

富国中证全指证券公司指数型证券投资基金

二〇二一年第 2 季度报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国建设银行股份有限公司

报告送出日期： 2021 年 07 月 21 日

## § 1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 19 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 2021 年 4 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富国中证全指证券公司指数
场内简称	证券
基金主代码	161027
交易代码	161027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年03月27日
报告期末基金份额总额（单位：份）	1,763,962,073.98
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证全指证券公司指数。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，按照成份股在中证全指证券公司指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证全指证券公司指数的收益表现，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、存托凭证投资策略、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%×中证全指证券公司指数收益率+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。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年04月01日-2021年06月30日）
1. 本期已实现收益	15,721,309.07
2. 本期利润	120,517,991.22
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0682

4. 期末基金资产净值	1, 839, 478, 070. 04
5. 期末基金份额净值	1. 043

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	6.76%	1.49%	6.26%	1.52%	0.50%	-0.03%
过去六个月	-8.19%	1.54%	-8.97%	1.57%	0.78%	-0.03%
过去一年	10.40%	1.95%	8.38%	1.99%	2.02%	-0.04%
过去三年	50.56%	2.00%	42.28%	2.04%	8.28%	-0.04%
过去五年	6.40%	1.73%	-2.55%	1.76%	8.95%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-34.71%	2.12%	-39.71%	2.18%	5.00%	-0.06%

#### 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2021年6月30日。

2、本基金于2015年3月27日成立，建仓期6个月，从2015年3月27日起至2015年9月26日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王保合	本基金基金经理	2015-05-13	—	15.0	博士，自2006年7月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监、量化与海外投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部总经理，兼任富国基金量化投资部资深定量基

					<p>金经理。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型证券投资基金（原富国创业板指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）基金经理，2014年4月起任富国中证军工指数型证券投资基金（原富国中证军工指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）基金经理，2015年4月起任富国中证移动互联网指数型证券投资基金（原富国中证移动互联网指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）、富国中证国有企业改革指数型证券投资基金（原富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）基金经理，2015年5月起任富国中证全指证券公司指数型证券投资基金（原富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）、富国中证银行指数型证券投资基金（原富国中证银行指数分级证券投资基金，于2019年5月10日更名）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月至</p>
--	--	--	--	--	---

					2021年6月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。具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证全指证券公司指数型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》、《富国中证全指证券公司指数型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包

括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

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

#### **4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析**

4月以来，随着公布的1季度GDP数据环比低于季节性，餐饮、制造业投资修复偏慢，投资者对于货币政策收紧预期担忧减弱，市场迎来反弹。4月下旬，印度疫情超预期爆发，使得货币政策收紧预期进一步降低，市场持续反弹。5月初，商品价格再度大幅上涨，螺纹钢、铜等品种创出本轮反弹新高，钢铁、煤炭、有色等周期板块大幅上涨。市场通胀预期大幅提升，成长板块出现明显回调。5月中旬起，国常会多次开会聚焦大宗商品价格问题，指出要高度重视大宗商品价格攀升带来的不利影响。国内相关大宗商品如钢价、煤价迎来大幅调整。随着通胀预期下降，市场风险偏好再度提升，消费、科技、医药、新能源等板块迎来大幅反弹。6月中，美联储会议并未实质性讨论收紧购债规模，同时美国10年期



国债利率进一步走低，因此短期流动性未受到明显影响，市场继续反弹。其中，景气度较高的新能源汽车、光伏、半导体等板块涨幅居前。总体来看，2021年2季度上证综指上涨4.34%，沪深300上涨3.48%，创业板指上涨26.05%，中证500指数上涨8.86%。

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6.76%，同期业绩比较基准收益率为6.26%

#### 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	1,698,653,631.70	91.76
	其中：股票	1,698,653,631.70	91.76
2	固定收益投资	14,669,370.08	0.79
	其中：债券	14,669,370.08	0.79
	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	128,383,122.38	6.94
7	其他资产	9,454,852.51	0.51
8	合计	1,851,160,976.67	100.00

注：本基金通过转融通证券出借业务出借证券的公允价值为160,089,500.00元，占资产净值比例为8.70%。

## 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	5,439.50	0.00
B	采矿业	—	—
C	制造业	2,717,970.25	0.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	77,638.12	0.00
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	300,795.24	0.02
J	金融业	34,721.10	0.00
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	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	30,146.60	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	—	—
S	综合	—	—
	合计	3,190,745.64	0.17

### 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	—	—
C	制造业	—	—
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	—	—
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	—	—
J	金融业	1,695,462,886.06	92.17
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	—	—
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	1,695,462,886.06	92.17

### 5.3 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

#### 5.3.1 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	300059	东方财富	8,755,704	287,099,534.16	15.61
2	600030	中信证券	9,008,130	224,662,762.20	12.21
3	600837	海通证券	8,691,410	99,951,215.00	5.43
4	601688	华泰证券	6,081,055	96,080,669.00	5.22
5	601211	国泰君安	4,769,110	81,742,545.40	4.44
6	600999	招商证券	3,924,102	74,636,420.04	4.06
7	601377	兴业证券	5,671,165	54,783,453.90	2.98
8	000776	广发证券	3,132,979	47,433,302.06	2.58
9	000166	申万宏源	9,542,362	44,658,254.16	2.43
10	600958	东方证券	4,421,181	44,167,598.19	2.40

#### 5.3.2 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	688608	恒玄科技	2,758	874,037.78	0.05

2	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
3	688619	罗普特	5,856	156,589.44	0.01
4	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.01
5	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.01

### 5.3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	14,669,370.08	0.80
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	14,669,370.08	0.80

### 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

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	123111	东财转3	100,228	14,669,370.08	0.80

### 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“广发证券”的发行主体广发证券股份有限公司（以下简称“公司”），由于在康美药业股份有限公司 2014 年非公开发行优先股项目、2015 年公司债券项目、2016 年非公开发行股票项目、2018 年公司债券项目、康美实业投资控股有限公司 2017 年可交换公司债券项目中未勤勉尽责，尽职调查环节基本程序缺失，缺乏应有的执业审慎，内部质量控制流

于形式，未按规定履行持续督导与受托管理义务，中国证监会广东监管局于 2020 年 7 月 20 日对公司采取责令改正、限制业务活动、责令限制高级管理人员权利的行政监管措施（广东证监局行政监管措施决定书（2020）97 号）。广发证券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“海通证券”的发行主体海通证券股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：（1）在开展部分投资顾问、私募资产管理业务过程中，未按照审慎经营原则，有效控制和防范风险，未能审慎评估公司经营管理行为对证券市场的影响；（2）未将相关业务行为纳入全面合规风控体系，合规风控机制存在缺失；（3）投资银行业务内部控制存在漏洞，债券承销与资产管理等业务缺少有效隔离，利益冲突审查机制存在缺失的违法违规事实，中国证券监督管理委员会上海监管局于 2021 年 3 月 30 日对公司作出责令 1 年内每 3 个月开展一次内部合规检查、12 个月内暂停为机构投资者提供债券投资顾问业务的行政监管措施（沪证监决（2021）40 号）。海通证券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“招商证券”的发行主体招商证券股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：（1）未按规定履行客户身份识别义务；（2）未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告的违法违规事实，中国人民银行深圳市中心支行于 2021 年 5 月 26 日对公司做出罚款人民币 173 万元的行政处罚（深人银罚（2021）10 号）。招商证券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 7 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	402,793.87
2	应收证券清算款	525,726.93
3	应收股利	70,338.00
4	应收利息	110,382.76
5	应收申购款	8,313,886.19
6	其他应收款	—
7	待摊费用	31,724.76
8	其他	—
9	合计	9,454,852.51

### 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

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	300059	东方财富	29,278,191.00	1.59	转融通流通受限
2	600030	中信证券	11,210,530.00	0.61	转融通流通受限
3	000776	广发证券	10,955,304.00	0.60	转融通流通受限
4	600837	海通证券	8,864,200.00	0.48	转融通流通受限
5	000166	申万宏源	6,845,904.00	0.37	转融通流通受限
6	601377	兴业证券	2,994,600.00	0.16	转融通流通受限
7	601688	华泰证券	1,390,400.00	0.08	转融通流通受限
8	600999	招商证券	897,744.00	0.05	转融通流通受限

注：本基金本报告期末持有东方财富（股票代码 300059）公允价值为 287,099,534.16 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 29,278,191.00 元，剩余部分为正常流通股票；中信证券（股票代码 600030）公允价值为 224,662,762.20 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 11,210,530.00 元，剩余部分为正常流通股票；广发证券（股票代码 000776）公允价值为 47,433,302.06 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 10,955,304.00 元，剩余部分为正常流通股票；海通证券（股票代码 600837）公允价值为 99,951,215.00 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 8,864,200.00 元，剩余部分为正常流通股票；申万宏源（股票代码 000166）公允价值为 44,658,254.16 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 6,845,904.00 元，剩余部分为正常流通股票；兴业证券（股票代码 601377）公允价值为 54,783,453.90 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 2,994,600.00 元，剩余部分为正常流通股票；华泰证券（股票代码 601688）公允价值为 96,080,669.00 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 1,390,400.00 元，剩余部分为正常流通股票；招商证券（股票代码 600999）公允价值为 74,636,420.04 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 897,744.00 元，剩余部分为正常流通股票。

#### 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	300957	贝泰妮	214,921.88	0.01	新股限售
2	688619	罗普特	156,589.44	0.01	新股限售
3	688345	博力威	129,495.96	0.01	新股限售
4	688689	银河微电	116,049.96	0.01	新股限售

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存



在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,792,187,229.66
报告期期间基金总申购份额	364,355,480.95
减：报告期期间基金总赎回份额	392,580,636.63
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	1,763,962,073.98

## § 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。

## §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全指证券公司指数分级证券投资基金的文件
- 2、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同
- 3、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金托管协议
- 4、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金财务报表及报表附注
- 5、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 6、富国中证全指证券公司指数型证券投资基金基金合同
- 7、富国中证全指证券公司指数型证券投资基金托管协议
- 8、富国中证全指证券公司指数型证券投资基金财务报表及报表附注
- 9、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07月21日