# 上证综指交易型开放式指数证券投资基金 二 0 二 0 年第 2 季度报告

2020年06月30日

基金管理人: 富国基金管理有限公司

基金托管人: 中国工商银行股份有限公司

报告送出日期: 2020年07月21日

#### §1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2020年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。 富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。 基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。 本报告财务资料未经审计。 本报告期自2020年4月1日起至2020年6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	上证综指 ETF
场内简称	综指 ETF
基金主代码	510210
交易代码	510210
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2011年01月30日
报告期末基金份额总额(单位:份)	62, 138, 513. 00
投资目标	紧密跟踪标的指数(上证综合指数),追
1又页 日 175	求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
	本基金采用最优化抽样复制标的指数。最
	优化抽样依托富国量化投资平台,利用长
投资策略	期稳定的风险模型,使用"跟踪误差最小
	化"的最优化方式创建目标组合,从而实
	现对标的指数的紧密跟踪。
业绩比较基准	上证综合指数
	本基金属股票型基金, 预期风险与预期收
	益高于混合型基金、债券型基金和货币市
风险收益特征	场基金。同时本基金为指数型基金, 跟踪
八四以红面村仙	上证综合指数, 具有与标的指数以及标的
	指数所代表的股票市场相似的风险收益
	特征。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

## §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

	1 区: 7 (147)
主要财务指标	报告期(2020年04月01日-2020
上女则分16你	年 06 月 30 日)
1. 本期已实现收益	6, 967, 346. 31
2. 本期利润	17, 961, 139. 66
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 4073
4. 期末基金资产净值	250, 208, 682. 91
5. 期末基金份额净值	4. 027

注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式

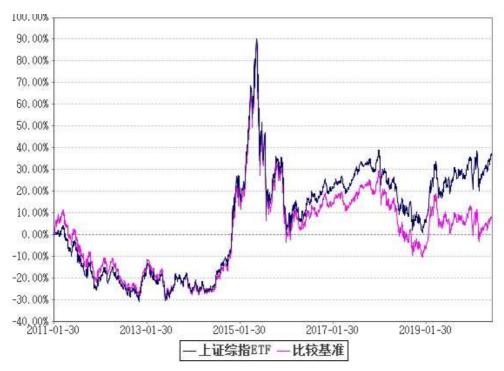
基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长 率①	净值增长 率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	1)-(3)	2-4
过去三个月	10.85%	0.78%	8. 52%	0. 79%	2.33%	-0. 01%
过去六个月	2.99%	1.34%	-2.15%	1. 37%	5.14%	-0. 03%
过去一年	11. 09%	1.08%	0. 19%	1. 11%	10.90%	-0. 03%
过去三年	9.88%	1.10%	-6. 51%	1. 13%	16.39%	-0. 03%
过去五年	-12.74%	1.32%	-30. 22%	1. 38%	17.48%	-0.06%
自基金合同 生效日起至 今	37. 82%	1. 31%	8. 43%	1. 34%	29. 39%	-0. 03%

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



注: 1、截止日期为2020年6月30日。

2、本基金于2011年1月30日成立,建仓期3个月,从2011年1月30日起至2011年4月29日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

#### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方旻	本基金基金经理	2014-11-19	_	7. 4	硕士,自 2010 年 2 月至 2014 年 4 月任富国基金管 理有限公司定量研究员; 2014 年 11 月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、富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理助理,2014年11

月起任富国中证经和指数 增强亚			Т	r		T
国沪深 300 增强证券投资基金、上证综报交易型开放式指数正券投资基金和富用证 500 指数增基金经型 证券投资基金和富产业 600 非数量证券投资基金 600 为级证券 600 为数证券 600 为数证券 600 为数证券 600 为数证券 600 为数证券 600 为数证券 600 为数						月起任富国中证红利指数
基金、上证综指交易型开放式指数运动型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、高为争证。指数分级证券投资基金公司高量中证证券投资基金公司高量的基金经理,2015年5月10日变更为富国中证级指数型证券投资基金(已开2018年10月指数型型证券投资基金的,2017年16月至2018年12月在含型起式证券投资基金(LOF)基金超式证券投资基金(LOF)基金超式证券投资基金(LOF)基金超过证券投资基金(LOF)基金国斯兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)基金国中证1000指数基金国派公司,2018年7月起程高型证券投资基金基金国工产。为价值基金基金国还CT中国各股国中证1000指数增基金,2019年1月起程高型证券投资基金基金国还CT中国各股国产品的价值基金基金国还CT中国各股国产品的价值基金国公司,2019年1月起任治量是化对冲策略三个月持投资基金基金经理,2020年2月中日持投资基金基金经理,并任量						增强型证券投资基金、富
基金、上证综指交易型开放式指数运动型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、高为争证。指数分级证券投资基金公司高量中证证券投资基金公司高量的基金经理,2015年5月10日变更为富国中证级指数型证券投资基金(已开2018年10月指数型型证券投资基金的,2017年16月至2018年12月在含型起式证券投资基金(LOF)基金超式证券投资基金(LOF)基金超式证券投资基金(LOF)基金超过证券投资基金(LOF)基金国斯兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)基金国中证1000指数基金国派公司,2018年7月起程高型证券投资基金基金国工产。为价值基金基金国还CT中国各股国中证1000指数增基金,2019年1月起程高型证券投资基金基金国还CT中国各股国产品的价值基金基金国还CT中国各股国产品的价值基金国公司,2019年1月起任治量是化对冲策略三个月持投资基金基金经理,2020年2月中日持投资基金基金经理,并任量						国沪深 300 增强证券投资
放式指数 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 (LOF) 基金 经理, 2015 年 5 月至 2019 年 11 月日 富国 创业 板 指数 分级证券投资基金 (担于 富国创业 证金 指 数 分级证券投资基金 (已于 富国 分级证券投资基金 (已于 富国 分级证券投资基金 (已于 高国 为投资 基金 (已于 高国 为投资 基金 (已 1 日 包 2 1 1 1 日 2 1 2 1 2 1 2 1 2 1 2 1 2 1 2						,
富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)基金经理,没15 年 5 月至 2019年11月任富国创业 板指数分级证券投资基金 1指数分级证券投资基金 1指数分级证券投资基金 16 月至 10 日安更为富国中证全指资基金 16 月至 10 日安更为常设资基金 17 月 10 日安更为常设资基金 10 月 月 10 型面证券投资基金 2015年 10 月 10 型面证券投资基金 2015年 10 月 10 型面证券投资基金 2017年 10 型元 11 型发基金 10 型开接 20 型元 20 14 年 12 月 16 型发起式证券投资基金 12 月 16 型发起式证券投资基金 (LOF)基定 20 18 年 5 月 起程 18 中证 10 00 指数 42 单元 20 18 年 7 月 起程 18 型 20 18 年 7 月 起程 18 型 20 19 年 1 月 国 1 月 国 1 月 国 1 月 国 1 月 国 1 月 国 1 月 国 1 月 国 1 月 国 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1						
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指国国中证金指证券投资基金 高国中证金指设基金 6 月至 2019年 5 月 10日变更为富国中证银行指数型证券投资基金 10 月 月 10 日变更为富国中证银行指数型证券投资基金 10 月 20 17年6 月至 2018年 12月任富国新活力灵持投资基金任国新活力灵持投资基金任理,2017年 6 月至 2018年 12月任富型发起式证券投资基金 (LOF) 基金国新兴成长量在(LOF)基金国新兴成长量在(LOF)基金国国新兴成长量在(LOF)基金国国中证 1000 指数增强经理,2018年 7 月起程运免经理,2018年 7 月起混合型证券投资基金基企经理,2018年 7 月起混合型证券投资基金基全理,2019年 1 月国际通指数增强型证券投资基金基任富国大盘价值量化对冲策强。经理,2020年 2 月之19年 1 月 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10						
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 中证金指证券公及筹投资基金及富为 级证券投资基金及资料资 基金(已于 2019 年 5 月 10 日变更为富国中证银行指 数型证券投资基金 10 月起任 富国上证综指交易型开放 式指数基金经理, 2015 年 10 月起任 富国上证综指交易型开放 式指数基金经理, 2017 年 6 月至 2018 年 12 月任富国 新活力灵活配置基金经理, 2017 年 7 月起程高型发起式证券投资基金 (LOF) 基金 经理,2018 年 5 月起强富国 新兴成长量化精选混合型 证券投资基金 (LOF) 基金 经理,2018 年 7 月起程富国 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 大盘价值量量量化对冲策备经 理,2019 年 2 月起任富国 上工金、1000 指数是经 是国,2019 年 2 月起任富国 是化对冲策备经 理,2020 年 2 月起任官司 量化对冲策备经 理,2020 年 2 月起任官司 量化对冲策备经						
年11月任富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证条投资基金、富国中证条投资基金及富国中证银行指数分级证券投资基金(已于 2019 年 5 月 10 日变更为富鱼工证银行指数型证券投资基金(已开 2015 年 10 月起任富国上证综持投资基金联接基金的基金经理, 2015 年 10 月起任富国为活配置混混查金经理, 2017 年 6 月至 2018 年 12 月任宫国新活力灵活配置混合型。证券投资基金 (1.0F)基金经理, 2017 年 7 月起任富国新兴成长量金 (1.0F)基金经理, 2018 年 5 月起程高国中证 1000 指数增基金经理, 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, 2019 年 1 月起任富型证券投资基金基金区理,2019 年 1 月起任富国工产组价值量化对冲策强。经理,2019 年 2 月起任自型证券投资基金基金经理,2020 年 2 月起任司量量化对冲策强经经理,2020 年 2 月起任司量量化对冲策强经经理,2020 年 2 月起任司量量化对冲策强经经理,2020 年 2 月起任司量量化对冲策强经经理,2020 年 2 月起任司量量化对冲策强经经理,兼任量						证券投资基金(LOF)基金
分级证券投资基金、富国中证全指证券公及证券投资基金及国中证金指资券公及证券投资基金(已于 2019 年 5 月 10 日变为富国基金(已于 2019 年 6 月 至 20 月 至 10 月 主任富国新兴投资基金(LOF)基金经理,2017 年 7 月 走任富国新兴投资基金(LOF)基金经理,2018 年 7 月 走任富国中证 1000 指数增强经理,2018 年 7 月 走任富国大盘价值量化基金经理,2019 年 1 月 起任富型证券投资基金金经理,2019 年 1 月 声 10 日 10						经理, 2015年5月至2019
中证全指证券公司指数分级证券投资基金及富寿投资基金及高寿投资基金(已于 2019 年 5 月 10 日 变更为富国中证银行指数型证券投资基金(已于 2019 年 5 月 10 日 变更为富国中证银行指数型证券投资基金 10 月起压富工证券投资基金经理,2017 年 6 月至 2018 年 12 月任富国新活力灵活验基金基全理,2017 年 7 月起选官国新兴成长量金(上6万)基全国新兴成长量金(上6万)基金国,2018 年 5 月起进了,2018 年 7 月起进高国中证 1000 指数增基金经理,2018 年 7 月起任富国大盘价值量化金基金经理,2018 年 7 月起任富国大盘价值量化高国域分量。从为产量。1019 年 1 月起任富国大盘价值量化对产策略。2019 年 1 月起任富国地区中国 4 股国际通路全型证券投资基金基金经理,2020年 2 月起日青有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理;兼任量						年11月任富国创业板指数
中证全指证券公司指数分级证券投资基金及富寿投资基金及高寿投资基金(已于 2019 年 5 月 10 日 变更为富国中证银行指数型证券投资基金(已于 2019 年 5 月 10 日 变更为富国中证银行指数型证券投资基金 10 月起压富工证券投资基金经理,2017 年 6 月至 2018 年 12 月任富国新活力灵活验基金基全理,2017 年 7 月起选官国新兴成长量金(上6万)基全国新兴成长量金(上6万)基金国,2018 年 5 月起进了,2018 年 7 月起进高国中证 1000 指数增基金经理,2018 年 7 月起任富国大盘价值量化金基金经理,2018 年 7 月起任富国大盘价值量化高国域分量。从为产量。1019 年 1 月起任富国大盘价值量化对产策略。2019 年 1 月起任富国地区中国 4 股国际通路全型证券投资基金基金经理,2020年 2 月起日青有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理;兼任量						分级证券投资基金、富国
级证券投资基金及富国中证银行指数分级证券投资基金(已于 2019 年 5 月 10 日变更为富国中证银行指数型证券投资基金)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 7 月在配置图,为一次一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一						
证银行指数分级证券投资基金(己于 2019 年 5 月 10 日变更为富国中证银行指数型证券投资基金)的基金经理,2015 年 10 月起任富国上证综指交易型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 月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)基金经理,2018 年 5 月起任富国中证 1000 指数增强型企经理,2018 年 7 月起任证券投资基金 (LOF)基金经理,2018 年 7 月起任证场投资基金年高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 月起任富国大盘价值量化精选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;兼任量						
基金(已于 2019 年 5 月 10 日变更为富国中证银行指数型证券投资基金)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 月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金 (LOF)基金经理,2018 年 5 月起任富国中证 1000 指数增强基金经理,2018 年 7 月起任富国中证 1000 指数增强基金经理,2018 年 7 月起任富国大盘价值量长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,兼任量						*** ** ** ** ** ** ** ** ** ** ** ** **
日变更为富国中证银行指数型证券投资基金)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月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)基金经理,2018年5月起任富国中证1000指数增强型证券投资基金基金经理,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,2019年1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,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,兼任量						
数型证券投资基金)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月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)基金经理,2018年5月起任富国中证1000指数增强型证券投资基金基金经理,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,2019年1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,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;兼任量						
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经理,2017年7月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)基金经理,2018年5月起任富国中证1000指数增强型证券投资基金基金经理,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,2019年1月起任富国断SCI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;兼任量						
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月起任富国 新兴成长量化精选混合型 证券投资基金(LOF)基金 经理,2018年5月起任富国中证1000指数增强型证 券投资基金基金经理,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,2019年1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,2019年1月起任富国 型证券投资基金基金经理,2019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;兼任量						数型证券投资基金) 的基
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月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)基金经理,2018年5月起任富国中证1000指数增强型证券投资基金基金经理,2019年1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,2019年1月起任富国大国新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;兼任量						金经理,2015年10月起任
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月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)基金经理,2018年5月起任富国中证1000指数增强型证券投资基金基金经理,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,2019年1月起任富国大盘价值量化精选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;兼任量						富国上证综指交易型开放
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月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)基金经理,2018年5月起任富国中证1000指数增强型证券投资基金基金经理,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,2019年1月起任富国大盘价值量化精选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;兼任量						式指数证券投资基金联接
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月起任富国 新兴成长量化精选混合型 证券投资基金 (LOF)基金 经理,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, 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;兼任量						
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月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)基金经理,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,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;兼任量						* *
起式证券投资基金基金经理,2017年7月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)基金经理,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,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;兼任量						
理,2017年7月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)基金经理,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,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;兼任量						******
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,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;兼任量						. =
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,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;兼任量						
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,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;兼任量						新兴成长量化精选混合型
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,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;兼任量						证券投资基金(LOF)基金
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,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;兼任量						经理, 2018年5月起任富
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,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;兼任量						国中证 1000 指数增强型证
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, 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;兼任量						
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;兼任量						
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;兼任量						
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;兼任量						
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;兼任量						
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;兼任量						
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;兼任量						中国 A 股国际通指数增强
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;兼任量						型证券投资基金基金经
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;兼任量						理,2020年2月起任富国
期灵活配置混合型证券投资基金基金经理;兼任量						
资基金基金经理; 兼任量						
11 .11. ½ Lkr						
从业资格。						
本基金基 2014 20 20   博士,曾任富国基金管理		太某全某				
王保合 2011-03-03 - 14.0 有限公司研究员、富国沪	王保合		2011-03-03	_	14.0	有限公司研究员、富国沪
深 300 增强证券投资基金		亚红垤				深 300 增强证券投资基金

基金经理助理: 2011 年 3 月起任上证综指交易型开 放式指数证券投资基金、 富国上证综指交易型开放 式指数证券投资基金联接 基金基金经理, 2013 年 9 月起任富国创业板指数分 级证券投资基金基金经 理,2014年4月起任富国 中证军工指数分级证券投 资基金基金经理,2015年 4 月起任富国中证移动互 联网指数分级证券投资基 金、富国中证国有企业改 革指数分级证券投资基金 基金经理, 2015年5月起 任富国中证全指证券公司 指数分级证券投资基金、 富国中证银行指数分级证 券投资基金(已于 2019 年 5月10日变更为富国中证 银行指数型证券投资基 金) 基金经理, 2017年9 月至 2019 年 10 月任富国 丰利增强债券型发起式证 券投资基金基金经理, 2018年3月至2019年10 月任富国中证10年期国债 交易型开放式指数证券投 资基金基金经理,2019年 3 月起任富国恒生中国企 业交易型开放式指数证券 投资基金基金经理,2019 年11月起任富国中证国企 一带一路交易型开放式指 数证券投资基金基金经 理,2019年12月起任富国 中证国企一带一路交易型 开放式指数证券投资基金 联接基金基金经理;兼任 量化投资部总经理。具有 基金从业资格。

注: 1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期,离任日期为根据公司确定的解聘日期;首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期,富国基金管理有限公司作为上证综指交易型开放式指数证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,以尽可能减少和分散投资风险,力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理办法》,对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节,实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括: 1、一级市场,通过标准化的办公流程,对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制; 2、二级市场,通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理,对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制,银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为,非经特别控制流程审核同意,不得进行;对于同日同向交易,通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合,对同一投资标的采用相同投资策略的,必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令,确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和 反向交易的合理性分析评估,以及不同时间窗口下(1 日、3 日、5 日)的季度 公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统,对涉及公平 性交易的投资行为进行分析评估,分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品, 并重点分析同类组合(股票型、混合型、债券型)间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为,若发现异常交易行为,风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释,并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字,并经督察长、总经理审阅签字后,归档保存,以备后查。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开 竞价同日反向交易的控制方面,报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交 较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

4月初,受全球疫情仍存在不确定的影响,国内宏观对冲政策持续发力,央行下调逆回购利率 20BP,国常会决定增加中小银行再贷款再贴现额度 1 万亿元。受政策刺激影响,以内需为主的消费、医药等板块率先反弹。进入 4 月中旬,由于美国新增确诊人数进入顶部平台期,意大利、西班牙等前期疫情严重的地区新增确诊人数逐步下降,疫情边际上得到控制,因此在充裕流动性的推动下,全球股市继续震荡反弹。5 月下旬,全国两会如期召开,会议公布的财政扩张措施基本符合预期,但由于未公布 GDP 目标,低于部分投资者预期,因此市场出现阶段性调整。6 月初,由于美国公布的 5 月非农就业人数大幅好转,超出市场预期,美股带动全球市场大幅反弹。进入下旬,央行下调 14 天逆回购利率 20 个基点,继续释放适度宽松的货币政策信号,同时北上资金继续大幅流入,A 股整体出现明显上涨,其中创业板涨幅较大。总体来看,2020 年 2 季度上证综指上涨 8.52%,沪深 300 上涨 12.96%,创业板指上涨 30.25%,中证 500 指数上涨 16.32%。

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

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为 10.85%,同期业绩比较基准收益率为 8.52%

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

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

#### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	242, 933, 572. 65	97. 01
	其中:股票	242, 933, 572. 65	97. 01
2	固定收益投资		_
	其中:债券	_	_
	资产支持证券		
3	贵金属投资		_
4	金融衍生品投资		
5	买入返售金融资产		_
	其中: 买断式回购的买入返		
	售金融资产		
6	银行存款和结算备付金合计	7, 469, 311. 18	2. 98
7	其他资产	30, 544. 84	0.01
8	合计	250, 433, 428. 67	100.00

注:上表中的股票投资项的金额包含可退替代款估值增值,而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	_	_
В	采矿业		_
С	制造业	1, 933, 865. 03	0. 77
D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	12, 766. 32	0. 01
Е	建筑业		_
F	批发和零售业		_
G	交通运输、仓储和邮政业		_
Н	住宿和餐饮业		_

Ι	信息传输、软件和信息技术服务 业	81, 487. 67	0. 03
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	212, 687. 90	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业		_
0	居民服务、修理和其他服务业		_
Р	教育	l	_
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业		_
S	综合		_
	合计	2, 240, 806. 92	0. 90

# 5.2.2 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1, 464, 888. 00	0. 59
В	采矿业	18, 238, 920. 86	7. 29
С	制造业	88, 106, 111. 00	35. 21
D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	12, 036, 958. 38	4. 81
Е	建筑业	6, 788, 799. 70	2. 71
F	批发和零售业	5, 183, 062. 04	2. 07
G	交通运输、仓储和邮政业	9, 250, 320. 30	3. 70
Н	住宿和餐饮业	730, 382. 40	0. 29
Ι	信息传输、软件和信息技术服务 业	7, 195, 598. 67	2. 88
J	金融业	72, 835, 579. 59	29. 11
K	房地产业	8, 190, 079. 39	3. 27
L	租赁和商务服务业	3, 542, 690. 00	1. 42
M	科学研究和技术服务业	3, 453, 543. 16	1. 38
N	水利、环境和公共设施管理业	_	
0	居民服务、修理和其他服务业	_	_
Р	教育	_	_
Q	卫生和社会工作	_	_
R	文化、体育和娱乐业	1, 448, 923. 00	0. 58
S	综合	2, 226, 960. 24	0.89
	合计	240, 692, 816. 73	96. 20

#### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

# 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	11, 893	17, 398, 031. 84	6. 95
2	601288	农业银行	2, 789, 739	9, 429, 317. 82	3. 77
3	601988	中国银行	2, 124, 900	7, 394, 652. 00	2. 96
4	601318	中国平安	96, 400	6, 882, 960. 00	2. 75
5	600036	招商银行	198, 222	6, 684, 045. 84	2. 67
6	600276	恒瑞医药	60, 587	5, 592, 180. 10	2. 24
7	601628	中国人寿	194, 525	5, 293, 025. 25	2. 12
8	601857	中国石油	1, 172, 658	4, 913, 437. 02	1. 96
9	600028	中国石化	913, 488	3, 571, 738. 08	1. 43
10	601888	中国中免	23, 000	3, 542, 690. 00	1. 42

# 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688396	华润微	10, 546	437, 131. 70	0. 17
2	688086	紫晶存储	3, 920	252, 996. 80	0. 10
3	688100	威胜信息	9, 418	244, 114. 56	0. 10
4	688558	国盛智科	6, 705	236, 418. 30	0.09
5	688520	神州细胞	3, 842	225, 986. 44	0.09

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

- 注: 本基金本报告期末未持有债券。
- 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
- 注: 本基金本报告期末未持有债券。
- 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券 投资明细
- 注: 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

- 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明 细
- 注: 本基金本报告期末未持有贵金属投资。
- 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
- 注: 本基金本报告期末未持有权证。
- 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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

注: 本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定,不允许投资股指期货。

- 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定, 不允许投资国债期货。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

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

本报告编制日前一年内,本基金持有的"农业银行"的发行主体中国农业银行股份有限公司(以下简称"公司"),由于存在:(1)违反审慎经营规则;(2)虚假代理业务等违法违规事实,中国银行保险监督管理委员会于2020年3月9日对公司做出罚款合计50万元的行政处罚(银保监罚决字〔2020〕3号);由于存在:(1)"两会一层"境外机构管理履职不到位;(2)国别风险管理不满足监管要求;(3)信贷资金被挪用作保证金;(4)未将集团成员纳入集团客户统一授信管理等违法违规事实,中国银行保险监督管理委员会于2020年4月22日对公司做出罚款合计200万元的行政处罚(银保监罚决字〔2020〕11号);由于存在:监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在违法违规行为,中国银行保险监督管理委员会于2020年4月22日对公司做出合计罚款230万元的行政处罚(银保监罚决字〔2020〕12号)。农业银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内,本基金持有的"中国银行"的发行主体中国银行股份有限公司(以下简称"公司"),由于存在:监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在违法违规行为,中国银行保险监督管理委员会于 2020 年4月20日对公司做出合计罚款270万元的行政处罚(银保监罚决字(2020)4号)。中国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,或在报告编制目前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

本报告期本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)

1	存出保证金	3, 027. 77
2	应收证券清算款	26, 832. 61
3	应收股利	_
4	应收利息	684. 46
5	应收申购款	_
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	30, 544. 84

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注: 本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

#### 5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值(元)	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情况说明
1	688396	华润微	437,131.70	0.17	新股限售
2	688086	紫晶存储	252,996.80	0.10	新股限售
3	688100	威胜信息	244,114.56	0.10	新股限售
4	688558	国盛智科	236,418.30	0.09	新股限售
5	688520	神州细胞	225,986.44	0.09	新股限售

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存 在尾差。

#### § 6 开放式基金份额变动

单位:份

	— 1\(\frac{1}{2}\). \(\frac{1}{2}\)
报告期期初基金份额总额	45, 138, 513. 00
报告期期间基金总申购份额	28, 500, 000. 00
减:报告期期间基金总赎回份额	11, 500, 000. 00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	_
报告期期末基金份额总额	62, 138, 513. 00

#### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位: 份

	1 12.
报告期期初管理人持有的本基金份额	_
报告期期间买入/申购总份额	_
报告期期间卖出/赎回总份额	_
报告期期末管理人持有的本基金份额	_
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	_

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

#### §8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情 况	
投资者 类别	序号	持有基金份额 比例达到或者 超过 20%的时 间区间	期初份额	申购 份额	赎回 份额	持有份额	份额占比
富国上 证综指	1	2020-04-01 至 2020-06-30	30, 453	4, 500, 000. 00	4, 514, 800. 00	30, 438, 300	48. 98%

交易型		0		
开放式				
指数证				
券投资				
基金联				
接基金				

#### 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。

#### §9 备查文件目录

#### 9.1 备查文件目录

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

#### 9.2 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层

#### 9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话: 95105686、4008880688(全国统一,免长途话费)

公司网址: http://www.fullgoal.com.cn

富国基金管理有限公司 2020年07月21日