

上证综指交易型开放式指数证券投资基金

二〇二〇年中期报告

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

送出日期： 2020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 2020 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 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	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	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	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	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	33
7.1	期末基金资产组合情况	34
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42
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	42
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	42
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	43

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	43
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.12	投资组合报告附注 .....	43
§8	基金份额持有人信息 .....	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	46
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
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 .....	46
§9	开放式基金份额变动 .....	46
§10	重大事件揭示 .....	47
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	47
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4	基金投资策略的改变 .....	47
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8	其他重大事件 .....	49
§11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
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 .....	49
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
§12	备查文件目录 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上证综指交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	上证综指 ETF
场内简称	上证指数 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
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	62,138,513.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 3 月 25 日

注：根据 2020 年 7 月 10 日发布的《富国基金管理有限公司关于上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金变更基金扩位简称的公告》，本基金场内简称进行了调整。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数（上证综合指数），追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	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
风险收益特征	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场基金。同时本基金为指数型基金，跟踪上证综合指数，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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	郭明
	联系电话	021-20361818	010-66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95588
传真		021-20361616	010-66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验	北京市西城区复兴门内大

	区世纪大道 1196 号世纪汇 办公楼二座 27-30 层	街 55 号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	北京市西城区复兴门内大 街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	裴长江	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披 露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正 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(2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	12,255,723.53
本期利润	10,583,506.82
加权平均基金份额本期利润	0.2496
本期加权平均净值利润率	6.53%
本期基金份额净值增长率	2.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	68,640,133.66
期末可供分配基金份额利润	1.1046
期末基金资产净值	250,208,682.91
期末基金份额净值	4.027

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)
基金份额累计净值增长率	37.82%

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。

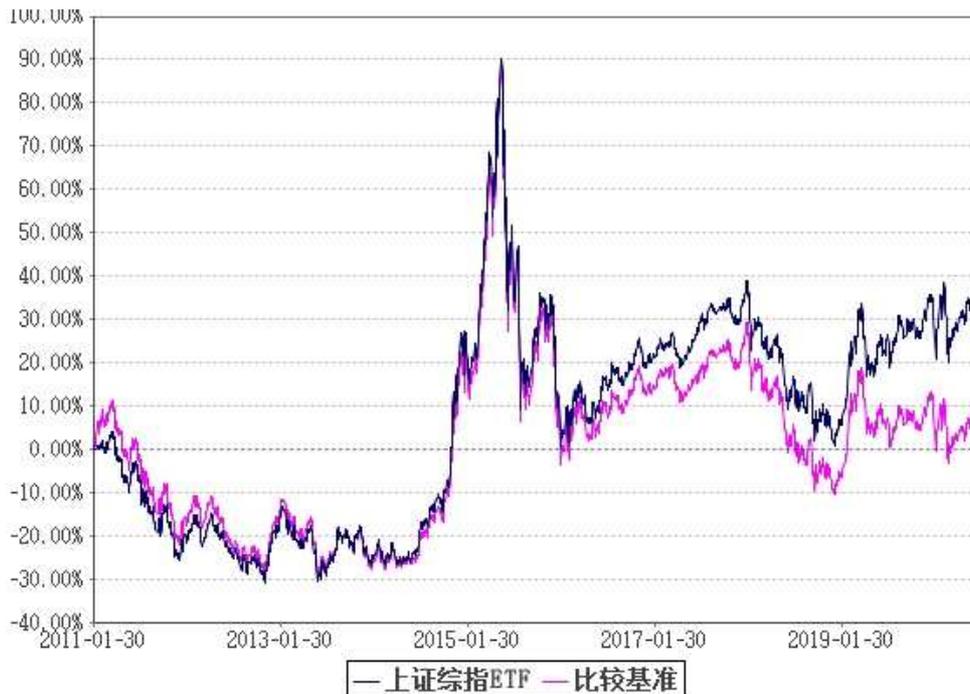
期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 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	5.53%	0.77%	4.64%	0.74%	0.89%	0.03%
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%
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 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 2020 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一百六十八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	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 4 月至 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 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券

					<p>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 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; 兼任量化投资副总监。具有基金从业资格。</p>
王保合	本基金基金经理	2011-03-03	—	14.0	<p>博士, 曾任富国基金管理有限公司研究员、富国沪深 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</p>

					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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 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 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**

2020年伊始，在央行下调存款准备金率0.5个百分点、中美正式签订第一阶段贸易协议等消息提振下，市场乐观预期提前发酵。2月末，受全球疫情加速蔓延的影响，美欧等发达国家股市均出现持续大幅下跌。进入3月，由于欧佩克谈判破裂，原油单日跌幅高达30%以上，同时海外疫情进一步扩散，全球资本市场恐慌性下跌，出现流动性枯竭的情况，多国股市因跌幅过大而迎来熔断。3月下旬，各国政府及央行加大救市力度，其中美联储开启不设上限的量化宽松，大幅缓解了市场的流动性压力，市场恐慌情绪得到有效缓解。4月初，受国内财政货币政策刺激影响，以内需为主的消费、医药等板块率先反弹。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年上半年上证综指下跌2.15%，沪深300上涨1.64%，创业板指上涨35.6%，中证500指数上涨11.33%。

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 2020 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 4.027 元;份额累计净值为 1.378 元;本报告期,本基金份额净值增长率为 2.99%,同期业绩比较基准收益率为 -2.15%

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,总体来看,由于全球流动性仍较为充裕,主要经济体仍将出台大规模经济刺激计划,经济仍有望逐步复苏,因此市场风险偏好仍有望延续提升。进入 4 季度,随着美国大选进入关键时刻,中美关系可能再度成为全球资本市场关注的焦点。从风格上看,随着经济逐步复苏,市场风格有望阶段性地切换,低估值的周期、蓝筹板块有望获得相对收益。从中期看,市场主线仍是科技、消费、医药等代表经济转型方向的行业。

#### 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

本报告期内,本基金托管人在对上证综指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,上证综指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上证综指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上证综指交易型开放式指数证券投资基金 2020 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: 上证综指交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日: 2020 年 06 月 30 日

单位: 人民币元

资 产	本期末 (2020 年 06 月 30 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
<b>资 产:</b>		
银行存款	7,397,068.02	6,483,695.64
结算备付金	72,243.16	20,459.76
存出保证金	3,027.77	11,103.68
交易性金融资产	242,933,572.65	193,063,517.98
其中: 股票投资	242,933,572.65	193,021,517.98
基金投资	—	—
债券投资	—	42,000.00
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	26,832.61	—
应收利息	684.46	1,418.69
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	250,433,428.67	199,580,195.75
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 (2020 年 06 月 30 日)</b>	<b>上年度末 (2019 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	5,001.70	1,236,427.32
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	73,583.65	88,255.19
应付托管费	14,716.73	17,651.03
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	16,551.92	13,368.90
应交税费	0.98	0.47
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	114,890.78	220,000.00
负债合计	224,745.76	1,575,702.91
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	181,568,549.25	147,965,583.73
未分配利润	68,640,133.66	50,038,909.11
所有者权益合计	250,208,682.91	198,004,492.84
负债和所有者权益总计	250,433,428.67	199,580,195.75

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 4.027 元，基金份额总额 62,138,513.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日)
<b>一、收入</b>	11,279,303.10	27,389,339.07
1. 利息收入	10,949.76	11,645.72
其中：存款利息收入	10,855.66	11,513.54
债券利息收入	94.10	132.18
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）	12,931,499.75	3,163,312.69
其中：股票投资收益	10,982,987.21	1,115,930.71
基金投资收益	—	—
债券投资收益	20,396.91	44,116.69
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	1,928,115.63	2,003,265.29
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,672,216.71	24,210,665.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	9,070.30	3,715.20
<b>减：二、费用</b>	695,796.28	628,655.15
1. 管理人报酬	402,847.31	339,311.67
2. 托管费	80,569.42	67,862.28
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	62,320.47	6,516.03
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 税金及附加	0.30	0.20
7. 其他费用	150,058.78	214,964.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	10,583,506.82	26,760,683.92
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	10,583,506.82	26,760,683.92

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (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）	147,965,583.73	50,038,909.11	198,004,492.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	10,583,506.82	10,583,506.82
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）	33,602,965.52	8,017,717.73	41,620,683.25
其中：1. 基金申购款	138,794,858.01	43,017,804.32	181,812,662.33
2. 基金赎回款	-105,191,892.49	-35,000,086.59	-140,191,979.08
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）	181,568,549.25	68,640,133.66	250,208,682.91
项目	上年度可比期间 (2019年01月01日至2019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）	115,823,616.65	2,228,690.21	118,052,306.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	26,760,683.92	26,760,683.92
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）	20,453,979.07	3,803,248.24	24,257,227.31
其中：1. 基金申购款	49,673,949.22	10,276,793.08	59,950,742.30
2. 基金赎回款	-29,219,970.15	-6,473,544.84	-35,693,514.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	136,277,595.72	32,792,622.37	169,070,218.09

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

上证综指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[2010]1379号《关于核准上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2011年1月30日正式生效，首次设立募集规模为320,363,407.00份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在10个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。

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

本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数变更的，业绩比较基准随之变更并公告。

#### **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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **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2020年6月30日的财务状况以及2020年1月1日至2020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。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。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（2020 年 06 月 30 日）
活期存款	7,397,068.02
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	7,397,068.02

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（2020 年 06 月 30 日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	236,182,184.66	242,933,572.65	6,751,387.99
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	236,182,184.66	242,933,572.65	6,751,387.99

##### 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（2020年06月30日）
应收活期存款利息	650.56
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	32.50
应收债券利息	—
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	1.40
合计	684.46

#### 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（2020年06月30日）
交易所市场应付交易费用	16,551.92
银行间市场应付交易费用	—
合计	16,551.92

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2020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	19,890.78
应付指数使用费	35,000.00
合计	114,890.78

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	50,638,513.00	147,965,583.73

本期申购	47,500,000.00	138,794,858.01
本期赎回（以“-”号填列）	-36,000,000.00	-105,191,892.49
本期末	62,138,513.00	181,568,549.25

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	47,613,428.27	2,425,480.84	50,038,909.11
本期利润	12,255,723.53	-1,672,216.71	10,583,506.82
本期基金份额交易产生的变动数	16,418,425.06	-8,400,707.33	8,017,717.73
其中：基金申购款	54,273,819.17	-11,256,014.85	43,017,804.32
基金赎回款	-37,855,394.11	2,855,307.52	-35,000,086.59
本期已分配利润	—	—	—
本期末	76,287,576.86	-7,647,443.20	68,640,133.66

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
活期存款利息收入	10,594.32
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	214.73
其他	46.61
合计	10,855.66

#### 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（2020年01月01日至2020年06月30日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,082,782.78
股票投资收益——赎回差价收入	2,900,204.43
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	10,982,987.21

#### 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（2020年01月01日至2020年06月30日）
卖出股票成交总额	16,101,575.66
减：卖出股票成本总额	8,018,792.88
买卖股票差价收入	8,082,782.78

#### 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（2020年01月01日至2020年06月30日）
赎回基金份额对价总额	140,191,979.08
减：现金支付赎回款总额	246,710.08
减：赎回股票成本总额	137,045,064.57
赎回差价收入	2,900,204.43

#### 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（2020年01月01日至2020年06月30日）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	261,495.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	241,000.00
减：应收利息总额	98.49
买卖债券差价收入	20,396.91

##### 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（2020年01月01日至2020年06月30日）
股票投资产生的股利收益	1,928,115.63
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	1,928,115.63

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
1. 交易性金融资产	-1,672,216.71
股票投资	-1,672,216.71
债券投资	—
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	-1,672,216.71

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
基金赎回费收入	—
替代损益	9,070.30
合计	9,070.30

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
交易所市场交易费用	62,320.47
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	62,320.47

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
审计费用	19,890.78
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	168.00
指数使用费	70,000.00
合计	150,058.78

#### 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、基金销售机构
富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

##### 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

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股票交易。

###### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 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（2020年01月01日至 2020年06月30日）	上年度可比期间（2019年01月 01日至2019年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	402,847.31	339,311.67
其中：支付销售机构的客户维护费	2,061.38	58,609.38

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

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（2020年01月01日至 2020年06月30日）	上年度可比期间（2019年01月 01日至2019年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	80,569.42	67,862.28

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固

定期限费率从事证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

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固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末（2020年06月30日）		上年度末（2019年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	30,438,300.00	48.98	25,453,100.00	50.26

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）		上年度可比期间（2019年01月01日至2019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
中国工商银行股份有限公司	7,397,068.02	10,594.32	5,588,556.34	11,473.87

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 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：本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2020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
688086	紫晶存储	2020-02-19	2020-08-26	新股限售	21.49	64.54	3,920	84,240.80	252,996.80	—
688096	京源环保	2020-03-31	2020-10-09	新股限售	14.34	21.42	4,485	64,314.90	96,068.70	—
688100	威胜信息	2020-01-09	2020-07-21	新股限售	13.78	25.92	9,418	129,780.04	244,114.56	—
688186	广大特材	2020-01-23	2020-08-11	新股限售	17.16	34.15	5,508	94,517.28	188,098.20	—
688222	成都先导	2020-04-03	2020-10-16	新股限售	20.52	43.70	4,867	99,870.84	212,687.90	—
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股认购	16.42	16.42	4,385	72,001.70	72,001.70	—
688396	华润微	2020-02-14	2020-08-27	新股限售	12.80	41.45	10,546	134,988.80	437,131.70	—
688520	神州细胞	2020-06-11	2020-12-22	新股限售	25.64	58.82	3,842	98,508.88	225,986.44	—
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新股认购	11.33	11.33	5,731	64,932.23	64,932.23	—
688558	国盛智科	2020-06-19	2020-12-30	新股限售	17.37	35.26	6,705	116,465.85	236,418.30	—
688568	中科星图	2020-06-30	2021-01-08	新股限售	16.21	16.21	5,027	81,487.67	81,487.67	—
688600	皖仪科技	2020-06-23	2021-01-04	新股限售	15.50	15.50	4,010	62,155.00	62,155.00	—

###### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

###### 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 2020 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 2020 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。

###### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常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（2020年06月30日）	上年度末（2019年12月31日）
AAA	—	32,000.00
AAA以下	—	10,000.00
未评级	—	—
合计	—	42,000.00

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的信用债。

#### 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均无重大流动性风险。

#### 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（2020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	7,397,068.02	—	—	—	—	—	7,397,068.02
结算备付金	72,243.16	—	—	—	—	—	72,243.16
存出保证金	3,027.77	—	—	—	—	—	3,027.77
交易性金融资产	—	—	—	—	—	242,933,572.65	242,933,572.65
应收证券清算款	—	—	—	—	—	26,832.61	26,832.61
应收利息	—	—	—	—	—	684.46	684.46
资产总计	7,472,338.95	—	—	—	—	242,961,089.72	250,433,428.67
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	5,001.70	5,001.70
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	73,583.65	73,583.65
应付托管费	—	—	—	—	—	14,716.73	14,716.73
应付交易费用	—	—	—	—	—	16,551.92	16,551.92
应付税费	—	—	—	—	—	0.98	0.98
其他负债	—	—	—	—	—	114,890.78	114,890.78
负债总计	—	—	—	—	—	224,745.76	224,745.76
利率敏感度缺口	7,472,338.95	—	—	—	—	242,736,343.96	250,208,682.91
上年度末（2019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	6,483,695.64	—	—	—	—	—	6,483,695.64

结算备付金	20,459.76	—	—	—	—	—	20,459.76
存出保证金	11,103.68	—	—	—	—	—	11,103.68
交易性金融资产	—	—	42,000.00	—	—	193,021,517.98	193,063,517.98
应收利息	—	—	—	—	—	1,418.69	1,418.69
资产总计	6,515,259.08	—	42,000.00	—	—	193,022,936.67	199,580,195.75
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	1,236,427.32	1,236,427.32
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	88,255.19	88,255.19
应付托管费	—	—	—	—	—	17,651.03	17,651.03
应付交易费用	—	—	—	—	—	13,368.90	13,368.90
应付税费	—	—	—	—	—	0.47	0.47
其他负债	—	—	—	—	—	220,000.00	220,000.00
负债总计	—	—	—	—	—	1,575,702.91	1,575,702.91
利率敏感度缺口	6,515,259.08	—	42,000.00	—	—	191,447,233.76	198,004,492.84

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券资产（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

本基金投资组合中投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在10个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。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（2020年06月30日）		上年度末（2019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	242,933,572.65	97.09	193,021,517.98	97.48
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	42,000.00	0.02
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	242,933,572.65	97.09	193,063,517.98	97.50

##### 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（2020年06月 30日）	上年度末（2019年12月 31日）
	1. 业绩比较基准增加1%	2,425,789.59	1,896,548.63
	2. 业绩比较基准减少1%	-2,425,789.59	-1,896,548.63

#### 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2020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240,759,544.45元，属于第二层次的余额为人民币218,421.60元，属于第三层次余额为人民币1,955,657.60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2,159,707.45元，本期变动人民币-204,049.85元，本期末人民币1,955,657.60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	242,933,572.65	97.01
	其中：股票	242,933,572.65	97.01
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	7,469,311.18	2.98
8	其他各项资产	30,544.84	0.01
9	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 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

## 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	—	—
B	采矿业	—	—
C	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
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	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	—	—
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	2,240,806.92	0.90

### 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	1,464,888.00	0.59
B	采矿业	18,238,920.86	7.29
C	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
E	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
H	住宿和餐饮业	730,382.40	0.29
I	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	—	—
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	1,448,923.00	0.58
S	综合	2,226,960.24	0.89
	合计	240,692,816.73	96.20

### 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	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
11	600588	用友网络	76,568	3,376,648.80	1.35
12	600900	长江电力	170,795	3,234,857.30	1.29
13	600000	浦发银行	286,779	3,034,121.82	1.21
14	601088	中国神华	203,521	2,922,561.56	1.17
15	600585	海螺水泥	54,951	2,907,457.41	1.16
16	601166	兴业银行	179,470	2,832,036.60	1.13
17	603393	新天然气	73,732	2,717,024.20	1.09
18	600030	中信证券	106,512	2,568,004.32	1.03
19	601012	隆基股份	60,870	2,479,235.10	0.99
20	603060	国检集团	116,884	2,336,511.16	0.93
21	600887	伊利股份	73,448	2,286,436.24	0.91
22	600016	民生银行	391,736	2,221,143.12	0.89
23	601998	中信银行	408,860	2,105,629.00	0.84
24	600779	水井坊	32,926	2,055,240.92	0.82
25	600305	恒顺醋业	110,474	2,049,292.70	0.82
26	600104	上汽集团	119,400	2,028,606.00	0.81
27	601668	中国建筑	419,420	2,000,633.40	0.80
28	601818	光大银行	550,200	1,969,716.00	0.79
29	600309	万华化学	38,049	1,902,069.51	0.76
30	601328	交通银行	363,920	1,866,909.60	0.75
31	601009	南京银行	253,416	1,857,539.28	0.74
32	600048	保利地产	120,247	1,777,250.66	0.71
33	600703	三安光电	68,640	1,716,000.00	0.69
34	601601	中国太保	61,800	1,684,050.00	0.67
35	603288	海天味业	13,076	1,626,654.40	0.65
36	600624	复旦复华	159,976	1,598,160.24	0.64
37	600459	贵研铂业	51,385	1,531,786.85	0.61
38	600346	恒力石化	109,020	1,526,280.00	0.61
39	601939	建设银行	239,900	1,513,769.00	0.61
40	600999	招商证券	66,850	1,467,357.50	0.59
41	600547	山东黄金	38,281	1,401,850.22	0.56
42	600862	中航高科	82,700	1,399,284.00	0.56
43	601933	永辉超市	142,006	1,332,016.28	0.53
44	600690	海尔智家	74,600	1,320,420.00	0.53

45	601169	北京银行	246,154	1,206,154.60	0.48
46	600015	华夏银行	194,587	1,190,872.44	0.48
47	600360	华微电子	136,300	1,177,632.00	0.47
48	600143	金发科技	87,106	1,147,186.02	0.46
49	601688	华泰证券	60,700	1,141,160.00	0.46
50	601155	新城控股	36,470	1,139,322.80	0.46
51	600988	赤峰黄金	94,200	1,120,980.00	0.45
52	600606	绿地控股	180,800	1,117,344.00	0.45
53	603859	能科股份	32,700	1,117,032.00	0.45
54	600850	华东电脑	44,617	1,093,562.67	0.44
55	600867	通化东宝	62,433	1,088,207.19	0.43
56	601336	新华保险	24,500	1,084,860.00	0.43
57	603528	多伦科技	101,100	1,078,737.00	0.43
58	600118	中国卫星	34,688	1,069,431.04	0.43
59	601231	环旭电子	47,882	1,045,742.88	0.42
60	600498	烽火通信	35,500	1,026,305.00	0.41
61	600584	长电科技	32,500	1,016,275.00	0.41
62	600834	申通地铁	81,300	1,016,250.00	0.41
63	600383	金地集团	73,672	1,009,306.40	0.40
64	600109	国金证券	87,500	998,375.00	0.40
65	600741	华域汽车	47,600	989,604.00	0.40
66	601766	中国中车	175,264	976,220.48	0.39
67	601800	中国交建	130,169	955,440.46	0.38
68	601006	大秦铁路	132,734	934,447.36	0.37
69	600009	上海机场	12,900	929,703.00	0.37
70	600975	新五丰	100,000	922,000.00	0.37
71	601390	中国中铁	180,500	906,110.00	0.36
72	601186	中国铁建	108,100	905,878.00	0.36
73	601899	紫金矿业	204,500	899,800.00	0.36
74	600233	圆通速递	61,500	895,440.00	0.36
75	600350	山东高速	143,100	878,634.00	0.35
76	600018	上港集团	206,000	865,200.00	0.35
77	600340	华夏幸福	37,734	862,599.24	0.34
78	601111	中国国航	130,100	859,961.00	0.34
79	600020	中原高速	241,461	854,771.94	0.34
80	601901	方正证券	120,500	853,140.00	0.34
81	601238	广汽集团	93,040	837,360.00	0.33
82	601377	兴业证券	121,700	833,645.00	0.33
83	601229	上海银行	100,012	830,099.60	0.33
84	601727	上海电气	155,100	781,704.00	0.31
85	603599	广信股份	46,300	781,081.00	0.31

86	600271	航天信息	48,020	779,844.80	0.31
87	600674	川投能源	83,834	777,141.18	0.31
88	601066	中信建投	19,700	775,786.00	0.31
89	600061	国投资本	60,900	775,257.00	0.31
90	600487	亨通光电	47,220	774,880.20	0.31
91	600116	三峡水利	86,900	772,541.00	0.31
92	600728	佳都科技	84,620	770,888.20	0.31
93	600050	中国联通	158,600	767,624.00	0.31
94	600332	白云山	23,500	759,755.00	0.30
95	600352	浙江龙盛	58,100	743,099.00	0.30
96	600188	兖州煤业	83,901	734,972.76	0.29
97	600258	首旅酒店	47,520	730,382.40	0.29
98	601618	中国中冶	286,184	718,321.84	0.29
99	600206	有研新材	50,600	706,882.00	0.28
100	601179	中国西电	145,700	705,188.00	0.28
101	600919	江苏银行	123,300	699,111.00	0.28
102	600085	同仁堂	25,600	694,272.00	0.28
103	601877	正泰电器	26,282	692,530.70	0.28
104	601555	东吴证券	84,030	685,684.80	0.27
105	601018	宁波港	190,700	680,799.00	0.27
106	600998	九州通	36,500	679,630.00	0.27
107	603993	洛阳钼业	184,100	675,647.00	0.27
108	600406	国电南瑞	33,260	673,515.00	0.27
109	603328	依顿电子	63,700	664,391.00	0.27
110	601607	上海医药	36,062	662,819.56	0.26
111	600803	新奥股份	62,238	643,540.92	0.26
112	601128	常熟银行	85,400	641,354.00	0.26
113	600273	嘉化能源	72,200	631,028.00	0.25
114	600770	综艺股份	131,000	628,800.00	0.25
115	600483	福能股份	86,446	627,597.96	0.25
116	600236	桂冠电力	147,476	625,298.24	0.25
117	603789	星光农机	45,820	612,613.40	0.24
118	600007	中国国贸	45,842	611,073.86	0.24
119	601211	国泰君安	35,400	611,004.00	0.24
120	600031	三一重工	32,500	609,700.00	0.24
121	600183	生益科技	20,800	608,816.00	0.24
122	603159	上海亚虹	50,240	602,880.00	0.24
123	601678	滨化股份	141,805	601,253.20	0.24
124	603019	中科曙光	15,600	599,040.00	0.24
125	600909	华安证券	86,500	590,795.00	0.24
126	600326	西藏天路	81,790	582,344.80	0.23

127	600838	上海九百	72,700	580,873.00	0.23
128	600663	陆家嘴	51,463	576,900.23	0.23
129	603969	银龙股份	130,634	568,257.90	0.23
130	600019	宝钢股份	124,600	568,176.00	0.23
131	600279	重庆港九	155,500	559,800.00	0.22
132	600979	广安爱众	179,400	550,758.00	0.22
133	600108	亚盛集团	171,800	542,888.00	0.22
134	600006	东风汽车	133,400	537,602.00	0.21
135	603901	永创智能	75,500	537,560.00	0.21
136	601016	节能风电	252,300	534,876.00	0.21
137	600489	中金黄金	57,693	527,314.02	0.21
138	601811	新华文轩	51,500	523,755.00	0.21
139	603003	龙宇燃油	61,400	522,514.00	0.21
140	600893	航发动力	22,100	518,908.00	0.21
141	603559	中通国脉	23,000	513,360.00	0.21
142	600516	方大炭素	81,248	510,237.44	0.20
143	601669	中国电建	146,200	505,852.00	0.20
144	600557	康缘药业	34,496	480,184.32	0.19
145	601890	亚星锚链	88,300	477,703.00	0.19
146	600688	上海石化	135,455	471,383.40	0.19
147	600863	内蒙华电	190,250	468,015.00	0.19
148	601633	长城汽车	60,237	465,029.64	0.19
149	601992	金隅集团	149,900	458,694.00	0.18
150	600011	华能国际	108,405	457,469.10	0.18
151	601158	重庆水务	91,660	457,383.40	0.18
152	600196	复星医药	13,500	456,975.00	0.18
153	600066	宇通客车	37,436	456,719.20	0.18
154	600575	淮河能源	217,000	453,530.00	0.18
155	603878	武进不锈	60,984	450,061.92	0.18
156	601368	绿城水务	83,100	447,078.00	0.18
157	603058	永吉股份	47,000	443,680.00	0.18
158	600111	北方稀土	47,250	440,370.00	0.18
159	600089	特变电工	63,423	429,373.71	0.17
160	600369	西南证券	92,600	425,034.00	0.17
161	601168	西部矿业	73,200	424,560.00	0.17
162	600490	鹏欣资源	134,000	422,100.00	0.17
163	600820	隧道股份	72,800	411,320.00	0.16
164	600987	航民股份	76,313	408,274.55	0.16
165	601375	中原证券	86,300	405,610.00	0.16
166	601098	中南传媒	38,200	404,156.00	0.16
167	600435	北方导航	53,300	402,948.00	0.16

168	601579	会稽山	48,200	401,024.00	0.16
169	600337	美克家居	90,160	398,507.20	0.16
170	600535	天士力	24,353	395,005.66	0.16
171	600566	济川药业	15,361	391,091.06	0.16
172	600503	华丽家族	88,200	388,962.00	0.16
173	601117	中国化学	70,300	385,244.00	0.15
174	600398	海澜之家	65,700	382,374.00	0.15
175	600220	江苏阳光	136,600	379,748.00	0.15
176	601588	北辰实业	134,700	378,507.00	0.15
177	600372	中航电子	28,000	372,960.00	0.15
178	601515	东风股份	60,400	369,044.00	0.15
179	600008	首创股份	121,900	366,919.00	0.15
180	600697	欧亚集团	23,600	366,272.00	0.15
181	600814	杭州解百	64,600	365,636.00	0.15
182	600758	辽宁能源	109,400	364,302.00	0.15
183	601069	西部黄金	25,100	347,133.00	0.14
184	600616	金枫酒业	62,600	346,804.00	0.14
185	603968	醋化股份	23,900	345,355.00	0.14
186	600664	哈药股份	109,052	335,880.16	0.13
187	600583	海油工程	73,544	334,625.20	0.13
188	601801	皖新传媒	59,900	333,044.00	0.13
189	600062	华润双鹤	25,017	330,724.74	0.13
190	600208	新湖中宝	110,340	328,813.20	0.13
191	600798	宁波海运	110,200	321,784.00	0.13
192	600230	沧州大化	36,260	306,397.00	0.12
193	600960	渤海汽车	98,840	305,415.60	0.12
194	600075	新疆天业	62,020	300,797.00	0.12
195	601319	中国人保	44,000	283,360.00	0.11
196	600589	广东榕泰	65,600	280,768.00	0.11
197	600682	南京新百	27,100	274,794.00	0.11
198	601138	工业富联	17,500	265,125.00	0.11
199	601212	白银有色	96,800	246,840.00	0.10
200	600715	文投控股	70,400	187,968.00	0.08

**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	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
6	688222	成都先导	4,867	212,687.90	0.09
7	688186	广大特材	5,508	188,098.20	0.08
8	688096	京源环保	4,485	96,068.70	0.04
9	688568	中科星图	5,027	81,487.67	0.03
10	688377	迪威尔	4,385	72,001.70	0.03
11	688528	秦川物联	5,731	64,932.23	0.03
12	688600	皖仪科技	4,010	62,155.00	0.02
13	603087	甘李药业	538	53,961.40	0.02
14	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	889,690.00	0.45
2	600036	招商银行	758,178.60	0.38
3	600009	上海机场	610,993.00	0.31
4	600584	长电科技	595,774.00	0.30
5	601288	农业银行	503,413.00	0.25
6	603019	中科曙光	442,690.00	0.22
7	600183	生益科技	429,438.00	0.22
8	601988	中国银行	419,285.00	0.21
9	600031	三一重工	417,752.00	0.21
10	601066	中信建投	399,735.48	0.20
11	688266	泽璟制药	346,850.24	0.18
12	600196	复星医药	315,214.00	0.16
13	601318	中国平安	300,993.00	0.15
14	600028	中国石化	274,132.00	0.14
15	601628	中国人寿	245,850.00	0.12
16	688169	石头科技	243,194.64	0.12
17	600703	三安光电	217,968.00	0.11
18	601857	中国石油	205,498.00	0.10
19	601088	中国神华	184,021.00	0.09
20	601336	新华保险	181,518.00	0.09

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	688111	金山办公	3,709,144.29	1.87
2	688266	泽璟制药	889,072.54	0.45
3	601857	中国石油	573,760.00	0.29
4	600537	亿晶光电	573,315.60	0.29
5	603628	清源股份	472,844.00	0.24
6	600483	福能股份	468,939.00	0.24
7	601628	中国人寿	432,804.00	0.22
8	688169	石头科技	408,135.00	0.21
9	688298	东方生物	389,571.00	0.20
10	688399	硕世生物	388,962.54	0.20
11	688360	德马科技	346,392.00	0.17
12	688208	道通科技	342,977.86	0.17
13	688004	博汇科技	295,500.00	0.15
14	688398	赛特新材	295,386.00	0.15
15	688200	华峰测控	286,440.00	0.14
16	688318	财富趋势	286,233.00	0.14
17	688518	联赢激光	283,929.50	0.14
18	688106	金宏气体	282,662.40	0.14
19	688365	光云科技	277,170.76	0.14
20	688080	映翰通	276,720.37	0.14

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	17,024,620.83
卖出股票收入（成交）总额	16,101,575.66

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

## 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。

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。

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。

#### 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	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

#### 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

#### 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(%)
4,785	12,986.11	32,052,945.00	51.58	30,085,568.00	48.42

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行股份有限公司—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“持有份额”和“占总份额比例”数据。

## 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	中国工商银行股份有限公司－富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	30,438,300	48.98
2	肖雅芳	464,000	0.75
3	中国国际金融股份有限公司	437,435	0.70
4	招商证券股份有限公司	339,220	0.55
5	沈其芬	318,100	0.51
6	马洁	312,300	0.50
7	中国建设银行股份有限公司－富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）	305,700	0.49
8	邓许	299,500	0.48
9	李雯	295,400	0.48
10	袁凤翔	270,000	0.43

## 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(2011年01月30日)基金份额总额	320,363,407.00
报告期期初基金份额总额	50,638,513.00
本报告期基金总申购份额	47,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	36,000,000.00

---

本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期末基金份额总额	62,138,513.00

## § 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

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。  
本报告期本基金管理人无重大人事变动。

### 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 (%)	
国元证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
申万宏源	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
银河证券	2	29,062,087.74	100.00	261,495.40	100.00	—	—	—	—	26,483.69	100.00	

注：我公司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：国元证券（46631）。

## 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提醒投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	规定披露媒介	2020年01月11日
2	富国基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下公募基金基金合同的公告	规定披露媒介	2020年01月20日
3	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	规定披露媒介	2020年02月03日
4	富国基金管理有限公司关于旗下部分上市基金增加扩位证券简称的公告	规定披露媒介	2020年03月16日
5	富国基金管理有限公司关于旗下部分ETF调整指数许可使用费和根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订基金合同等法律文件的公告	规定披露媒介	2020年03月25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
富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2020-01-01至 2020-06-30	25,453,100.00	12,500,000.00	7,514,800.00	30,438,300.00	48.98%

### 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

本报告期，根据中证指数有限公司通知，基金管理人对本基金的指数许可使用费进行调整，调整后的收费下限自 2020 年第一季度起适用。具体可参见基金管理人于 2020 年 3 月 25 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 调整指数许可使用费和根据〈公开募集证券投资基金信息披露管理办法〉修订基金合同等法律文件的公告》及本基金更新的招募说明书。

### § 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上证综指交易型开放式指数证券投资基金的文件	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。 咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费） 公司网址： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a>
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		