

富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

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： 中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
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.....	13
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.....	13
§5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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 13	
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.....	13
§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.....	15
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.....	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.....	39
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12	投资组合报告附注	55
§8	基金份额持有人信息	56
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2	期末上市基金前十名持有人	56
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§9	开放式基金份额变动	57
§10	重大事件揭示	57
10.1	基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4	基金投资策略的改变	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8	其他重大事件	61
§11	影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	62
§12	备查文件目录	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF)
基金简称	富国中证 1000 指数增强 (LOF)
场内简称	富国 1000
基金主代码	161039
交易代码	161039
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 05 月 31 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额 (单位: 份)	233,036,613.83
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2018 年 6 月 20 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金, 在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上, 通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制, 力争实现超越目标指数的投资收益, 谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”, 主要策略为复制目标指数, 即投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础, 利用富国定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。本基金在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股, 力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。本基金对标的指数的跟踪目标是: 力争使基金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%, 年化跟踪误差不超过 8%。本基金的股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率 (税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金, 其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	秦一楠
	联系电话	021-20361818	010-66060069

	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-63201816
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	北京市东城区建国门内大街69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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		裴长江	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

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	15,847,390.33
本期利润	41,375,990.23
加权平均基金份额本期利润	0.3022
本期加权平均净值利润率	17.18%
本期基金份额净值增长率	15.87%
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	178,562,997.40
期末可供分配基金份额利润	0.7662
期末基金资产净值	452,347,873.30
期末基金份额净值	1.9411
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	94.11%

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	5.20%	0.90%	3.76%	0.97%	1.44%	-0.07%
过去三个月	13.89%	0.84%	11.91%	0.84%	1.98%	0.00%
过去六个月	15.87%	1.12%	6.29%	1.10%	9.58%	0.02%
过去一年	29.57%	1.31%	11.60%	1.32%	17.97%	-0.01%
过去三年	93.45%	1.39%	25.45%	1.50%	68.00%	-0.11%
自基金合同生效起至今	94.11%	1.37%	13.51%	1.51%	80.60%	-0.14%

注：中证 1000 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%

由于本基金投资标的指数为中证 1000 指数，且每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为中证 1000 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1 日收益率（benchmark_t）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 95\% * [\text{中证 1000 指数收益率}_t / (\text{中证 1000 指数收益率}_{t-1}) - 1] + 5\% * \text{银行人民币活期存款利率（税后）} / 360;$$

其中，t=1, 2, 3, ..., T, T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（benchmark_T）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示 t 日至 T 日的 $(1 + \text{benchmark}_t)$ 数学连乘。

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2018年5月31日成立，建仓期6个月，从2018年5月31日起至2018年11月29日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

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		
方旻	本基金基金经理	2018-05-31	—	11.4	硕士，自 2010 年 2 月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、量化投资部量化投资副总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼高级定量基金经理。2014 年 4 月至 2014 年 11 月任富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理助理，2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2015 年 5 月至 2019 年 11 月任富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金及富国中证银行指数型证券投资基金（原富国中证银行指数分级证券投资基金，于 2019 年 5 月 10 日更名）的基金经理，2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2017 年 6 月至 2018 年 12 月任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2017 年 7 月至 2020 年 9 月任富国新兴成长量化精选混合型证

					券投资基金 (LOF) 基金经理, 2018 年 5 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2018 年 7 月至 2020 年 9 月任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 1 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理, 2020 年 2 月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
徐幼华	本基金基金经理	2018-05-31	—	16.0	硕士, 曾任上海京华创业投资有限公司投资部经理助理; 自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司, 历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监, 量化与海外投资部量化投资总监; 现任富国基金量化投资部副总经理, 兼任富国基金量化投资部资深定量基金经理。2011 年 5 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理, 2011 年 10 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2015 年 6 月至 2017 年 12 月任富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金基金经理, 2016 年 11 月至 2020 年 1 月任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2015 年 6 月至 2017 年 11 月任富国中证煤炭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, 2017 年 3 月至 2020 年 1 月任富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2017 年 4 月至 2020 年 1 月任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2018 年 5 月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金

					(LOF)基金经理, 2018年7月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理, 2018年12月起任富国MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金基金经理。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

本报告期内，富国基金管理有限公司作为富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）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1000指数增强型证券投资基金（LOF）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 1 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,我们坚持采取量化策略进行投资和风险管理,积极获取超额收益率。

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 1.9411 元;份额累计净值为 1.9411 元;本报告期,本基金份额净值增长率为 15.87%,同期业绩比较基准收益率为 6.29%

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

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司2021年1月1日至2021年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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1000指数增强型证券投资基金（LOF）

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)
资 产:		
银行存款	40,816,170.54	12,645,286.47
结算备付金	562,959.49	203,237.74
存出保证金	29,986.02	51,221.38
交易性金融资产	419,757,199.88	184,668,378.79
其中：股票投资	419,561,365.58	184,583,057.55
基金投资	—	—
债券投资	195,834.30	85,321.24
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	—	1,573,689.86
应收利息	6,797.27	2,365.42
应收股利	—	—
应收申购款	3,179,406.98	77,421.76
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	464,352,520.18	199,221,601.42
负债和所有者权益	本期末 (2021年06月30日)	上年度末 (2020年12月31日)
负 债:		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	7,561,821.13	—
应付赎回款	3,635,327.47	735,173.67
应付管理人报酬	281,705.43	173,748.48
应付托管费	42,255.82	26,062.27
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	290,632.81	163,206.41
应交税费	0.65	0.53
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	192,903.57	177,115.09
负债合计	12,004,646.88	1,275,306.45
所有者权益:		
实收基金	233,036,613.83	118,156,134.78
未分配利润	219,311,259.47	79,790,160.19

所有者权益合计	452,347,873.30	197,946,294.97
负债和所有者权益总计	464,352,520.18	199,221,601.42

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.9411 元，基金份额总额 233,036,613.83 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

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 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日)
一、收入	43,475,367.84	23,859,330.42
1. 利息收入	88,281.15	40,957.77
其中：存款利息收入	81,201.86	38,334.90
债券利息收入	109.42	2,622.87
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	6,969.87	—
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	17,620,051.38	16,545,519.98
其中：股票投资收益	15,148,498.37	15,581,923.09
基金投资收益	—	—
债券投资收益	72,963.44	60,044.84
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	2,398,589.57	903,552.05
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	25,528,599.90	7,120,960.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	238,435.41	151,891.80
减：二、费用	2,099,377.61	1,049,982.37
1. 管理人报酬	1,184,579.63	513,800.10
2. 托管费	177,686.99	77,070.07
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	529,429.41	275,248.96
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 税金及附加	0.32	0.34
7. 其他费用	207,681.26	183,862.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	41,375,990.23	22,809,348.05

减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	41,375,990.23	22,809,348.05

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）

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）	118,156,134.78	79,790,160.19	197,946,294.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	41,375,990.23	41,375,990.23
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）	114,880,479.05	98,145,109.05	213,025,588.10
其中：1. 基金申购款	209,006,316.79	168,418,914.19	377,425,230.98
2. 基金赎回款	-94,125,837.74	-70,273,805.14	-164,399,642.88
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）	233,036,613.83	219,311,259.47	452,347,873.30
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）	63,323,227.96	12,352,451.94	75,675,679.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	22,809,348.05	22,809,348.05
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）	32,885,623.76	12,757,600.06	45,643,223.82
其中：1. 基金申购款	101,191,885.49	33,941,112.00	135,132,997.49
2. 基金赎回款	-68,306,261.73	-21,183,511.94	-89,489,773.67
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）	96,208,851.72	47,919,400.05	144,128,251.77

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

富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）（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[2018]30 号文《关于准予富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）注册的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集。基金合同于 2018 年 5 月 31 日正式生效，首次设立募集规模为 512,114,043.76 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 1000 指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）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的相关规定）。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。

基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股的资产（均含存托凭证）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需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

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	40,816,170.54

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	40,816,170.54

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	390,368,493.90	419,561,365.58	29,192,871.68
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	180,900.00	195,834.30
	银行间市场	—	—
	合计	180,900.00	195,834.30
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	390,549,393.90	419,757,199.88	29,207,805.98

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	6,535.96
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	227.97
应收债券利息	21.19
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	12.15
合计	6,797.27

6.4.7.6其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

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	290,632.81
银行间市场应付交易费用	—
合计	290,632.81

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	13,274.40
应付证券出借违约金	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	39,876.39
应付指数使用费	50,000.00
预提上市年费	29,752.78
合计	192,903.57

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	118,156,134.78	118,156,134.78
本期申购	209,006,316.79	209,006,316.79
本期赎回（以“-”号填列）	-94,125,837.74	-94,125,837.74
本期末	233,036,613.83	233,036,613.83

注：申购含红利再投、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	76,530,102.15	3,260,058.04	79,790,160.19
本期利润	15,847,390.33	25,528,599.90	41,375,990.23
本期基金份额交易产生的变动数	86,185,504.92	11,959,604.13	98,145,109.05
其中：基金申购款	152,549,679.10	15,869,235.09	168,418,914.19
基金赎回款	-66,364,174.18	-3,909,630.96	-70,273,805.14
本期已分配利润	—	—	—
本期末	178,562,997.40	40,748,262.07	219,311,259.47

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	77,179.23
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	2,180.41
其他	1,842.22
合计	81,201.86

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
卖出股票成交总额	107,911,146.98
减：卖出股票成本总额	92,762,648.61
买卖股票差价收入	15,148,498.37

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	453,168.05
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	380,100.00
减：应收利息总额	104.61
买卖债券差价收入	72,963.44

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	2,398,589.57
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	2,398,589.57

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	25,528,599.90
股票投资	25,514,286.84
债券投资	14,313.06
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	25,528,599.90

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	232,227.20

转换费收入	6,208.21
合计	238,435.41

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	529,429.41
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	529,429.41

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	3,052.09
指数使用费	100,000.00
上市费	29,752.78
合计	207,681.26

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

根据本基金管理人于2021年8月17日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加C类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，基金管理人经与基金托管人协商一致，决定于2021年8月19日起对旗下富国中证1000指数增强型证券投资基金增加收取销售服务费的C类份额，并对本基金的基金合同及托管协议做相应修改，相应内容也将在定期更新的招募说明书中一并修改。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、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
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
中国农业银行股份有限公司	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(%)
海通证券	11,721,533.68	2.90	36,916,309.39	19.58
申万宏源	51,654,832.98	12.78	25,922,541.43	13.75

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

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	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
申万宏源	172,488.40	38.06	4,232,130.00	64.78

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	47,065.35	12.78	44,916.73	15.45
海通证券	10,682.09	2.90	4,353.04	1.50
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）			
	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	23,616.12	13.75	11,983.61	9.86
海通证券	33,641.54	19.58	29,810.54	24.53

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	1,184,579.63	513,800.10
其中：支付销售机构的客户维护费	263,533.24	153,893.84

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.0%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。

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	177,686.99	77,070.07

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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)
基金合同生效日(2018年05月31日)持有的基金份额	—	—
期初持有的基金份额	8,014,588.01	—
期间申购/买入总份额	—	8,014,588.01
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	8,014,588.01	8,014,588.01
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.44%	8.33%

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

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
中国农业银行股份有限公司	40,816,170.54	77,179.23	7,335,405.86	35,691.56

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	2,016	97,957.44
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	946	43,467.38
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	2,035	58,941.94
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	1,687	50,066.20
海通证券股份有限公司	688687	凯因科技	IPO网下申购	3,710	70,767.88

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

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

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	312	6,648.72	15,581.28	—
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	240	6,904.80	23,964.00	—
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	182	8,614.06	45,856.72	—
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	1,099	7,550.13	13,264.93	—
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	240	6,787.20	27,770.40	—
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	319	10,597.18	27,912.50	—
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	202	9,815.18	18,258.78	—
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	24.90	24.81	271	6,747.90	6,723.51	—
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	928	4,584.32	12,110.40	—
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	—
688083	中望软件	2021-03-04	2021-09-13	新股限售	150.50	524.08	519	78,109.50	271,997.52	—
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股认购	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	—
688131	皓元医药	2021-06-01	2021-12-08	新股限售	64.99	247.10	1,369	88,971.31	338,279.90	—
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	—
688328	深科达	2021-03-01	2021-09-09	新股限售	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	—
688329	艾隆科技	2021-03-16	2021-09-29	新股限售	16.81	50.04	1,846	31,031.26	92,373.84	—
688468	科美诊断	2021-03-31	2021-10-11	新股限售	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	—
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股认购	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	—
688601	力芯微	2021-06-18	2021-12-28	新股限售	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	—
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-07-07	新股限售	74.46	373.24	836	62,248.56	312,028.64	—
688626	翔宇医疗	2021-03-23	2021-10-08	新股限售	28.82	104.16	2,035	58,648.70	211,965.60	—
688639	华恒生物	2021-04-14	2021-10-22	新股限售	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	—
688669	聚石化学	2021-01-15	2021-07-26	新股限售	36.65	32.39	1,915	70,184.75	62,026.85	—
688681	科汇股份	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	9.56	14.54	1,899	18,154.44	27,611.46	—
688683	莱尔科技	2021-04-01	2021-10-12	新股限售	9.51	14.73	3,296	31,344.96	48,550.08	—
688700	东威科技	2021-06-07	2021-12-15	新股限售	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	—

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
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	认购新发 证券	100.00	100.00	870	87,000.00	87,000.00	

113625	江山转债	2021-06-11	2021-07-01	认购新发 证券	100.00	100.00	420	42,000.00	42,000.00	
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	认购新发 证券	100.00	100.00	184	18,400.00	18,400.00	

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

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
688368	晶丰明源	2021-06-21	筹划重大事项	335.26	2021-07-05	402.31	8,300	2,776,856.86	2,782,658.00	—

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%。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	87,000.00	—
AAA 以下	108,834.30	85,321.24
未评级	—	—
合计	195,834.30	85,321.24

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。

本基金本报告期末及上年度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，包括其他价格风险、利率风险和外汇风险。

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	40,816,170.54	—	—	—	—	—	40,816,170.54
结算备付金	562,959.49	—	—	—	—	—	562,959.49
存出保证金	29,986.02	—	—	—	—	—	29,986.02
交易性金融资产	—	—	195,834.30	—	—	419,561,365.58	419,757,199.88
应收利息	—	—	—	—	—	6,797.27	6,797.27
应收申购款	62,805.62	—	—	—	—	3,116,601.36	3,179,406.98
资产总计	41,471,921.67	—	195,834.30	—	—	422,684,764.21	464,352,520.18
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	7,561,821.13	7,561,821.13
应付赎回款	—	—	—	—	—	3,635,327.47	3,635,327.47
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	281,705.43	281,705.43
应付托管费	—	—	—	—	—	42,255.82	42,255.82
应付交易费用	—	—	—	—	—	290,632.81	290,632.81
应付税费	—	—	—	—	—	0.65	0.65
其他负债	—	—	—	—	—	192,903.57	192,903.57
负债总计	—	—	—	—	—	12,004,646.88	12,004,646.88
利率敏感度缺口	41,471,921.67	—	195,834.30	—	—	410,680,117.33	452,347,873.30
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	12,645,286.47	—	—	—	—	—	12,645,286.47
结算备付金	203,237.74	—	—	—	—	—	203,237.74
存出保证金	51,221.38	—	—	—	—	—	51,221.38
交易性金融资产	—	—	85,321.24	—	—	184,583,057.55	184,668,378.79
应收证券清算款	—	—	—	—	—	1,573,689.86	1,573,689.86
应收利息	—	—	—	—	—	2,365.42	2,365.42
应收申购款	14,059.30	—	—	—	—	63,362.46	77,421.76
资产总计	12,913,804.89	—	85,321.24	—	—	186,222,475.29	199,221,601.42
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	735,173.67	735,173.67
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	173,748.48	173,748.48
应付托管费	—	—	—	—	—	26,062.27	26,062.27
应付交易费用	—	—	—	—	—	163,206.41	163,206.41
应付税费	—	—	—	—	—	0.53	0.53
其他负债	—	—	—	—	—	177,115.09	177,115.09
负债总计	—	—	—	—	—	1,275,306.45	1,275,306.45
利率敏感度缺口	12,913,804.89	—	85,321.24	—	—	184,947,168.84	197,946,294.97

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证券，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

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 1000 指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）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的相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产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需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；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	419,561,365.58	92.75	184,583,057.55	93.25
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	195,834.30	0.04	85,321.24	0.04
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	419,757,199.88	92.80	184,668,378.79	93.29

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%	4,441,376.85	1,877,563.82
2. 业绩比较基准减少 1%	-4,441,376.85	-1,877,563.82	

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413,997,533.22元，属于第二层次的余额为人民币3,263,504.37元，属于第三层次余额为人民币2,496,162.29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964,026.53元，本期变动人民币1,532,135.76元，本期末人民币2,496,162.29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	419,561,365.58	90.35
	其中：股票	419,561,365.58	90.35
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	195,834.30	0.04
	其中：债券	195,834.30	0.04
	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	41,379,130.03	8.91
8	其他各项资产	3,216,190.27	0.69
9	合计	464,352,520.18	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	2,192,734.00	0.48
C	制造业	48,532,048.65	10.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,410,794.39	0.31
E	建筑业	594,226.44	0.13
F	批发和零售业	605,300.12	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	82,820.00	0.02

H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,702,647.84	2.14
J	金融业	130,459.10	0.03
K	房地产业	1,829,718.00	0.40
L	租赁和商务服务业	552,074.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	516,179.90	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	30,146.60	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	223,655.00	0.05
Q	卫生和社会工作	223,678.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	3,382,826.00	0.75
S	综合	—	—
	合计	70,014,747.54	15.48

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	1,218,060.00	0.27
B	采矿业	6,501,403.00	1.44
C	制造业	244,976,317.71	54.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,422,925.60	1.20
E	建筑业	7,815,380.00	1.73
F	批发和零售业	2,902,546.00	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	8,106,851.30	1.79
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,110,416.43	9.75
J	金融业	5,884,918.00	1.30
K	房地产业	2,901,556.00	0.64
L	租赁和商务服务业	4,331,053.00	0.96
M	科学研究和技术服务业	3,903,990.00	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	6,442,702.00	1.42
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	39,501.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,209,982.00	0.27
S	综合	3,779,016.00	0.84
	合计	349,546,618.04	77.27

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	300496	中科创达	47,300	7,428,938.00	1.64
2	300458	全志科技	64,200	5,627,772.00	1.24
3	601678	滨化股份	662,900	5,243,539.00	1.16
4	000683	远兴能源	1,077,300	5,030,991.00	1.11
5	600742	一汽富维	437,570	4,458,838.30	0.99
6	300639	凯普生物	134,217	4,430,503.17	0.98
7	002022	科华生物	241,900	4,332,429.00	0.96
8	603363	傲农生物	417,000	4,295,100.00	0.95
9	603613	国联股份	42,555	4,254,223.35	0.94
10	000498	山东路桥	732,100	4,099,760.00	0.91
11	600057	厦门象屿	622,000	3,887,500.00	0.86
12	000550	江铃汽车	165,800	3,884,694.00	0.86
13	000933	神火股份	407,400	3,849,930.00	0.85
14	600603	广汇物流	935,400	3,779,016.00	0.84
15	300775	三角防务	97,900	3,739,780.00	0.83
16	603337	杰克股份	133,800	3,576,474.00	0.79
17	000403	派林生物	104,800	3,261,376.00	0.72
18	688202	美迪西	6,200	3,223,380.00	0.71
19	300740	水羊股份	145,200	3,031,776.00	0.67
20	601827	三峰环境	316,700	2,999,149.00	0.66
21	300397	天和防务	153,300	2,981,685.00	0.66
22	603267	鸿远电子	23,300	2,980,536.00	0.66
23	600688	上海石化	786,500	2,957,240.00	0.65
24	601677	明泰铝业	149,000	2,912,950.00	0.64
25	002034	旺能环境	181,100	2,888,545.00	0.64
26	603606	东方电缆	140,600	2,831,684.00	0.63
27	002043	兔宝宝	285,000	2,810,100.00	0.62
28	000507	珠海港	462,700	2,799,335.00	0.62
29	688368	晶丰明源	8,300	2,782,658.00	0.62
30	002726	龙大肉食	271,500	2,747,580.00	0.61
31	600565	迪马股份	1,059,800	2,691,892.00	0.60
32	002833	弘亚数控	69,100	2,677,625.00	0.59
33	603566	普莱柯	117,300	2,674,440.00	0.59
34	600966	博汇纸业	204,000	2,662,200.00	0.59
35	600483	福能股份	252,500	2,648,725.00	0.59
36	300373	扬杰科技	43,700	2,645,598.00	0.58
37	002421	达实智能	687,600	2,640,384.00	0.58
38	300390	天华超净	54,900	2,636,847.00	0.58

39	002139	拓邦股份	145,800	2,622,942.00	0.58
40	600490	鹏欣资源	676,900	2,606,065.00	0.58
41	300394	天孚通信	102,739	2,601,351.48	0.58
42	002568	百润股份	27,340	2,591,558.60	0.57
43	002585	双星新材	126,800	2,552,484.00	0.56
44	600110	诺德股份	205,700	2,505,426.00	0.55
45	000733	振华科技	40,900	2,497,763.00	0.55
46	300363	博腾股份	29,600	2,489,952.00	0.55
47	002727	一心堂	74,900	2,479,939.00	0.55
48	600502	安徽建工	634,400	2,461,472.00	0.54
49	600318	新力金融	310,500	2,434,320.00	0.54
50	603180	金牌厨柜	50,784	2,421,888.96	0.54
51	688139	海尔生物	22,900	2,406,790.00	0.53
52	600063	皖维高新	469,400	2,403,328.00	0.53
53	600096	云天化	170,000	2,386,800.00	0.53
54	002245	蔚蓝锂芯	120,000	2,364,000.00	0.52
55	688001	华兴源创	61,900	2,349,724.00	0.52
56	600882	妙可蓝多	33,000	2,303,400.00	0.51
57	002614	奥佳华	99,600	2,253,948.00	0.50
58	300748	金力永磁	70,800	2,239,404.00	0.50
59	002611	东方精工	480,200	2,223,326.00	0.49
60	688298	东方生物	9,900	2,154,240.00	0.48
61	300114	中航电测	141,200	2,146,240.00	0.47
62	300659	中孚信息	63,920	2,145,794.40	0.47
63	002777	久远银海	121,160	2,143,320.40	0.47
64	688016	心脉医疗	4,600	2,091,206.00	0.46
65	600864	哈投股份	341,300	2,054,626.00	0.45
66	300624	万兴科技	34,780	2,037,412.40	0.45
67	300638	广和通	43,520	2,032,384.00	0.45
68	002641	永高股份	294,400	2,031,360.00	0.45
69	300726	宏达电子	28,000	1,973,720.00	0.44
70	002158	汉钟精机	73,200	1,965,420.00	0.43
71	600894	广日股份	287,900	1,934,688.00	0.43
72	603678	火炬电子	28,400	1,917,000.00	0.42
73	000885	城发环境	200,400	1,915,824.00	0.42
74	002497	雅化集团	83,800	1,908,964.00	0.42
75	300613	富瀚微	12,146	1,893,318.48	0.42
76	300696	爱乐达	43,200	1,797,984.00	0.40
77	002309	中利集团	286,400	1,787,136.00	0.40
78	600531	豫光金铅	338,200	1,785,696.00	0.39
79	600797	浙大网新	265,600	1,774,208.00	0.39

80	603801	志邦家居	55,280	1,766,748.80	0.39
81	600756	浪潮软件	130,200	1,752,492.00	0.39
82	600123	兰花科创	224,300	1,736,082.00	0.38
83	000543	皖能电力	441,400	1,672,906.00	0.37
84	603185	上机数控	9,300	1,664,235.00	0.37
85	002097	山河智能	192,400	1,650,792.00	0.36
86	002322	理工环科	146,300	1,645,875.00	0.36
87	300751	迈为股份	3,440	1,564,168.00	0.35
88	603005	晶方科技	26,268	1,555,853.64	0.34
89	600075	新疆天业	228,300	1,552,440.00	0.34
90	300327	中颖电子	18,100	1,542,663.00	0.34
91	002115	三维通信	268,400	1,532,564.00	0.34
92	600331	宏达股份	746,800	1,523,472.00	0.34
93	300785	值得买	15,800	1,501,000.00	0.33
94	000923	河钢资源	76,800	1,464,576.00	0.32
95	300573	兴齐眼药	10,300	1,452,609.00	0.32
96	600073	上海梅林	167,400	1,371,006.00	0.30
97	300219	鸿利智汇	103,600	1,367,520.00	0.30
98	300777	中简科技	30,200	1,364,436.00	0.30
99	300548	博创科技	38,100	1,355,979.00	0.30
100	300623	捷捷微电	35,820	1,355,070.60	0.30
101	300829	金丹科技	20,160	1,320,480.00	0.29
102	603026	石大胜华	8,100	1,312,605.00	0.29
103	688188	柏楚电子	3,000	1,308,000.00	0.29
104	603013	亚普股份	96,100	1,305,038.00	0.29
105	603456	九洲药业	26,100	1,267,938.00	0.28
106	002402	和而泰	52,100	1,248,837.00	0.28
107	300502	新易盛	39,487	1,233,968.75	0.27
108	600975	新五丰	181,800	1,218,060.00	0.27
109	688005	容百科技	9,900	1,199,880.00	0.27
110	002950	奥美医疗	69,750	1,155,060.00	0.26
111	603887	城地香江	109,320	1,092,106.80	0.24
112	601001	晋控煤业	150,000	1,089,000.00	0.24
113	002293	罗莱生活	80,400	1,076,556.00	0.24
114	002547	春兴精工	240,900	1,069,596.00	0.24
115	688399	硕世生物	6,200	1,045,320.00	0.23
116	600668	尖峰集团	87,400	1,043,556.00	0.23
117	688366	昊海生科	4,900	1,025,570.00	0.23
118	002291	星期六	53,200	999,096.00	0.22
119	603012	创力集团	163,200	997,152.00	0.22
120	603766	隆鑫通用	273,400	992,442.00	0.22

121	688166	博瑞医药	23,700	990,897.00	0.22
122	603877	太平鸟	18,200	971,516.00	0.21
123	300119	瑞普生物	28,600	967,252.00	0.21
124	603345	安井食品	3,800	965,276.00	0.21
125	600308	华泰股份	172,900	954,408.00	0.21
126	603612	索通发展	52,100	936,237.00	0.21
127	300267	尔康制药	240,700	919,474.00	0.20
128	300299	富春股份	155,500	897,235.00	0.20
129	300034	钢研高纳	27,500	885,775.00	0.20
130	300724	捷佳伟创	7,500	870,075.00	0.19
131	300068	南都电源	81,500	863,900.00	0.19
132	603686	龙马环卫	56,400	857,844.00	0.19
133	002446	盛路通信	129,900	844,350.00	0.19
134	300353	东土科技	86,200	837,864.00	0.19
135	300079	数码视讯	107,500	827,750.00	0.18
136	002979	雷赛智能	28,565	818,958.55	0.18
137	603393	新天然气	44,620	815,653.60	0.18
138	000049	德赛电池	17,690	811,971.00	0.18
139	002803	吉宏股份	28,300	803,154.00	0.18
140	002498	汉缆股份	224,000	801,920.00	0.18
141	002145	中核钛白	61,800	800,310.00	0.18
142	300031	宝通科技	50,500	795,880.00	0.18
143	601375	中原证券	163,200	794,784.00	0.18
144	601918	新集能源	158,200	773,598.00	0.17
145	600715	文投控股	254,900	772,347.00	0.17
146	002383	合众思壮	96,900	764,541.00	0.17
147	300073	当升科技	13,600	764,184.00	0.17
148	688116	天奈科技	6,400	755,200.00	0.17
149	603222	济民医疗	46,000	745,200.00	0.16
150	002539	云图控股	83,900	732,447.00	0.16
151	603208	江山欧派	7,600	714,324.00	0.16
152	002978	安宁股份	11,700	706,914.00	0.16
153	603520	司太立	11,400	702,810.00	0.16
154	603127	昭衍新药	3,704	680,610.00	0.15
155	600846	同济科技	79,700	679,044.00	0.15
156	000917	电广传媒	138,000	677,580.00	0.15
157	603609	禾丰股份	65,000	677,300.00	0.15
158	603128	华贸物流	46,800	659,412.00	0.15
159	600261	阳光照明	167,000	652,970.00	0.14
160	600458	时代新材	77,400	644,742.00	0.14
161	002407	多氟多	17,300	614,842.00	0.14

162	300229	拓尔思	68,400	613,548.00	0.14
163	688037	芯源微	4,100	610,900.00	0.14
164	300666	江丰电子	12,100	603,427.00	0.13
165	300379	东方通	20,700	589,743.00	0.13
166	300311	任子行	97,600	576,816.00	0.13
167	300737	科顺股份	18,000	565,920.00	0.13
168	002685	华东重机	114,100	552,244.00	0.12
169	603229	奥翔药业	16,100	537,579.00	0.12
170	002204	大连重工	145,800	535,086.00	0.12
171	688200	华峰测控	1,100	520,663.00	0.12
172	002737	葵花药业	28,900	471,648.00	0.10
173	300171	东富龙	11,500	467,475.00	0.10
174	603008	喜临门	13,500	445,635.00	0.10
175	605111	新洁能	2,400	432,648.00	0.10
176	603236	移远通信	2,470	421,406.70	0.09
177	300685	艾德生物	4,000	416,320.00	0.09
178	300102	乾照光电	43,000	399,470.00	0.09
179	000597	东北制药	76,900	385,269.00	0.09
180	601163	三角轮胎	26,400	383,328.00	0.08
181	002847	盐津铺子	3,800	378,936.00	0.08
182	600100	同方股份	61,400	375,154.00	0.08
183	300369	绿盟科技	23,300	371,635.00	0.08
184	600512	腾达建设	120,400	366,016.00	0.08
185	300841	康华生物	1,350	362,880.00	0.08
186	605168	三人行	2,300	352,728.00	0.08
187	601567	三星医疗	16,200	345,060.00	0.08
188	600810	神马股份	28,400	339,948.00	0.08
189	600997	开滦股份	44,700	335,250.00	0.07
190	300773	拉卡拉	11,800	333,114.00	0.07
191	002335	科华数据	14,500	330,165.00	0.07
192	600621	华鑫股份	20,600	327,128.00	0.07
193	002228	合兴包装	85,300	319,875.00	0.07
194	600496	精工钢构	75,900	309,672.00	0.07
195	000951	中国重汽	11,400	308,484.00	0.07
196	300604	长川科技	4,500	306,945.00	0.07
197	002100	天康生物	34,200	304,722.00	0.07
198	600587	新华医疗	13,400	303,510.00	0.07
199	002918	蒙娜丽莎	9,300	291,927.00	0.06
200	000921	海信家电	20,300	291,711.00	0.06
201	002409	雅克科技	3,600	291,600.00	0.06
202	601126	四方股份	32,100	287,295.00	0.06

203	688019	安集科技	900	279,900.00	0.06
204	000697	炼石航空	32,900	277,347.00	0.06
205	300803	指南针	7,100	274,060.00	0.06
206	600831	广电网络	46,400	273,296.00	0.06
207	002515	金字火腿	57,000	271,890.00	0.06
208	600711	盛屯矿业	38,100	271,653.00	0.06
209	300109	新开源	16,100	270,802.00	0.06
210	002649	博彦科技	25,600	268,800.00	0.06
211	002657	中科金财	23,400	265,824.00	0.06
212	300602	飞荣达	14,797	263,386.60	0.06
213	300209	天泽信息	39,300	262,524.00	0.06
214	002254	泰和新材	12,600	255,402.00	0.06
215	603258	电魂网络	9,800	250,782.00	0.06
216	002015	协鑫能科	27,500	248,325.00	0.05
217	600971	恒源煤电	36,500	242,725.00	0.05
218	603915	国茂股份	6,100	240,950.00	0.05
219	688066	航天宏图	5,720	235,606.80	0.05
220	300767	震安科技	2,800	232,540.00	0.05
221	603027	千禾味业	8,760	230,300.40	0.05
222	600184	光电股份	20,900	227,183.00	0.05
223	601949	中国出版	35,700	226,695.00	0.05
224	300287	飞利信	41,100	226,461.00	0.05
225	002484	江海股份	14,600	226,008.00	0.05
226	002955	鸿合科技	11,800	225,262.00	0.05
227	600612	老凤祥	4,200	222,474.00	0.05
228	601666	平煤股份	30,500	216,855.00	0.05
229	300497	富祥药业	17,200	216,548.00	0.05
230	002214	大立科技	11,280	215,899.20	0.05
231	002428	云南锗业	17,400	215,586.00	0.05
232	000793	华闻集团	79,600	210,940.00	0.05
233	300673	佩蒂股份	9,450	210,357.00	0.05
234	601588	北辰实业	89,600	209,664.00	0.05
235	002163	海南发展	12,100	209,088.00	0.05
236	002042	华孚时尚	43,200	208,656.00	0.05
237	300441	鲍斯股份	20,100	208,638.00	0.05
238	000848	承德露露	17,300	206,562.00	0.05
239	002301	齐心集团	20,300	203,812.00	0.05
240	300248	新开普	20,600	202,704.00	0.04
241	603169	兰石重装	45,500	201,110.00	0.04
242	600459	贵研铂业	8,060	198,276.00	0.04
243	603378	亚士创能	3,600	198,072.00	0.04

244	300190	维尔利	30,400	197,904.00	0.04
245	002626	金达威	4,300	192,210.00	0.04
246	002091	江苏国泰	21,100	192,010.00	0.04
247	000035	中国天楹	42,000	191,520.00	0.04
248	603113	金能科技	10,600	191,436.00	0.04
249	002531	天顺风能	22,000	190,300.00	0.04
250	002581	未名医药	10,300	187,254.00	0.04
251	603601	再升科技	15,600	180,492.00	0.04
252	600873	梅花生物	32,000	179,200.00	0.04
253	002987	京北方	5,600	178,920.00	0.04
254	603220	中贝通信	14,500	178,060.00	0.04
255	300598	诚迈科技	2,100	175,497.00	0.04
256	002324	普利特	14,520	169,884.00	0.04
257	002283	天润工业	30,400	168,416.00	0.04
258	600295	鄂尔多斯	9,300	166,377.00	0.04
259	002351	漫步者	12,000	162,480.00	0.04
260	603713	密尔克卫	1,500	161,970.00	0.04
261	603298	杭叉集团	8,900	161,446.00	0.04
262	300047	天源迪科	22,100	161,330.00	0.04
263	000902	新洋丰	10,000	156,300.00	0.03
264	002929	润建股份	6,100	156,282.00	0.03
265	603956	威派格	8,500	155,550.00	0.03
266	300607	拓斯达	4,360	151,728.00	0.03
267	603533	掌阅科技	5,200	148,200.00	0.03
268	600562	国睿科技	9,800	147,686.00	0.03
269	002698	博实股份	11,500	146,395.00	0.03
270	603869	新智认知	16,200	143,532.00	0.03
271	600686	金龙汽车	20,800	141,232.00	0.03
272	603733	仙鹤股份	3,700	140,600.00	0.03
273	603416	信捷电气	2,200	139,634.00	0.03
274	002537	海联金汇	25,300	138,138.00	0.03
275	002055	得润电子	10,600	137,588.00	0.03
276	300188	美亚柏科	7,800	135,720.00	0.03
277	002194	武汉凡谷	10,000	133,900.00	0.03
278	603179	新泉股份	4,000	131,520.00	0.03
279	300348	长亮科技	7,100	129,930.00	0.03
280	000936	华西股份	18,300	128,100.00	0.03
281	300603	立昂技术	11,551	127,061.00	0.03
282	002930	宏川智慧	7,590	124,248.30	0.03
283	300664	鹏鹞环保	18,400	122,912.00	0.03
284	300763	锦浪科技	680	122,808.00	0.03

285	600449	宁夏建材	10,800	122,688.00	0.03
286	600366	宁波韵升	18,000	120,600.00	0.03
287	603283	赛腾股份	4,000	117,680.00	0.03
288	603111	康尼机电	23,700	117,315.00	0.03
289	002481	双塔食品	9,300	107,508.00	0.02
290	002798	帝欧家居	6,870	107,034.60	0.02
291	300276	三丰智能	26,500	105,205.00	0.02
292	002850	科达利	1,200	104,880.00	0.02
293	603876	鼎胜新材	3,300	102,465.00	0.02
294	300755	华致酒行	2,500	102,025.00	0.02
295	000910	大亚圣象	8,000	95,040.00	0.02
296	300559	佳发教育	10,730	94,102.10	0.02
297	002697	红旗连锁	17,800	91,492.00	0.02
298	002400	省广集团	17,500	90,825.00	0.02
299	300256	星星科技	17,500	90,475.00	0.02
300	600210	紫江企业	17,800	84,550.00	0.02
301	600850	电科数字	3,100	83,421.00	0.02
302	600662	强生控股	9,400	82,062.00	0.02
303	002838	道恩股份	4,100	72,734.00	0.02
304	603313	梦百合	2,360	70,918.00	0.02
305	002605	姚记科技	3,112	68,059.44	0.02
306	300771	智莱科技	2,800	67,984.00	0.02
307	000555	神州信息	3,900	56,433.00	0.01
308	300007	汉威科技	3,000	55,080.00	0.01
309	600206	有研新材	3,600	51,480.00	0.01
310	688007	光峰科技	1,202	50,339.76	0.01
311	300298	三诺生物	1,600	50,112.00	0.01
312	300684	中石科技	2,200	48,290.00	0.01
313	300036	超图软件	2,131	46,583.66	0.01
314	002258	利尔化学	1,800	46,440.00	0.01
315	603360	百傲化学	3,100	43,214.00	0.01
316	300725	药石科技	270	42,905.70	0.01
317	601330	绿色动力	4,800	42,672.00	0.01
318	000650	仁和药业	3,900	42,588.00	0.01
319	601058	赛轮轮胎	4,100	40,959.00	0.01
320	603218	日月股份	1,500	40,620.00	0.01
321	002106	莱宝高科	3,600	40,500.00	0.01
322	300198	纳川股份	10,500	39,795.00	0.01
323	000516	国际医学	2,100	39,501.00	0.01
324	688122	西部超导	600	38,922.00	0.01
325	300674	宇信科技	2,080	38,875.20	0.01

326	000600	建投能源	7,600	37,316.00	0.01
327	600710	苏美达	6,000	37,080.00	0.01
328	300770	新媒股份	760	37,012.00	0.01
329	002216	三全食品	2,190	36,069.30	0.01
330	300552	万集科技	1,080	35,942.40	0.01
331	600986	浙文互联	8,500	35,700.00	0.01
332	002768	国恩股份	1,400	35,532.00	0.01
333	300682	朗新科技	2,100	35,322.00	0.01
334	300206	理邦仪器	2,200	34,980.00	0.01
335	002840	华统股份	3,820	34,418.20	0.01
336	600789	鲁抗医药	4,500	33,120.00	0.01
337	002367	康力电梯	3,700	33,078.00	0.01
338	600720	祁连山	3,000	31,620.00	0.01
339	002959	小熊电器	400	26,576.00	0.01
340	603129	春风动力	200	24,816.00	0.01
341	601606	长城军工	2,000	20,660.00	0.00
342	603508	思维列控	840	16,472.40	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	300627	华测导航	101,900	3,475,809.00	0.77
2	000725	京东方A	541,900	3,381,456.00	0.75
3	300223	北京君正	33,100	3,340,452.00	0.74
4	300364	中文在线	521,900	3,204,466.00	0.71
5	002623	亚玛顿	72,100	3,049,109.00	0.67
6	601636	旗滨集团	164,000	3,043,840.00	0.67
7	000799	酒鬼酒	11,900	3,041,640.00	0.67
8	600845	宝信软件	57,130	2,907,917.00	0.64
9	000100	TCL 科技	318,900	2,439,585.00	0.54
10	688099	晶晨股份	18,900	2,120,580.00	0.47
11	300687	赛意信息	89,720	1,917,316.40	0.42
12	300529	健帆生物	19,600	1,692,656.00	0.37
13	603727	博迈科	90,600	1,650,732.00	0.36
14	002279	久其软件	311,600	1,614,088.00	0.36
15	000830	鲁西化工	85,100	1,593,923.00	0.35
16	600176	中国巨石	92,900	1,440,879.00	0.32
17	600325	华发股份	213,000	1,435,620.00	0.32
18	605006	山东玻纤	95,800	1,168,760.00	0.26
19	000157	中联重科	118,200	1,092,168.00	0.24

20	002603	以岭药业	32,300	941,868.00	0.21
21	300593	新雷能	21,440	931,568.00	0.21
22	688180	君实生物	10,700	868,947.00	0.19
23	600409	三友化工	84,000	849,240.00	0.19
24	002341	新纶科技	169,200	818,928.00	0.18
25	002645	华宏科技	43,300	691,934.00	0.15
26	300019	硅宝科技	38,400	674,304.00	0.15
27	300782	卓胜微	1,200	645,000.00	0.14
28	600461	洪城环境	87,300	633,798.00	0.14
29	300300	海峡创新	99,600	623,496.00	0.14
30	600027	华电国际	174,100	598,904.00	0.13
31	300750	宁德时代	1,100	588,280.00	0.13
32	603010	万盛股份	24,300	509,571.00	0.11
33	300415	伊之密	22,500	483,750.00	0.11
34	600132	重庆啤酒	2,100	415,695.00	0.09
35	600141	兴发集团	20,700	389,781.00	0.09
36	000751	锌业股份	120,100	387,923.00	0.09
37	000711	京蓝科技	143,400	375,708.00	0.08
38	002933	新兴装备	14,600	373,322.00	0.08
39	300769	德方纳米	1,800	372,042.00	0.08
40	688516	奥特维	2,500	370,000.00	0.08
41	603660	苏州科达	52,600	366,096.00	0.08
42	002709	天赐材料	3,400	362,372.00	0.08
43	688131	皓元医药	1,369	338,279.90	0.07
44	000039	中集集团	17,900	325,422.00	0.07
45	688617	惠泰医疗	836	312,028.64	0.07
46	002138	顺络电子	7,400	286,898.00	0.06
47	002459	晶澳科技	5,800	284,200.00	0.06
48	000026	飞亚达	20,400	283,968.00	0.06
49	000488	晨鸣纸业	33,600	273,504.00	0.06
50	688083	中望软件	519	271,997.52	0.06
51	002669	康达新材	21,200	269,876.00	0.06
52	601615	明阳智能	15,100	244,469.00	0.05
53	600626	申达股份	58,300	243,694.00	0.05
54	300037	新宙邦	2,400	240,240.00	0.05
55	000932	华菱钢铁	34,900	230,340.00	0.05
56	603238	诺邦股份	9,700	228,920.00	0.05
57	688161	威高骨科	2,150	228,007.50	0.05
58	300558	贝达药业	2,100	227,304.00	0.05
59	603882	金域医学	1,400	223,678.00	0.05
60	600298	安琪酵母	4,000	217,520.00	0.05

61	002223	鱼跃医疗	5,700	217,341.00	0.05
62	600708	光明地产	88,400	213,928.00	0.05
63	688626	翔宇医疗	2,035	211,965.60	0.05
64	601888	中国中免	700	210,070.00	0.05
65	601390	中国中铁	39,600	207,504.00	0.05
66	002878	元隆雅图	11,800	206,500.00	0.05
67	002594	比亚迪	800	200,800.00	0.04
68	688002	睿创微纳	2,000	199,660.00	0.04
69	000975	银泰黄金	20,800	197,808.00	0.04
70	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.04
71	000581	威孚高科	9,400	195,802.00	0.04
72	300433	蓝思科技	6,600	194,106.00	0.04
73	002791	坚朗五金	1,000	194,050.00	0.04
74	002414	高德红外	6,580	181,476.40	0.04
75	002244	滨江集团	43,000	180,170.00	0.04
76	300413	芒果超媒	2,600	178,360.00	0.04
77	002080	中材科技	6,800	177,956.00	0.04
78	300676	华大基因	1,500	177,900.00	0.04
79	601899	紫金矿业	18,100	175,389.00	0.04
80	002039	黔源电力	11,400	165,072.00	0.04
81	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.03
82	002829	星网宇达	4,800	155,328.00	0.03
83	002156	通富微电	6,300	151,452.00	0.03
84	603638	艾迪精密	3,500	150,045.00	0.03
85	002434	万里扬	17,300	140,303.00	0.03
86	300408	三环集团	3,200	135,744.00	0.03
87	002027	分众传媒	14,400	135,504.00	0.03
88	688568	中科星图	2,100	134,400.00	0.03
89	600988	赤峰黄金	8,900	133,411.00	0.03
90	002705	新宝股份	5,000	131,250.00	0.03
91	002084	海鸥住工	23,800	128,282.00	0.03
92	600143	金发科技	5,900	123,074.00	0.03
93	300463	迈克生物	2,900	122,061.00	0.03
94	000526	学大教育	4,500	119,205.00	0.03
95	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.03
96	600764	中国海防	4,000	113,200.00	0.03
97	002607	中公教育	5,000	104,450.00	0.02
98	300482	万孚生物	1,560	100,916.40	0.02
99	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.02
100	688015	交控科技	3,092	96,594.08	0.02
101	688329	艾隆科技	1,846	92,373.84	0.02

102	603317	天味食品	3,120	91,821.60	0.02
103	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.02
104	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
105	601598	中国外运	16,400	82,820.00	0.02
106	600571	信雅达	9,100	66,794.00	0.01
107	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
108	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.01
109	688669	聚石化学	1,915	62,026.85	0.01
110	300896	爱美客	76	59,954.88	0.01
111	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.01
112	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
113	300033	同花顺	500	56,390.00	0.01
114	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
115	300677	英科医疗	400	49,920.00	0.01
116	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
117	688683	莱尔科技	3,296	48,550.08	0.01
118	300957	贝泰妮	182	45,856.72	0.01
119	300919	中伟股份	259	42,217.00	0.01
120	300059	东方财富	1,200	39,348.00	0.01
121	002241	歌尔股份	900	38,466.00	0.01
122	600521	华海药业	1,700	35,496.00	0.01
123	002128	露天煤业	3,400	35,394.00	0.01
124	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
125	002028	思源电气	1,100	33,869.00	0.01
126	002532	天山铝业	3,800	31,882.00	0.01
127	300729	乐歌股份	1,300	31,109.00	0.01
128	300979	华利集团	319	27,912.50	0.01
129	300973	立高食品	240	27,770.40	0.01
130	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.01
131	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
132	300981	中红医疗	202	18,258.78	0.00
133	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
134	300941	创识科技	312	15,581.28	0.00
135	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
136	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
137	300968	格林精密	1,099	13,264.93	0.00
138	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
139	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
140	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
141	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
142	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00

143	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
144	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
145	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
146	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
147	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
148	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
149	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
150	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
151	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
152	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
153	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
154	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
155	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
156	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
157	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
158	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
159	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
160	300985	致远新能	271	6,723.51	0.00
161	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
162	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
163	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
164	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
165	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
166	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
167	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
168	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
169	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
170	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
171	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	300496	中科创达	6,619,281.86	3.34
2	000683	远兴能源	5,006,943.00	2.53
3	603363	傲农生物	4,473,671.80	2.26
4	601678	滨化股份	4,082,810.60	2.06
5	000933	神火股份	3,965,835.80	2.00
6	300639	凯普生物	3,953,841.84	2.00
7	603337	杰克股份	3,850,414.00	1.95

8	002022	科华生物	3,848,222.99	1.94
9	600057	厦门象屿	3,844,908.00	1.94
10	000550	江铃汽车	3,810,658.50	1.93
11	600603	广汇物流	3,726,925.00	1.88
12	000403	派林生物	3,654,730.54	1.85
13	300775	三角防务	3,565,346.48	1.80
14	000725	京东方 A	3,477,248.00	1.76
15	300364	中文在线	3,455,798.79	1.75
16	300458	全志科技	3,308,285.00	1.67
17	000498	山东路桥	3,237,479.00	1.64
18	300627	华测导航	3,150,341.00	1.59
19	600966	博汇纸业	3,100,024.00	1.57
20	002034	旺能环境	3,094,424.70	1.56

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	002015	协鑫能科	2,542,103.00	1.28
2	603218	日月股份	2,517,653.62	1.27
3	601058	赛轮轮胎	2,241,843.99	1.13
4	300737	科顺股份	2,075,410.00	1.05
5	300059	东方财富	1,960,636.08	0.99
6	603127	昭衍新药	1,806,736.40	0.91
7	600720	祁连山	1,805,586.52	0.91
8	000157	中联重科	1,793,068.00	0.91
9	300206	理邦仪器	1,755,324.00	0.89
10	002539	云图控股	1,730,743.95	0.87
11	601598	中国外运	1,683,133.00	0.85
12	601330	绿色动力	1,633,981.24	0.83
13	000507	珠海港	1,615,000.98	0.82
14	002106	莱宝高科	1,546,818.00	0.78
15	600206	有研新材	1,535,322.95	0.78
16	300677	英科医疗	1,500,660.00	0.76
17	300119	瑞普生物	1,478,267.00	0.75
18	600708	光明地产	1,393,587.00	0.70
19	002139	拓邦股份	1,390,724.00	0.70
20	002497	雅化集团	1,373,593.00	0.69

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	302,226,669.80
卖出股票收入（成交）总额	107,911,146.98

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）	195,834.30	0.04
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	195,834.30	0.04

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	870	87,000.00	0.02
2	123115	捷捷转债	335	48,434.30	0.01
3	113625	江山转债	420	42,000.00	0.01
4	123117	健帆转债	184	18,400.00	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。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

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。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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	29,986.02
2	应收证券清算款	—

3	应收股利	—
4	应收利息	6,797.27
5	应收申购款	3,179,406.98
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,216,190.27

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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

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(%)
22,374	10,415.51	93,925,388.00	40.30	139,111,225.83	59.70

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	卢志福	3,685,429	31.86
2	熊振国	573,600	4.96

3	王琪	475,780	4.11
4	方平	434,288	3.75
5	李群	400,023	3.46
6	张建强	347,516	3.00
7	陈雷	343,077	2.97
8	邓玉良	300,040	2.59
9	宗爱云	213,983	1.85
10	北京新湖巨源投资管理有限公司—新湖巨源泓湖百世风险平衡1号私募证券投资基金	129,796	1.12

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	435,243.92	0.1868

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	10~50
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(2018年05月31日)基金份额总额	512,114,043.76
报告期期初基金份额总额	118,156,134.78
本报告期基金总申购份额	209,006,316.79
减：本报告期基金总赎回份额	94,125,837.74
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	233,036,613.83

§ 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。

2021年5月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

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 (%)	
安信证券	2	30,330,534.00	7.50	—	—	—	—	—	—	27,644.99	7.51	—
德邦证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
第一创业证券	2	29,903,364.06	7.40	31,758.04	7.01	—	—	—	—	27,251.41	7.40	—
东北证券	2	22,029,886.73	5.45	—	—	—	—	—	—	20,073.89	5.45	—
东方证券	2	36,785,444.55	9.10	210,530.77	46.46	—	—	—	—	33,522.04	9.10	—
国海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国联证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	11,721,533.68	2.90	—	—	—	—	—	—	10,682.09	2.90	—
华菁证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
汇丰前海	2	193,556.00	0.05	—	—	—	—	—	—	176.41	0.05	—
开源证券	2	24,606,419.34	6.09	13,498.64	2.98	—	—	—	—	22,423.26	6.09	—
申万宏源	4	51,654,832.98	12.78	172,488.40	38.06	—	—	—	—	47,065.35	12.78	—
兴业证券	2	100,671,080.37	24.91	—	—	9,000,000.00	47.37	—	—	91,742.46	24.91	—
浙商证券	1	64,551,371.06	15.97	24,892.20	5.49	—	—	—	—	58,827.05	15.97	—

中泰证券	1	3,603,337.08	0.89	—	—	10,000,000.00	52.63	—	—	3,285.52	0.89	—
中信建投	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	2	28,139,471.29	6.96	—	—	—	—	—	—	25,643.48	6.96	—

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。本报告期本基金新增券商交易单元：德邦证券（50404），中信建投（012789、50588）。

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
5	富国基金管理有限公司关于调整旗下部分基金场内最低申购金额的公告	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 2021-02-25;2021-04-27 至 2021-05-05	24,771,271.87	4,376,476.90	7,113,103.83	22,034,644.94	9.46%
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）的文件	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、

<p>2、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同</p> <p>3、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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>4008880688 (全国统一, 免长途话费) 公司网址: http://www.fullgoal.com.cn。</p>
---	--	--