

# 华富中证 100 指数证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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合规守信情况的说明 .....	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 .....	10
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 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
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 .....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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 .....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
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 .....	39
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 本基金投资股指期货的投资政策 .....	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
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
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
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
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 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
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 .....	49
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>50</b>
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 .....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录 .....	50
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	51

## § 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	151,062,623.64 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×95%+一年期银行定期存款收益率（税后）×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		赵万利	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
会计师事务所	天健会计师事务所(特殊普通合伙)	浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号新湖商贸大厦 6 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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-7,321,304.86
本期利润	-9,340,938.51
加权平均基金份额本期利润	-0.0851
本期加权平均净值利润率	-4.23%
本期基金份额净值增长率	-6.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	166,270,921.96
期末可供分配基金份额利润	1.1007
期末基金资产净值	317,333,545.60
期末基金份额净值	2.1007
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	110.07%

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	10.16%	1.03%	9.19%	1.04%	0.97%	-0.01%
过去三个月	7.30%	1.31%	6.34%	1.32%	0.96%	-0.01%
过去六个月	-6.75%	1.38%	-7.60%	1.38%	0.85%	0.00%
过去一年	-9.74%	1.21%	-14.50%	1.23%	4.76%	-0.02%
过去三年	45.61%	1.19%	7.53%	1.21%	38.08%	-0.02%
自基金合同生效起至今	110.07%	1.36%	31.16%	1.36%	78.91%	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《华富中证 100 指数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。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 2022 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、华富新能源股票型发起式证券投资基金、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华富中债 1-3 年国开

行债券指数证券投资基金、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金、华富国潮优选混合型发起式证券投资基金、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华富匠心明选一年持有期混合型证券投资基金、华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金和华富安业一年持有期债券型证券投资基金共五十五只基金。

#### 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	本基金的基金经理	2018 年 2 月 23 日	-	八年	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，自 2018 年 2 月 23 日起任华富中证 100 指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 1 月 28 日起任华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 24 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 4 月 23 日起任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基金经理，自 2020 年 8 月 3 日起任华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 15 日起任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，自 2021 年 6 月 29 日起任华富新能源股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 11 日起任华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 9 月 15 日起任华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。
李孝华	本基金的基金经理	2021 年 5 月 7 日	-	九年	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人员、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，自 2021 年 5 月 7 日起任华富中证 100 指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 28 日起任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，自 2021 年 8 月 11 日起任华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 17 日起任华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

## 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，市场表现得一波三折，1-4 月份市场受市场热门板块估值较高、国际地缘政治局势恶化及国内局部地区疫情爆发等突发因素影响大幅杀跌。而在 4 月底随着上述利空因素影响消退后市场开始企稳，并持续强劲反弹至 6 月底。期间沪深 300、中证 500 和中证 1000 分别下跌 9.22%、12.30% 和 12.67%，中证 100 指数今年上半年下跌 8.07%。具体到各个板块，稳增长板块在 1-4 月份的市场下跌中表现非常抗跌后，不过随着 4 月底之后市场大幅反弹，成长板块重归强势，

新能源主题板块在本轮反弹中更是一马当先。本基金在本报告期继续延续了此前的投资策略，保持了对中证 100 指数的紧密跟踪。

#### 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 2.1007 元，累计份额净值为 2.1007 元。报告期，本基金份额净值增长率为-6.75%，同期业绩比较基准收益率为-7.60%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年六月份中证 100 指数迎来了指数编制规则的大修订，修订后的中证 100 指数更为准确的囊括了 A 股市场各行业的龙头公司，而且具有更强的行业代表性，是当之无愧的 A 股龙头公司的集中营。相对于其他公司，龙头公司作为市场中的“核心资产，其经营更为稳定，确定性更强，可以作为投资者的底仓品种进行配置。华富中证 100 作为紧密跟踪中证 100 指数的被动基金，未来将继续跟踪好标的指数，同时辅以打新策略，以期为投资者提供满意的投资回报。

#### 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 -9,340,938.51 元，期末可供分配利润为 166,270,921.96 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合规守信情况声明

本报告期内，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，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

本报告期内，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中期报告中财务指标、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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	73,677,991.80	12,765,878.49
结算备付金		252,088.28	81,515.93
存出保证金		38,822.85	38,922.08
交易性金融资产	6.4.7.2	299,088,995.68	230,675,462.62
其中：股票投资		299,088,995.68	230,675,462.62
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	148,466.00
应收股利		-	-
应收申购款		39,409.71	226,138.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	2,932.25
资产总计		373,097,308.32	243,939,315.76
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	-
应付清算款		54,524,381.70	-
应付赎回款		531,451.96	465,404.65
应付管理人报酬		110,070.87	103,858.02
应付托管费		33,021.26	31,157.40
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	564,836.93	346,366.46
负债合计		55,763,762.72	946,786.53
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	151,062,623.64	107,869,536.01
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	166,270,921.96	135,122,993.22
净资产合计		317,333,545.60	242,992,529.23
负债和净资产总计		373,097,308.32	243,939,315.76

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.1007 元，基金份额总额 151,062,623.64 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-8,442,466.17	9,075,197.45
1. 利息收入		51,195.74	83,644.75
其中：存款利息收入	6.4.7.13	51,195.74	74,486.40
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）		-6,590,103.68	32,907,883.65
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-8,822,835.42	31,000,058.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,232,731.74	1,907,825.61
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-2,019,633.65	-24,008,656.07
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	116,075.42	92,325.12
<b>减：二、营业总支出</b>		898,472.34	1,391,037.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	545,113.16	680,028.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	163,534.03	204,008.51
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	189,825.15	507,000.56

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,340,938.51	7,684,160.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,340,938.51	7,684,160.08
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-9,340,938.51	7,684,160.08

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

### 6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	107,869,536.01	-	135,122,993.22	242,992,529.23
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	107,869,536.01	-	135,122,993.22	242,992,529.23
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	43,193,087.63	-	31,147,928.74	74,341,016.37
(一)、综合收益总额	-	-	-9,340,938.51	-9,340,938.51
(二)、本期基	43,193,087.63	-	40,488,867.25	83,681,954.88

金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	105,856,900.28	-	100,632,968.14	206,489,868.42
2. 基金赎回款	-62,663,812.65	-	-60,144,100.89	-122,807,913.54
（三）、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)	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	151,062,623.64	-	166,270,921.96	317,333,545.60
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	122,032,260.11	-	152,501,522.45	274,533,782.56
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	122,032,260.11	-	152,501,522.45	274,533,782.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-43,398,450.22	-	-48,132,225.83	-91,530,676.05
(一)、综合收益总额	-	-	7,684,160.08	7,684,160.08
(二)、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)	-43,398,450.22	-	-55,816,385.91	-99,214,836.13
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
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	78,633,809.89	-	104,369,296.62	183,003,106.51

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：

<u>赵万里</u>	<u>曹华玮</u>	<u>邵恒</u>
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、经营成果和净资产变动等有关信息。

#### 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

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本报告期所采用的其他会计政策、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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

##### 原金融工具准则 新金融工具准则

列报项目 计量类别 账面价值 列报项目 计量类别 账面价值

银行存款 摊余成本 12,765,878.49 银行存款 摊余成本 12,768,751.23

结算备付金 摊余成本 81,515.93 结算备付金 摊余成本 81,556.19

存出保证金 摊余成本 38,922.08 存出保证金 摊余成本 38,941.33

交易性金融资产 以公允价值计量且其变动计入当期损益 230,675,462.62 交易性金融资产

以公允价值计量且其变动计入当期损益 230,675,462.62

衍生金融资产 以公允价值计量且其变动计入当期损益 - 衍生金融资产 以公允价值计量且其变动计入当期损益 -

买入返售金融资产 摊余成本 - 买入返售金融资产 摊余成本 -

应收利息 摊余成本 2,932.25 其他资产-应收利息 摊余成本 -

应收证券清算款 摊余成本 148,466.00 应收清算款 摊余成本 148,466.00

应收股利 摊余成本 应收股利 摊余成本

应收申购款 摊余成本 226,138.39 应收申购款 摊余成本 226,138.39

其他资产-持有至到期投资 摊余成本 - 债权投资 摊余成本 -

其他资产-其他应收款 摊余成本 - 其他资产-其他应收款 摊余成本 -

交易性金融负债 以公允价值计量且其变动计入当期损益 - 交易性金融负债 以公允价值计量且其变动计入当期损益 -

衍生金融负债 以公允价值计量且其变动计入当期损益 - 衍生金融负债 以公允价值计量且其变动计入当期损益 -

卖出回购金融资产款 摊余成本 - 卖出回购金融资产款 摊余成本 -

应付证券清算款 摊余成本 - 应付清算款 摊余成本 -

应付赎回款 摊余成本 465,404.65 应付赎回款 摊余成本 465,404.65

应付管理人报酬 摊余成本 103,858.02 应付管理人报酬 摊余成本 103,858.02

应付托管费 摊余成本 31,157.40 应付托管费 摊余成本 31,157.40

应付销售服务费 摊余成本 - 应付销售服务费 摊余成本 -

应付利润 摊余成本 - 应付利润 摊余成本 -

应付交易费用 摊余成本 84,656.54 其他负债-应付交易费用 摊余成本 84,656.54

应付利息 摊余成本 - 其他负债-应付利息 摊余成本 -

其他负债-其他应付款 摊余成本 261,709.92 其他负债-其他应付款 摊余成本 261,709.92

于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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〉》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 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重大变更。

#### 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)、《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》(财税〔2014〕81 号)、《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》(财税〔2016〕127 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。

(四) 对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

主要税种及税率列示如下：

税种 计税依据 税率

增值税 以按税法规定计算的金融服务销售额 3%

城市维护建设税 实际缴纳的流转税税额 7%

教育费附加 实际缴纳的流转税税额 3%

地方教育附加 实际缴纳的流转税税额 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 2022年6月30日
活期存款	73,677,991.80
等于：本金	73,672,225.95
加：应计利息	5,765.85
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	73,677,991.80

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	289,476,300.26	-	299,088,995.68	9,612,695.42
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	289,476,300.26	-	299,088,995.68	9,612,695.42

#### 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 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,823.70
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	333,753.08
其中：交易所市场	333,753.08
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	69,752.78
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	100,000.00
合计	564,836.93

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	107,869,536.01	107,869,536.01
本期申购	105,856,900.28	105,856,900.28
本期赎回（以“-”号填列）	-62,663,812.65	-62,663,812.65
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	151,062,623.64	151,062,623.64

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益

#### 6.4.7.9 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
本期期初	140,500,306.96	-5,377,313.74	135,122,993.22
本期利润	-7,321,304.86	-2,019,633.65	-9,340,938.51
本期基金份额交易产生的变动数	53,409,904.52	-12,921,037.27	40,488,867.25
其中：基金申购款	133,085,477.54	-32,452,509.40	100,632,968.14
基金赎回款	-79,675,573.02	19,531,472.13	-60,144,100.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	186,588,906.62	-20,317,984.66	166,270,921.96

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	49,775.87
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	1,175.70
其他	244.17
合计	51,195.74

注：其他所列本期金额为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,822,835.42
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	-8,822,835.42

**6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	167,177,431.07
减：卖出股票成本总额	175,411,002.01
减：交易费用	589,264.48
买卖股票差价收入	-8,822,835.42

**6.4.7.12 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 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,232,731.74
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	2,232,731.74

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,019,633.65
股票投资	-2,019,633.65
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	-2,019,633.65

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	115,935.12
基金转换费收入	140.30
合计	116,075.42

#### 6.4.7.19 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	565.00
指数使用费	100,000.00
合计	189,825.15

#### 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

根据本管理人于 2022 年 8 月 29 日发布的分红公告，本基金于 2022 年 8 月 30 日（除权日）进行本年度第一次分红。

#### 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、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

## 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	407,363,932.60	100.00	169,927,125.11	100.00

## 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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：本基金本报告期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 2022年1月1日至2022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	377,357.62	100.00	333,753.08	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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

## 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	545, 113. 16	680, 028. 30
其中：支付销售机构的客户维护费	130, 199. 86	112, 138. 97

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	163, 534. 03	204, 008. 51

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	73,677,991.80	49,775.87	13,108,549.76	73,595.07

注：1)本表仅列示活期存款余额及产生利息。

#### 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

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2022 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	受限期	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
300834	星辉环材	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股流通受限	55.57	30.03	123	6,835.11	3,693.69	-
301102	兆讯传媒	2022 年 3 月 15 日	6 个月	新股流通受限	39.88	31.09	165	6,580.20	5,129.85	-
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.67	32.02	186	6,077.50	5,955.72	-
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股流通受限	23.17	16.14	341	7,901.87	5,503.74	-
301110	青木股份	2022 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	63.10	39.85	99	6,246.90	3,945.15	-
301112	信邦智能	2022 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	27.53	45.04	315	8,671.95	14,187.60	-
301116	益客	2022 年	6 个月	新股流	11.40	20.46	505	5,757.00	10,332.30	-

	食品	1月10日		通受限							
301120	新特电气	2022年4月11日	6个月	新股流通受限	13.73	15.49	708	9,720.84	10,966.92		-
301123	奕东电子	2022年1月14日	6个月	新股流通受限	37.23	25.39	182	6,775.86	4,620.98		-
301125	腾亚精工	2022年5月27日	6个月	新股流通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34		-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新股流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90		-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	6个月	新股流通受限	31.98	26.26	165	5,276.70	4,332.90		-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	15.37	15.99	442	6,793.54	7,067.58		-
301139	元道通信	2022年6月30日	1-6个月(含)	新股流通受限	38.46	38.46	2,938	112,995.48	112,995.48		-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新股流通受限	33.68	43.98	179	6,028.72	7,872.42		-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	15.64	20.38	347	5,427.08	7,071.86		-
301160	翔楼新材	2022年5月25日	6个月	新股流通受限	31.56	37.66	340	10,730.40	12,804.40		-
301163	宏德股份	2022年4月11日	6个月	新股流通受限	26.27	32.33	226	5,937.02	7,306.58		-
301175	中科环保	2022年6月30日	1-6个月(含)	新股流通受限	3.82	3.82	25,530	97,524.60	97,524.60		-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股流通受限	40.25	30.59	165	6,641.25	5,047.35		-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	68	4,357.44	2,551.36		-

301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	6 个月	新股流 通受限	3.80	6.39	2,240	8,512.00	14,313.60	-
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	35.68	29.84	187	6,672.16	5,580.08	-
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股流 通受限	17.27	14.83	560	9,671.20	8,304.80	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流 通受限	97.11	87.82	43	4,175.52	3,776.26	-
301220	亚香股份	2022 年 6 月 15 日	6 个月	新股流 通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股流 通受限	33.98	28.96	192	6,524.16	5,560.32	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	1-6 个 月(含)	新股流 通受限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股流 通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301235	华康医疗	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	39.30	37.93	225	8,842.50	8,534.25	-
301236	软通动力	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新股流 通受限	48.59	31.38	198	9,620.16	6,213.24	-
301237	和顺科技	2022 年 3 月 16 日	6 个月	新股流 通受限	56.69	41.86	118	6,689.42	4,939.48	-
301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新股流 通受限	19.18	32.07	518	9,935.24	16,612.26	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1-6 个 月(含)	新股流 通受限	33.65	33.65	2,413	81,197.45	81,197.45	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股流 通受限	33.65	33.65	269	9,051.85	9,051.85	-
301256	华融化学	2022 年 3 月 14	6 个月	新股流 通受限	8.05	10.08	839	6,753.95	8,457.12	-

301258	富士莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	48.30	41.68	118	5,699.40	4,918.24	-
301298	东利机械	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	52.03	56.42	207	10,770.21	11,678.94	-
688119	中钢洛耐	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	5.06	7.01	16,081	81,369.86	112,727.81	-
688170	德龙激光	2022 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	30.18	47.04	3,046	91,928.28	143,283.84	-
688237	超卓航科	2022 年 6 月 24 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	41.27	41.27	2,313	95,457.51	95,457.51	-
688283	坤恒顺维	2022 年 2 月 8 日	6 个月	新股流通受限	33.80	45.41	1,117	37,754.60	50,722.97	-
688337	普源精电	2022 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	60.88	51.03	1,313	79,935.44	67,002.39	-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	21.93	21.93	4,068	89,211.24	89,211.24	-

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：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及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：本基金本报告期末及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：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及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：本基金本报告期末及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同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 2022 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	73,677,991.80	-	-	-	-	-	73,677,991.80
结算备付金	252,088.28	-	-	-	-	-	252,088.28
存出保证金	38,822.85	-	-	-	-	-	38,822.85
交易性金融资产	-	-	-	-	-	299,088,995.68	299,088,995.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	39,409.71	39,409.71
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	73,968,902.93	-	-	-	-	-299,128,405.39	373,097,308.32
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	531,451.96	531,451.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	110,070.87	110,070.87
应付托管费	-	-	-	-	-	33,021.26	33,021.26
应付清算款	-	-	-	-	-	54,524,381.70	54,524,381.70
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	564,836.93	564,836.93
负债总计	-	-	-	-	-	-55,763,762.72	55,763,762.72
利率敏感度缺口	73,968,902.93	-	-	-	-	-243,364,642.67	317,333,545.60
上年度末 2021 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	12,765,878.49	-	-	-	-	-	12,765,878.49
结算备付金	81,515.93	-	-	-	-	-	81,515.93
存出保证金	38,922.08	-	-	-	-	-	38,922.08
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-230,675,462.62	230,675,462.62
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	226,138.39	226,138.39
应收证券清算款	-	-	-	-	-	148,466.00	148,466.00
其他资产	-	-	-	-	-	2,932.25	2,932.25
资产总计	12,886,316.50	-	-	-	-	-231,052,999.26	243,939,315.76
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	465,404.65	465,404.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	103,858.02	103,858.02
应付托管费	-	-	-	-	-	31,157.40	31,157.40
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-

应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	346,366.46	346,366.46
负债总计	-	-	-	-	-	946,786.53	946,786.53
利率敏感度缺口	12,886,316.50	-	-	-	-	-230,106,212.73	242,992,529.23

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

假设	1. 除利率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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率下降 25 基点	0.00	0.00
	市场利率上升 25 基点	0.00	0.00

注：本期末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 2022年6月30日		上年度末 2021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	299,088,995.68	94.25	230,675,462.62	94.93
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	299,088,995.68	94.25	230,675,462.62	94.93

#### 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	中证 100 指数上升百分之五	15,063,897.46	9,483,673.99
	中证 100 指数下降百分之五	-15,063,897.46	-9,483,673.99

#### 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	合计	123,965,478.48	56,172,928.97

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	297,904,840.82	229,835,651.67
第二层次	550,873.65	143,984.41
第三层次	633,281.21	695,826.54
合计	299,088,995.68	230,675,462.62

## 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

## 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 06 月 30 日：同)。

## 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## 6.4.15 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	299,088,995.68	80.16
	其中：股票	299,088,995.68	80.16
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	73,930,080.08	19.82
8	其他各项资产	78,232.56	0.02
9	合计	373,097,308.32	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	3,624,606.60	1.14
B	采矿业	11,646,119.50	3.67
C	制造业	192,896,402.97	60.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,396,153.68	2.96
E	建筑业	2,745,918.00	0.87
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	7,289,857.94	2.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,256,397.06	3.55
J	金融业	36,042,077.11	11.36
K	房地产业	6,888,210.18	2.17
L	租赁和商务服务业	7,283,546.29	2.30
M	科学研究和技术服务业	5,247,127.42	1.65
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	2,989,830.14	0.94
R	文化、体育和娱乐业	550,440.00	0.17
S	综合	-	-
	合计	297,856,686.89	93.86

注：本基金本报告期指数投资部分含拟于 2022 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	862,392.50	0.27
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	142,705.23	0.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,129.85	0.00
M	科学研究和技术服务业	22,847.85	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	103,028.34	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	96,205.02	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,232,308.79	0.39

### 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港股通投资股票。

### 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	15,492	31,681,140.00	9.98

2	300750	宁德时代	34,400	18,369,600.00	5.79
3	600036	招商银行	304,746	12,860,281.20	4.05
4	601318	中国平安	266,728	12,453,530.32	3.92
5	601012	隆基绿能	149,257	9,944,993.91	3.13
6	002594	比亚迪	22,291	7,433,825.59	2.34
7	300059	东方财富	260,289	6,611,340.60	2.08
8	600900	长江电力	279,914	6,471,611.68	2.04
9	000333	美的集团	96,773	5,844,121.47	1.84
10	601888	中国中免	24,075	5,607,789.75	1.77
11	603259	药明康德	50,458	5,247,127.42	1.65
12	002415	海康威视	116,154	4,204,774.80	1.33
13	002475	立讯精密	122,138	4,127,043.02	1.30
14	601398	工商银行	863,087	4,116,924.99	1.30
15	600276	恒瑞医药	109,991	4,079,566.19	1.29
16	600438	通威股份	66,500	3,980,690.00	1.25
17	000651	格力电器	116,544	3,929,863.68	1.24
18	600309	万华化学	38,700	3,753,513.00	1.18
19	300760	迈瑞医疗	11,900	3,727,080.00	1.17
20	000725	京东方 A	923,366	3,638,062.04	1.15
21	002714	牧原股份	65,580	3,624,606.60	1.14
22	601899	紫金矿业	354,798	3,310,265.34	1.04
23	002812	恩捷股份	13,200	3,305,940.00	1.04
24	002129	TCL 中环	55,700	3,280,173.00	1.03
25	000792	盐湖股份	107,000	3,205,720.00	1.01
26	600048	保利发展	176,858	3,087,940.68	0.97
27	300124	汇川技术	45,400	2,990,498.00	0.94
28	300015	爱尔眼科	66,782	2,989,830.14	0.94
29	603799	华友钴业	31,260	2,989,081.20	0.94
30	002460	赣锋锂业	19,800	2,944,260.00	0.93
31	600031	三一重工	146,300	2,788,478.00	0.88
32	000002	万科 A	134,345	2,754,072.50	0.87
33	601668	中国建筑	516,150	2,745,918.00	0.87
34	300014	亿纬锂能	27,900	2,720,250.00	0.86
35	601088	中国神华	81,191	2,703,660.30	0.85
36	002352	顺丰控股	48,274	2,694,171.94	0.85
37	600436	片仔癀	7,400	2,639,802.00	0.83
38	600690	海尔智家	93,224	2,559,931.04	0.81
39	600089	特变电工	93,400	2,558,226.00	0.81
40	002271	东方雨虹	49,672	2,556,617.84	0.81
41	300274	阳光电源	25,600	2,515,200.00	0.79
42	601816	京沪高铁	483,800	2,428,676.00	0.77
43	603986	兆易创新	16,400	2,332,244.00	0.73

44	603501	韦尔股份	13,000	2,249,390.00	0.71
45	600406	国电南瑞	82,504	2,227,608.00	0.70
46	300122	智飞生物	19,700	2,186,897.00	0.69
47	601919	中远海控	155,900	2,167,010.00	0.68
48	688981	中芯国际	47,742	2,156,506.14	0.68
49	600585	海螺水泥	59,045	2,083,107.60	0.66
50	002709	天赐材料	33,200	2,060,392.00	0.65
51	601225	陕西煤业	95,500	2,022,690.00	0.64
52	002049	紫光国微	10,500	1,992,060.00	0.63
53	002241	歌尔股份	58,900	1,979,040.00	0.62
54	300142	沃森生物	39,400	1,906,566.00	0.60
55	600111	北方稀土	53,700	1,888,092.00	0.59
56	002230	科大讯飞	45,800	1,887,876.00	0.59
57	000661	长春高新	8,000	1,867,360.00	0.59
58	002371	北方华创	6,500	1,801,280.00	0.57
59	300450	先导智能	27,000	1,705,860.00	0.54
60	002027	分众传媒	248,998	1,675,756.54	0.53
61	000338	潍柴动力	133,500	1,664,745.00	0.52
62	000100	TCL 科技	345,800	1,656,382.00	0.52
63	000063	中兴通讯	62,843	1,604,381.79	0.51
64	601985	中国核电	232,300	1,593,578.00	0.50
65	600050	中国联通	457,561	1,583,161.06	0.50
66	600745	闻泰科技	18,400	1,566,024.00	0.49
67	601766	中国中车	299,580	1,557,816.00	0.49
68	600893	航发动力	32,800	1,492,728.00	0.47
69	300782	卓胜微	10,420	1,406,700.00	0.44
70	600028	中国石化	329,432	1,344,082.56	0.42
71	600905	三峡能源	211,600	1,330,964.00	0.42
72	600019	宝钢股份	219,383	1,320,685.66	0.42
73	600010	包钢股份	561,100	1,318,585.00	0.42
74	002410	广联达	23,400	1,273,896.00	0.40
75	601857	中国石油	239,321	1,268,401.30	0.40
76	600570	恒生电子	28,800	1,253,952.00	0.40
77	600346	恒力石化	52,000	1,156,480.00	0.36
78	002493	荣盛石化	74,800	1,151,172.00	0.36
79	001979	招商蛇口	77,900	1,046,197.00	0.33
80	603993	洛阳钼业	174,000	997,020.00	0.31
81	600426	华鲁恒升	33,100	966,520.00	0.30
82	600176	中国巨石	53,900	938,399.00	0.30
83	601600	中国铝业	177,200	841,700.00	0.27
84	600588	用友网络	38,700	840,177.00	0.26
85	600989	宝丰能源	49,600	726,640.00	0.23

86	002648	卫星化学	27,200	703,120.00	0.22
87	000301	东方盛虹	38,800	656,108.00	0.21
88	002601	龙佰集团	32,000	641,600.00	0.20
89	002555	三七互娱	29,900	634,777.00	0.20
90	000938	紫光股份	32,000	620,800.00	0.20
91	600941	中国移动	10,100	611,050.00	0.19
92	300628	亿联网络	8,000	609,200.00	0.19
93	600219	南山铝业	161,700	596,673.00	0.19
94	603260	合盛硅业	4,900	578,004.00	0.18
95	300413	芒果超媒	16,500	550,440.00	0.17
96	002602	世纪华通	100,800	485,856.00	0.15
97	601728	中国电信	122,800	458,044.00	0.14
98	000708	中信特钢	22,400	451,360.00	0.14
99	002080	中材科技	14,900	409,750.00	0.13
100	002064	华峰化学	33,600	283,584.00	0.09

注：本基金本报告期指数投资部分含拟于 2022 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	688170	德龙激光	3,046	143,283.84	0.05
2	301139	元道通信	2,938	112,995.48	0.04
3	688119	中钢洛耐	16,081	112,727.81	0.04
4	301175	中科环保	25,530	97,524.60	0.03
5	688237	超卓航科	2,313	95,457.51	0.03
6	301239	普瑞眼科	2,682	90,249.30	0.03
7	688400	凌云光	4,068	89,211.24	0.03
8	688337	普源精电	1,313	67,002.39	0.02
9	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
10	688283	坤恒顺维	1,117	50,722.97	0.02
11	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
12	301238	瑞泰新材	518	16,612.26	0.01
13	301215	中汽股份	2,240	14,313.60	0.00
14	301112	信邦智能	315	14,187.60	0.00
15	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
16	301160	翔楼新材	340	12,804.40	0.00
17	301302	华如科技	207	11,678.94	0.00
18	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
19	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
20	301120	新特电气	708	10,966.92	0.00

21	301116	益客食品	505	10,332.30	0.00
22	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
23	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
24	301235	华康医疗	225	8,534.25	0.00
25	301256	华融化学	839	8,457.12	0.00
26	301217	铜冠铜箔	560	8,304.80	0.00
27	301153	中科江南	179	7,872.42	0.00
28	301163	宏德股份	226	7,306.58	0.00
29	301158	德石股份	347	7,071.86	0.00
30	301137	哈焊华通	442	7,067.58	0.00
31	301236	软通动力	198	6,213.24	0.00
32	301103	何氏眼科	186	5,955.72	0.00
33	301216	万凯新材	187	5,580.08	0.00
34	301222	浙江恒威	192	5,560.32	0.00
35	301109	军信股份	341	5,503.74	0.00
36	301102	兆讯传媒	165	5,129.85	0.00
37	301181	标榜股份	165	5,047.35	0.00
38	301237	和顺科技	118	4,939.48	0.00
39	301258	富士莱	118	4,918.24	0.00
40	301123	奕东电子	182	4,620.98	0.00
41	301135	瑞德智能	165	4,332.90	0.00
42	301110	青木股份	99	3,945.15	0.00
43	301219	腾远钴业	43	3,776.26	0.00
44	300834	星辉环材	123	3,693.69	0.00
45	301196	唯科科技	68	2,551.36	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	21,486,713.00	8.84
2	300750	宁德时代	11,521,963.00	4.74
3	600036	招商银行	8,908,157.00	3.67
4	601318	中国平安	8,660,274.93	3.56
5	601012	隆基绿能	5,858,287.40	2.41
6	002594	比亚迪	4,535,689.00	1.87
7	600900	长江电力	4,417,191.00	1.82
8	300059	东方财富	4,124,272.00	1.70
9	000792	盐湖股份	3,775,571.00	1.55
10	603259	药明康德	3,398,178.84	1.40
11	000333	美的集团	3,201,925.63	1.32
12	000858	五粮液	3,187,330.84	1.31

13	601888	中国中免	2,959,581.00	1.22
14	002129	TCL 中环	2,939,612.00	1.21
15	002460	赣锋锂业	2,928,601.50	1.21
16	603799	华友钴业	2,872,642.20	1.18
17	601166	兴业银行	2,761,161.00	1.14
18	002415	海康威视	2,669,931.00	1.10
19	600089	特变电工	2,651,438.00	1.09
20	601398	工商银行	2,603,725.00	1.07

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	11,041,413.00	4.54
2	000858	五粮液	8,687,148.80	3.58
3	601166	兴业银行	7,471,493.90	3.07
4	300750	宁德时代	6,256,714.05	2.57
5	600030	中信证券	5,111,160.32	2.10
6	600887	伊利股份	4,845,128.08	1.99
7	600036	招商银行	4,705,260.00	1.94
8	601318	中国平安	4,440,573.00	1.83
9	000568	泸州老窖	3,748,137.00	1.54
10	000001	平安银行	3,402,371.57	1.40
11	600809	山西汾酒	3,358,379.12	1.38
12	002142	宁波银行	3,356,856.24	1.38
13	601288	农业银行	3,205,742.36	1.32
14	600000	浦发银行	2,879,188.00	1.18
15	601012	隆基绿能	2,865,164.36	1.18
16	603288	海天味业	2,696,503.18	1.11
17	002304	洋河股份	2,374,518.84	0.98
18	601988	中国银行	2,275,659.40	0.94
19	600016	民生银行	2,273,706.94	0.94
20	600837	海通证券	2,271,619.50	0.93

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	245,844,168.72
卖出股票收入（成交）总额	167,177,431.07

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 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司、中国平安保险(集团)股份有限公司曾出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本报告期内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 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	38,822.85

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	39,409.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,232.56

#### 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：本基金本报告期末指数投资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	688170	德龙激光	143,283.84	0.05	新股流通受限
2	301139	元道通信	112,995.48	0.04	新股流通受限
3	688119	中钢洛耐	112,727.81	0.04	新股流通受限
4	301175	中科环保	97,524.60	0.03	新股流通受限
5	688237	超卓航科	95,457.51	0.03	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 (%)
26,045	5,800.06	91,696,742.54	60.70	59,365,881.10	39.30

#### 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	13,445.68	0.0089

### 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

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（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	107,869,536.01
本报告期基金总申购份额	105,856,900.28
减：本报告期基金总赎回份额	62,663,812.65
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	151,062,623.64

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. 本基金本报告期内基金管理人无重大人事变动。
2. 本基金本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

### 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	407,363,932.60	100.00	377,357.62	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。

3)本报告期本基金交易单元没有发生变化。

### 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比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
华安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

注：债券交易的成交金额按净价统计，其中交易所上市实行全价交易的债券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公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	中国证监会指定媒介	2022年1月5日
2	华富基金管理有限公司旗下基金2021年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2022年1月21日
3	华富中证100指数证券投资基金2021年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2022年1月21日
4	华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提	中国证监会指定媒介	2022年1月29日

	示性公告		
5	华富基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2022 年 3 月 31 日
6	华富中证 100 指数证券投资基金 2021 年度报告	中国证监会指定媒介	2022 年 3 月 31 日
7	华富中证 100 指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2022 年 4 月 22 日
8	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	2022 年 6 月 10 日
9	华富基金管理有限公司关于华富中证 100 指数证券投资基金落实中证 100 指数编制方案修订相关安排的公告	中国证监会指定媒介	2022 年 6 月 10 日
10	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	2022 年 6 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

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 (%)
产品特有风险							
无							

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

2022 年 8 月 31 日