	兴发集团	3,800	71,554.00	0.04

488	002831	裕同科技	2,400	71,256.00	0.04
489	603707	健友股份	1,700	70,975.00	0.04
490	300315	掌趣科技	16,700	70,975.00	0.04
491	601231	环旭电子	4,200	70,602.00	0.04
492	002195	二三四五	34,700	70,441.00	0.04
493	002268	卫士通	3,600	70,128.00	0.04
494	600482	中国动力	4,000	69,680.00	0.04
495	300017	网宿科技	11,900	69,615.00	0.04
496	600325	华发股份	10,300	69,422.00	0.04
497	000540	中天金融	25,400	69,342.00	0.04
498	600859	王府井	2,400	69,312.00	0.04
499	603260	合盛硅业	900	69,219.00	0.04
500	603225	新凤鸣	3,400	69,020.00	0.04
501	600216	浙江医药	4,300	68,843.00	0.04
502	603927	中科软	1,600	68,720.00	0.04
503	601016	节能风电	18,300	68,442.00	0.04
504	600536	中国软件	1,200	68,316.00	0.04
505	000060	中金岭南	15,100	68,252.00	0.04
506	600027	华电国际	19,800	68,112.00	0.04
507	000158	常山北明	5,900	67,791.00	0.04
508	601992	金隅集团	25,200	67,788.00	0.04
509	300383	光环新网	4,700	67,633.00	0.04
510	000961	中南建设	11,400	67,488.00	0.04
511	600598	北大荒	4,500	67,320.00	0.04
512	600567	山鹰国际	19,500	67,275.00	0.04
513	688088	虹软科技	1,200	66,900.00	0.04
514	002429	兆驰股份	11,000	66,770.00	0.04
515	603077	和邦生物	32,000	66,560.00	0.04
516	002081	金螳螂	8,400	66,528.00	0.04
517	603198	迎驾贡酒	1,500	66,450.00	0.04
518	600282	南钢股份	18,600	66,216.00	0.04
519	600500	中化国际	8,400	66,024.00	0.04
520	002153	石基信息	2,800	65,828.00	0.04
521	600528	中铁工业	8,100	65,610.00	0.04
522	601577	长沙银行	7,300	65,262.00	0.04
523	600839	四川长虹	22,400	65,184.00	0.04
524	600580	卧龙电驱	4,900	65,170.00	0.04
525	600737	中粮糖业	6,500	65,065.00	0.04
526	002056	横店东磁	5,000	65,000.00	0.04
527	000671	阳光城	12,500	65,000.00	0.04
528	000581	威孚高科	3,100	64,573.00	0.04

529	000898	鞍钢股份	14,500	64,525.00	0.04
530	603883	老百姓	1,220	64,269.60	0.04
531	000999	华润三九	2,400	64,200.00	0.04
532	002595	豪迈科技	2,400	64,080.00	0.04
533	002396	星网锐捷	3,000	64,050.00	0.04
534	603290	斯达半导	200	64,000.00	0.04
535	002281	光迅科技	2,600	63,960.00	0.04
536	002203	海亮股份	6,000	63,840.00	0.04
537	002032	苏泊尔	1,000	63,790.00	0.04
538	300212	易华录	2,360	63,507.60	0.04
539	002939	长城证券	5,700	63,441.00	0.04
540	000709	河钢股份	25,700	63,222.00	0.04
541	600025	华能水电	10,900	63,111.00	0.04
542	600728	佳都科技	8,500	62,985.00	0.04
543	002745	木林森	4,700	62,980.00	0.04
544	002191	劲嘉股份	5,900	62,776.00	0.04
545	002124	天邦股份	8,940	62,669.40	0.04
546	002065	东华软件	7,900	62,647.00	0.04
547	601236	红塔证券	4,600	62,376.00	0.04
548	300182	捷成股份	12,500	62,375.00	0.04
549	688029	南微医学	200	62,338.00	0.04
550	000729	燕京啤酒	8,600	62,264.00	0.04
551	600340	华夏幸福	11,850	62,094.00	0.04
552	300166	东方国信	5,000	61,800.00	0.04
553	600808	马钢股份	14,400	61,776.00	0.04
554	002242	九阳股份	1,900	61,731.00	0.04
555	002010	传化智联	8,000	61,680.00	0.04
556	000930	中粮科技	6,800	61,268.00	0.04
557	000488	晨鸣纸业	7,500	61,050.00	0.04
558	002387	维信诺	5,800	60,494.00	0.04
559	002048	宁波华翔	3,100	60,450.00	0.04
560	600820	隧道股份	11,400	60,306.00	0.04
561	688321	微芯生物	1,300	60,047.00	0.04
562	002563	森马服饰	5,000	59,750.00	0.04
563	002004	华邦健康	9,600	59,616.00	0.04
564	000629	攀钢钒钛	26,000	59,540.00	0.04
565	600755	厦门国贸	7,200	59,112.00	0.04
566	600970	中材国际	6,400	58,688.00	0.03
567	603000	人民网	3,400	58,446.00	0.03
568	600803	新奥股份	3,500	57,785.00	0.03
569	603712	七一二	1,600	57,760.00	0.03

570	300002	神州泰岳	11,900	57,715.00	0.03
571	600398	海澜之家	7,900	57,196.00	0.03
572	601456	国联证券	3,700	56,980.00	0.03
573	600022	山东钢铁	33,100	56,932.00	0.03
574	000598	兴蓉环境	10,900	56,789.00	0.03
575	600037	歌华有线	5,900	56,699.00	0.03
576	600039	四川路桥	9,000	56,430.00	0.03
577	601106	中国一重	16,600	56,274.00	0.03
578	600597	光明乳业	3,900	56,199.00	0.03
579	600881	亚泰集团	19,700	56,145.00	0.03
580	688363	华熙生物	200	55,572.00	0.03
581	603885	吉祥航空	3,600	54,936.00	0.03
582	600811	东方集团	18,000	54,900.00	0.03
583	002002	鸿达兴业	13,900	54,627.00	0.03
584	601808	中海油服	3,800	54,568.00	0.03
585	000887	中鼎股份	4,500	54,360.00	0.03
586	601880	辽港股份	31,700	54,207.00	0.03
587	600260	ST凯乐	6,100	54,168.00	0.03
588	600348	华阳股份	7,300	54,166.00	0.03
589	000883	湖北能源	11,800	54,162.00	0.03
590	600782	新钢股份	9,700	54,126.00	0.03
591	000778	新兴铸管	14,500	53,940.00	0.03
592	000690	宝新能源	10,500	53,655.00	0.03
593	603568	伟明环保	2,350	53,650.50	0.03
594	002867	周大生	2,700	53,379.00	0.03
595	300251	光线传媒	4,900	52,969.00	0.03
596	002701	奥瑞金	10,300	52,942.00	0.03
597	601118	海南橡胶	10,400	52,936.00	0.03
598	002925	盈趣科技	1,360	52,917.60	0.03
599	603650	彤程新材	1,100	52,910.00	0.03
600	600645	中源协和	2,300	52,785.00	0.03
601	600967	内蒙一机	5,200	52,624.00	0.03
602	002249	大洋电机	10,000	52,500.00	0.03
603	002705	新宝股份	2,000	52,500.00	0.03
604	600908	无锡银行	9,000	52,200.00	0.03
605	000877	天山股份	4,000	52,120.00	0.03
606	002085	万丰奥威	9,300	52,080.00	0.03
607	600410	华胜天成	6,700	51,992.00	0.03
608	600718	东软集团	5,300	51,834.00	0.03
609	600026	中远海能	8,400	51,744.00	0.03
610	000528	柳工	6,300	51,660.00	0.03

611	002183	怡亚通	9,000	51,570.00	0.03
612	601179	中国西电	12,400	51,088.00	0.03
613	000990	诚志股份	4,000	50,920.00	0.03
614	002773	康弘药业	2,200	50,886.00	0.03
615	600918	中泰证券	4,700	50,854.00	0.03
616	600329	中新药业	1,800	50,562.00	0.03
617	002368	太极股份	2,520	50,551.20	0.03
618	002110	三钢闽光	7,500	50,550.00	0.03
619	600446	金证股份	3,500	50,540.00	0.03
620	600572	康恩贝	11,300	50,172.00	0.03
621	600985	淮北矿业	4,100	50,061.00	0.03
622	600167	联美控股	5,600	50,008.00	0.03
623	000970	中科三环	5,200	49,660.00	0.03
624	300072	三聚环保	8,600	49,364.00	0.03
625	600663	陆家嘴	3,700	49,284.00	0.03
626	000402	金融街	7,300	49,275.00	0.03
627	600064	南京高科	5,300	49,237.00	0.03
628	601200	上海环境	4,100	49,077.00	0.03
629	000089	深圳机场	6,300	48,951.00	0.03
630	002128	露天煤业	4,700	48,927.00	0.03
631	002266	浙富控股	9,800	48,902.00	0.03
632	601598	中国外运	9,600	48,480.00	0.03
633	600126	杭钢股份	9,300	47,709.00	0.03
634	600732	爱旭股份	3,400	47,328.00	0.03
635	000519	中兵红箭	4,400	47,168.00	0.03
636	000400	许继电气	3,700	46,842.00	0.03
637	600158	中体产业	4,100	46,781.00	0.03
638	300026	红日药业	10,900	46,325.00	0.03
639	300376	易事特	5,700	45,828.00	0.03
640	003035	南网能源	4,600	45,724.00	0.03
641	000959	首钢股份	8,100	45,522.00	0.03
642	002233	塔牌集团	4,400	45,232.00	0.03
643	600120	浙江东方	10,512	44,991.36	0.03
644	601975	招商南油	21,000	44,940.00	0.03
645	600507	方大特钢	6,600	44,748.00	0.03
646	600195	中牧股份	3,739	44,718.44	0.03
647	001914	招商积余	2,600	44,668.00	0.03
648	600435	北方导航	5,600	44,464.00	0.03
649	000090	天健集团	8,000	44,240.00	0.03
650	000685	中山公用	5,400	44,064.00	0.03
651	600307	酒钢宏兴	18,900	43,848.00	0.03

652	601698	中国卫通	2,700	43,713.00	0.03
653	600376	首开股份	7,800	43,680.00	0.03
654	601333	广深铁路	20,600	43,672.00	0.03
655	002440	闰土股份	4,900	43,365.00	0.03
656	000800	一汽解放	4,000	43,280.00	0.03
657	002505	鹏都农牧	19,300	43,232.00	0.03
658	601000	唐山港	17,900	43,139.00	0.03
659	603087	甘李药业	400	42,632.00	0.03
660	000559	万向钱潮	8,000	42,480.00	0.03
661	603228	景旺电子	1,620	42,444.00	0.03
662	600373	中文传媒	4,300	42,398.00	0.03
663	600804	鹏博士	8,700	42,108.00	0.02
664	002839	张家港行	7,700	41,888.00	0.02
665	601718	际华集团	14,800	41,736.00	0.02
666	300133	华策影视	7,000	41,440.00	0.02
667	600643	爱建集团	5,900	41,182.00	0.02
668	600673	东阳光	9,100	40,859.00	0.02
669	002155	湖南黄金	5,200	40,300.00	0.02
670	601860	紫金银行	11,100	40,293.00	0.02
671	600056	中国医药	3,300	40,095.00	0.02
672	002038	双鹭药业	3,800	40,014.00	0.02
673	000758	中色股份	8,400	39,900.00	0.02
674	000967	盈峰环境	5,800	39,846.00	0.02
675	601991	大唐发电	15,000	39,600.00	0.02
676	600062	华润双鹤	3,300	39,303.00	0.02
677	601608	中信重工	10,500	39,270.00	0.02
678	600388	龙净环保	4,600	39,192.00	0.02
679	600582	天地科技	10,000	39,000.00	0.02
680	002936	郑州银行	10,590	38,865.30	0.02
681	601098	中南传媒	4,400	38,808.00	0.02
682	000681	视觉中国	3,000	38,790.00	0.02
683	600266	城建发展	8,180	38,773.20	0.02
684	600928	西安银行	8,300	38,678.00	0.02
685	000563	陕国投A	12,000	38,640.00	0.02
686	600131	国网信通	2,900	38,396.00	0.02
687	601958	金钼股份	5,900	38,232.00	0.02
688	002416	爱施德	3,800	38,114.00	0.02
689	600901	江苏租赁	7,300	37,960.00	0.02
690	002458	益生股份	3,800	37,886.00	0.02
691	300113	顺网科技	2,900	37,526.00	0.02
692	600259	广晟有色	1,100	37,191.00	0.02



693	300180	华峰超纤	7,500	37,125.00	0.02
694	600959	江苏有线	12,100	36,905.00	0.02
695	600764	中国海防	1,300	36,790.00	0.02
696	600517	国网英大	5,400	36,774.00	0.02
697	600649	城投控股	7,700	36,652.00	0.02
698	002399	海普瑞	2,300	36,639.00	0.02
699	600094	大名城	9,700	36,569.00	0.02
700	000415	渤海租赁	15,000	36,300.00	0.02
701	601611	中国核建	5,000	36,100.00	0.02
702	600776	东方通信	2,900	35,960.00	0.02
703	600546	山煤国际	5,000	35,900.00	0.02
704	600006	东风汽车	4,900	35,770.00	0.02
705	300741	华宝股份	700	35,504.00	0.02
706	600556	天下秀	3,300	34,848.00	0.02
707	600021	上海电力	5,000	34,550.00	0.02
708	600717	天津港	8,808	34,527.36	0.02
709	300257	开山股份	2,400	34,488.00	0.02
710	600633	浙数文化	4,800	34,464.00	0.02
711	002317	众生药业	4,000	34,440.00	0.02
712	000028	国药一致	900	34,056.00	0.02
713	600648	外高桥	2,300	33,994.00	0.02
714	000717	韶钢松山	7,400	33,966.00	0.02
715	601928	凤凰传媒	4,700	33,558.00	0.02
716	002434	万里扬	4,100	33,251.00	0.02
717	002985	北摩高科	340	33,150.00	0.02
718	601828	美凯龙	2,750	33,000.00	0.02
719	600729	重庆百货	1,200	32,940.00	0.02
720	000501	鄂武商A	2,800	32,760.00	0.02
721	002244	滨江集团	7,800	32,682.00	0.02
722	600863	内蒙华电	14,000	32,620.00	0.02
723	000078	海王生物	10,000	32,600.00	0.02
724	600835	上海机电	2,000	32,500.00	0.02
725	002375	亚厦股份	4,100	32,472.00	0.02
726	000062	深圳华强	1,900	32,129.00	0.02
727	600968	海油发展	12,300	31,857.00	0.02
728	002424	贵州百灵	4,300	31,648.00	0.02
729	603355	莱克电气	500	31,115.00	0.02
730	600623	华谊集团	3,500	30,835.00	0.02
731	002468	申通快递	3,900	29,718.00	0.02
732	000869	张裕A	800	29,712.00	0.02
733	600377	宁沪高速	3,000	29,280.00	0.02

734	600312	平高电气	5,000	29,200.00	0.02
735	600339	中油工程	10,200	28,968.00	0.02
736	000031	大悦城	8,000	28,800.00	0.02
737	600787	中储股份	5,400	28,782.00	0.02
738	600823	世茂股份	7,100	28,684.00	0.02
739	600639	浦东金桥	2,100	28,665.00	0.02
740	600566	济川药业	1,600	28,640.00	0.02
741	601778	晶科科技	5,200	28,392.00	0.02
742	000826	启迪环境	5,300	28,355.00	0.02
743	603317	天味食品	960	28,252.80	0.02
744	002583	海能达	5,600	28,224.00	0.02
745	601969	海南矿业	2,400	27,912.00	0.02
746	002635	安洁科技	1,900	27,797.00	0.02
747	003022	联泓新科	900	27,630.00	0.02
748	603888	新华网	1,300	27,521.00	0.02
749	002815	崇达技术	2,200	27,456.00	0.02
750	600466	蓝光发展	9,200	27,140.00	0.02
751	600095	湘财股份	2,300	26,933.00	0.02
752	601298	青岛港	4,300	26,574.00	0.02
753	000937	冀中能源	6,700	26,331.00	0.02
754	000156	华数传媒	3,400	26,214.00	0.02
755	603708	家家悦	1,500	26,055.00	0.02
756	002532	天山铝业	3,100	26,009.00	0.02
757	000813	德展健康	5,700	25,878.00	0.02
758	600299	安迪苏	2,100	25,116.00	0.01
759	000553	安道麦 A	2,700	25,029.00	0.01
760	300010	豆神教育	4,400	24,948.00	0.01
761	002948	青岛银行	5,000	24,850.00	0.01
762	601228	广州港	7,800	24,804.00	0.01
763	600350	山东高速	4,000	24,600.00	0.01
764	002302	西部建设	3,100	24,490.00	0.01
765	603377	东方时尚	2,280	24,373.20	0.01
766	000061	农产品	4,300	23,736.00	0.01
767	601139	深圳燃气	3,600	23,616.00	0.01
768	002945	华林证券	1,700	23,494.00	0.01
769	600640	号百控股	1,900	23,161.00	0.01
770	605358	立昂微	200	23,116.00	0.01
771	603515	欧普照明	900	23,103.00	0.01
772	600871	石化油服	11,500	22,655.00	0.01
773	603786	科博达	300	22,650.00	0.01
774	603056	德邦股份	2,000	21,980.00	0.01

775	002901	大博医疗	300	21,867.00	0.01
776	000046	泛海控股	9,500	21,850.00	0.01
777	603379	三美股份	1,160	21,703.60	0.01
778	002653	海思科	1,000	21,520.00	0.01
779	601568	北元集团	2,400	20,544.00	0.01
780	002419	天虹股份	3,100	20,336.00	0.01
781	601003	柳钢股份	3,300	19,470.00	0.01
782	600657	信达地产	5,400	18,792.00	0.01
783	001872	招商港口	1,100	18,612.00	0.01
784	000537	广宇发展	3,500	18,305.00	0.01
785	601512	中新集团	1,800	17,928.00	0.01
786	601801	皖新传媒	3,700	17,464.00	0.01
787	601869	长飞光纤	700	17,052.00	0.01
788	600917	重庆燃气	1,900	15,523.00	0.01
789	002946	新乳业	1,000	15,150.00	0.01
790	000732	泰禾集团	6,300	13,608.00	0.01
791	600903	贵州燃气	1,400	12,880.00	0.01
792	603868	飞科电器	300	12,618.00	0.01
793	600956	新天绿能	1,000	11,710.00	0.01
794	601187	厦门银行	1,200	11,376.00	0.01
795	002818	富森美	900	10,854.00	0.01
796	603983	丸美股份	200	10,422.00	0.01
797	603256	宏和科技	1,100	10,054.00	0.01
798	002423	中粮资本	1,100	9,955.00	0.01
799	603719	良品铺子	200	9,000.00	0.01
800	601068	中铝国际	1,900	6,555.00	0.00

### 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	688696	极米科技	429	334,722.96	0.20
2	688383	新益昌	2,195	233,196.80	0.14
3	688665	四方光电	1,518	196,520.28	0.12
4	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.12
5	688276	百克生物	1,153	120,580.74	0.07
6	688161	威高骨科	1,154	94,939.58	0.06
7	688201	信安世纪	1,672	75,925.52	0.05
8	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.04
9	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.03
10	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.03

11	688499	利元亨	1,323	51,398.55	0.03
12	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.03
13	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.03
14	688087	英科再生	1,802	39,571.92	0.02
15	300957	贝泰妮	120	30,235.20	0.02
16	300919	中伟股份	183	29,829.00	0.02
17	300953	震裕科技	189	18,871.65	0.01
18	300979	华利集团	213	18,637.50	0.01
19	300973	立高食品	159	18,397.89	0.01
20	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
21	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
22	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
23	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
24	300941	创识科技	259	12,934.46	0.01
25	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
26	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
27	300981	中红医疗	133	12,021.87	0.01
28	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
29	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
30	300997	欢乐家	838	10,935.90	0.01
31	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.01
32	300996	普联软件	241	10,177.43	0.01
33	300956	英力股份	371	9,571.80	0.01
34	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.01
35	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.01
36	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.01
37	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.01
38	300968	格林精密	734	8,859.38	0.01
39	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.01
40	300950	德固特	219	8,569.47	0.01
41	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
42	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
43	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
44	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
45	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
46	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
47	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
48	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
49	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
50	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
51	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00

52	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
53	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
54	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
55	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
56	300985	致远新能	177	4,391.37	0.00
57	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
58	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
59	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
60	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

#### 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	600519	贵州茅台	866,506.00	0.54
2	601816	京沪高铁	397,942.00	0.25
3	000858	五粮液	363,178.00	0.23
4	688111	金山办公	329,384.00	0.21
5	688169	石头科技	291,206.00	0.18
6	000799	酒鬼酒	270,586.00	0.17
7	300450	先导智能	269,042.00	0.17
8	002415	海康威视	263,424.00	0.16
9	000333	美的集团	247,615.00	0.15
10	601658	邮储银行	240,115.00	0.15
11	601318	中国平安	225,032.00	0.14
12	000725	京东方 A	208,624.00	0.13
13	600900	长江电力	205,134.00	0.13
14	002607	中公教育	183,306.00	0.11
15	600036	招商银行	180,879.00	0.11
16	600050	中国联通	179,680.00	0.11
17	000651	格力电器	179,271.00	0.11
18	002475	立讯精密	175,299.00	0.11
19	601636	旗滨集团	173,765.00	0.11
20	300122	智飞生物	170,033.00	0.11

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。

##### 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	000858	五粮液	511,931.00	0.32
2	300012	华测检测	371,459.00	0.23

3	000333	美的集团	352,528.00	0.22
4	688131	皓元医药	317,658.55	0.20
5	300496	中科创达	301,277.00	0.19
6	601318	中国平安	270,399.00	0.17
7	600036	招商银行	256,872.00	0.16
8	000651	格力电器	254,491.00	0.16
9	688076	诺泰生物	248,545.61	0.16
10	300997	欢乐家	243,014.20	0.15
11	300059	东方财富	216,832.00	0.14
12	002568	百润股份	199,774.60	0.12
13	688687	凯因科技	199,186.01	0.12
14	000001	平安银行	199,185.00	0.12
15	688819	天能股份	196,157.00	0.12
16	601966	玲珑轮胎	194,841.00	0.12
17	002594	比亚迪	182,416.00	0.11
18	300979	华利集团	180,166.34	0.11
19	301002	崧盛股份	178,920.00	0.11
20	300957	贝泰妮	176,040.00	0.11

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。

#### 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	24,243,366.03
卖出股票收入（成交）总额	26,848,111.21

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。

#### 7.5 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）	180,162.95	0.11
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	180,162.95	0.11

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113050	南银转债	900	90,000.00	0.05
2	110079	杭银转债	470	53,518.90	0.03
3	127036	三花转债	95	12,444.05	0.01
4	113051	节能转债	110	11,000.00	0.01
5	127038	国微转债	62	6,200.00	0.00

## 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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 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

注：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

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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 7.11.3 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。

### 7.12 投资组合报告附注

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

本报告编制日前一年内，本基金持有的“兴业银行”的发行主体兴业银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保的违法违规事实，中国银保监会福建监管局于2020年8月31日对公司做出没收违法所得6,361,807.97元，并合计处以罚款15,961,807.97元的行政处罚（闽银保监罚决字〔2020〕29号）；由于存在为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；违反银行卡收单外包管理规定等5项违法违规事实，中国人民银行福州中心支行于2020年9月4日对公司做出警告，没收违法所得10,875,088.15元，并处13,824,431.23元罚款的行政处罚（福银罚字〔2020〕35号）。兴业银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

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。

#### 7.12.2 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。

#### 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	4,675.37
2	应收证券清算款	119,163.48
3	应收股利	—
4	应收利息	269.99
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	—
9	合计	199,725.08

#### 7.12.4 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。

#### 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

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。

##### 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

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	占基金资产净	流通受限情况说明
----	------	------	---------	--------	----------

			公允价值(元)	值比例 (%)	
1	688696	极米科技	334,722.96	0.20	新股限售
2	688383	新益昌	233,196.80	0.14	新股限售
3	688665	四方光电	196,520.28	0.12	新股限售
4	688269	凯立新材	195,885.72	0.12	新股限售

### 7.12.6 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。

## § 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 (%)
210	566,790.91	114,087,192.00	95.85	4,938,900.00	4.15

### 8.2 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	92.75
2	华泰证券股份有限公司	1,697,082	1.43
3	中信证券股份有限公司	1,492,110	1.25
4	尤咏杰	1,027,700	0.86
5	张晓晖	1,000,000	0.84
6	袁洪	1,000,000	0.84
7	深圳市中泓汇富资产管理有限公司—中泓汇富钧新 1 号私募证券投资基金	303,800	0.26

8	何宇杰	216,500	0.18
9	深圳市服务贸易协会	200,000	0.17
10	王永平	150,000	0.13

### 8.3 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	—	—

### 8.4 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

## § 9 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	7,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	10,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	119,026,092.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有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

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

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。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期本基金投资策略无改变。

**10.5 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。

**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、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 10.7 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	4,344,408.77	9.46	21,162.60	7.01	—	—	—	—	3,959.29	11.37	—
川财证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
广发证券	2	2,855,461.99	6.22	102,392.69	33.92	—	—	—	—	2,602.13	7.47	—
国都证券	2	11,904,770.27	25.91	—	—	—	—	—	—	10,849.11	31.16	—
国海证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国元证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	413,414.36	0.90	—	—	—	—	—	—	376.78	1.08	—
华宝证券	1	2,761,519.11	6.01	17,976.50	5.96	—	—	—	—	2,516.41	7.23	—
华创证券	1	3,101,545.57	6.75	—	—	—	—	—	—	2,826.44	8.12	—
江海证券	2	5,128,664.15	11.16	41,542.85	13.76	—	—	—	—	4,674.13	13.42	—
瑞银证券	2	20,614.62	0.04	—	—	—	—	—	—	18.79	0.05	—
上海证券	2	1,208,745.88	2.63	—	—	—	—	—	—	1,101.49	3.16	—
申万宏源	4	1,099,795.01	2.39	—	—	—	—	—	—	1,002.22	2.88	—

西部证券	2	849,800.24	1.85	16,103.00	5.33	—	—	—	—	774.44	2.22	—
新时代证券	2	2,507,932.80	5.46	98,968.00	32.79	—	—	—	—	2,285.40	6.56	—
招商证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	3	9,742,806.03	21.21	3,693.90	1.22	—	—	—	—	1,834.41	5.27	—

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）。

## 10.8 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调整旗下基金最低定投金额的公告	规定披露媒介	2021年03月05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13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17日
8	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年03月24日
9	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
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14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04月20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06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05月10日

## § 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	2021-01-01 至 2021-06-30	110,394,100.00	-	-	110,394,100.00	92.75%

#### 产品特有风险

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期，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，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，对本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。

## § 12 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	中国（上海）自由贸易试	投资者对本报告书如有



<p>富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的文件</p> <p>2、富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同</p> <p>3、富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议</p> <p>4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件</p> <p>5、富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注</p> <p>6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告</p>	<p>验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层</p>	<p>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：<a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a>。</p>
--	--------------------------------------	---