

富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金

二〇二〇年第4季度报告

2020年12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

报告送出日期：2021年01月22日

§ 1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。本报告财务资料未经审计。本报告期自2020年10月1日起至2020年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

| | | | |
|-----------------------|---|-----------------|------------------|
| 基金简称 | 富国中证国有企业改革指数分级 | | |
| 场内简称 | 国企改革 | | |
| 基金主代码 | 161026 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2014年12月17日 | | |
| 报告期末基金份额总额（单位：份） | 4,694,249,429.14 | | |
| 投资目标 | 本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证国有企业改革指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。 | | |
| 投资策略 | 本基金主要采用完全复制法进行投资，依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型和交易成本模型，按照成份股在中证国有企业改革指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证国有企业改革指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。本基金的资产配置策略、股票投资组合构建、债券投资策略、金融衍生工具投资策略详见法律文件。 | | |
| 业绩比较基准 | 95%×中证国有企业改革指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后） | | |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，富国国企改革A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；富国国企改革B份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。 | | |
| 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 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 富国中证国有企业改革指数分级A | 富国中证国有企业改革指数分级B | 富国中证国有企业改革指数分级 |
| 下属分级基金场内简称 | 国企改A | 国企改B | 国企改革 |
| 下属分级基金的交易代码 | 150209 | 150210 | 161026 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份） | 452,811,924.00 | 452,811,924.00 | 3,788,625,581.14 |

| | | | |
|----------------------|---|---|---|
| <p>下属分级基金的风险收益特征</p> | <p>本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，富国国企改革 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；富国国企改革 B 份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。</p> | <p>本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，富国国企改革 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；富国国企改革 B 份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。</p> | <p>本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，富国国企改革 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；富国国企改革 B 份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。</p> |
|----------------------|---|---|---|

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2020年10月01日-2020年12月31日） |
|-----------------|------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 149,331,943.80 |
| 2. 本期利润 | 614,286,508.34 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1202 |
| 4. 期末基金资产净值 | 5,204,358,693.72 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.109 |

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 12.22% | 0.95% | 12.81% | 0.95% | -0.59% | 0.00% |
| 过去六个月 | 24.01% | 1.31% | 23.48% | 1.33% | 0.53% | -0.02% |
| 过去一年 | 26.78% | 1.41% | 25.29% | 1.42% | 1.49% | -0.01% |
| 过去三年 | 25.13% | 1.30% | 21.88% | 1.31% | 3.25% | -0.01% |
| 过去五年 | 21.45% | 1.30% | 19.06% | 1.29% | 2.39% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 33.99% | 1.59% | 39.09% | 1.61% | -5.10% | -0.02% |

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



注：1、截止日期为2020年12月31日。

2、本基金于2014年12月17日成立，建仓期6个月，从2014年12月17日起至2015年6月16日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.3 其他指标

| 其他指标 | 报告期末（2020年12月31日） |
|-----------------|-------------------|
| 国企改A与国企改B基金份额配比 | 1:1 |
| 期末国企改A份额参考净值 | 1.002 |
| 期末国企改A份额累计参考净值 | 1.284 |
| 期末国企改B份额参考净值 | 1.216 |
| 期末国企改B份额累计参考净值 | 1.496 |
| 富国国企改A的预计年收益率 | 4.50% |

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王保合 | 本基金基金经理 | 2015-04-15 | — | 14.5 | 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, 2020 年 9 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; 兼任量化投资部总经理。具有基金从业资格。 |
| 张圣贤 | 本基金基金经理 | 2015-06-05 | — | 13.5 | 硕士, 自 2007 年 7 月至 2015 年 3 月任上海申银万国证券研究所有限公司分析师; 自 2015 年 3 月至 2015 年 6 月任富国基金管理有限公司基金经理助理; 2015 年 6 月起任富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金基金经理; 自 2015 年 8 月起任富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理, 2016 年 2 月起任富国中证智能汽车指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2017 年 7 月至 2020 年 12 月任 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2017年11月起任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理，2020年4月起任富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020年7月起担任富国上海金交易型开放式证券投资基金、富国上海金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理，2020年12月起任富国中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、富国中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；兼任量化投资部量化投资总监助理。具有基金从业资格。 |
|--|--|--|--|--|---|

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评

估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现1次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

由于国庆期间并未出现明显负面信息，国庆后首周海外资金回流，市场大幅上涨。受欧洲及国内销量超预期、苹果 5G 手机发布等消息的刺激，新能源车、苹果产业链等科技板块表现突出。随着市场回到前期高点，估值压力再度显现，同时央行表态把好货币总闸门，市场对货币政策进一步收缩产生担忧，市场整体出现回调。11 月初，随着美国大选逐步落地，不确定性逐步消失，同时伴随着疫苗进展出现积极信号，市场风险偏好大幅提升，全球股市均出现较大幅度的上涨。11 月中旬起，市场开始担忧经济复苏后央行货币政策可能进一步收紧，同时公布的 10 月金融数据显示社融增速可能进一步放缓，导致 A 股出现调整。12 月下旬起，中央经济工作会议召开，会议部署明年经济工作时指出，明年宏观政策要保持连续性、稳定性、可持续性，政策操作上要更加精准有效、不急转弯。这一阐述打消了市场前期对于货币政策大幅收紧的担忧。同时，随着美国新一轮财政刺激政策落地，市场风险偏好明显提升，食品饮料、新能源车、军工等板块轮番上涨，前期跌幅较大的 TMT 板块也迎来反弹。12 月末，随着中欧投资协定签署，市场情绪进一步高涨，主要指数创出本轮反弹新高。总体来看，2020 年 4 季度上证综指上涨 7.92%，沪深 300 上涨 13.6%，创业板指上涨 15.21%，中证 500 指数上涨 2.82%。

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

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金份额净值增长率为 12.22%，同期业绩比较基准收益率为 12.81%

4.6 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 4,887,579,760.20 | 92.75 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| | 其中：股票 | 4,887,579,760.20 | 92.75 |
| 2 | 固定收益投资 | — | — |
| | 其中：债券 | — | — |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 3 | 贵金属投资 | — | — |
| 4 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 5 | 买入返售金融资产 | — | — |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 347,251,830.83 | 6.59 |
| 7 | 其他资产 | 34,650,307.65 | 0.66 |
| 8 | 合计 | 5,269,481,898.68 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | — | — |
| B | 采矿业 | — | — |
| C | 制造业 | 1,804,749.19 | 0.03 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | — | — |
| E | 建筑业 | — | — |
| F | 批发和零售业 | 16,322.72 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 19,998.88 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | — | — |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,350,900.26 | 0.03 |
| J | 金融业 | — | — |
| K | 房地产业 | 8,975.14 | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | — | — |
| M | 科学研究和技术服务业 | — | — |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 62,972.16 | 0.00 |
| 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 | 48,261.27 | 0.00 |
| S | 综合 | — | — |

| | | | |
|--|----|--------------|------|
| | 合计 | 3,312,179.62 | 0.06 |
|--|----|--------------|------|

5.2.2 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | — | — |
| B | 采矿业 | 211,824,167.84 | 4.07 |
| C | 制造业 | 2,731,344,621.58 | 52.48 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 174,893,467.91 | 3.36 |
| E | 建筑业 | 79,643,628.78 | 1.53 |
| F | 批发和零售业 | — | — |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 102,222,116.73 | 1.96 |
| H | 住宿和餐饮业 | — | — |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 208,141,221.49 | 4.00 |
| J | 金融业 | 812,369,614.10 | 15.61 |
| K | 房地产业 | 298,420,857.65 | 5.73 |
| L | 租赁和商务服务业 | 189,645,403.50 | 3.64 |
| M | 科学研究和技术服务业 | — | — |
| 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 | 75,762,481.00 | 1.46 |
| S | 综合 | — | — |
| | 合计 | 4,884,267,580.58 | 93.85 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1 | 601888 | 中国中免 | 671,430 | 189,645,403.50 | 3.64 |
| 2 | 000725 | 京东方A | 26,419,200 | 158,515,200.00 | 3.05 |
| 3 | 002415 | 海康威视 | 3,113,600 | 151,040,736.00 | 2.90 |
| 4 | 000858 | 五粮液 | 516,204 | 150,654,137.40 | 2.89 |
| 5 | 600309 | 万华化学 | 1,636,248 | 148,964,017.92 | 2.86 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 6,804,293 | 142,005,594.91 | 2.73 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|----------------|------|
| 7 | 600036 | 招商银行 | 3,140,326 | 138,017,327.70 | 2.65 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 4,648,200 | 136,657,080.00 | 2.63 |
| 9 | 600809 | 山西汾酒 | 363,326 | 136,352,614.54 | 2.62 |
| 10 | 000002 | 万科A | 4,743,023 | 136,124,760.10 | 2.62 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 688256 | 寒武纪 | 8,962 | 1,286,405.48 | 0.02 |
| 2 | 688526 | 科前生物 | 14,620 | 573,688.80 | 0.01 |
| 3 | 688580 | 伟思医疗 | 3,439 | 338,431.99 | 0.01 |
| 4 | 300896 | 爱美客 | 473 | 285,389.28 | 0.01 |
| 5 | 688617 | 惠泰医疗 | 1,673 | 124,571.58 | 0.00 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本报告编制日前一年内，本基金持有的“兴业银行”的发行主体兴业银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保的违法违规事实，中国银保监会福建监管局于2020年8月31日对公司做出没收违法所得6,361,807.97元，并合计处以罚款15,961,807.97元的行政处罚（闽银保监罚决字（2020）24号）；由于存在为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程

中的一致性；违反银行卡收单外包管理规定等 5 项违法违规事实，中国人民银行福州中心支行于 2020 年 9 月 4 日对公司做出警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款的行政处罚（福银罚字（2020）35 号）。兴业银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

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 9 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。

5.11.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 516,058.24 |
| 2 | 应收证券清算款 | 33,932,086.79 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 69,950.08 |
| 5 | 应收申购款 | 132,212.54 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 34,650,307.65 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 688256 | 寒武纪 | 1,286,405.48 | 0.02 | 新股限售 |
| 2 | 688526 | 科前生物 | 573,688.80 | 0.01 | 新股限售 |
| 3 | 688580 | 伟思医疗 | 338,431.99 | 0.01 | 新股限售 |
| 4 | 300896 | 爱美客 | 285,389.28 | 0.01 | 新股限售 |
| 5 | 688617 | 惠泰医疗 | 124,571.58 | 0.00 | 新股认购 |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 富国中证国有企业改革指数分级 A | 富国中证国有企业改革指数分级 B | 富国中证国有企业改革指数分级 |
|-------------------------------|------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 612,279,723.00 | 612,279,723.00 | 4,166,951,204.20 |
| 报告期期间基金总申购份额 | — | — | 11,453,644.36 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | — | — | 813,554,963.70 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | -159,467,799.00 | -159,467,799.00 | 423,775,696.28 |
| 报告期期末基金份额总额 | 452,811,924.00 | 452,811,924.00 | 3,788,625,581.14 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

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

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期，依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会。在基金托管人监督下，本基金管理人对本次大会表决进行了计票，上海市通力律师事务所对计票过程进行了见证，上海市东方公证处对计票过程及结果进行了公证。经统计，本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的基金份额持有人所代表的富国国企改革份额和富国国企改革 B 份额少于权益登记日富国国企改革份额和富国国企改革 B 份额各自基金总份额的 50%，未达到法定的会议召开条件。具体可参见基金管理人于 2020 年 10 月 31 日发布的《富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》。

二、本报告期，根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关法律法规的规定，经与基金托管人协商一致，基金管理人对本基金基金合同进行了修改，并已报监管部门备案。本次基金合同修订涉及根据监管规定取消分级机制，并据此就分级份额的终止运作，包括终止上市与份额折算等后续具体操作做了安排，本次基金合同修改自 2020 年

11月19日起生效。具体可参见基金管理人于2020年11月18日发布的《关于富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金修订基金合同的公告》及修订后的基金合同。

三、本报告期，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定，基金管理人制定了本基金的分级份额终止运作、终止上市的实施方案，并对本基金基金合同进行了修改，根据实施方案内容，富国国企改革A份额和富国国企改革B份额的终止上市日为2021年1月4日，基金管理人于2020年12月31日（份额折算基准日）日终，以富国国企改革份额的基金份额净值为基准，将富国国企改革A份额、富国国企改革B份额按照各自的基金份额参考净值折算成场内富国国企改革份额。富国国企改革A份额和富国国企改革B份额终止运作后，《富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》将修订为《富国中证国有企业改革指数型证券投资基金基金合同》，《富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金托管协议》将修订为《富国中证国有企业改革指数型证券投资基金托管协议》。修订后的基金合同于2021年1月1日正式生效，《富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金的基金名称将变更为“富国中证国有企业改革指数型证券投资基金”，场外简称将由“富国中证国有企业改革指数分级”变更为“富国中证国有企业改革指数”。具体可参见基金管理人分别于2020年12月2日、2020年12月29日发布的《关于富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金之A类份额和B类份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》、《关于富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金名称变更的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金的文件
- 2、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同

- 3、富国中证国有企业改革指数分级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、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）

公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

富国基金管理有限公司
2021 年 01 月 22 日