富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金

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：　中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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.....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.....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).....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.....16
6.4 报表附注.....17
§7 投资组合报告.....40
7.1 期末基金资产组合情况.....41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....41
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.....42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....46
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.....47
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.47
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.47
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.....47

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....47
7.12 投资组合报告附注.....48
§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.....51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....51
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.....51
§9 开放式基金份额变动.....51
§10 重大事件揭示.....52
10.1 基金份额持有人大会决议.....52
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.....52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....52
10.4 基金投资策略的改变.....52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....52
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.....52
10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....53
10.8 其他重大事件.....55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....56
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.....56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....56
§12 备查文件目录.....57

§2　基金简介

2.1　基金基本情况

基金名称	富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	富国中证军工龙头 ETF
场内简称	军工龙头 ETF
基金主代码	512710
交易代码	512710
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 07 月 23 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
报告期末基金份额总额（单位：份）	6,982,158,398.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 8 月 26 日

注：根据 2020 年 3 月 16 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分上市基金增加扩位证券简称的公告》，本基金场内简称进行了调整。

2.2　基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的资产配置策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证军工龙头指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3　基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	李申
	联系电话	021-20361818	021-60637102
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		95105686、4008880688	021-60637111
传真		021-20361616	021-60635778
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇	北京市西城区金融大街 25 号

	办公楼二座 27-30 层	
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	裴长江	田国立

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 中国建设银行股份有限公司　北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

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(2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	356,059,847.10
本期利润	-699,006,698.43
加权平均基金份额本期利润	-0.1146
本期加权平均净值利润率	-11.06%
本期基金份额净值增长率	-7.57%
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	2,089,415,422.82
期末可供分配基金份额利润	0.2993
期末基金资产净值	5,847,258,281.24
期末基金份额净值	0.8375

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	67.50%

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。

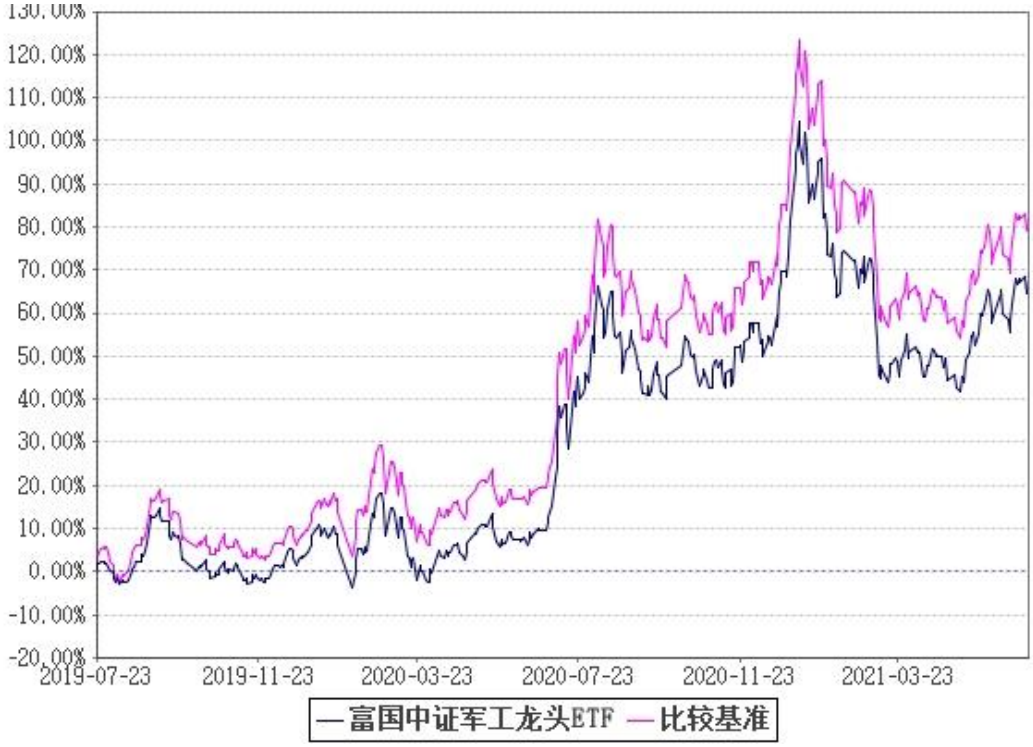
期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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	1.17%	1.78%	1.13%	1.82%	0.04%	-0.04%
过去三个月	12.04%	1.64%	11.80%	1.65%	0.24%	-0.01%
过去六个月	-7.57%	2.25%	-7.90%	2.27%	0.33%	-0.02%
过去一年	50.28%	2.31%	50.16%	2.34%	0.12%	-0.03%
自基金合同生效起至今	67.50%	2.02%	82.31%	2.06%	-14.81%	-0.04%

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 2021 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2019 年 7 月 23 日成立，建仓期 6 个月，从 2019 年 7 月 23 日起至 2020 年 1 月 22 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		
牛志冬	本基金基金经理	2019-07-23	—	14.0	硕士，曾任华夏基金管理有限公司研究员；自 2010 年 8 月加入富国基金管理有限公司，历任量化投资基金经理助理、投资经理、量化与海外投资部量化投资总监助理兼基金经理、定量基金经理；现任富国基金量化投资部量化投资副总监兼高级定量基金经理。自 2015 年 5 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）、富国中证新能源汽车指数型证券投资基金（原富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金，于 2021 年 1 月 1 日更名）基金经理，自 2016 年 11 月起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，2017 年 3 月起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 7 月起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，2017 年 11 月至 2018 年 12 月任富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 11 月至 2020 年 5 月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018 年 12 月至 2020 年 5 月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019 年 7 月起任富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
王乐乐	本基金基金经理	2019-07-23	—	11.1	博士，曾任上海证券有限责任公司研究员，华泰联合证券有限责任公司研究员，华泰证券股份有限公司研究员、创新规划团队负责人；自 2015 年 5 月加入富国基金管理有限公司，历任定量基金经理、量化投资部量化投资总监助理；现任富国基金量化投资部 ETF 投资总监兼高级定量基金经理。2015 年 8 月至 2020 年 1 月任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 7 月任富国全球债券证券投资基金基金经理，2017 年 10 月至 2020 年 1 月任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，2017 年 11 月至 2020 年 1 月任富国中证工业 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，2018 年 11 月至 2020 年 5 月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018 年 12 月至 2020 年 5 月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019 年 3 月至 2020 年 8 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 6 月至 2020 年 8 月任富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019 年 7 月起任富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019 年 9 月起任富国中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019 年 10 月起任富国中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019 年 11 月至 2020 年 12 月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 11 月起任富国中证科技 50 策略交易型开放式指数证券投资基金、富国中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，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 1 月起任富国中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 2 月起任富国中证科技 50 策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020 年 3 月起任富国中证医药 50 交易型开放式指数证券投资基金、富国中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2020 年 5 月起任富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 7 月起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，2021 年 5 月起任富国中证 800 银行交易型开放式指数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中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，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

年初以来，在中欧投资协定达成、PMI 向好、货币政策不急转弯等多重利好因素的刺激下，市场风险偏好大幅提升。在美国新一轮财政刺激落地，国内公募基金发行火爆等消息的推动下，上证指数先后突破 3500、3600 点。随着美国经济复苏预期加强，美国 10 年期国债利率快速突破 1.5%，导致全球投资者对美联储货币政策提前收缩的担忧加大，使得全球股市均出现不同程度的下跌。3 月下旬，随着上市公司年报、季报预告陆续披露，部分估值相对合理的公司开始企稳反弹。同时海外疫情再度爆发，美国 10 年期国债利率升幅放缓，A 股快速杀估值阶段告一段落，前期调整较多的板块陆续迎来反弹。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 年上半年上证综指上涨 3.4%，沪深 300 上涨 0.24%，创业板指上涨 17.22%，中证 500 指数上涨 6.93%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2021年6月30日，本基金份额净值为0.8375元；份额累计净值为1.6750元；本报告期，本基金份额净值增长率为-7.57%，同期业绩比较基准收益率为-7.90%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，由于美国非农就业人数仍未明显好转，美联储收紧货币政策仍需等待，因此 3 季度市场仍存在流动性宽松的窗口期。随着中报业绩披露，市场仍存在结构性机会。从行业配置上，随着前期成长板块大幅上涨后，需关注部分公司估值过高的风险，适当均衡配置，关注业绩与估值的匹配情况。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金未实施利润分配。

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。

§6 中期财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金

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	43,003,305.13	54,737,149.84

结算备付金	3,462,370.69	5,392,753.06
存出保证金	1,291,886.46	1,249,639.35
交易性金融资产	5,806,762,021.37	5,968,462,449.14
其中：股票投资	5,805,890,021.37	5,968,462,449.14
基金投资	—	—
债券投资	872,000.00	—
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	21,158,689.67	89,135,772.69
应收利息	206,701.27	140,512.37
应收股利	223,593.20	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	75,616.24	—
资产总计	5,876,184,184.03	6,119,118,276.45
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	24,602,711.26	93,445,301.10
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	2,382,795.54	2,179,670.29
应付托管费	476,559.11	435,934.06
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	830,243.89	397,904.52
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	633,592.99	566,687.87
负债合计	28,925,902.79	97,025,497.84
所有者权益：		
实收基金	3,491,079,199.34	3,323,329,199.00
未分配利润	2,356,179,081.90	2,698,763,579.61
所有者权益合计	5,847,258,281.24	6,022,092,778.61
负债和所有者权益总计	5,876,184,184.03	6,119,118,276.45

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8375 元，基金份额总额

6,982,158,398.00 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金

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	-669,795,036.51	480,424,712.24
1.利息收入	3,137,219.95	341,240.56
其中：存款利息收入	173,149.93	332,058.45
债券利息收入	61.16	9.31
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
证券出借利息收入	2,964,008.86	9,172.80
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	374,525,794.27	295,864,564.38
其中：股票投资收益	349,221,448.16	273,052,261.74
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	28,307.00
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	25,304,346.11	22,783,995.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,055,066,545.53	178,575,337.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7,608,494.80	5,643,570.08
减：二、费用	29,211,661.92	26,442,783.32
1．管理人报酬	15,649,890.27	13,704,841.70
2．托管费	3,129,978.04	2,740,968.34
3．销售服务费	—	—
4．交易费用	9,270,239.61	8,957,587.89
5．利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6．税金及附加	—	0.04
7．其他费用	1,161,554.00	1,039,385.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-699,006,698.43	453,981,928.92
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-699,006,698.43	453,981,928.92

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金

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）	3,323,329,199.00	2,698,763,579.61	6,022,092,778.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-699,006,698.43	-699,006,698.43
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）	167,750,000.34	356,422,200.72	524,172,201.06
其中：1.基金申购款	2,456,500,000.25	1,921,889,079.30	4,378,389,079.55
2.基金赎回款	-2,288,749,999.91	-1,565,466,878.58	-3,854,216,878.49
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）	3,491,079,199.34	2,356,179,081.90	5,847,258,281.24
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）	6,044,329,199.00	263,159,024.39	6,307,488,223.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	453,981,928.92	453,981,928.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,532,000,000.00	-200,244,930.43	-1,732,244,930.43
其中：1.基金申购款	1,160,000,000.00	79,748,902.88	1,239,748,902.88
2.基金赎回款	-2,692,000,000.00	-279,993,833.31	-2,971,993,833.31
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）	4,512,329,199.00	516,896,022.88	5,029,225,221.88

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

富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]808号《关于准予富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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2019年7月23日正式生效，首次设立募集规模为7,202,329,199.00份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、存托凭证、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）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）、现金资产以及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：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

本基金业绩比较基准为：中证军工龙头指数收益率。

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。

6.4.7 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	43,003,305.13
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	43,003,305.13

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		5,343,021,258.77	5,805,890,021.37	462,868,762.60
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	872,000.00	872,000.00	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	872,000.00	872,000.00	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		5,343,893,258.77	5,806,762,021.37	462,868,762.60

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	4,213.39
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	1,558.00
应收债券利息	61.16
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	200,287.32
其他	581.40
合计	206,701.27

6.4.7.6其他资产

单位：人民币元

项目	本期末（2021 年 06 月 30 日）
其他应收款	—
待摊费用	75,616.24

合计	75,616.24

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	830,243.89
银行间市场应付交易费用	—
合计	830,243.89

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	—
应付证券出借违约金	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	109,671.58
应付指数使用费	439,126.22
IOPV 计算发布费	24,795.19
合计	633,592.99

6.4.7.9实收基金

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	3,323,329,199.00	3,323,329,199.00
本期申购	1,960,000,000.00	1,960,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,235,000,000.00	-1,235,000,000.00
2021 年 03 月 19 日基金拆分/份额折算前	4,048,329,199.00	4,048,329,199.00
基金拆分/份额折算调整	4,048,329,199.00	-
本期申购	993,000,000.00	496,500,000.25
本期赎回（以“-”号填列）	-2,107,500,000.00	-1,053,749,999.91
本期末	6,982,158,398.00	3,491,079,199.34

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	1,676,612,863.55	1,022,150,716.06	2,698,763,579.61
本期利润	356,059,847.10	-1,055,066,545.53	-699,006,698.43

本期基金份额交易产生的变动数	56,742,712.17	299,679,488.55	356,422,200.72
其中：基金申购款	1,382,370,526.23	539,518,553.07	1,921,889,079.30
基金赎回款	-1,325,627,814.06	-239,839,064.52	-1,565,466,878.58
本期已分配利润	—	—	—
本期末	2,089,415,422.82	266,763,659.08	2,356,179,081.90

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	99,115.66
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	62,739.83
其他	11,294.44
合计	173,149.93

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	232,009,647.21
股票投资收益——赎回差价收入	117,211,800.95
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	349,221,448.16

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）
卖出股票成交总额	2,996,622,673.75
减：卖出股票成本总额	2,764,613,026.54
买卖股票差价收入	232,009,647.21

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）
赎回基金份额对价总额	3,854,216,878.49
减：现金支付赎回款总额	2,205,502,772.49
减：赎回股票成本总额	1,531,502,305.05
赎回差价收入	117,211,800.95

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期末无股票投资收益证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

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	25,304,346.11
其中：证券出借权益补偿收入	1,578,942.20
基金投资产生的股利收益	—
合计	25,304,346.11

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	-1,055,066,545.53
股票投资	-1,055,066,545.53

债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2.衍生工具	—
权证投资	—
3.其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-1,055,066,545.53

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	—
替代损益	7,608,494.80
合计	7,608,494.80

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	9,270,239.61
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	9,270,239.61

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	39,671.58
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	23,710.06
指数使用费	938,993.41
其他	99,178.95
合计	1,161,554.00

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、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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
申万宏源证券承销保荐有限责任公司（“申万宏源承销保荐”）	基金管理人的股东控制的子公司

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（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）	
	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	918,533,721.67	14.49	—	—

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）			
	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（%）
海通证券	837,059.55	14.73	828,666.03	99.81

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。本基金上年度可比期间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	15,649,890.27	13,704,841.70
其中：支付销售机构的客户维护费	2,008,945.02	5,264,399.47

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

H＝E×0.50%÷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	3,129,978.04	2,740,968.34

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷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

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	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
申万宏源	16,672,428.00	11,022.33	—	—
海通证券	327,043,818.00	248,155.16	22,481,566.00	10,799.76
上年度可比期间（2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日）				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
海通证券	7,558,300.00	3,107.48	8,003,700.00	3,107.48

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均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

6.4.10.5　各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末（2021 年 06 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
申万宏源证券有限公司	10,916,305.00	0.16	497,316.00	0.01

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（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
中国建设银行股份有限公司	43,003,305.13	99,115.66	76,098,325.21	280,875.58

6.4.10.7 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	6,003	291,685.77
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	300937	药易购	IPO 网下申购	2,434	29,816.50
海通证券股份有限公司	688217	睿昂基因	IPO 网下申购	1,040	19,252.58
海通证券股份有限公司	688685	迈信林	IPO 网下申购	2,612	23,678.04
海通证券股份有限公司	688682	霍莱沃	IPO 网下申购	946	43,467.38
海通证券股份有限公司	688092	爱科科技	IPO 网下申购	1,137	21,836.71
海通证券股份有限公司	688626	翔宇医疗	IPO 网下申购	3,652	105,776.89
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
海通证券股份有限公司	688665	四方光电	IPO 网下申购	1,687	50,066.20
海通证券股份有限公司	688687	凯因科技	IPO 网下申购	5,354	102,127.01

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	—
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股限售	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	—
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	—
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股限售	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	—
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	—
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	—
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	—
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	—
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股限售	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	—
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股限售	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	—
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股限售	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	—
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股限售	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	—
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	—
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	—
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	—
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	360	10,180.80	41,655.60	—
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	925	30,728.50	80,937.50	—
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	—
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	—
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	—
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股认购	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	—
688070	纵横股份	2021-02-02	2021-08-10	新股限售	23.16	34.47	2,407	55,746.12	82,969.29	—
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股认购	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	—
688117	圣诺生物	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	—
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	—
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股认购	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	—
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	—
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股认购	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	—
688687	凯因科技	2021-01-29	2021-08-09	新股限售	18.98	27.98	5,354	101,618.92	149,804.92	—
688689	银河微电	2021-01-15	2021-07-27	新股限售	14.01	35.62	3,258	45,644.58	116,049.96	—
688696	极米科技	2021-02-23	2021-09-03	新股限售	133.73	780.24	1,252	167,429.96	976,860.48	—

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	2021-06-17	2021-07-01	认购新发	100.	100.00	8,720	872,000.00	872,000.00	

				证券	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。

6.4.12.4　期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：　）	期末估值总额
1	000066	中国长城	2021 年 07 月 01 日-2021 年 07 月 22 日	14.60	1,755,000	25,623,000.00
2	600879	航天电子	2021 年 07 月 02 日-2021 年 07 月 19 日	7.52	1,515,700	11,398,064.00
3	000547	航天发展	2021 年 07 月 01 日-2021 年 07 月 19 日	18.87	1,253,600	23,655,432.00
4	002415	海康威视	2021 年 07 月 01 日-2021 年 07 月 27 日	64.50	1,231,400	79,425,300.00
5	600893	航发动力	2021 年 07 月 01 日-2021 年 07 月 28 日	53.19	1,032,000	54,892,080.00
6	002414	高德红外	2021 年 07 月 02 日-2021 年 07 月 28 日	27.58	958,600	26,438,188.00

7	002465	海格通信	2021年07月05日-2021年07月16日	9.46	669,300	6,331,578.00
8	000768	中航西飞	2021年07月02日-2021年07月14日	26.28	594,500	15,623,460.00
9	002389	航天彩虹	2021年07月01日-2021年07月16日	21.83	557,200	12,163,676.00
10	600372	中航电子	2021年07月01日-2021年07月28日	16.55	555,800	9,198,490.00
11	002013	中航机电	2021年07月02日-2021年07月28日	10.07	522,300	5,259,561.00
12	000738	航发控制	2021年07月02日-2021年07月09日	20.83	454,700	9,471,401.00
13	600765	中航重机	2021年07月02日-2021年07月28日	22.65	429,100	9,719,115.00
14	600562	国睿科技	2021年07月01日-2021年07月28日	15.07	399,100	6,014,437.00
15	600316	洪都航空	2021年07月01日-2021年07月28日	38.48	398,100	15,318,888.00
16	600967	内蒙一机	2021年07月14日-2021年07月28日	10.12	310,500	3,142,260.00
17	603712	七一二	2021年07月02日-2021年07月14日	36.10	290,900	10,501,490.00

18	603678	火炬电子	2021年07月01日-2021年07月19日	67.50	279,000	18,832,500.00
19	002179	中航光电	2021年07月06日-2021年07月14日	79.02	251,400	19,865,628.00
20	000021	深科技	2021年07月07日-2021年07月14日	19.14	245,700	4,702,698.00
21	600862	中航高科	2021年07月02日-2021年07月28日	30.78	224,500	6,910,110.00
22	002025	航天电器	2021年07月02日-2021年07月19日	50.17	215,000	10,786,550.00
23	600456	宝钛股份	2021年07月01日-2021年07月08日	42.90	212,300	9,107,670.00
24	600760	中航沈飞	2021年07月06日-2021年07月14日	60.30	182,400	10,998,720.00
25	600764	中国海防	2021年07月02日-2021年07月28日	28.30	158,300	4,479,890.00
26	600171	上海贝岭	2021年07月07日-2021年07月14日	30.43	155,300	4,725,779.00
27	688122	西部超导	2021年07月08日-2021年07月27日	64.87	114,900	7,453,563.00
28	000733	振华科技	2021年07月05日-2021年07月08日	61.07	104,000	6,351,280.00

29	300726	宏达电子	2021年07月06日-2021年07月14日	70.49	103,300	7,281,617.00
30	600990	四创电子	2021年07月14日-2021年07月28日	39.77	63,000	2,505,510.00
31	002916	深南电路	2021年07月05日-2021年07月23日	111.13	56,700	6,301,071.00
32	600038	中直股份	2021年07月05日-2021年07月28日	52.74	53,400	2,816,316.00
33	002049	紫光国微	2021年07月05日-2021年07月07日	154.19	40,000	6,167,600.00
34	300747	锐科激光	2021年07月02日-2021年07月28日	114.06	34,800	3,969,288.00
合计	-	-	-	-	15,421,800.00	457,432,210.00

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%，但标的指数成分券不受此限。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	872,000.00	—
AAA 以下	—	—
未评级	—	—
合计	872,000.00	—

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	43,003,305.13	—	—	—	—	—	43,003,305.13
结算备付金	3,462,370.69	—	—	—	—	—	3,462,370.69
存出保证金	1,291,886.46	—	—	—	—	—	1,291,886.46
交易性金融资产	—	—	872,000.00	—	—	5,805,890,021.37	5,806,762,021.37
应收证券清算款	—	—	—	—	—	21,158,689.67	21,158,689.67
应收利息	—	—	—	—	—	206,701.27	206,701.27
应收股利	—	—	—	—	—	223,593.20	223,593.20
其他资产	—	—	—	—	—	75,616.24	75,616.24
资产总计	47,757,562.28	—	872,000.00	—	—	5,827,554,621.75	5,876,184,184.03
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	24,602,711.26	24,602,711.26
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,382,795.54	2,382,795.54
应付托管费	—	—	—	—	—	476,559.11	476,559.11
应付交易费用	—	—	—	—	—	830,243.89	830,243.89
其他负债	—	—	—	—	—	633,592.99	633,592.99
负债总计	—	—	—	—	—	28,925,902.79	28,925,902.79
利率敏感度缺口	47,757,562.28	—	872,000.00	—	—	5,798,628,718.96	5,847,258,281.24
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	54,737,149.84	—	—	—	—	—	54,737,149.84
结算备付金	5,392,753.06	—	—	—	—	—	5,392,753.06
存出保证金	1,249,639.35	—	—	—	—	—	1,249,639.35
交易性金融资产	—	—	—	—	—	5,968,462,449.14	5,968,462,449.14
应收证券清算款	—	—	—	—	—	89,135,772.69	89,135,772.69
应收利息	—	—	—	—	—	140,512.37	140,512.37
资产总计	61,379,542.25	—	—	—	—	6,057,738,734.20	6,119,118,276.45
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	93,445,301.10	93,445,301.10
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,179,670.29	2,179,670.29
应付托管费	—	—	—	—	—	435,934.06	435,934.06
应付交易费用	—	—	—	—	—	397,904.52	397,904.52
其他负债	—	—	—	—	—	566,687.87	566,687.87
负债总计	—	—	—	—	—	97,025,497.84	97,025,497.84
利率敏感度缺口	61,379,542.25	—	—	—	—	5,960,713,236.36	6,022,092,778.61

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

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

基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。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	5,805,890,021.37	99.29	5,968,462,449.14	99.11
交易性金融资产－基金投资	－	－	－	－
交易性金融资产－债券投资	872,000.00	0.01	－	－
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	5,806,762,021.37	99.31	5,968,462,449.14	99.11

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%	57,890,820.05	59,441,603.31
	2.业绩比较基准减少 1%	-57,890,820.05	-59,441,603.31

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 5,803,360,426.10 元，属于第二层次的余额为人民币 1,205,446.37 元，属于第三层次余额为人民币 2,196,148.90 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 1,746,510.19 元，本期变动人民币 449,638.71 元，本期末人民币 2,196,148.90 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	5,805,890,021.37	98.80
	其中：股票	5,805,890,021.37	98.80
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	872,000.00	0.01
	其中：债券	872,000.00	0.01
	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	46,465,675.82	0.79
8	其他各项资产	22,956,486.84	0.39
9	合计	5,876,184,184.03	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 457,432,210.00 元，占资产净值比例为 7.82%。

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	5,439.50	0.00
B	采矿业	—	—
C	制造业	2,859,271.32	0.05
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	55,057.62	0.00
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—

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	3,051,587.99	0.05

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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	5,802,837,923.78	99.24
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	—	—
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	5,802,837,923.78	99.24

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	002415	海康威视	11,489,224	741,054,948.00	12.67
2	002049	紫光国微	3,320,675	512,014,878.25	8.76
3	600893	航发动力	8,681,002	461,742,496.38	7.90

4	002179	中航光电	4,488,366	354,670,681.32	6.07
5	000768	中航西飞	11,309,794	297,221,386.32	5.08
6	600760	中航沈飞	4,809,305	290,001,091.50	4.96
7	002414	高德红外	7,671,611	211,583,031.38	3.62
8	000066	中国长城	14,347,900	209,479,340.00	3.58
9	000547	航天发展	10,485,320	197,857,988.40	3.38
10	000733	振华科技	2,946,696	179,954,724.72	3.08
11	600862	中航高科	5,689,416	175,120,224.48	2.99
12	002013	中航机电	15,728,450	158,385,491.50	2.71
13	603678	火炬电子	2,251,453	151,973,077.50	2.60
14	002465	海格通信	15,061,300	142,479,898.00	2.44
15	600316	洪都航空	3,508,824	135,019,547.52	2.31
16	600879	航天电子	17,766,166	133,601,568.32	2.28
17	600038	中直股份	2,408,730	127,036,420.20	2.17
18	002389	航天彩虹	5,366,773	117,156,654.59	2.00
19	688122	西部超导	1,782,015	115,599,313.05	1.98
20	002025	航天电器	2,097,230	105,218,029.10	1.80
21	600765	中航重机	4,601,919	104,233,465.35	1.78
22	600372	中航电子	6,293,356	104,155,041.80	1.78
23	000738	航发控制	4,679,270	97,469,194.10	1.67
24	603712	七一二	2,487,961	89,815,392.10	1.54
25	600456	宝钛股份	1,952,912	83,779,924.80	1.43
26	600967	内蒙一机	6,954,338	70,377,900.56	1.20
27	300726	宏达电子	932,650	65,742,498.50	1.12
28	600562	国睿科技	3,996,686	60,230,058.02	1.03
29	002985	北摩高科	596,900	58,197,750.00	1.00
30	002916	深南电路	482,561	53,627,003.93	0.92
31	600764	中国海防	1,703,117	48,198,211.10	0.82
32	000021	深科技	2,156,100	41,267,754.00	0.71
33	600171	上海贝岭	1,312,000	39,924,160.00	0.68
34	300747	锐科激光	330,600	37,708,236.00	0.64
35	600990	四创电子	777,987	30,940,542.99	0.53

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	688696	极米科技	1,252	976,860.48	0.02
2	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.01
3	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
4	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.00

5	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.00
6	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
7	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.00
8	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
9	688070	纵横股份	2,407	82,969.29	0.00
10	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
11	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
12	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.00
13	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
14	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
15	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
16	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
17	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
18	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
19	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
20	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
21	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
22	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
23	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
24	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
25	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
26	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
27	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
28	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
29	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
30	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
31	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
32	300882	万胜智能	572	9,981.40	0.00
33	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
34	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
35	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
36	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
37	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
38	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
39	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
40	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
41	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
42	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
43	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
44	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
45	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00

46	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
47	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
48	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
49	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
50	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
51	300699	光威复材	82	6,227.90	0.00
52	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
53	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
54	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
55	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
56	002368	太极股份	232	4,653.92	0.00
57	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
58	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
59	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
60	600271	XD 航天信	316	4,117.48	0.00
61	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
62	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
63	600184	光电股份	236	2,565.32	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	002415	海康威视	521,591,449.29	8.66
2	002049	紫光国微	490,370,120.72	8.14
3	000768	中航西飞	278,899,317.94	4.63
4	002179	中航光电	255,750,282.42	4.25
5	000066	中国长城	187,967,558.29	3.12
6	000547	航天发展	187,350,244.33	3.11
7	002414	高德红外	178,900,588.37	2.97
8	002013	中航机电	141,292,553.61	2.35
9	000733	振华科技	127,327,997.34	2.11
10	300699	光威复材	126,215,952.11	2.10
11	002465	海格通信	116,536,877.68	1.94
12	002389	航天彩虹	110,635,601.58	1.84
13	002025	航天电器	88,543,865.59	1.47
14	000738	航发控制	78,308,840.05	1.30
15	300726	宏达电子	69,068,543.73	1.15
16	002985	北摩高科	60,627,987.60	1.01
17	002916	深南电路	53,277,129.92	0.88
18	000021	深科技	40,678,219.72	0.68

19	300747	锐科激光	34,463,497.64	0.57
20	600171	上海贝岭	32,440,539.92	0.54

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	002415	海康威视	562,830,112.64	9.35
2	300699	光威复材	266,868,160.67	4.43
3	002179	中航光电	250,890,762.18	4.17
4	000768	中航西飞	249,509,950.31	4.14
5	000066	中国长城	171,997,343.52	2.86
6	000547	航天发展	166,270,794.63	2.76
7	002414	高德红外	158,367,879.67	2.63
8	600118	中国卫星	154,411,645.30	2.56
9	002013	中航机电	132,219,390.41	2.20
10	000733	振华科技	122,708,002.67	2.04
11	002465	海格通信	113,346,016.31	1.88
12	002389	航天彩虹	82,582,858.83	1.37
13	002025	航天电器	81,406,641.57	1.35
14	000738	航发控制	73,503,163.93	1.22
15	600705	中航产融	72,511,686.70	1.20
16	002916	深南电路	61,748,610.32	1.03
17	600271	航天信息	52,017,903.38	0.86
18	002368	太极股份	50,606,424.35	0.84
19	600184	光电股份	24,586,749.00	0.41
20	600893	航发动力	24,256,488.96	0.40

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	3,350,219,600.63
卖出股票收入（成交）总额	2,996,622,673.75

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）	872,000.00	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	872,000.00	0.01

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	8,720	872,000.00	0.01

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，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

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

本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，在风险可控的基础上，

以套期保值为目的，参与国债期货的投资，以降低跟踪误差。

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	1,291,886.46
2	应收证券清算款	21,158,689.67
3	应收股利	223,593.20
4	应收利息	206,701.27
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	—
9	合计	22,956,486.84

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002415	海康威视	79,425,300.00	1.36	转融通流通受限
2	600893	航发动力	54,892,080.00	0.94	转融通流通受限
3	002414	高德红外	26,438,188.00	0.45	转融通流通受限
4	000066	中国长城	25,623,000.00	0.44	转融通流通受限
5	000547	航天发展	23,655,432.00	0.40	转融通流通受限
6	002179	中航光电	19,865,628.00	0.34	转融通流通受限
7	000768	中航西飞	15,623,460.00	0.27	转融通流通受限
8	600760	中航沈飞	10,998,720.00	0.19	转融通流通受限
9	000733	振华科技	6,351,280.00	0.11	转融通流通受限
10	002049	紫光国微	6,167,600.00	0.11	转融通流通受限

注：本基金本报告期末持有海康威视（股票代码 002415）公允价值为 741,054,948.00 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 79,425,300.00 元，剩余部分为正常流通股票；航发动力（股票代码 600893）公允价值为 461,742,496.38 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 54,892,080.00 元，剩余部分为正常流通股票；高德红外（股票代码 002414）公允价值为 211,583,031.38 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 26,438,188.00 元，剩余部分为正常流通股票；中国长城（股票代码 000066）公允价值为 209,479,340.00 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 25,623,000.00 元，剩余部分为正常流通股票；航天发展（股票代码 000547）公允价值为 197,857,988.40 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 23,655,432.00 元，剩余部分为正常流通股票；中航光电（股票代码 002179）公允价值为 354,670,681.32 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 19,865,628.00

元，剩余部分为正常流通股票；中航西飞（股票代码 000768）公允价值为 297,221,386.32 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 15,623,460.00 元，剩余部分为正常流通股票；中航沈飞（股票代码 600760）公允价值为 290,001,091.50 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 10,998,720.00 元，剩余部分为正常流通股票；振华科技（股票代码 000733）公允价值为 179,954,724.72 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 6,351,280.00 元，剩余部分为正常流通股票；紫光国微（股票代码 002049）公允价值为 512,014,878.25 元，其中转融通流通受限股票部分公允价值为 6,167,600.00 元，剩余部分为正常流通股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688696	极米科技	976,860.48	0.02	新股限售
2	300957	贝泰妮	214,921.88	0.00	新股限售
3	688687	凯因科技	149,804.92	0.00	新股限售
4	688689	银河微电	116,049.96	0.00	新股限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
85,432	81,727.67	3,837,762,404.00	54.97	3,144,395,994.00	45.03

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国航空工业集团有限公司	1,107,925,000	15.87
2	汉中航空工业（集团）有限公司	933,168,600	13.37
3	中航投资控股有限公司	609,891,800	8.74
4	哈尔滨飞机工业集团有限责任公司	431,531,962	6.18
5	中国贵州航空工业（集团）有限责任公司	160,400,000	2.30
6	中国人民财产保险股份有限公司－传统－普通保险产品－008C－CT001沪	100,000,000	1.43
7	东兴证券股份有限公司	42,421,600	0.61
8	中信保诚人寿保险有限公司－盛世优选投资账户	35,000,000	0.50
9	中国航空科技工业股份有限公司	34,800,000	0.50
10	胡伟华	34,581,376	0.50

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理公司所有从业人员持有本基金	8,200.00	0.0001

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019 年 07 月 23 日)基金份额总额	7,202,329,199.00
报告期期初基金份额总额	3,323,329,199.00

本报告期基金总申购份额	2,953,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,342,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	4,048,329,199.00
本报告期期末基金份额总额	6,982,158,398.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
渤海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
长江证券	3	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
德邦证券	2	102,955,196.32	1.62	—	—	—	—	—	—	1,164.15	0.02	—
东北证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
东财证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
方正证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
高华证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
广发证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国盛证券	2	6,469,788.92	0.10	—	—	—	—	—	—	5,896.01	0.10	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国信证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

海通证券	2	918,533,721.67	14.49	—	—	—	—	—	—	837,059.55	14.73	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
平安证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
西南证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中航证券	2	5,309,944,696.61	83.78	—	—	—	—	—	—	4,838,970.17	85.15	—
中金公司	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	3	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信建投	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中银证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金退租券商交易单元：中金公司（010919、48233）。本报告期本基金新增券商交易单元：中泰证券（38659）,长江证券（720709）,德邦证券（012561、50401）。

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 01 月 21 日
2	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 01 月 30 日
3	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 02 月 03 日
4	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
5	富国基金管理有限公司关于旗下由中国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 06 日
6	关于富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分及相关业务安排的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 10 日
7	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 13 日
8	关于富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分及相关业务安排的第一次提示性公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 15 日
9	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
10	关于富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分及相关业务安排的第二次提示性公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 18 日
11	关于富国中证军工龙头交易型开放式	规定披露媒介	2021 年 03 月 22 日

	指数证券投资基金基金份额拆分结果及恢复交易和申购、赎回的公告		
12	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
13	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同及托管协议的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 30 日
14	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 14 日
15	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
16	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 05 月 06 日
17	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 05 月 10 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、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 9 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 6 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下由中国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。

二、本报告期，经与基金托管人、上海证券交易所协商一致，基金管理人决定对本基金实施份额拆分，份额拆分日（2021 年 3 月 19 日）经本基金托管人中国建设银行股份有限公司复核的本基金拆分前的基金份额总额为 4,048,329,199.00 份，基金份额净值为 1.4839 元。本基金基金份额拆分比例为 1:2，拆分后基金份额总额为 8,096,658,398.00 份，拆分后基金份额净值为 0.7419 元。本基金管理人已按照上述拆分比例，对 2021 年 3 月 18 日（权益登记日）登记在册的各基

金份额持有人的基金份额进行了拆分，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于 2021 年 3 月 19 日完成了变更登记。具体可参见基金管理人于 2021 年 3 月 10 日发布的《关于富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分及相关业务安排的公告》、2021 年 3 月 22 日发布的《关于富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果及恢复交易和申购、赎回的公告》及相关提示性公告。 三、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》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》、《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 31 日起，对本基金的基金合同及托管协议的相应条款进行修订，增加《指数基金指引》规定的相关内容。具体可参见基金管理人于 2021 年 3 月 30 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金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中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金的文件 2、富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金合同 3、富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊	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。

上披露的各项公告		