富国优质发展混合型证券投资基金

二 0 二一年中期报告

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： 中国民生银行股份有限公司

送出日期： 2021 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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.....6
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.....8
§4 管理人报告.....10
4.1 基金管理人及基金经理.....10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....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.....13
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遵规守信情况声明.....13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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).....14
6.1 资产负债表.....14
6.2 利润表.....15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....16
6.4 报表附注.....17
§7 投资组合报告.....37
7.1 期末基金资产组合情况.....37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....37
7.3 期末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.....38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....40
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.....44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....45
8.3 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.....45
§9 开放式基金份额变动.....46
§10 重大事件揭示.....46
10.1 基金份额持有人大会决议.....46
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.....46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....46
10.4 基金投资策略的改变.....46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....46
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.....46
10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....47
10.8 其他重大事件.....48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....48
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.....48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....49
§12 备查文件目录.....49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国优质发展混合型证券投资基金	
基金简称	富国优质发展混合	
基金主代码	006527	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 01 月 25 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（单位：份）	178,273,941.39	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国优质发展混合 A	富国优质发展混合 C
下属分级基金的交易代码	006527	006528
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	149,666,422.99	28,607,518.40

2.2 基金产品说明

投资目标	在严控风险的基础上，通过积极、主动的管理，挖掘中国经济发展目标从追求 GDP 增速等定量目标转向追求经济增长内在质量等定性目标过程中的各类投资机遇，力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金重点关注优质发展相关行业，包括但不限于新兴技术行业、现代服务及消费领域、供给侧结构性改革受益行业、环境保护及生态文明建设受益行业；本基金将采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例；在股票投资方面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法和 “自下而上”的选股策略，并通过定量筛选和基本面分析，挑选出优质的上市公司股票进行投资；在存托凭证投资方面，本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。在债券投资方面，本基金将采用“自上而下”的投资策略对债券类资产进行合理有效的配置，并在此框架下进行具有针对性的债券选择。本基金的中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略和金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	罗菲菲
	联系电话	021-20361818	010-58560666
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95568
传真		021-20361616	010-58560798
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	北京市西城区复兴门内大街 2 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 2 号
邮政编码		200120	100031
法定代表人		裴长江	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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 中国民生银行股份有限公司　北京市西城区复兴门内大街 2 号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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

§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

（1）富国优质发展混合 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日)

本期已实现收益	47,303,507.27
本期利润	43,001,455.12
加权平均基金份额本期利润	0.2878
本期加权平均净值利润率	14.51%
本期基金份额净值增长率	14.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	109,928,382.66
期末可供分配基金份额利润	0.7345
期末基金资产净值	315,966,069.44
期末基金份额净值	2.1111
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	147.98%

（2）富国优质发展混合 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	3,649,397.38
本期利润	4,476,331.84
加权平均基金份额本期利润	0.2956
本期加权平均净值利润率	15.05%
本期基金份额净值增长率	13.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	20,139,809.31
期末可供分配基金份额利润	0.7040
期末基金资产净值	59,410,795.76
期末基金份额净值	2.0768
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	144.07%

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

（1）富国优质发展混合 A

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	2.38%	1.05%	-1.22%	0.48%	3.60%	0.57%
过去三个月	11.47%	0.98%	2.33%	0.59%	9.14%	0.39%
过去六个月	14.10%	1.30%	0.65%	0.79%	13.45%	0.51%
过去一年	61.30%	1.35%	15.09%	0.80%	46.21%	0.55%
自基金合同生效起至今	147.98%	1.18%	37.79%	0.80%	110.19%	0.38%

（2）富国优质发展混合 C

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	2.33%	1.05%	-1.22%	0.48%	3.55%	0.57%
过去三个月	11.31%	0.98%	2.33%	0.59%	8.98%	0.39%
过去六个月	13.77%	1.30%	0.65%	0.79%	13.12%	0.51%
过去一年	60.35%	1.35%	15.09%	0.80%	45.26%	0.55%
自基金合同生效起至今	144.07%	1.18%	37.79%	0.80%	106.28%	0.38%

注：根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%

沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两市指数，该指数编制合理、透明，有一定的市场覆盖、抗操纵性强，并且有较高的知名度和市场影响力。中债综合全价指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场、不同发行主体和期限，能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。本基金的业绩比较基准能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征，合理地衡量比较本基金的业绩表现。

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：

benchmarkt =60%*[沪深 300 指数收益率 t/(沪深 300 指数收益率 t-1)-1] +40%*[中债综合全价指数收益率 t/(中债综合全价指数收益率 t-1)-1]；

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：

benchmarkT =[∏Tt=1(1+benchmarkt)]-1

其中，T=2,3,4,…；∏Tt=1(1+benchmarkt)表示 t 日至 T 日的(1+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

（1）自基金合同生效以来富国优质发展混合 A 基金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 2021 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2019 年 1 月 25 日成立，建仓期 6 个月，从 2019 年 1 月 25 日起至 2019 年 7 月 24 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

（2）自基金合同生效以来富国优质发展混合 C 基金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 2021 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2019 年 1 月 25 日成立，建仓期 6 个月，从 2019 年 1 月 25 日起至 2019 年 7 月 24 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 2021 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 212 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		
曹文俊	本基金基金经理	2019-01-25	—	16.1	硕士，曾任申银万国证券研究所助理分析师，申万巴黎基金管理有限公司研究员，交银施罗德基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、基金经理；自 2017 年 6 月加入富国基金管理有限公司，现任富国基金权益投资部高级权益基金经理。2018 年 4 月起任富国转型机遇混合型证券投资基金基金经理，2019 年 1 月起任富国优质发展混合型证券投资基金基金经理，2020 年 10 月起任富国低碳环保混合型证券投资基金（原富国低碳环保股票型证券投资基金，于 2015 年 7 月 30 日更名）基金经理，2021 年 2 月起任富国稳健策略 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理。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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国优质发展混合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》、《富国优质发展混合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 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 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 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

2021 年上半年，A 股市场呈现一波三折的走势，指数总体上涨，但波动率较大。核心资产经历了两年大幅上涨后总体估值水平偏高，对于流动性收紧预期变得非常敏感。二季度以来，银行间市场流动性超预期的宽松，新兴成长领域估值提升明显。本基金上半年净值表现跑赢市场和同业中位数水平，在一季度快速下跌过程中实现了较好的回撤控制，二季度反弹过程中组合弹性略偏小，基本跑平市场。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值 A 级为 2.1111 元，C 级为 2.0768 元；份额累计净值 A 级为 2.4201 元，C 级为 2.3828 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为 14.10%，C 级为 13.77%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 0.65%，C 级为 0.65%

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，我们认为市场将维持震荡格局，指数的上行和下行空间均有限。

当前阶段，全球宏观基本面处于经济持续复苏而流动性尚未紧缩的甜蜜期，我们需要对于未来流动性格局的变化更加紧密跟踪，重点关注美国通胀指标和就业指标以及美联储措辞上的变化。风格上，我们认为估值合理的中小市值个股性价比更具吸引力，有望成为未来一段时间超额收益的重要来源。行业配置上，我们相对看好医药、化工和油气装备、新能源汽车和光伏等行业。

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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、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方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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：富国优质发展混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 （2021 年 06 月 30 日）	上年度末 （2020 年 12 月 31 日）
资 产：		
银行存款	69,084,797.57	40,552,798.54
结算备付金	794,031.65	1,275,438.05
存出保证金	219,219.37	163,224.17
交易性金融资产	307,276,287.60	291,158,480.84
其中：股票投资	305,633,187.60	291,158,480.84
基金投资	-	-
债券投资	1,643,100.00	-
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	-	-
应收利息	7,087.67	4,784.73
应收股利	-	-
应收申购款	765,007.74	566,691.94
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	378,146,431.60	333,721,418.27
负债和所有者权益	**本期末 （2021 年 06 月 30 日）**	**上年度末 （2020 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	1,734,921.41	546,646.50
应付管理人报酬	441,365.01	405,069.99
应付托管费	73,560.81	67,511.65
应付销售服务费	26,260.33	9,281.17
应付交易费用	353,189.03	395,103.06
应交税费	36.51	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	140,233.30	50,942.06
负债合计	2,769,566.40	1,474,554.43
所有者权益：		
实收基金	178,273,941.39	179,714,799.75
未分配利润	197,102,923.81	152,532,064.09
所有者权益合计	375,376,865.20	332,246,863.84
负债和所有者权益总计	378,146,431.60	333,721,418.27

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.1056 元，基金份额总额 178,273,941.39 份。其中：富国优质发展混合 A 份额净值 2.1111 元，份额总额 149,666,422.99 份；富国优质发展混合 C 份额净值 2.0768 元，份额总额 28,607,518.40 份。

6.2 利润表

会计主体：富国优质发展混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 （2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）	上年度可比期间 （2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日）
一、收入	51,871,008.06	4,424,765.71
1.利息收入	111,910.67	16,435.10
其中：存款利息收入	101,400.56	15,854.08
债券利息收入	8,968.38	581.02
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,541.73	-
证券出借利息收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	54,487,915.14	5,090,142.48
其中：股票投资收益	49,313,226.62	4,873,407.70
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,516,333.24	117,272.59
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	1,658,355.28	99,462.19
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-3,475,117.69	-720,179.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	746,299.94	38,367.95
减：二、费用	4,393,221.10	376,993.47

1．管理人报酬	2,426,834.27	176,443.69
2．托管费	404,472.33	29,407.27
3．销售服务费	88,104.36	12,144.54
4．交易费用	1,387,154.91	148,214.06
5．利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6．税金及附加	31.88	2.15
7．其他费用	86,623.35	10,781.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	47,477,786.96	4,047,772.24
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	47,477,786.96	4,047,772.24

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国优质发展混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 （2021 年 01 月 01 日至 2021 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）	179,714,799.75	152,532,064.09	332,246,863.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	47,477,786.96	47,477,786.96
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）	-1,440,858.36	-2,906,927.24	-4,347,785.60
其中：1.基金申购款	124,774,548.86	121,887,352.56	246,661,901.42
2.基金赎回款	-126,215,407.22	-124,794,279.80	-251,009,687.02
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）	178,273,941.39	197,102,923.81	375,376,865.20
项目	上年度可比期间 （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）	21,313,743.97	5,897,495.53	27,211,239.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,047,772.24	4,047,772.24
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）	-6,747,541.57	-2,157,367.04	-8,904,908.61

其中：1.基金申购款	4,412,264.48	1,497,628.54	5,909,893.02
2.基金赎回款	-11,159,806.05	-3,654,995.58	-14,814,801.63
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）	14,566,202.40	7,787,900.73	22,354,103.13

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

富国优质发展混合型证券投资基金（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[2018]1484 号《关于准予富国优质发展混合型证券投资基金注册的批复》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 2019 年 1 月 25 日生效，首次设立募集规模为 351,455,627.02 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及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货、权证等）以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：股票及存托凭证投资占基金资产的比例 45%-90%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%）；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，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：沪深 300 指数收益率×60%+中债综合全价指数

收益率×40%。

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。

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 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。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 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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（2021 年 06 月 30 日）
活期存款	69,084,797.57
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	69,084,797.57

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（2021 年 06 月 30 日）		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		267,280,315.91	305,633,187.60	38,352,871.69
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,643,100.00	1,643,100.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,643,100.00	1,643,100.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		268,923,415.91	307,276,287.60	38,352,871.69

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（2021 年 06 月 30 日）
应收活期存款利息	6,519.03
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	357.30
应收债券利息	112.74
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	98.60
合计	7,087.67

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（2021 年 06 月 30 日）
交易所市场应付交易费用	353,189.03
银行间市场应付交易费用	-
合计	353,189.03

6.4.7.8其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2021 年 06 月 30 日）
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,438.11
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	90,000.00
预提审计费	44,795.19
合计	140,233.30

6.4.7.9实收基金

富国优质发展混合 A：

金额单位：人民币元

项目	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	168,830,171.45	168,830,171.45
本期申购	96,656,257.32	96,656,257.32
本期赎回（以“-”号填列）	-115,820,005.78	-115,820,005.78
本期末	149,666,422.99	149,666,422.99

富国优质发展混合 C：

金额单位：人民币元

项目	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,884,628.30	10,884,628.30
本期申购	28,118,291.54	28,118,291.54
本期赎回（以“-”号填列）	-10,395,401.44	-10,395,401.44
本期末	28,607,518.40	28,607,518.40

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

富国优质发展混合 A：

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	70,102,056.13	73,444,731.41	143,546,787.54
本期利润	47,303,507.27	-4,302,052.15	43,001,455.12
本期基金份额交易产生的变动数	-7,477,180.74	-12,771,415.47	-20,248,596.21
其中：基金申购款	59,682,178.96	34,974,404.33	94,656,583.29
基金赎回款	-67,159,359.70	-47,745,819.80	-114,905,179.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	109,928,382.66	56,371,263.79	166,299,646.45

富国优质发展混合 C：

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	4,300,504.02	4,684,772.53	8,985,276.55
本期利润	3,649,397.38	826,934.46	4,476,331.84
本期基金份额交易产生的变动数	12,189,907.91	5,151,761.06	17,341,668.97
其中：基金申购款	18,202,258.38	9,028,510.89	27,230,769.27

基金赎回款	-6,012,350.47	-3,876,749.83	-9,889,100.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,139,809.31	10,663,468.05	30,803,277.36

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）
活期存款利息收入	89,354.42
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	5,937.69
其他	6,108.45
合计	101,400.56

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）
卖出股票成交总额	472,968,246.31
减：卖出股票成本总额	423,655,019.69
买卖股票差价收入	49,313,226.62

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（2021年01月01日至2021年06月30日）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	15,731,869.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	12,187,211.63
减：应收利息总额	28,324.83
买卖债券差价收入	3,516,333.24

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（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）
股票投资产生的股利收益	1,658,355.28
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	1,658,355.28

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）
1.交易性金融资产	-3,475,117.69
股票投资	-3,475,117.69
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	-3,475,117.69

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）
基金赎回费收入	580,542.88
转换费收入	165,757.06
合计	746,299.94

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）
交易所市场交易费用	1,387,154.91
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	1,387,154.91

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）
审计费用	24,795.19
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	1,828.16
合计	86,623.35

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、注册登记机构、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、基金代销机构
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
中国民生银行股份有限公司	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

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（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的管理费	2,426,834.27	176,443.69
其中：支付销售机构的客户维护费	461,900.93	63,884.82

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.50%÷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，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	404,472.33	29,407.27

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计

算方法如下：
H＝E×0.25%÷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。

6.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A 级	C 级	合计
富国基金管理有限公司	-	22,727.12	22,727.12
申万宏源证券有限公司	-	407.87	407.87
中国民生银行股份有限公司	-	6,511.54	6,511.54
合计	-	29,646.53	29,646.53

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A 级	C 级	合计
富国基金管理有限公司	-	419.16	419.16
民生银行	-	390.50	390.50
申万宏源	-	20.54	20.54
合计	-	830.20	830.20

注：本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类基金份额不收取销售服务费。本基金 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×0.60%÷当年天数
H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费
E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值
基金销售服务费每日计提，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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2020 年 01 月 01 日至 2020 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
中国民生银行股份有限公司	69,084,797.57	89,354.42	2,065,074.23	14,906.92

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	300981	中红医疗	IPO 网下申购	2,530	122,932.70
海通证券股份有限公司	688626	翔宇医疗	IPO 网下申购	2,583	74,814.27
海通证券股份有限公司	688329	艾隆科技	IPO 网下申购	1,846	31,186.42

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 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：本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 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
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股限售	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股限售	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股限售	28.28	115.71	303	8,568.84	35,060.13	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	33.22	87.50	407	13,520.54	35,612.50	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	253	12,293.27	22,868.67	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股限售	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股限售	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-

301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	—
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股限售	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	—
301006	迈拓股份	2021-05-31	2021-12-07	新股限售	14.42	24.89	5,051	72,835.42	125,719.39	—
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	—
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	—
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股认购	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股认购	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	—
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股认购	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	—
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股认购	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	—
688456	有研粉材	2021-03-10	2021-09-17	新股限售	10.62	26.50	3,396	36,065.52	89,994.00	—

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
113050	南银转债	2021-06-15	2021-07-01	认购新发证券	100.00	100.00	13,980	1,398,000.00	1,398,000.00	
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	认购新发证券	100.00	100.00	1,020	102,000.00	102,000.00	
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	认购新发证券	100.00	100.00	1,431	143,100.00	143,100.00	

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

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 2021 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 2021 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。

6.4.13 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（2021 年 06 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
AAA	1,500,000.00	-
AAA 以下	143,100.00	-
未评级	-	-
合计	1,643,100.00	-

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（2021 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	69,084,797.57	—	—	—	—	—	69,084,797.57
结算备付金	794,031.65	—	—	—	—	—	794,031.65
存出保证金	219,219.37	—	—	—	—	—	219,219.37
交易性金融资产	—	—	1,643,100.00	—	—	305,633,187.60	307,276,287.60
应收利息	—	—	—	—	—	7,087.67	7,087.67
应收申购款	—	—	—	—	—	765,007.74	765,007.74
资产总计	70,098,048.59	—	1,643,100.00	—	—	306,405,283.01	378,146,431.60
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	1,734,921.41	1,734,921.41
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	441,365.01	441,365.01
应付托管费	—	—	—	—	—	73,560.81	73,560.81
应付销售服务费	—	—	—	—	—	26,260.33	26,260.33
应付交易费用	—	—	—	—	—	353,189.03	353,189.03
应付税费	—	—	—	—	—	36.51	36.51
其他负债	—	—	—	—	—	140,233.30	140,233.30
负债总计	—	—	—	—	—	2,769,566.40	2,769,566.40
利率敏感度缺口	70,098,048.59	—	1,643,100.00	—	—	303,635,716.61	375,376,865.20
上年度末（2020 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	40,552,798.54	—	—	—	—	—	40,552,798.54
结算备付金	1,275,438.05	—	—	—	—	—	1,275,438.05
存出保证金	163,224.17	—	—	—	—	—	163,224.17
交易性金融资产	—	—	—	—	—	291,158,480.84	291,158,480.84
应收利息	—	—	—	—	—	4,784.73	4,784.73
应收申购款	—	—	—	—	—	566,691.94	566,691.94
资产总计	41,991,460.76	—	—	—	—	291,729,957.51	333,721,418.27
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	546,646.50	546,646.50
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	405,069.99	405,069.99
应付托管费	—	—	—	—	—	67,511.65	67,511.65
应付销售服务费	—	—	—	—	—	9,281.17	9,281.17
应付交易费用	—	—	—	—	—	395,103.06	395,103.06
其他负债	—	—	—	—	—	50,942.06	50,942.06
负债总计	—	—	—	—	—	1,474,554.43	1,474,554.43
利率敏感度缺口	41,991,460.76	—	—	—	—	290,255,403.08	332,246,863.84

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均未持有债券资产（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

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

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，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货、权证等）以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）。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例 45%-90%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%）；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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（2021 年 06 月 30 日）		上年度末（2020 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	305,633,187.60	81.42	291,158,480.84	87.63
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	1,643,100.00	0.44	-	-
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	307,276,287.60	81.86	291,158,480.84	87.63

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（2021 年 06 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准增加 1%	5,467,997.51	4,881,289.27
	2.业绩比较基准减少 1%	-5,467,997.51	-4,881,289.27

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 2021 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 305,002,849.05 元，属于第二层次的余额为人民币 1,771,273.56 元，属于第三层次余额为人民币 502,164.99 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 0.00 元，本期变动人民币 502,164.99 元，本期末人民币 502,164.99 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	305,633,187.60	80.82
	其中：股票	305,633,187.60	80.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,643,100.00	0.43
	其中：债券	1,643,100.00	0.43
	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	69,878,829.22	18.48
8	其他各项资产	991,314.78	0.26
9	合计	378,146,431.60	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

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	5,439.50	0.00
B	采矿业	10,512.39	0.00
C	制造业	245,397,683.30	65.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,735,519.39	0.73
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	55,583.76	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	18,850.59	0.01
H	住宿和餐饮业	3,280,320.00	0.87
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,148,062.64	3.50

J	金融业	23,154,351.40	6.17
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,788,622.00	4.74
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	21,980.60	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,262.03	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	305,633,187.60	81.42

7.3 期末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	占基金资产净值比例（%）
1	603901	永创智能	1,253,600	22,602,408.00	6.02
2	603185	上机数控	119,000	21,295,050.00	5.67
3	601968	宝钢包装	1,265,300	12,096,268.00	3.22
4	002027	分众传媒	1,211,400	11,399,274.00	3.04
5	603612	索通发展	631,700	11,351,649.00	3.02
6	002182	云海金属	892,100	10,687,358.00	2.85
7	002409	雅克科技	128,900	10,440,900.00	2.78
8	002493	荣盛石化	594,772	10,271,712.44	2.74
9	002511	中顺洁柔	368,749	10,159,034.95	2.71
10	600036	招商银行	187,100	10,138,949.00	2.70
11	300529	健帆生物	115,183	9,947,203.88	2.65
12	601678	滨化股份	1,152,633	9,117,327.03	2.43
13	300724	捷佳伟创	77,240	8,960,612.40	2.39
14	300470	中密控股	230,320	8,899,564.80	2.37
15	300750	宁德时代	16,500	8,824,200.00	2.35
16	600563	法拉电子	54,300	8,598,948.00	2.29
17	000661	长春高新	20,300	7,856,100.00	2.09
18	600885	宏发股份	125,100	7,843,770.00	2.09
19	002353	杰瑞股份	166,400	7,438,080.00	1.98
20	601009	南京银行	699,500	7,358,740.00	1.96
21	600529	山东药玻	216,116	7,337,138.20	1.95
22	002318	久立特材	571,928	6,874,574.56	1.83
23	600845	宝信软件	131,950	6,716,255.00	1.79
24	002555	三七互娱	266,500	6,401,330.00	1.71
25	300662	科锐国际	105,400	6,389,348.00	1.70

26	688016	心脉医疗	14,048	6,386,361.28	1.70
27	603520	司太立	92,156	5,681,417.40	1.51
28	601601	中国太保	191,900	5,559,343.00	1.48
29	002402	和而泰	208,100	4,988,157.00	1.33
30	603920	世运电路	269,844	3,785,911.32	1.01
31	300014	亿纬锂能	35,300	3,668,729.00	0.98
32	002158	汉钟精机	128,400	3,447,540.00	0.92
33	000938	紫光股份	155,100	3,393,588.00	0.90
34	600754	锦江酒店	57,600	3,280,320.00	0.87
35	603599	广信股份	98,500	2,962,880.00	0.79
36	601689	拓普集团	76,300	2,855,909.00	0.76
37	000921	海信家电	190,300	2,734,611.00	0.73
38	600803	新奥股份	164,900	2,722,499.00	0.73
39	603906	龙蟠科技	68,460	2,396,100.00	0.64
40	002876	三利谱	14,840	960,148.00	0.26
41	300979	华利集团	4,068	452,600.40	0.12
42	688161	威高骨科	2,544	269,791.20	0.07
43	301006	迈拓股份	5,051	125,719.39	0.03
44	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.03
45	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.02
46	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
47	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.02
48	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.02
49	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
50	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.01
51	300973	立高食品	303	35,060.13	0.01
52	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
53	605089	味知香	370	32,197.40	0.01
54	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.01
55	300981	中红医疗	253	22,868.67	0.01
56	001206	依依股份	321	20,389.92	0.01
57	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.01
58	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
59	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
60	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
61	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
62	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
63	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
64	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
65	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
66	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00

67	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
68	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
69	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
70	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
71	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
72	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
73	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
74	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
75	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
76	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
77	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
78	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
79	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
80	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
81	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
82	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
83	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
84	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
85	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
86	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
87	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
88	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
89	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	603185	上机数控	16,392,819.00	4.93
2	603901	永创智能	15,859,918.72	4.77
3	002511	中顺洁柔	15,157,313.11	4.56
4	300750	宁德时代	14,669,336.00	4.42
5	601601	中国太保	12,710,773.00	3.83
6	002027	分众传媒	12,552,965.00	3.78
7	000661	长春高新	12,040,572.42	3.62
8	002142	宁波银行	11,487,729.00	3.46
9	000651	格力电器	10,765,453.00	3.24
10	603612	索通发展	10,179,327.00	3.06
11	601318	中国平安	10,124,462.00	3.05
12	002353	杰瑞股份	9,415,270.00	2.83
13	300470	中密控股	9,277,054.00	2.79

14	002555	三七互娱	9,243,509.00	2.78
15	300122	智飞生物	9,103,976.00	2.74
16	601968	宝钢包装	8,625,765.00	2.60
17	600845	宝信软件	8,539,763.76	2.57
18	601678	滨化股份	7,971,698.47	2.40
19	603520	司太立	7,882,414.48	2.37
20	002493	荣盛石化	7,690,241.45	2.31
21	600887	伊利股份	7,685,014.00	2.31
22	002032	苏泊尔	7,535,674.00	2.27
23	300724	捷佳伟创	7,400,897.20	2.23
24	601009	南京银行	7,300,220.00	2.20
25	600885	宏发股份	6,971,282.07	2.10
26	300144	宋城演艺	6,872,607.00	2.07

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	601318	中国平安	23,452,906.00	7.06
2	300122	智飞生物	22,645,613.00	6.82
3	002142	宁波银行	21,370,816.64	6.43
4	002027	分众传媒	18,089,303.96	5.44
5	600887	伊利股份	17,696,031.36	5.33
6	300014	亿纬锂能	17,085,875.64	5.14
7	000661	长春高新	16,303,716.60	4.91
8	002493	荣盛石化	15,771,149.28	4.75
9	600754	锦江酒店	15,114,146.00	4.55
10	002353	杰瑞股份	14,155,487.46	4.26
11	601601	中国太保	13,668,352.66	4.11
12	002475	立讯精密	12,835,294.94	3.86
13	000858	五粮液	12,392,611.06	3.73
14	600690	海尔智家	11,332,895.88	3.41
15	603599	广信股份	11,185,901.00	3.37
16	000651	格力电器	10,268,106.96	3.09
17	601888	中国中免	10,206,761.00	3.07
18	600438	通威股份	9,838,736.00	2.96
19	600426	华鲁恒升	9,050,428.00	2.72
20	300750	宁德时代	8,745,383.00	2.63
21	002511	中顺洁柔	8,504,348.00	2.56
22	601689	拓普集团	8,444,811.00	2.54
23	300470	中密控股	8,440,171.00	2.54

24	300144	宋城演艺	8,328,939.00	2.51
25	002180	纳思达	8,195,588.00	2.47
26	603906	龙蟠科技	7,507,106.00	2.26
27	000001	平安银行	7,198,491.60	2.17
28	002032	苏泊尔	6,931,684.00	2.09

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	441,604,844.14
卖出股票收入（成交）总额	472,968,246.31

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	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）	1,643,100.00	0.44
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,643,100.00	0.44

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	113050	南银转债	15,000	1,500,000.00	0.40
2	123117	健帆转债	1,431	143,100.00	0.04

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

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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

基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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“招商银行”的发行主体招商银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：为同业投资提供第三方信用担保、

为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；理财产品之间风险隔离不到位；理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准等 27 项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 5 月 17 日对公司做出罚款 7170 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕16 号）。

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。

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	219,219.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,087.67
5	应收申购款	765,007.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	991,314.78

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

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

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

份额级别	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（%）
富国优质发展混合 A	27,165	5,509.53	74,239,795.69	49.60	75,426,627.30	50.40
富国优质发展混合 C	2,197	13,021.17	16,344,839.79	57.13	12,262,678.61	42.87
合计	29,362	6,071.59	90,584,635.48	50.81	87,689,305.91	49.19

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	富国优质发展混合 A	569,460.53	0.3805
	富国优质发展混合 C	63,372.07	0.2215
	合计	632,832.60	0.3550

8.3 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	份额级别	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	富国优质发展混合 A	0
	富国优质发展混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富国优质发展混合 A	50~100
	富国优质发展混合 C	0
	合计	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国优质发展混合 A	富国优质发展混合 C
基金合同生效日(2019 年 01 月 25 日)基金份额总额	325,191,680.59	26,263,946.43
报告期期初基金份额总额	168,830,171.45	10,884,628.30
本报告期基金总申购份额	96,656,257.32	28,118,291.54
减：本报告期基金总赎回份额	115,820,005.78	10,395,401.44
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	149,666,422.99	28,607,518.40

§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

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。
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。

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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	2	912,001,145.32	100.00	27,938,284.80	100.00	26,700,000.00	100.00	-	-	831,098.66	100.00	-
天风证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

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旗下部分基金 2021 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	规定披露媒介	2021 年 01 月 06 日
2	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金最低定投金额的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 05 日
3	富国基金管理有限公司关于旗下由中国民生银行股份有限公司等基金托管人托管的部分基金投资范围增加存托凭证、增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 05 日
4	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 17 日
5	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 24 日
6	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021 年 04 月 20 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
机构	1	2021-01-01 至 2021-01-13	42,479,922.75	-	42,479,922.75	-	-
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《中华人民共和国证券法》、《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定自2021年3月8日起，在本基金投资范围中增加存托凭证，并对基金合同及托管协议的相应条款进行修订。具体可参见基金管理人于2021年3月5日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下由中国民生银行股份有限公司等基金托管人托管的部分基金投资范围增加存托凭证、增加C类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》及修订后的基金合同、托管协议。

§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优质发展混合型证券投资基金的文件 2、富国优质发展混合型证券投资基金基金合同 3、富国优质发展混合型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、富国优质发展混合型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	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：http://www.fullgoal.com.cn。