

华富中证 100 指数证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本半年度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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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。

基金管理人承诺以诚实信用、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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
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	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
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	46

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	46
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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情况	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富中证 100 指数证券投资基金
基金简称	华富中证 100 指数
基金主代码	410008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 30 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	78,633,809.89 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资约束和数量化风险控制，力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35% 和年跟踪误差不超过 4%，以实现中证 100 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，本基金的标的指数为中证 100 指数。本基金原则上采用完全复制指数的投资策略，即按照标的指数成份股及其权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，力争净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差最小化。
业绩比较基准	中证 100 指数收益率 $\times 95\%$ + 一年期银行定期存款收益率（税后） $\times 5\%$
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。一般情况下，其风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华富基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	满志弘	陆志俊
	联系电话	021-68886996	95559
	电子邮箱	manzh@hffund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-700-8001	95559
传真		021-68887997	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		赵万里	任德奇

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	http://www.hffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	31,692,816.15
本期利润	7,684,160.08
加权平均基金份额本期利润	0.0648
本期加权平均净值利润率	2.81%
本期基金份额净值增长率	3.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	89,150,018.64
期末可供分配基金份额利润	1.1337
期末基金资产净值	183,003,106.51
期末基金份额净值	2.3273
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	132.73%

注：1) 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。

2) 以上所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等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3) 期末可供分配利润指标的计算方法为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期末余额的孰低数，表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日。

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	-0.53%	0.69%	-3.50%	0.73%	2.97%	-0.04%
过去三个月	4.54%	0.93%	-0.21%	0.96%	4.75%	-0.03%
过去六个月	3.45%	1.26%	-2.63%	1.28%	6.08%	-0.02%
过去一年	39.37%	1.24%	22.95%	1.27%	16.42%	-0.03%
过去三年	90.56%	1.27%	42.70%	1.29%	47.86%	-0.02%
自基金合同生效起至今	132.73%	1.37%	53.40%	1.37%	79.33%	0.00%

注：业绩比较基准收益率=中证 100 指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率（税后）×5%，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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：根据基金合同的规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数的成份股及其备选成份股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，本基金投资于中证 100 指数的成份股及其备选成份股的比例为基金资产的 90%~95%，基金保留的现金以及投资

于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为 2009 年 12 月 30 日至 2010 年 6 月 30 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富中证 100 指数证券投资基金基金合同》的相关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用融资担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中债-0-5 年中高等级信用债收益平衡指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金和华富新能源股票

型发起式证券投资基金共四十六只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郜哲	华富中证 100 指数基金基金经理、华富中小企业 100 指数增强型基金基金经理、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型基金基金经理、华富中证人工智能产业交易型开放式指数基金基金经理、华富中债-0-5 年中高等级信用债收益平衡指数基金基金经理、华富中证人工智能产业交易型开放式指数基金联接基金基金经理、华富中债-安徽省公司信用类债券指	2018 年 2 月 23 日	-	七年	北京大学理学博士，研究生学历。先后担任方正证券股份有限公司博士后研究员、上海同安投资管理有限公司高级研究员。2017 年 4 月加入华富基金管理有限公司，2018 年 2 月 23 日至 2020 年 11 月 11 日任华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理。

	数基金基金 经理、 华富中证 证券公司 先锋策略 交易型开 放式指数 基金基金 经理、华 富新能源 股票型发 起式基金 基金经理				
李 孝 华	华富中证 100 指数 基金基金 经理、华 富中证证 券公司先 锋策略交 易型开放 式指数基 金基金经 理	2021 年 5 月 7 日		八年	南开大学金融学硕士、硕士研究生学历。 曾任金瑞期货研究所贵金属研究员、国泰 安信息技术有限公司量化投资平台设计与 开发员、华泰柏瑞基金基金经理助理。2019 年 10 月加入华富基金管理有限公司，曾任 基金经理助理。

注：这里的任职日期为公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上，证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，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全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上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。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价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的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年的市场仍呈现出明显的结构化行情，二三月份抱团板块出现了较大幅度的调整，低估值板块则表现相对抗跌。然后在 3 月中旬以后，以芯片、新能源车、光伏及创新药为代表的科技股持续表现靓丽，聚焦这些领域的创业板指数表现突出，而期间价值板块又开始重归平淡。

中证 100 指数作为均衡配置的典型代表，由于在新能源、半导体等热点板块上的配置比例并不算高，今年上半年表现一般，期间指数下跌 2.85%。同期华富中证 100 受益于打新则上涨 3.45%，相对业绩基准存在着 6.3% 的超额收益。本基金为完全复制的指数基金，报告期实现了对业绩基准的有效跟踪，并通过打新策略，明显增厚了基金收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，本基金份额净值为 2.3273 元，累计份额净值为 2.3273 元。报告期，本基金份额净值增长率为 3.45%，同期业绩比较基准收益率为 -2.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前市场依然呈现出极端分化的态势，一半冰山一半火焰，贵的更贵便宜的更便宜。我们认为长期来看这一趋势不太可能永远持续下去，估值的锚迟早会起作用的。部分行业虽然发展前景良好，但估值已经处于历史极高位，未来依赖于业绩去消化高高在上的估值是大概率事件；部分行业发展前景相对逊色，但其估值处于历史低位，哪怕公司未来业绩保持现有状态不增长也未必没有配置价值。

当前不少投资者存在着非常强的焦虑心理，一方面担心极致的分化行情继续延续下去，持有低估值板块存在踏空风险；另一方面又担心自己成为高估值板块的最后一个接棒者。客观说，有些事情我们认为未来大概率会发生，但什么时候发生并不清楚，那么这个时候继续进行组合的均衡配置，投资价值&成长、周期&非周期兼顾的中证 100 将是一个相对不错的选择。

中证 100 指数作为 A 股市场龙头公司的典型代表，龙头公司的业绩相对稳定，大家对它的担忧不在于业绩而是估值。今年春节以来中证 100 指数出现了 20% 级别的调整，通过调整市场对于龙头公司估值较高的担忧得以缓解。2015 年以来中证 100 指数的估值也从今年春节前的历史偏高位置回到了当下的合理区间。

本基金将继续跟踪好标的指数，同时辅以打新策略，为投资者提供投资中证 100 的有力工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富中证 100 指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 7,684,160.08 元，期末可供分配利润为 89,150,018.64 元。本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

2021 年上半年度，基金托管人在华富中证 100 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2021 年上半年度，华富基金管理有限公司在华富中证 100 指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2021 年上半年度，由华富基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华富中证 100 指数证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华富中证 100 指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	13,108,549.76	20,798,154.16
结算备付金		32,665.58	79,344.58
存出保证金		15,319.86	24,572.61
交易性金融资产	6.4.7.2	170,759,826.40	256,022,979.34
其中：股票投资		170,759,826.40	256,022,979.34
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		424,082.02	—
应收利息	6.4.7.5	6,138.43	4,298.09
应收股利		—	—
应收申购款		206,561.78	302,898.48
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		184,553,143.83	277,232,247.26
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 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	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	1,836,603.03
应付赎回款		1,103,730.29	504,294.86

应付管理人报酬		100,938.51	110,971.29
应付托管费		30,281.59	33,291.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	132,075.05	2,605.47
应交税费		-	0.09
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	183,011.88	210,698.59
负债合计		1,550,037.32	2,698,464.70
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	78,633,809.89	122,032,260.11
未分配利润	6.4.7.10	104,369,296.62	152,501,522.45
所有者权益合计		183,003,106.51	274,533,782.56
负债和所有者权益总计		184,553,143.83	277,232,247.26

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.3273 元，基金份额总额 78,633,809.89 份。

6.2 利润表

会计主体：华富中证 100 指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		9,075,197.45	3,614,133.89
1. 利息收入		83,644.75	61,090.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	74,486.40	61,090.64
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,158.35	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		32,907,883.65	13,015,859.15
其中：股票投资收益	6.4.7.12	31,000,058.04	10,525,478.11
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收	6.4.7.13.5	-	-

益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,907,825.61	2,490,381.04
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-24,008,656.07	-9,580,868.30
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	92,325.12	118,052.40
减：二、费用		1,391,037.37	1,183,345.61
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	680,028.30	591,700.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	204,008.51	177,510.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	326,962.40	234,201.61
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	180,038.16	179,933.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,684,160.08	2,430,788.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,684,160.08	2,430,788.28

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富中证 100 指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 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）	122,032,260.11	152,501,522.45	274,533,782.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,684,160.08	7,684,160.08
三、本期基金份额交易产生的基	-43,398,450.22	-55,816,385.91	-99,214,836.13

金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中: 1. 基金申 购款	24,093,803.91	32,017,764.67	56,111,568.58
2. 基金赎 回款	-67,492,254.13	-87,834,150.58	-155,326,404.71
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)	78,633,809.89	104,369,296.62	183,003,106.51
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 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)	149,301,779.83	93,153,383.03	242,455,162.86
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数(本期 利润)	-	2,430,788.28	2,430,788.28
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)	-21,557,665.02	-10,004,397.59	-31,562,062.61
其中: 1. 基金申 购款	40,462,602.60	24,191,570.42	64,654,173.02
2. 基金赎 回款	-62,020,267.62	-34,195,968.01	-96,216,235.63
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)	127,744,114.81	85,579,773.72	213,323,888.53

注: 后附报表附注为本财务报表的组成部分。

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：

赵万里

曹华玮

邵恒

基金管理人负责人

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

华富中证 100 指数型证券投资基金（以下简称本基金或基金）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【2009】1158 号）核准，基金合同于 2009 年 12 月 30 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集资金到位情况经天健光华（北京）会计师事务所审验，并出具《验资报告》（天健光华验（2009）综字第 070007 号）。有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《华富中证 100 指数型证券投资基金基金合同》的规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数的成份股及其备选成份股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

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，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1 号）、《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》（财税〔2012〕85 号）、《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》（财税〔2015〕101 号）、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36 号）、《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》（财税〔2016〕46 号）、《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》（财税〔2016〕140 号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56 号）、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》（财税〔2016〕70 号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税〔2017〕90 号）及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- （一）自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品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。
- （二）对基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收企业所得税；
- （三）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。

主要税种及税率列示如下：

税 种	计 税 依 据	税 率
增值税	金融服务销售额	3%
城市维护建设税	应缴流转税税额	7%
教育费附加	应缴流转税税额	3%
地方教育附加[注]	应缴流转税税额	1%、2%

[注]：接地方税务局通知，自 2019 年 7 月 1 日起调整地方教育附加税税率，由原来的 1% 调整为 2%。

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 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	13,108,549.76
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	13,108,549.76

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	138,925,784.70	170,759,826.40	31,834,041.70
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	138,925,784.70	170,759,826.40	31,834,041.70

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/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：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	6,116.83
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	14.70

应收债券利息	-
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	6.90
合计	6,138.43

注：本表列示的其他为应收结算保证金利息。

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 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	132,075.05
银行间市场应付交易费用	-
合计	132,075.05

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,668.72
应付证券出借违约金	-
应付信息披露费	59,507.37
应付审计费	19,835.79
应付指数使用费	100,000.00
合计	183,011.88

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	122,032,260.11	122,032,260.11
本期申购	24,093,803.91	24,093,803.91
本期赎回（以“-”号填列）	-67,492,254.13	-67,492,254.13
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	78,633,809.89	78,633,809.89
-----	---------------	---------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	100,245,446.07	52,256,076.38	152,501,522.45
本期利润	31,692,816.15	-24,008,656.07	7,684,160.08
本期基金份额交易产生的变动数	-42,788,243.58	-13,028,142.33	-55,816,385.91
其中：基金申购款	20,933,356.77	11,084,407.90	32,017,764.67
基金赎回款	-63,721,600.35	-24,112,550.23	-87,834,150.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	89,150,018.64	15,219,277.98	104,369,296.62

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	73,595.07
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	752.51
其他	138.82
合计	74,486.40

注：其他所列本期金额为结算保证金利息收入。

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1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	31,000,058.04
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	31,000,058.04

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	136,118,876.01
减：卖出股票成本总额	105,118,817.97
买卖股票差价收入	31,000,058.04

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,907,825.61
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	1,907,825.61

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-24,008,656.07
股票投资	-24,008,656.07
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	-24,008,656.07

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	92,183.60
基金转换费收入	141.52
合计	92,325.12

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	326,962.40
银行间市场交易费用	—
合计	326,962.40

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	695.00
指数使用费	100,000.00
合计	180,038.16

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

无

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化

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
华富基金管理有限公司	基金管理人
交通银行股份有限公司（“交通银行股份有限公司”）	基金托管人
华安证券（“华安证券”）	基金管理人的股东

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 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 (%)
华安证券	169,927,125.11	100.00	94,643,622.48	75.47

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
华安证券	36,200,000.00	100.00	-	-

注：本基金上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期 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 (%)
华安证券	157,178.10	100.00	132,075.05	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			

	当期 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 (%)
华安证券	88,141.26	75.87	45,179.38	73.95

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	680,028.30	591,700.67
其中：支付销售机构的客户维护费	112,138.97	59,741.69

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.50%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	204,008.51	177,510.21

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

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：本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：报告期内未发生转融通证券出借业务

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无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。

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：本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有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

注：本基金本报告期内和上年度可比期间基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	13,108,549.76	73,595.07	15,337,924.69	59,550.01

注：1) 本表仅列示活期存款余额及产生利息。

2) 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。本期末和上年度末的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无

6.4.11 利润分配情况

6.4.12 期末(2021 年 6 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟	2020	2021	新股流	24.60	163.00	241	5,928.60	39,283.00	-

	股份	年 12 月 15 日	年 7 月 2 日	通受限						
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 07 月 12 日	新股流 通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流 通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流 通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流 通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流 通受限	24.69	31.71	389	9,604.41	12,335.19	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流 通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股流 通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股流 通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流 通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流 通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流 通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股流 通受限	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股流 通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-

300952	恒辉 安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股流 通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕 科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股流 通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨 家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股流 通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力 股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股流 通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰 妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股流 通受限	47.33	251.96	175	8,282.75	44,093.00	-
300958	建工 修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股流 通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业 科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股流 通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水 海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股流 通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金 辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股流 通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲 特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股流 通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同 药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股流 通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣 股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股流 通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林 精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股流 通受限	6.87	12.07	937	6,437.19	11,309.59	-

300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	28.28	115.71	192	5,429.76	22,216.32	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	33.22	87.50	278	9,235.16	24,325.00	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股流通受限	24.90	24.81	227	5,652.30	5,631.87	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300996	普联	2021	2021	新股流	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-

	软件	年 5 月 26 日	年 12 月 3 日	通受限						
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股流 通受限	4.94	13.05	910	4,495.40	11,875.50	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股流 通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股流 通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新股流 通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股流 通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流 通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股流 通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股流 通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股流 通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股流 通受限	8.86	8.86	5,550	49,173	49,173	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流 通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流 通受限	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-

600905	三峡能源	2021 年 6 月 2 日	2021 年 12 月 10 日	新股流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688083	中望软件	2021 年 3 月 4 日	2021 年 9 月 13 日	新股流通受限	150.50	524.08	599	90,149.50	313,923.92	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股流通受限	21.96	21.96	2,172	47,697.12	47,697.12	-
688097	博众精工	2021 年 4 月 29 日	2021 年 11 月 12 日	新股流通受限	11.27	28.01	3,958	44,606.66	110,863.58	-
688131	皓元医药	2021 年 6 月 1 日	2021 年 12 月 8 日	新股流通受限	64.99	247.10	1,212	78,767.88	299,485.20	-
688195	腾景科技	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股流通受限	13.60	19.87	2,693	36,624.80	53,509.91	-
688201	信安世纪	2021 年 4 月 13 日	2021 年 10 月 21 日	新股流通受限	26.78	45.41	2,129	57,014.62	96,677.89	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688328	深科达	2021 年 3 月 1 日	2021 年 9 月 9 日	新股流通受限	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股流通受限	38.85	38.85	1,819	70,668.15	70,668.15	-
688538	和辉光电	2021 年 5 月	2021 年 11	新股流通受限	2.65	3.38	51,021	135,205.65	172,450.98	-

		20 日	月 29 日							
688662	富信科技	2021 年 3 月 25 日	2021 年 10 月 8 日	新股流通受限	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56	-
688686	奥普特	2020 年 12 月 24 日	2021 年 7 月 1 日	新股流通受限	78.49	451.00	932	73,152.68	420,332.00	-

注：实际可流通日以该证券公告为准。本报告期间若有除权，认购价格为除权后价格，数量为期末实际持有数量。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：期末无参与转融通证券出借业务的证券

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，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。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 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。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投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6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	13,108,549.76	-	-	-	-	-	13,108,549.76
结算备付金	32,665.58	-	-	-	-	-	32,665.58
存出保证金	15,319.86	-	-	-	-	-	15,319.86
交易性金融资产	-	-	-	-	-	170,759,826.40	170,759,826.40
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	6,138.43	6,138.43
应收股利	-	-	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-	206,561.78	206,561.78
应收证券清算款	-	-	-	-	-	424,082.02	424,082.02
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,156,535.20	-	-	-	-	171,396,608.63	184,553,143.83
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,103,730.29	1,103,730.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	100,938.51	100,938.51
应付托管费	-	-	-	-	-	30,281.59	30,281.59
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	132,075.05	132,075.05
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	183,011.88	183,011.88
负债总计	-	-	-	-	-	1,550,037.32	1,550,037.32
利率敏感度缺口	13,156,535.20	-	-	-	-	169,846,571.31	183,003,106.51
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	20,798,154.16	-	-	-	-	-	20,798,154.16
结算备付金	79,344.58	-	-	-	-	-	79,344.58
存出保证金	24,572.61	-	-	-	-	-	24,572.61
交易性金融资产	-	-	-	-	-	256,022,979.34	256,022,979.34
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	4,298.09	4,298.09
应收股利	-	-	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-	302,898.48	302,898.48
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	20,902,071.35	-	-	-	-	256,330,175.91	277,232,247.26
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	504,294.86	504,294.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	110,971.29	110,971.29
应付托管费	-	-	-	-	-	33,291.37	33,291.37
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,836,603.03	1,836,603.03
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,605.47	2,605.47
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	0.09	0.09
其他负债	-	-	-	-	-	210,698.59	210,698.59
负债总计	-	-	-	-	-	2,698,464.70	2,698,464.70
利率敏感度缺口	20,902,071.35	-	-	-	-	253,631,711.21	274,533,782.56

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本期未及上期末未持有债券型资产，因此若除利率外其他市场变量保持不变，则本基金资产净值不会发生重大变动。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他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其他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股票和债券，所面临的最大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。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 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	170,759,826.40	93.31	256,022,979.34	93.26
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	170,759,826.40	93.31	256,022,979.34	93.26

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除中证 100 指数外其他市场变量保持不变		
	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：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	中证 100 指数上升百分之五	6,770,660.63	13,056,279.68
	中证 100 指数下降百分之五	-6,770,660.63	-13,056,279.68

6.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间（95%）		
	2. 观察期（1 年）		
	—		
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）

	合计	48,611,223.88	75,765,856.77
--	----	---------------	---------------

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 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	170,759,826.40	92.53
	其中：股票	170,759,826.40	92.53
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	13,141,215.34	7.12
8	其他各项资产	652,102.09	0.35
9	合计	184,553,143.83	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 7.12.3 期末其他各项资产构成。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,603,954.20	1.42
B	采矿业	3,577,608.55	1.95
C	制造业	81,963,182.18	44.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,092,088.96	1.69
E	建筑业	2,149,346.87	1.17
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	3,055,732.26	1.67
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,448,089.32	1.88
J	金融业	49,046,358.01	26.80

K	房地产业	3,289,275.42	1.80
L	租赁和商务服务业	4,536,231.68	2.48
M	科学研究和技术服务业	3,266,154.22	1.78
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	449,135.00	0.25
Q	卫生和社会工作	1,908,084.36	1.04
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	162,385,241.03	88.73

注：本基金本报告期指数投资部分含拟于 2021 年 7 月 1 日调入中证 100 指数的备选成分股，具体情况请查阅中证指数有限公司相关公告。因成份股停牌、流动性不足或法律法规中的投资比例限制等因素使得本基金无法购买中证 100 指数某成份股或者无法按照中证 100 指数某成份股的权重购买足够数量的该成份股时，本基金可以根据市场情况，买入该成份股的替代股票，以维持该成份股在本基金股票资产中的配置比例。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.01
B	采矿业	—	—
C	制造业	2,019,989.23	1.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	2.82
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	328,753.90	0.18
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	455,907.01	0.25
J	金融业	34,721.10	0.02
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	299,485.20	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	39,030.68	0.02

0	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	8,374,585.37	4.58

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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

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	600519	贵州茅台	7,492	15,408,796.40	8.42
2	601318	中国平安	129,228	8,306,775.84	4.54
3	600036	招商银行	147,546	7,995,517.74	4.37
4	000858	五粮液	23,110	6,884,237.90	3.76
5	601012	隆基股份	50,255	4,464,654.20	2.44
6	000333	美的集团	57,273	4,087,574.01	2.23
7	600276	恒瑞医药	51,991	3,533,828.27	1.93
8	002415	海康威视	54,254	3,499,383.00	1.91
9	601166	兴业银行	168,911	3,471,121.05	1.90
10	601888	中国中免	11,375	3,413,637.50	1.87
11	603259	药明康德	20,858	3,266,154.22	1.78
12	300059	东方财富	96,041	3,149,184.39	1.72
13	000651	格力电器	55,944	2,914,682.40	1.59
14	600900	长江电力	132,114	2,726,832.96	1.49
15	002594	比亚迪	10,491	2,633,241.00	1.44
16	002475	立讯精密	56,738	2,609,948.00	1.43
17	600887	伊利股份	70,591	2,599,866.53	1.42
18	000001	平安银行	112,681	2,548,844.22	1.39
19	600030	中信证券	98,921	2,467,089.74	1.35
20	000725	京东方A	393,266	2,453,979.84	1.34
21	601398	工商银行	407,187	2,105,156.79	1.15
22	600031	三一重工	69,000	2,005,830.00	1.10
23	000568	泸州老窖	8,500	2,005,490.00	1.10
24	600309	万华化学	18,200	1,980,524.00	1.08
25	603501	韦尔股份	6,100	1,964,200.00	1.07
26	300015	爱尔眼科	26,882	1,908,084.36	1.04

27	603288	海天味业	14,716	1,897,628.20	1.04
28	000002	万 科 A	79,045	1,882,061.45	1.03
29	002714	牧原股份	30,580	1,859,875.60	1.02
30	600809	山西汾酒	4,000	1,792,000.00	0.98
31	300122	智飞生物	9,300	1,736,589.00	0.95
32	600000	XD 浦发银	167,400	1,674,000.00	0.91
33	002142	宁波银行	41,831	1,630,154.07	0.89
34	600436	片仔癀	3,500	1,569,050.00	0.86
35	601899	紫金矿业	160,498	1,555,225.62	0.85
36	002304	洋河股份	7,008	1,452,057.60	0.79
37	002352	顺丰控股	21,174	1,433,479.80	0.78
38	600438	通威股份	31,400	1,358,678.00	0.74
39	601288	农业银行	436,064	1,321,273.92	0.72
40	600837	海通证券	112,103	1,289,184.50	0.70
41	000661	长春高新	3,300	1,277,100.00	0.70
42	000063	中兴通讯	35,843	1,191,062.89	0.65
43	601601	中国太保	39,808	1,153,237.76	0.63
44	600585	海螺水泥	27,845	1,143,037.25	0.62
45	600690	海尔智家	43,960	1,139,003.60	0.62
46	601668	中国建筑	243,750	1,133,437.50	0.62
47	002027	分众传媒	119,298	1,122,594.18	0.61
48	600016	民生银行	247,074	1,089,596.34	0.60
49	601988	中国银行	345,982	1,065,624.56	0.58
50	601818	XD 光大银	274,169	1,036,358.82	0.57
51	600048	保利地产	83,458	1,004,834.32	0.55
52	601229	上海银行	115,548	947,493.60	0.52
53	601688	华泰证券	59,898	946,388.40	0.52
54	600050	中国联通	216,261	934,247.52	0.51
55	601211	国泰君安	52,360	897,450.40	0.49
56	600009	上海机场	18,600	895,218.00	0.49
57	600104	上汽集团	40,693	894,025.21	0.49
58	601766	中国中车	141,280	858,982.40	0.47
59	601169	北京银行	171,888	837,094.56	0.46
60	688111	金山办公	2,100	829,080.00	0.45
61	600999	招商证券	43,052	818,849.04	0.45
62	600019	宝钢股份	103,383	789,846.12	0.43
63	600406	国电南瑞	32,220	748,792.80	0.41
64	601088	中国神华	38,291	747,440.32	0.41
65	300498	温氏股份	51,780	744,078.60	0.41
66	600745	闻泰科技	7,200	697,680.00	0.38
67	000538	云南白药	5,913	684,252.36	0.37
68	600028	中国石化	155,532	678,119.52	0.37

69	601628	中国人寿	19,296	653,941.44	0.36
70	600346	恒力石化	24,600	645,504.00	0.35
71	601658	邮储银行	126,500	635,030.00	0.35
72	600588	用友网络	19,000	631,940.00	0.35
73	601390	中国中铁	118,182	619,273.68	0.34
74	601633	长城汽车	14,200	618,978.00	0.34
75	002493	荣盛石化	35,300	609,631.00	0.33
76	601857	中国石油	112,821	596,823.09	0.33
77	000895	双汇发展	16,100	511,980.00	0.28
78	300433	蓝思科技	17,300	508,793.00	0.28
79	000166	申万宏源	104,534	489,219.12	0.27
80	601006	大秦铁路	69,194	455,296.52	0.25
81	002607	中公教育	21,500	449,135.00	0.25
82	601336	新华保险	9,713	445,923.83	0.24
83	600015	华夏银行	71,427	442,133.13	0.24
84	601989	中国重工	106,050	436,926.00	0.24
85	601138	工业富联	34,700	430,627.00	0.24
86	001979	招商蛇口	36,747	402,379.65	0.22
87	601186	中国铁建	53,383	396,635.69	0.22
88	000876	新 希 望	26,100	382,887.00	0.21
89	003816	中国广核	136,800	365,256.00	0.20
90	002736	国信证券	33,423	359,297.25	0.20
91	601066	中信建投	11,300	355,159.00	0.19
92	601360	三六零	24,900	304,029.00	0.17
93	002938	鹏鼎控股	8,100	290,628.00	0.16
94	601995	中金公司	4,400	270,600.00	0.15
95	601319	中国人保	43,000	254,990.00	0.14
96	601998	中信银行	45,855	233,860.50	0.13
97	600018	上港集团	40,222	191,858.94	0.10
98	600918	中泰证券	14,400	155,808.00	0.09
99	601816	京沪高铁	15,100	79,879.00	0.04

注：本基金本报告期指数投资部分含拟于 2021 年 7 月 1 日调入中证 100 指数的备选成分股，具体情况请查阅中证指数有限公司相关公告。

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	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	2.81
2	688686	奥普特	932	420,332.00	0.23
3	688083	中望软件	599	313,923.92	0.17

4	688131	皓元医药	1,212	299,485.20	0.16
5	688063	派能科技	1,503	295,790.40	0.16
6	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.14
7	688538	和辉光电	51,021	172,450.98	0.09
8	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.06
9	688097	博众精工	3,958	110,863.58	0.06
10	688201	信安世纪	2,129	96,677.89	0.05
11	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.04
12	688499	利元亨	1,819	70,668.15	0.04
13	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.03
14	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.03
15	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.03
16	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.03
17	688087	英科再生	2,172	47,697.12	0.03
18	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
19	300957	贝泰妮	175	44,093.00	0.02
20	300894	火星号	578	39,304.00	0.02
21	300919	中伟股份	241	39,283.00	0.02
22	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
23	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
24	300979	华利集团	278	24,325.00	0.01
25	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
26	300973	立高食品	192	22,216.32	0.01
27	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
28	300925	法本信息	564	14,827.56	0.01
29	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
30	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
31	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
32	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
33	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
34	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
35	300932	三友联众	389	12,335.19	0.01
36	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
37	300997	欢乐家	910	11,875.50	0.01
38	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.01
39	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
40	300968	格林精密	937	11,309.59	0.01
41	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
42	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.01
43	300996	普联软件	241	10,177.43	0.01
44	300956	英力股份	371	9,571.80	0.01
45	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.01
46	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.01

47	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
48	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
49	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
50	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
51	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
52	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
53	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
54	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
55	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
56	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
57	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
58	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
59	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
60	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
61	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
62	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
63	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
64	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
65	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
66	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
67	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
68	300985	致远新能	227	5,631.87	0.00
69	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
70	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
71	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
72	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
73	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
74	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
75	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	5,696,045.00	2.07
2	600905	三峡能源	3,436,527.95	1.25
3	601318	中国平安	2,273,711.00	0.83
4	600436	片仔癀	2,087,748.00	0.76
5	600438	通威股份	1,653,474.00	0.60
6	601816	京沪高铁	1,597,066.00	0.58
7	600036	招商银行	1,435,575.00	0.52
8	000858	五粮液	1,389,756.00	0.51
9	688111	金山办公	1,343,091.48	0.49

10	601633	长城汽车	929,046.00	0.34
11	002493	荣盛石化	898,410.50	0.33
12	000333	美的集团	832,090.00	0.30
13	002415	海康威视	820,829.00	0.30
14	300433	蓝思科技	716,555.00	0.26
15	601658	邮储银行	706,410.00	0.26
16	600900	长江电力	698,189.00	0.25
17	601012	隆基股份	628,970.00	0.23
18	600050	中国联通	580,118.00	0.21
19	000651	格力电器	558,921.00	0.20
20	601166	兴业银行	558,417.00	0.20

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

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	600519	贵州茅台	10,185,542.88	3.71
2	601318	中国平安	7,662,440.37	2.79
3	600036	招商银行	6,453,898.08	2.35
4	000858	五粮液	5,564,196.67	2.03
5	000333	美的集团	3,588,796.00	1.31
6	601166	兴业银行	2,860,026.75	1.04
7	600276	恒瑞医药	2,849,136.25	1.04
8	601888	中国中免	2,574,664.25	0.94
9	000651	格力电器	2,433,229.50	0.89
10	601012	隆基股份	2,093,842.90	0.76
11	300059	东方财富	2,004,507.00	0.73
12	600887	伊利股份	1,881,596.00	0.69
13	600905	三峡能源	1,797,364.80	0.65
14	000001	平安银行	1,795,079.00	0.65
15	601816	京沪高铁	1,761,932.50	0.64
16	002415	海康威视	1,744,904.00	0.64
17	600030	中信证券	1,708,049.50	0.62
18	002594	比亚迪	1,693,838.86	0.62
19	603259	药明康德	1,628,401.20	0.59
20	600900	长江电力	1,481,899.00	0.54

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

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	43,864,321.10
卖出股票收入（成交）总额	136,118,876.01

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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不存在被监管部门立案调查的情况，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定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	15,319.86
2	应收证券清算款	424,082.02

3	应收股利	—
4	应收利息	6,138.43
5	应收申购款	206,561.78
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	652,102.09

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	2.81	新股流通受限
2	688686	奥普特	420,332.00	0.23	新股流通受限
3	688083	中望软件	313,923.92	0.17	新股流通受限
4	688131	皓元医药	299,485.20	0.16	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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 (%)
22,948	3,426.61	32,644,778.27	41.51	45,989,031.62	58.49

8.2 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（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	18,181.44	0.0231

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情况

注：本期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本开放式基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 12 月 30 日） 基金份额总额	337,421,352.99
本报告期期初基金份额总额	122,032,260.11
本报告期基金总申购份额	24,093,803.91
减：本报告期基金总赎回份额	67,492,254.13
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	78,633,809.89

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

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

1. 2021 年 3 月 19 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘姚姣女士为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
2. 2021 年 3 月 19 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘陈奇先生为华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
3. 2021 年 3 月 26 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，张亮先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
4. 2021 年 3 月 26 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，张亮先生不再担任华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
5. 2021 年 5 月 7 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘李孝华先生为华富中证 100 指数证券投资基金基金经理。
6. 2021 年 6 月 28 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘李孝华先生为华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

7. 本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

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

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		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	佣金	占当期佣金总量的比例	
华安证券	2	169,927,125.11	100.00%	157,178.10	100.00%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

注：1)根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的券商租用了基金专用交易单元。

2)此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证

		比例		成交总额的 比例		成交总额的 比例
华安证券	-	-	36,200,000.00	100.00%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

注：债券交易中企业债及可分离债券的成交金额按净价统计，可转债的成交金额按全价统计。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行“2021 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 4 日
2	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行 AI 投服务基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 4 日
3	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 4 日
4	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与国金证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 16 日
5	华富基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 22 日
6	华富中证 100 指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 22 日
7	华富基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 26 日
8	华富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与科创板股票投资及相关风险提示的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 18 日
9	华富基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 20 日
10	关于华富基金管理有限公司旗下部分基金参加国金证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 26 日
11	华富基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 30 日
12	华富中证 100 指数证券投资基金按指数新规修改后的基金合同修订对照表	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 30 日
13	华富中证 100 指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 30 日
14	华富中证 100 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 30 日

15	华富中证 100 指数证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 30 日
16	华富基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 31 日
17	华富中证 100 指数证券投资基金 2020 年度报告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 31 日
18	关于华富基金管理有限公司旗下部分基金参加天风证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 16 日
19	关于华富基金管理有限公司旗下部分基金参加招商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 17 日
20	华富基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第一季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 22 日
21	华富中证 100 指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 22 日
22	华富基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 5 月 11 日
23	华富中证 100 指数证券投资基金更新招募说明书	中国证监会指定媒介	2021 年 5 月 11 日
24	华富中证 100 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2021 年 5 月 11 日
25	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 6 月 30 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. 1. 1-2021. 6. 30	47,910,118.82	0.00	23,910,118.82	24,000,000.00	30.52
产品特有风险							
无							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华富中证 100 指数型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富中证 100 指数型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富中证 100 指数型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富中证 100 指数型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日