

富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

二 0 二 0 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： 中国农业银行股份有限公司

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。基金托管人中国农业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.....	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.....	15
6.4	报表附注.....	17
§7	投资组合报告.....	35
7.1	期末基金资产组合情况.....	35
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	37
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	48
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	48
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	48

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12	投资组合报告附注	49
§8	基金份额持有人信息	50
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2	期末上市基金前十名持有人	50
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§9	开放式基金份额变动	51
§10	重大事件揭示	51
10.1	基金份额持有人大会决议	51
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4	基金投资策略的改变	51
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8	其他重大事件	54
§11	影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
§12	备查文件目录	54

§ 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	96,208,851.72 份
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”，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。 本基金主要策略为复制目标指数，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。一方面将严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离目标指数，另一方面在指数跟踪的同时力求超越指数。 富国研发的定量投资模型借鉴国际一流定量分析的应用经验，利用多因子 alpha 模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。
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	贺倩

	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	010-68121816
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	周慕冰

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(2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	15,688,387.18
本期利润	22,809,348.05
加权平均基金份额本期利润	0.2933
本期加权平均净值利润率	22.08%
本期基金份额净值增长率	25.35%
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	40,362,033.82
期末可供分配基金份额利润	0.4195
期末基金资产净值	144,128,251.77
期末基金份额净值	1.4981
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	49.81%

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	10.45%	0.85%	8.21%	0.85%	2.24%	0.00%
过去三个月	20.33%	1.09%	15.59%	1.17%	4.74%	-0.08%
过去六个月	25.35%	1.71%	12.92%	1.79%	12.43%	-0.08%
过去一年	41.72%	1.41%	17.93%	1.48%	23.79%	-0.07%
自基金合同生效日起至今	49.81%	1.40%	1.72%	1.59%	48.09%	-0.19%

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（benchmarkt）按下列公式计算：

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

其中，t=1, 2, 3, ..., T，T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

$$\text{benchmarkT} = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})] - 1$$

其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})$ 表示 t 日至 T 日的 $(1 + \text{benchmarkt})$ 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2020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	2018-05-31	—	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。
徐幼华	本 基 金 基 金 经 理	2018-05-31	—	15.0	硕士, 曾任上海京华创业投资有限公司投资经理助理; 2006 年 7 月至 2008 年 12 月任富国基金管理有限公司金融工程部数量研究员, 2009 年 1 月至 2011 年 5 月任富国基金管理有限公司另类投资部数量研究员、基金经理助理, 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; 兼任量化投资部副总经理。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 2 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

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，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 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.4981 元；份额累计净值为 1.4981 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 25.35%，同期业绩比较基准收益率为 12.92%

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

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《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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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《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：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)
资 产：		
银行存款	7,335,405.86	4,991,768.53
结算备付金	204,943.52	120,666.05

存出保证金	18,237.89	44,648.54
交易性金融资产	134,590,347.25	71,831,597.27
其中：股票投资	132,499,533.25	71,779,597.27
基金投资	—	—
债券投资	2,090,814.00	52,000.00
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	103,212.67	—
应收利息	24,078.65	1,119.20
应收股利	—	—
应收申购款	3,209,232.59	290,960.09
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	145,485,458.43	77,280,759.68
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	(2020年06月30日)	(2019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	—	—
应付赎回款	982,942.56	1,274,034.10
应付管理人报酬	101,639.54	66,667.29
应付托管费	15,245.94	10,000.09
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	121,538.72	49,756.99
应交税费	0.59	0.10
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	135,839.31	204,621.21
负债合计	1,357,206.66	1,605,079.78
所有者权益：		
实收基金	96,208,851.72	63,323,227.96
未分配利润	47,919,400.05	12,352,451.94
所有者权益合计	144,128,251.77	75,675,679.90
负债和所有者权益总计	145,485,458.43	77,280,759.68

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4981 元，基金份额总额 96,208,851.72 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：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)
一、收入	23,859,330.42	51,173,331.65
1. 利息收入	40,957.77	58,955.91
其中：存款利息收入	38,334.90	48,757.16
债券利息收入	2,622.87	6,053.54
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	4,145.21
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	16,545,519.98	21,896,218.28
其中：股票投资收益	15,581,923.09	21,064,493.39
基金投资收益	—	—
债券投资收益	60,044.84	-8,928.87
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	903,552.05	840,653.76
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7,120,960.87	28,888,770.26
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	151,891.80	329,387.20
减：二、费用	1,049,982.37	1,509,744.97
1. 管理人报酬	513,800.10	692,354.84
2. 托管费	77,070.07	103,853.22
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	275,248.96	497,509.16
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 税金及附加	0.34	0.30
7. 其他费用	183,862.90	216,027.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	22,809,348.05	49,663,586.68
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	22,809,348.05	49,663,586.68

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：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）	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
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）	218,818,493.83	-33,833,424.50	184,985,069.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	49,663,586.68	49,663,586.68
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）	-132,331,918.18	-10,892,252.35	-143,224,170.53
其中：1. 基金申购款	72,916,994.49	6,316,725.67	79,233,720.16
2. 基金赎回款	-205,248,912.67	-17,208,978.02	-222,457,890.69
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）	86,486,575.65	4,937,909.83	91,424,485.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈 戈

林志松

徐慧

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国中证 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）、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。

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作为增值税纳税人；

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（2020年06月30日）
活期存款	7,335,405.86
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	7,335,405.86

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		118,551,288.40	132,499,533.25	13,948,244.85
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	2,080,700.00	2,090,814.00	10,114.00
	银行间市场	—	—	—
	合计	2,080,700.00	2,090,814.00	10,114.00
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		120,631,988.40	134,590,347.25	13,958,358.85

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	2,631.88
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	83.07
应收债券利息	21,356.32
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	7.38
合计	24,078.65

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	121,538.72
银行间市场应付交易费用	—
合计	121,538.72

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	3,571.63
应付证券出借违约金	—
预提信息披露费	40,000.00
预提审计费	12,432.42
应付指数使用费	50,000.00
预提上市年费	29,835.26
合计	135,839.31

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	63,323,227.96	63,323,227.96
本期申购	101,191,885.49	101,191,885.49
本期赎回（以“-”号填列）	-68,306,261.73	-68,306,261.73
本期末	96,208,851.72	96,208,851.72

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	14,146,385.06	-1,793,933.12	12,352,451.94
本期利润	15,688,387.18	7,120,960.87	22,809,348.05
本期基金份额交易产生的变	10,527,261.58	2,230,338.48	12,757,600.06

动数			
其中：基金申购款	30,086,942.77	3,854,169.23	33,941,112.00
基金赎回款	-19,559,681.19	-1,623,830.75	-21,183,511.94
本期已分配利润	—	—	—
本期末	40,362,033.82	7,557,366.23	47,919,400.05

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	35,691.56
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	1,038.23
其他	1,605.11
合计	38,334.90

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
卖出股票成交总额	76,678,364.07
减：卖出股票成本总额	61,096,440.98
买卖股票差价收入	15,581,923.09

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	2,449,373.99
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,355,910.00
减：应收利息总额	33,419.15
买卖债券差价收入	60,044.84

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	903,552.05
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	903,552.05

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	7,120,960.87
股票投资	7,110,846.87
债券投资	10,114.00
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	7,120,960.87

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	150,422.43
转换费收入	1,469.37
合计	151,891.80

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	275,248.96
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	275,248.96

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	12,432.42
信息披露费	40,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	1,595.22
指数使用费	100,000.00
上市费	29,835.26
合计	183,862.90

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
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

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(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)	
	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	36,916,309.39	19.58	6,701,690.66	2.32
申万宏源	25,922,541.43	13.75	14,793,877.47	5.13

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(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)	
	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	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(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
关联方名称	上年度可比期间(2019年01月01日至2019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	13,477.67	5.10	7,025.66	8.87
海通证券	6,107.87	2.31	778.97	0.98

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(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	513,800.10	692,354.84

其中：支付销售机构的客户维护费	153,893.84	221,812.19
-----------------	------------	------------

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(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	77,070.07	103,853.22

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 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

份额单位：份

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)
----	---	--

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	—	—
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	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	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。

6.4.10.5.2 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

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。

6.4.10.6 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
中国农业银行股份有限公司	7,335,405.86	35,691.56	4,860,572.74	45,498.18

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: 本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

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: 本基金本报告期末未进行利润分配。

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
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股认购	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	—
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股认购	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	—
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股认购	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	—
688081	兴图新科	2019-12-26	2020-07-06	新股限售	28.21	42.01	1,419	40,029.99	59,612.19	—
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股认购	16.42	16.42	3,411	56,008.62	56,008.62	—
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新股认购	11.33	11.33	4,429	50,180.57	50,180.57	—
688558	国盛智科	2020-06-19	2020-12-30	新股限售	17.37	35.26	5,177	89,924.49	182,541.02	—
688568	中科星图	2020-06-30	2021-01-08	新股限售	16.21	16.21	3,857	62,521.97	62,521.97	—
688600	皖仪科技	2020-06-23	2021-01-04	新股限售	15.50	15.50	3,144	48,732.00	48,732.00	—

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
113585	寿仙转债	2020-06-09	2020-07-07	认购新发 证券	100.00	100.00	320	32,000.00	32,000.00	—

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
000662	天夏智慧	2020-06-30	重大事项停牌	2.48	2020-07-01	2.36	19,600	51,749.00	48,608.00	—
600090	同济堂	2020-06-30	重大事项停牌	2.90	2020-07-01	2.76	99,600	439,277.00	288,840.00	—
600242	中昌数据	2020-06-30	重大事项停牌	6.35	2020-07-01	6.03	46,500	351,199.00	295,275.00	—

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 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	—	—
AAA 以下	89,814.00	52,000.00
未评级	—	—
合计	89,814.00	52,000.00

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	7,335,405.86	—	—	—	—	—	7,335,405.86
结算备付金	204,943.52	—	—	—	—	—	204,943.52
存出保证金	18,237.89	—	—	—	—	—	18,237.89
交易性金融资产	—	—	2,090,814.00	—	—	132,499,533.25	134,590,347.25
应收证券清算款	—	—	—	—	—	103,212.67	103,212.67
应收利息	—	—	—	—	—	24,078.65	24,078.65
应收申购款	93,145.10	—	—	—	—	3,116,087.49	3,209,232.59
资产总计	7,651,732.37	—	2,090,814.00	—	—	135,742,912.06	145,485,458.43
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	982,942.56	982,942.56
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	101,639.54	101,639.54
应付托管费	—	—	—	—	—	15,245.94	15,245.94
应付交易费用	—	—	—	—	—	121,538.72	121,538.72
应付税费	—	—	—	—	—	0.59	0.59
其他负债	—	—	—	—	—	135,839.31	135,839.31
负债总计	—	—	—	—	—	1,357,206.66	1,357,206.66
利率敏感度缺口	7,651,732.37	—	2,090,814.00	—	—	134,385,705.40	144,128,251.77
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	4,991,768.53	—	—	—	—	—	4,991,768.53
结算备付金	120,666.05	—	—	—	—	—	120,666.05
存出保证金	44,648.54	—	—	—	—	—	44,648.54
交易性金融资产	—	—	52,000.00	—	—	71,779,597.27	71,831,597.27
应收利息	—	—	—	—	—	1,119.20	1,119.20
应收申购款	120,128.09	—	—	—	—	170,832.00	290,960.09
资产总计	5,277,211.21	—	52,000.00	—	—	71,951,548.47	77,280,759.68
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	1,274,034.10	1,274,034.10
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	66,667.29	66,667.29
应付托管费	—	—	—	—	—	10,000.09	10,000.09
应付交易费用	—	—	—	—	—	49,756.99	49,756.99
应付税费	—	—	—	—	—	0.10	0.10
其他负债	—	—	—	—	—	204,621.21	204,621.21
负债总计	—	—	—	—	—	1,605,079.78	1,605,079.78
利率敏感度缺口	5,277,211.21	—	52,000.00	—	—	70,346,468.69	75,675,679.90

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。本基金上年度末未持有债券资产（不含可转债），因此上年度末市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值其他变量不变，仅利率发生变动； 2. 利率变动范围合理。		
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. 基准点利率增加 0.1%	-1,043.72	0.00
	2. 基准点利率减少 0.1%	1,043.72	0.00

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。基金的投资组合比例为：本基金的股票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	132,499,533.25	91.93	71,779,597.27	94.85

交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	2,090,814.00	1.45	52,000.00	0.07
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	134,590,347.25	93.38	71,831,597.27	94.92

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%	1,350,383.68	691,629.83
	2. 业绩比较基准减少 1%	-1,350,383.68	-691,629.83

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131,446,660.00元，属于第二层次的余额为人民币2,852,802.04元，属于第三层次余额为人民币290,885.21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 2,045,324.36 元，本期变动人民币-1,754,439.15 元，本期末人民币 290,885.21 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	132,499,533.25	91.07
	其中：股票	132,499,533.25	91.07
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	2,090,814.00	1.44
	其中：债券	2,090,814.00	1.44
	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	7,540,349.38	5.18
8	其他各项资产	3,354,761.80	2.31
9	合计	145,485,458.43	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	31,318.77	0.02
B	采矿业	30,030.00	0.02
C	制造业	14,603,381.43	10.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	995,222.32	0.69
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	987,841.60	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	1,141,264.00	0.79
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	180,855.44	0.13
J	金融业	—	—
K	房地产业	1,334,757.20	0.93
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	806,880.00	0.56
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	56,525.00	0.04
S	综合	—	—
	合计	20,168,075.76	13.99

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	144,016.00	0.10
B	采矿业	2,007,015.00	1.39
C	制造业	73,163,522.79	50.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,292,144.60	2.28
E	建筑业	954,138.00	0.66
F	批发和零售业	3,362,475.00	2.33
G	交通运输、仓储和邮政业	3,054,810.30	2.12
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,581,860.38	12.20
J	金融业	1,266,629.00	0.88

K	房地产业	1,345,057.70	0.93
L	租赁和商务服务业	20,276.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	2,851,468.52	1.98
N	水利、环境和公共设施管理业	942,126.00	0.65
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	23,209.20	0.02
Q	卫生和社会工作	237,808.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	2,081,904.00	1.44
S	综合	2,997.00	0.00
	合计	112,331,457.49	77.94

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	002214	大立科技	66,400	1,871,152.00	1.30
2	603127	昭衍新药	15,704	1,650,961.52	1.15
3	002216	三全食品	69,000	1,649,100.00	1.14
4	000672	上峰水泥	68,900	1,626,729.00	1.13
5	600459	贵研铂业	53,100	1,582,911.00	1.10
6	002531	天顺风能	260,800	1,559,584.00	1.08
7	300607	拓斯达	37,260	1,516,109.40	1.05
8	300726	宏达电子	51,300	1,426,653.00	0.99
9	300502	新易盛	22,100	1,394,952.00	0.97
10	300661	圣邦股份	4,350	1,326,967.50	0.92
11	000507	珠海港	243,200	1,274,368.00	0.88
12	002023	海特高新	82,700	1,271,099.00	0.88
13	002063	远光软件	99,800	1,260,474.00	0.87
14	300066	三川智慧	255,300	1,256,076.00	0.87
15	603218	日月股份	68,600	1,255,380.00	0.87
16	002697	红旗连锁	114,800	1,253,616.00	0.87
17	603606	东方电缆	85,000	1,235,900.00	0.86
18	300397	天和防务	49,900	1,218,059.00	0.85
19	603313	梦百合	51,460	1,210,853.80	0.84
20	300676	华大基因	7,700	1,200,507.00	0.83
21	600742	一汽富维	145,470	1,195,763.40	0.83
22	600308	华泰股份	259,900	1,195,540.00	0.83
23	601588	北辰实业	422,200	1,186,382.00	0.82
24	002928	华夏航空	77,600	1,167,880.00	0.81
25	300659	中孚信息	19,000	1,140,380.00	0.79
26	600720	祁连山	68,000	1,105,000.00	0.77

27	603609	禾丰牧业	73,500	1,095,150.00	0.76
28	600063	皖维高新	324,100	1,056,566.00	0.73
29	300724	捷佳伟创	11,800	1,044,654.00	0.72
30	601677	明泰铝业	119,700	1,038,996.00	0.72
31	600458	时代新材	160,300	1,038,744.00	0.72
32	603596	伯特利	29,400	1,034,880.00	0.72
33	300226	上海钢联	13,100	1,029,660.00	0.71
34	300638	广和通	17,100	1,027,710.00	0.71
35	601163	三角轮胎	76,300	1,010,212.00	0.70
36	002605	姚记科技	26,500	1,007,000.00	0.70
37	603533	掌阅科技	26,000	991,380.00	0.69
38	603980	吉华集团	137,400	957,678.00	0.66
39	603345	安井食品	8,100	955,800.00	0.66
40	300770	新媒股份	4,200	939,372.00	0.65
41	600681	百川能源	180,120	922,214.40	0.64
42	002312	三泰控股	200,400	911,820.00	0.63
43	002100	天康生物	56,600	911,260.00	0.63
44	002562	兄弟科技	171,300	899,325.00	0.62
45	603603	博天环境	130,200	898,380.00	0.62
46	600971	恒源煤电	196,300	897,091.00	0.62
47	300248	新开普	71,200	880,032.00	0.61
48	600995	文山电力	116,800	878,336.00	0.61
49	300363	博腾股份	24,700	853,632.00	0.59
50	600986	科达股份	174,600	843,318.00	0.59
51	601949	中国出版	157,300	825,825.00	0.57
52	603727	博迈科	45,900	814,725.00	0.57
53	601058	赛轮轮胎	228,800	807,664.00	0.56
54	000498	山东路桥	158,300	767,755.00	0.53
55	000810	创维数字	62,500	755,000.00	0.52
56	603180	金牌厨柜	15,960	752,992.80	0.52
57	603111	康尼机电	118,800	735,372.00	0.51
58	000921	海信家电	60,200	732,032.00	0.51
59	600764	中国海防	28,900	731,170.00	0.51
60	300036	超图软件	28,831	725,964.58	0.50
61	000555	神州信息	47,200	725,936.00	0.50
62	603008	喜临门	66,900	717,837.00	0.50
63	002585	双星新材	113,400	713,286.00	0.49
64	600850	华东电脑	28,900	708,339.00	0.49
65	300602	飞荣达	21,497	705,531.54	0.49
66	300379	东方通	16,200	697,086.00	0.48
67	603456	九洲药业	25,400	688,340.00	0.48

68	600715	文投控股	255,800	682,986.00	0.47
69	600318	新力金融	52,100	663,754.00	0.46
70	600261	阳光照明	186,300	661,365.00	0.46
71	603039	泛微网络	8,460	653,619.60	0.45
72	002840	华统股份	33,700	638,278.00	0.44
73	002960	青鸟消防	27,000	629,640.00	0.44
74	603686	龙马环卫	25,800	628,746.00	0.44
75	300559	佳发教育	29,430	624,504.60	0.43
76	601366	利群股份	96,600	590,226.00	0.41
77	600756	浪潮软件	30,600	566,100.00	0.39
78	300623	捷捷微电	18,580	558,329.00	0.39
79	600114	东睦股份	52,000	539,760.00	0.37
80	600596	新安股份	61,400	528,040.00	0.37
81	002091	江苏国泰	86,900	525,745.00	0.36
82	002649	博彦科技	56,400	524,520.00	0.36
83	300185	通裕重工	265,800	520,968.00	0.36
84	002043	兔宝宝	60,900	519,477.00	0.36
85	002930	宏川智慧	36,690	516,228.30	0.36
86	601636	旗滨集团	86,900	514,448.00	0.36
87	300709	精研科技	5,340	513,441.00	0.36
88	603368	柳药股份	22,260	510,867.00	0.35
89	002497	雅化集团	55,200	509,496.00	0.35
90	300682	朗新科技	29,000	493,580.00	0.34
91	603081	大丰实业	42,000	474,180.00	0.33
92	300119	瑞普生物	21,100	471,585.00	0.33
93	300309	吉艾科技	131,300	470,054.00	0.33
94	600810	神马股份	65,600	467,728.00	0.32
95	000544	中原环保	71,200	463,512.00	0.32
96	002611	东方精工	100,500	463,305.00	0.32
97	300016	北陆药业	36,400	442,624.00	0.31
98	600449	宁夏建材	36,100	441,142.00	0.31
99	002777	久远银海	14,360	436,687.60	0.30
100	002291	星期六	18,900	436,590.00	0.30
101	300624	万兴科技	5,380	433,090.00	0.30
102	002850	科达利	6,200	429,040.00	0.30
103	603299	苏盐井神	69,300	427,581.00	0.30
104	300102	乾照光电	94,000	423,000.00	0.29
105	300423	鲁亿通	34,100	421,476.00	0.29
106	002324	普利特	27,400	411,274.00	0.29
107	603118	共进股份	33,800	401,882.00	0.28
108	002015	协鑫能科	75,900	399,234.00	0.28

109	300456	赛微电子	14,100	389,442.00	0.27
110	600110	诺德股份	77,400	377,712.00	0.26
111	002161	远望谷	46,500	372,000.00	0.26
112	600131	国网信通	19,100	362,327.00	0.25
113	600668	尖峰集团	24,700	360,126.00	0.25
114	002409	雅克科技	6,800	354,756.00	0.25
115	603520	司太立	4,200	353,052.00	0.24
116	601908	京运通	80,600	351,416.00	0.24
117	002851	麦格米特	13,200	342,144.00	0.24
118	600211	西藏药业	5,280	336,441.60	0.23
119	603387	基蛋生物	8,100	326,349.00	0.23
120	603169	兰石重装	76,700	320,606.00	0.22
121	300702	天宇股份	2,800	297,696.00	0.21
122	600242	*ST中昌	46,500	295,275.00	0.20
123	600090	*ST济堂	99,600	288,840.00	0.20
124	002950	奥美医疗	10,100	286,638.00	0.20
125	603613	国联股份	3,045	286,230.00	0.20
126	000525	红太阳	35,900	285,046.00	0.20
127	300674	宇信科技	6,600	284,790.00	0.20
128	600797	浙大网新	34,000	280,160.00	0.19
129	300238	冠昊生物	15,700	279,617.00	0.19
130	600295	鄂尔多斯	39,000	274,950.00	0.19
131	300348	长亮科技	14,200	269,800.00	0.19
132	600076	康欣新材	83,600	269,192.00	0.19
133	300598	诚迈科技	1,400	265,160.00	0.18
134	603220	中贝通信	14,500	253,750.00	0.18
135	002370	亚太药业	53,100	252,756.00	0.18
136	600422	昆药集团	25,800	251,808.00	0.17
137	000650	仁和药业	41,600	249,600.00	0.17
138	600483	福能股份	33,300	241,758.00	0.17
139	000150	宜华健康	66,800	237,808.00	0.16
140	603678	火炬电子	8,400	235,368.00	0.16
141	600105	永鼎股份	55,700	235,054.00	0.16
142	300603	立昂技术	7,700	225,841.00	0.16
143	603383	顶点软件	5,040	224,733.60	0.16
144	600206	有研新材	15,500	216,535.00	0.15
145	600363	联创光电	13,800	213,762.00	0.15
146	002343	慈文传媒	24,500	212,660.00	0.15
147	600229	城市传媒	28,100	208,502.00	0.14
148	603601	再升科技	15,600	204,360.00	0.14
149	600184	光电股份	20,900	201,476.00	0.14

150	603421	鼎信通讯	13,200	197,736.00	0.14
151	002367	康力电梯	22,000	192,060.00	0.13
152	300525	博思软件	5,100	187,527.00	0.13
153	600929	湖南盐业	30,000	185,100.00	0.13
154	300303	聚飞光电	31,400	184,946.00	0.13
155	600812	华北制药	14,200	183,038.00	0.13
156	603063	禾望电气	25,400	180,848.00	0.13
157	603005	晶方科技	2,240	176,198.40	0.12
158	002467	二六三	24,600	172,938.00	0.12
159	600750	江中药业	13,520	170,892.80	0.12
160	300256	星星科技	26,900	170,546.00	0.12
161	600789	鲁抗医药	18,400	168,728.00	0.12
162	600490	鹏欣资源	53,000	166,950.00	0.12
163	300047	天源迪科	22,100	160,446.00	0.11
164	002567	唐人神	16,200	154,224.00	0.11
165	601858	中国科传	16,900	151,931.00	0.11
166	300044	赛为智能	21,200	142,252.00	0.10
167	600988	赤峰黄金	11,400	135,660.00	0.09
168	300571	平治信息	2,900	133,980.00	0.09
169	601606	长城军工	9,900	133,452.00	0.09
170	603429	集友股份	3,800	120,954.00	0.08
171	002737	葵花药业	7,600	111,188.00	0.08
172	002959	小熊电器	900	110,700.00	0.08
173	603801	志邦家居	4,000	106,760.00	0.07
174	300771	智莱科技	2,800	105,840.00	0.07
175	002610	爱康科技	79,400	105,602.00	0.07
176	002351	漫步者	5,000	105,600.00	0.07
177	000711	京蓝科技	32,700	104,313.00	0.07
178	300107	建新股份	19,000	104,120.00	0.07
179	300118	东方日升	6,900	103,500.00	0.07
180	600618	氯碱化工	14,200	100,820.00	0.07
181	603367	辰欣药业	6,100	98,637.00	0.07
182	603896	寿仙谷	2,900	98,252.00	0.07
183	603803	瑞斯康达	8,300	96,944.00	0.07
184	600075	新疆天业	19,600	95,060.00	0.07
185	600984	建设机械	3,800	94,240.00	0.07
186	603308	应流股份	4,600	93,840.00	0.07
187	600571	信雅达	9,100	82,719.00	0.06
188	603920	世运电路	3,200	79,328.00	0.06
189	600330	天通股份	7,900	78,763.00	0.05
190	601700	风范股份	14,800	77,848.00	0.05

191	300176	派生科技	14,600	77,672.00	0.05
192	600210	紫江企业	17,800	76,362.00	0.05
193	603128	华贸物流	13,000	75,530.00	0.05
194	002798	帝欧家居	2,270	73,706.90	0.05
195	601020	华钰矿业	9,100	70,980.00	0.05
196	300299	富春股份	7,700	69,685.00	0.05
197	600846	同济科技	8,000	68,000.00	0.05
198	000697	炼石航空	7,100	67,308.00	0.05
199	600864	哈投股份	11,100	66,711.00	0.05
200	600562	国睿科技	4,500	66,690.00	0.05
201	601116	三江购物	4,600	65,734.00	0.05
202	600197	伊力特	3,300	65,241.00	0.05
203	000933	神火股份	15,300	63,495.00	0.04
204	600702	舍得酒业	1,700	63,495.00	0.04
205	600331	宏达股份	30,800	63,448.00	0.04
206	600990	四创电子	1,500	59,550.00	0.04
207	600975	新五丰	6,400	59,008.00	0.04
208	300776	帝尔激光	700	58,646.00	0.04
209	600708	光明地产	20,600	57,886.00	0.04
210	300572	安车检测	900	57,195.00	0.04
211	600987	航民股份	10,675	57,111.25	0.04
212	600391	航发科技	3,000	56,130.00	0.04
213	300369	绿盟科技	2,400	55,896.00	0.04
214	603626	科森科技	4,600	55,890.00	0.04
215	300378	鼎捷软件	4,100	55,760.00	0.04
216	300527	中船应急	6,100	55,327.00	0.04
217	300761	立华股份	1,400	53,956.00	0.04
218	002618	丹邦科技	5,500	53,075.00	0.04
219	300075	数字政通	4,000	53,000.00	0.04
220	002664	长鹰信质	4,000	52,880.00	0.04
221	600981	汇鸿集团	16,800	52,752.00	0.04
222	600123	兰花科创	11,100	52,281.00	0.04
223	600456	宝钛股份	1,900	51,965.00	0.04
224	600569	安阳钢铁	25,400	51,562.00	0.04
225	603026	石大胜华	1,900	50,711.00	0.04
226	600587	新华医疗	3,200	49,792.00	0.03
227	300409	道氏技术	4,400	49,368.00	0.03
228	000662	*ST 天夏	19,600	48,608.00	0.03
229	600621	华鑫股份	2,500	48,250.00	0.03
230	300552	万集科技	1,080	45,986.40	0.03
231	601515	东风股份	7,500	45,825.00	0.03

232	600775	南京熊猫	5,500	45,045.00	0.03
233	603363	傲农生物	1,900	44,403.00	0.03
234	600894	广日股份	6,400	43,840.00	0.03
235	300366	创意信息	4,600	41,860.00	0.03
236	600366	宁波韵升	7,100	40,470.00	0.03
237	603105	芯能科技	4,600	40,434.00	0.03
238	601666	平煤股份	9,700	36,278.00	0.03
239	603636	南威软件	2,900	35,090.00	0.02
240	600239	云南城投	8,800	33,704.00	0.02
241	600855	航天长峰	2,100	33,390.00	0.02
242	603587	地素时尚	1,920	32,352.00	0.02
243	600129	太极集团	2,200	31,108.00	0.02
244	002234	民和股份	1,400	31,052.00	0.02
245	600626	申达股份	6,100	30,561.00	0.02
246	603508	思维列控	840	28,257.60	0.02
247	000034	神州数码	1,100	26,774.00	0.02
248	600323	瀚蓝环境	1,200	26,256.00	0.02
249	603737	三棵树	280	25,821.60	0.02
250	600503	华丽家族	5,700	25,137.00	0.02
251	600622	光大嘉宝	6,390	25,112.70	0.02
252	603393	新天然气	672	24,763.20	0.02
253	300596	利安隆	700	24,381.00	0.02
254	002621	美吉姆	3,780	23,209.20	0.02
255	600936	广西广电	5,800	22,330.00	0.02
256	603711	香飘飘	700	21,077.00	0.01
257	603713	密尔克卫	200	20,804.00	0.01
258	300034	钢研高纳	1,100	20,636.00	0.01
259	601126	四方股份	3,400	20,570.00	0.01
260	600057	厦门象屿	3,700	20,276.00	0.01
261	300130	新国都	1,300	17,875.00	0.01
262	601375	中原证券	3,800	17,860.00	0.01
263	600873	梅花生物	3,900	17,706.00	0.01
264	603588	高能环境	1,500	17,490.00	0.01
265	600710	苏美达	4,000	17,360.00	0.01
266	000030	富奥股份	2,700	17,253.00	0.01
267	600533	栖霞建设	4,600	16,836.00	0.01
268	601929	吉视传媒	7,600	16,264.00	0.01
269	603730	岱美股份	500	16,125.00	0.01
270	300735	光弘科技	840	15,498.00	0.01
271	600496	精工钢构	4,200	14,070.00	0.01
272	600300	维维股份	3,800	11,134.00	0.01

273	600552	凯盛科技	1,600	10,400.00	0.01
274	600612	老凤祥	200	9,638.00	0.01
275	600685	中船防务	500	8,455.00	0.01
276	600577	精达股份	2,900	8,062.00	0.01
277	603660	苏州科达	660	6,052.20	0.00
278	603590	康辰药业	100	3,876.00	0.00
279	600624	复旦复华	300	2,997.00	0.00
280	600997	开滦股份	100	460.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300558	贝达药业	9,200	1,287,816.00	0.89
2	300782	卓胜微	3,060	1,241,656.20	0.86
3	601615	明阳智能	89,300	1,111,785.00	0.77
4	603501	韦尔股份	5,300	1,070,335.00	0.74
5	300482	万孚生物	9,600	998,400.00	0.69
6	000543	皖能电力	233,300	937,866.00	0.65
7	603712	七一二	24,000	921,120.00	0.64
8	300759	康龙化成	8,200	806,880.00	0.56
9	603233	大参林	8,880	721,233.60	0.50
10	300677	英科医疗	5,400	690,120.00	0.48
11	002414	高德红外	21,700	635,376.00	0.44
12	603208	江山欧派	6,500	633,100.00	0.44
13	601872	招商轮船	100,900	588,247.00	0.41
14	600026	中远海能	81,900	529,074.00	0.37
15	002244	滨江集团	111,000	473,970.00	0.33
16	002124	天邦股份	35,000	449,750.00	0.31
17	300772	运达股份	35,700	440,895.00	0.31
18	600466	蓝光发展	80,200	432,278.00	0.30
19	600584	长电科技	13,700	428,399.00	0.30
20	300474	景嘉微	6,100	410,530.00	0.28
21	600606	绿地控股	61,400	379,452.00	0.26
22	002156	通富微电	12,400	310,620.00	0.22
23	603986	兆易创新	1,300	306,683.00	0.21
24	002641	永高股份	41,000	275,110.00	0.19
25	600172	黄河旋风	92,700	254,925.00	0.18
26	600180	瑞茂通	34,100	217,558.00	0.15
27	603566	普莱柯	6,600	182,754.00	0.13
28	688558	国盛智科	5,177	182,541.02	0.13

29	600216	浙江医药	9,400	181,044.00	0.13
30	002084	海鸥住工	18,600	168,330.00	0.12
31	300179	四方达	28,200	159,894.00	0.11
32	002241	歌尔股份	5,400	158,544.00	0.11
33	603799	华友钴业	4,000	155,440.00	0.11
34	002001	新 和 成	5,200	151,320.00	0.10
35	600745	闻泰科技	1,200	151,140.00	0.10
36	603773	沃格光电	4,200	136,794.00	0.09
37	000581	威孚高科	6,000	124,080.00	0.09
38	002475	立讯精密	2,080	106,808.00	0.07
39	300278	华昌达	24,600	87,084.00	0.06
40	300738	奥飞数据	1,500	86,520.00	0.06
41	002511	中顺洁柔	3,000	66,900.00	0.05
42	603916	苏博特	2,600	65,390.00	0.05
43	688568	中科星图	3,857	62,521.97	0.04
44	300595	欧普康视	900	62,406.00	0.04
45	688081	兴图新科	1,419	59,612.19	0.04
46	600760	中航沈飞	1,800	59,076.00	0.04
47	603999	读者传媒	9,500	56,525.00	0.04
48	688377	迪威尔	3,411	56,008.62	0.04
49	000547	航天发展	4,000	54,680.00	0.04
50	002557	洽洽食品	1,000	54,190.00	0.04
51	603605	珀莱雅	300	54,006.00	0.04
52	300259	新天科技	8,800	50,864.00	0.04
53	688528	秦川物联	4,429	50,180.57	0.03
54	600382	广东明珠	7,500	49,050.00	0.03
55	688600	皖仪科技	3,144	48,732.00	0.03
56	603658	安图生物	300	48,732.00	0.03
57	601717	郑煤机	7,900	46,531.00	0.03
58	600481	双良节能	15,200	46,056.00	0.03
59	603538	美诺华	900	45,882.00	0.03
60	600461	洪城水业	7,000	44,590.00	0.03
61	603087	甘李药业	408	40,922.40	0.03
62	600346	恒力石化	2,700	37,800.00	0.03
63	600667	太极实业	2,900	34,278.00	0.02
64	601233	桐昆股份	2,600	33,176.00	0.02
65	002048	宁波华翔	2,100	32,424.00	0.02
66	002458	益生股份	2,051	31,318.77	0.02
67	600583	海油工程	6,600	30,030.00	0.02
68	600067	冠城大通	8,400	28,980.00	0.02
69	600038	中直股份	700	28,749.00	0.02

70	600570	恒生电子	260	28,002.00	0.02
71	601919	中远海控	6,900	23,943.00	0.02
72	603160	汇顶科技	100	22,290.00	0.02
73	600266	城建发展	3,960	20,077.20	0.01
74	000739	普洛药业	800	18,632.00	0.01
75	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
76	603086	先达股份	1,120	16,497.60	0.01
77	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
78	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
79	600031	三一重工	600	11,256.00	0.01
80	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
81	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
82	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
83	600616	金枫酒业	100	554.00	0.00
84	600303	曙光股份	100	327.00	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	002216	三全食品	1,557,698.00	2.06
2	002531	天顺风能	1,526,897.00	2.02
3	002214	大立科技	1,480,579.00	1.96
4	300607	拓斯达	1,398,070.00	1.85
5	000507	珠海港	1,365,538.68	1.80
6	002851	麦格米特	1,361,039.64	1.80
7	300726	宏达电子	1,341,360.00	1.77
8	300066	三川智慧	1,321,751.00	1.75
9	002063	远光软件	1,309,039.60	1.73
10	002023	海特高新	1,238,922.00	1.64
11	002697	红旗连锁	1,231,106.00	1.63
12	600764	中国海防	1,173,586.96	1.55
13	002928	华夏航空	1,173,342.78	1.55
14	300659	中孚信息	1,139,143.25	1.51
15	000933	神火股份	1,117,575.00	1.48
16	300397	天和防务	1,097,353.60	1.45
17	300676	华大基因	1,073,616.00	1.42
18	600708	光明地产	1,059,686.19	1.40
19	600180	瑞茂通	1,054,668.00	1.39
20	601588	北辰实业	1,036,313.00	1.37

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	3,725,629.05	4.92
2	600667	太极实业	1,408,447.00	1.86
3	603737	三棵树	1,340,083.00	1.77
4	600057	厦门象屿	1,323,256.01	1.75
5	600984	建设机械	1,266,386.00	1.67
6	600988	赤峰黄金	1,189,103.00	1.57
7	603538	美诺华	1,148,038.00	1.52
8	603916	苏博特	1,138,945.00	1.51
9	600211	西藏药业	1,134,072.98	1.50
10	600894	广日股份	1,059,009.00	1.40
11	603588	高能环境	1,055,154.00	1.39
12	603160	汇顶科技	957,224.02	1.26
13	300130	新国都	950,859.63	1.26
14	000933	神火股份	946,177.00	1.25
15	600708	光明地产	938,987.00	1.24
16	601908	京运通	903,974.00	1.19
17	300034	钢研高纳	894,996.00	1.18
18	002851	麦格米特	887,339.05	1.17
19	600031	三一重工	885,873.00	1.17
20	603658	安图生物	878,369.91	1.16

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	114,705,530.09
卖出股票收入（成交）总额	76,678,364.07

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	2,001,000.00	1.39
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）	89,814.00	0.06
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,090,814.00	1.45

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	019627	20 国债 01	20,000	2,001,000.00	1.39
2	113585	寿仙转债	320	32,000.00	0.02
3	113582	火炬转债	220	27,981.80	0.02
4	110069	瀚蓝转债	190	23,784.20	0.02
5	113569	科达转债	60	6,048.00	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	18,237.89
2	应收证券清算款	103,212.67
3	应收股利	—
4	应收利息	24,078.65
5	应收申购款	3,209,232.59
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,354,761.80

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(%)
6,329	15,201.27	25,482,964.25	26.49	70,725,887.47	73.51

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	陈志坚	662,316	13.09
2	熊振国	573,600	11.34
3	李群	400,023	7.91
4	邓玉良	300,040	5.93
5	宗爱云	213,983	4.23
6	黄楚璇	140,002	2.77
7	李春	122,300	2.42
8	陈曦	118,016	2.33
9	陶建锋	100,007	1.98
10	张中京	100,005	1.98

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	83,305.07	0.0866

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	0

和研究部门负责人持有本开放式基金	
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	63,323,227.96
本报告期基金总申购份额	101,191,885.49
减：本报告期基金总赎回份额	68,306,261.73
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	96,208,851.72

§ 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 (%)	
安信证券	2	27,694,948.80	14.69	2,001,700.00	30.64	—	—	—	—	25,238.30	14.69	—
第一创业证券	2	9,688,949.27	5.14	165,078.10	2.53	—	—	—	—	8,829.52	5.14	—
东北证券	2	40,384,951.35	21.42	133,744.00	2.05	—	—	—	—	36,795.25	21.42	—
东方证券	2	17,319,377.70	9.19	—	—	—	—	—	—	15,782.30	9.19	—
国海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国联证券	1	78,591.87	0.04	—	—	—	—	—	—	71.61	0.04	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	36,916,309.39	19.58	—	—	—	—	—	—	33,641.54	19.58	—
华菁证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
汇丰前海	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
开源证券	2	20,770.75	0.01	—	—	—	—	—	—	18.93	0.01	—
申万宏源	4	25,922,541.43	13.75	4,232,130.00	64.78	—	—	—	—	23,616.12	13.75	—
兴业证券	2	24,238,808.03	12.86	—	—	—	—	—	—	22,089.57	12.86	—
浙商证券	1	5,173,194.15	2.74	—	—	—	—	—	—	4,714.31	2.74	—
中泰证券	1	987,213.44	0.52	—	—	—	—	—	—	919.34	0.54	—

中信证券	2	103,325.14	0.05	—	—	—	—	—	—	94.16	0.05	—
------	---	------------	------	---	---	---	---	---	---	-------	------	---

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：开源证券（002114、46516）。

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公司固有资金及高级管理人员投资公司旗下偏股型公募基金的公告	规定披露媒介	2020 年 02 月 04 日
5	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	规定披露媒介	2020 年 03 月 17 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

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

§ 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 2、富国中证 1000 指数增	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，

强型证券投资基金（LOF）基金合同 3、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）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、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 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告		免长途话费）公司网址：http://www.fullgoal.com.cn。
--	--	--