

富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

二 0 二 0 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国农业银行股份有限公司

送出日期： 2020 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。本报告中财务资料未经审计。本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§3	主要财务指标、基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6	中期财务报表(未经审计)	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	15
6.3	所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4	报表附注	17
§7	投资组合报告	37
7.1	期末基金资产组合情况	37
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	38
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	47
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	47
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	47

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12	投资组合报告附注	48
§8	基金份额持有人信息	49
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2	期末上市基金前十名持有人	50
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	50
§9	开放式基金份额变动	50
§10	重大事件揭示	51
10.1	基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4	基金投资策略的改变	51
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8	其他重大事件	54
§11	影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
§12	备查文件目录	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)
基金简称	富国中证 500 指数增强 (LOF)
场内简称	富国 500
基金主代码	161017
交易代码	前端交易代码: 161017 后端交易代码: 161021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 10 月 12 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,850,348,695.54 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 10 月 21 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=95%×中证 500 指数收益率+1%(指年收益率，评价时按期间折算)。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	赵瑛	贺倩
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	95105686、4008880688	95599	
传真	021-20361616	010-68121816	
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇	北京市东城区建国门内大街 69 号	

	办公楼二座 27-30 层	
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	裴长江	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	富国基金管理有限公司上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年01月01日至2020年06月30日)
本期已实现收益	876,352,311.56
本期利润	1,018,233,269.57
加权平均基金份额本期利润	0.2839
本期加权平均净值利润率	15.85%
本期基金份额净值增长率	15.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)
期末可供分配利润	2,532,265,069.55
期末可供分配基金份额利润	0.8884
期末基金资产净值	5,600,003,193.89
期末基金份额净值	1.965

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)
基金份额累计净值增长率	144.09%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	9.96%	0.79%	8.13%	0.84%	1.83%	-0.05%
过去三个月	17.24%	1.02%	15.76%	1.08%	1.48%	-0.06%
过去六个月	15.32%	1.64%	11.39%	1.70%	3.93%	-0.06%
过去一年	26.78%	1.34%	18.80%	1.39%	7.98%	-0.05%
过去三年	18.20%	1.37%	-0.94%	1.39%	19.14%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	144.09%	1.58%	66.50%	1.61%	77.59%	-0.03%

注：根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金业绩比较基准 = 95% × 中证 500 指数收益率 + 1% (指年收益率，评价时按期间折算)。中证 500 指数全称“中证小盘 500 指数”，它的样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体状况。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1 日收益率 (benchmark) 按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 95\% * [\text{中证 500 指数}_t / (\text{中证 500 指数}_{t-1}) - 1] + [(1+0.01)^{(1/250)} - 1];$$

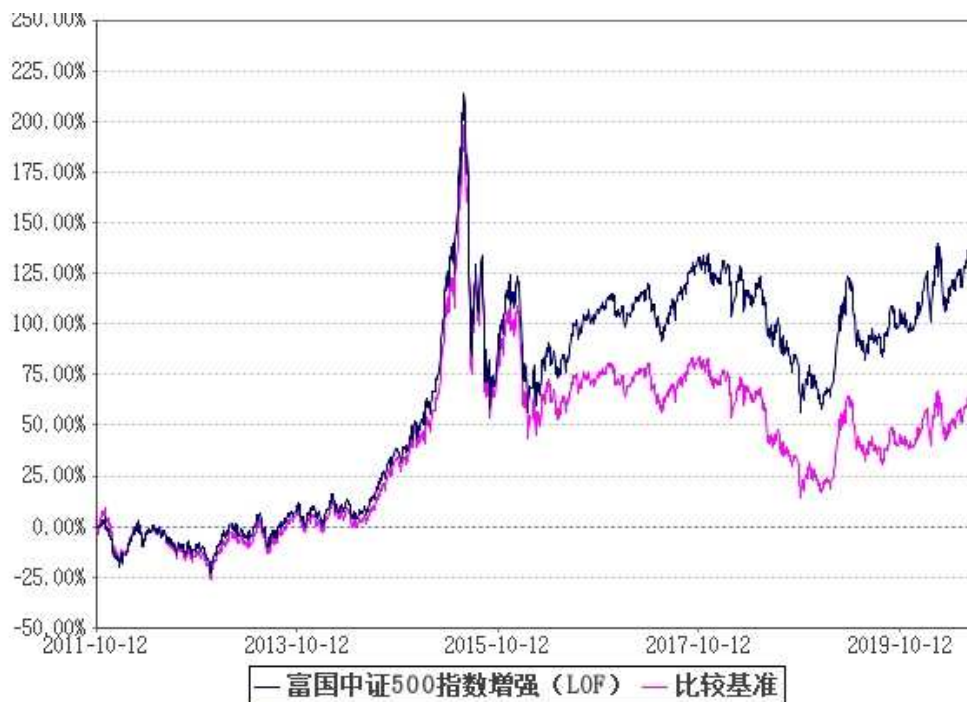
其中，t=1, 2, 3, ..., T, T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率 (benchmark_T) 按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中，T=2, 3, 4, ...; $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示 t 日至 T 日的 (1+benchmark_t) 数学连乘。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2020年6月30日。

2、本基金于2011年10月12日成立，建仓期6个月，从2011年10月12日起至2012年4月11日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于1999年4月13日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于2001年3月从北京迁址上海。2003年9月，加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。

目前，公司注册资本金5.2亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省国际信托股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

截至2020年6月30日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券

投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金等一百六十八只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方旻	本基金基金经理	2014-11-19	—	7.4	硕士，自 2010 年 2 月至 2014 年 4 月任富国基金管理有限公司定量研究员；2014 年 4 月至 2014 年 11 月任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理助理，2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2015 年 5 月至 2019 年 11 月任富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金及富国中证银行指数分级证券投资基金（已于 2019 年 5 月 10 日变更为富国中证银行指数型证券投资基金）的基金经理，2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2017 年 6 月至 2018 年 12 月任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2017 年 7 月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2018 年 5 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2018 年 7 月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经

					理, 2019年1月起任富国MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金基金经理, 2020年2月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 兼任量化投资副总监。具有基金从业资格。
李笑薇	本基金基金经理	2011-10-12	—	17.0	博士, 曾任摩根士丹利资本国际Barra公司(MSCIBARRA), BARRA股票风险评估部高级研究员; 巴克莱国际投资管理公司(BarclaysGlobal Investors), 大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员; 2009年6月加入富国基金管理有限公司, 2009年12月至今任富国沪深300增强证券投资基金基金经理, 2011年1月至2012年5月任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2011年10月至今任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理; 兼任副总经理; 具有中国基金从业资格。
徐幼华	本基金基金经理	2011-10-12	—	15.0	硕士, 曾任上海京华创业投资有限公司投资经理助理; 2006年7月至2008年12月任富国基金管理有限公司金融工程部数量研究员, 2009年1月至2011年5月任富国基金管理有限公司另类投资部数量研究员、基金经理助理, 2011年5月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理, 2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理, 2015年6月至2017年12月任富国中证工业4.0指数分级证券投资基金基金经理, 2016年11月至2020年1月任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理, 2015年6月至2017年11月任富国中证煤炭指数分级证券投资基

					金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理，2017年3月至2020年1月任富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2017年4月至2020年1月任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2018年5月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金、富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2018年7月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理，2018年12月起任富国MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；兼任量化投资部副总经理。具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制

行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现30次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020年伊始，在央行下调存款准备金率0.5个百分点、中美正式签订第一阶段贸易协议等消息提振下，市场乐观预期提前发酵。2月末，受全球疫情加速蔓延的影响，美欧等发达国家股市均出现持续大幅下跌。进入3月，由于欧佩克谈判破裂，原油单日跌幅高达30%以上，同时海外疫情进一步扩散，全球资本市场恐慌性下跌，出现流动性枯竭的情况，多国股市因跌幅过大而迎来熔断。3月下旬，各国政府及央行加大救市力度，其中美联储开启不设上限的量化宽松，大幅缓解了市场的流动性压力，市场恐慌情绪得到有效缓解。4月初，受国内财政货币政策刺激影响，以内需为主的消费、医药等板块率先反弹。5月下旬，全国两会如期召开，会议公布的财政扩张措施基本符合预期，但由于未公布GDP目标，低于部分投资者预期，因此市场出现阶段性调整。6月初，由于美国公布的5月非农就业人数大幅好转，超出市场预期，美股带动全球市场大幅反弹。进入下旬，央行下调14天逆回购利率20个基点，继续释放适度宽松的货币政策信号，同时北上资金继续大幅流入，A股整体出现明显上涨，其中创业板涨幅较大。总体来看，2020年上半年上证综指下跌2.15%，沪深300上涨1.64%，创业板指上涨35.6%，中证500指数上涨11.33%。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极获取超额收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2020年6月30日，本基金份额净值为1.965元；份额累计净值为2.334元；本报告期，本基金份额净值增长率为15.32%，同期业绩比较基准收益率为

11.39%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，总体来看，由于全球流动性仍较为充裕，主要经济体仍将出台大规模经济刺激计划，经济仍有望逐步复苏，因此市场风险偏好仍有望延续提升。进入4季度，随着美国大选进入关键时刻，中美关系可能再度成为全球资本市场关注的焦点。从风格上看，随着经济逐步复苏，市场风格有望阶段性地切换，低估值的周期、蓝筹板块有望获得相对收益。从中期看，市场主线仍是科技、消费、医药等代表经济转型方向的行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司2020年1月1日至2020年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 中期财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2020 年 06 月 30 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
资 产：		
银行存款	668,646,649.18	496,466,976.38
结算备付金	8,550,042.64	6,961,251.60
存出保证金	1,111,837.11	1,082,072.23
交易性金融资产	5,299,469,897.18	5,540,207,248.97
其中：股票投资	5,291,648,877.64	5,538,909,148.97
基金投资	—	—
债券投资	7,821,019.54	1,298,100.00
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	388,857,120.47	—
应收利息	105,856.94	98,345.33
应收股利	—	—
应收申购款	33,507,331.42	79,215,454.23
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	6,400,248,734.94	6,124,031,348.74
负债和所有者权益	本期末 (2020 年 06 月 30 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	—	189,191,299.01

应付赎回款	782,504,771.37	26,942,980.77
应付管理人报酬	5,429,475.91	4,737,746.63
应付托管费	814,421.38	710,661.99
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	8,146,875.07	5,554,197.28
应交税费	43.05	11.25
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	3,349,954.27	542,991.34
负债合计	800,245,541.05	227,679,888.27
所有者权益：		
实收基金	2,850,348,695.54	3,460,588,929.82
未分配利润	2,749,654,498.35	2,435,762,530.65
所有者权益合计	5,600,003,193.89	5,896,351,460.47
负债和所有者权益总计	6,400,248,734.94	6,124,031,348.74

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.965 元，基金份额总额 2,850,348,695.54 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日)
一、收入	1,077,078,545.21	761,150,912.82
1. 利息收入	2,099,519.55	2,156,586.53
其中：存款利息收入	2,096,190.67	1,254,900.12
债券利息收入	3,328.88	799,688.73
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	101,997.68
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	926,592,566.76	313,237,931.15
其中：股票投资收益	861,540,566.37	269,361,710.22
基金投资收益	—	—
债券投资收益	1,605,765.57	425,248.19
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—

股利收益	63,446,234.82	43,450,972.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	141,880,958.01	441,734,859.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6,505,500.89	4,021,536.09
减：二、费用	58,845,275.64	35,624,298.75
1. 管理人报酬	31,863,599.92	21,228,269.05
2. 托管费	4,779,539.97	3,184,240.38
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	21,551,107.62	10,725,905.87
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 税金及附加	11.56	22.00
7. 其他费用	651,016.57	485,861.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,018,233,269.57	725,526,614.07
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,018,233,269.57	725,526,614.07

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,460,588,929.82	2,435,762,530.65	5,896,351,460.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	1,018,233,269.57	1,018,233,269.57
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）	-610,240,234.28	-704,341,301.87	-1,314,581,536.15
其中：1. 基金申购款	2,095,757,967.72	1,548,960,805.41	3,644,718,773.13
2. 基金赎回款	-2,705,998,202.00	-2,253,302,107.28	-4,959,300,309.28
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）	2,850,348,695.54	2,749,654,498.35	5,600,003,193.89
项目	上年度可比期间 (2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,998,450,852.62	887,566,154.83	2,886,017,007.45

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	725,526,614.07	725,526,614.07
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）	449,742,722.28	167,186,961.94	616,929,684.22
其中：1. 基金申购款	2,004,245,153.61	1,426,989,688.91	3,431,234,842.52
2. 基金赎回款	-1,554,502,431.33	-1,259,802,726.97	-2,814,305,158.30
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）	2,448,193,574.90	1,780,279,730.84	4,228,473,305.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈 戈	林志松	徐 慧
—————	—————	—————
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]1095 号《关于核准富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)募集的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2011 年 10 月 12 日正式生效，首次设立募集规模为 455,487,249.88 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。其中，股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%；保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准=95%×中证 500 指数收益率+1%(指年收益率，评价时按期间折算)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会

计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和中期报告》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2020年6月30日的财务状况以及2020年1月1日至2020年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3%调整为1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开

发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策

有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2020 年 06 月 30 日）
活期存款	668,646,649.18
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	668,646,649.18

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2020 年 06 月 30 日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,756,464,019.39	5,291,648,877.64	535,184,858.25
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	7,821,019.54	2,469,319.54
	银行间市场	—	—
	合计	7,821,019.54	2,469,319.54
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	4,761,815,719.39	5,299,469,897.18	537,654,177.79

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）
应收活期存款利息	100,590.90
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	3,462.75
应收债券利息	1,353.02
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	450.27
合计	105,856.94

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（2020年06月30日）
交易所市场应付交易费用	8,146,875.07
银行间市场应付交易费用	—
合计	8,146,875.07

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	2,948,189.66
应付证券出借违约金	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	44,753.80
应付指数使用费	267,175.55
预提上市年费	29,835.26
合计	3,349,954.27

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,460,588,929.82	3,460,588,929.82
本期申购	2,095,757,967.72	2,095,757,967.72

本期赎回（以“-”号填列）	-2,705,998,202.00	-2,705,998,202.00
本期末	2,850,348,695.54	2,850,348,695.54

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	2,197,501,019.70	238,261,510.95	2,435,762,530.65
本期利润	876,352,311.56	141,880,958.01	1,018,233,269.57
本期基金份额交易产生的变动数	-541,588,261.71	-162,753,040.16	-704,341,301.87
其中：基金申购款	1,512,823,542.89	36,137,262.52	1,548,960,805.41
基金赎回款	-2,054,411,804.60	-198,890,302.68	-2,253,302,107.28
本期已分配利润	—	—	—
本期末	2,532,265,069.55	217,389,428.80	2,749,654,498.35

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
活期存款利息收入	1,872,929.30
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	81,232.97
其他	142,028.40
合计	2,096,190.67

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
卖出股票成交总额	7,583,706,046.86
减：卖出股票成本总额	6,722,165,480.49
买卖股票差价收入	861,540,566.37

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,859,307.42
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,251,400.00
减：应收利息总额	2,141.85
买卖债券差价收入	1,605,765.57

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
股票投资产生的股利收益	63,446,234.82
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	63,446,234.82

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
1. 交易性金融资产	141,880,958.01
股票投资	139,411,638.47
债券投资	2,469,319.54

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	141,880,958.01

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
基金赎回费收入	6,469,608.23
转换费收入	35,892.66
合计	6,505,500.89

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
交易所市场交易费用	21,551,107.62
银行间市场交易费用	—
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	21,551,107.62

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
审计费用	44,753.80
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	6,609.90
指数使用费	509,817.61
上市费	29,835.26
合计	651,016.57

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2020年01月01日至2020年06月30日)		上年度可比期间(2019年01月01日至2019年06月30日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
海通证券	2,001,988,241.39	14.40	401,710,701.03	5.47
申万宏源	1,309,209,926.99	9.42	158,465,310.42	2.16

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2020年01月01日至2020年06月30日)		上年度可比期间(2019年01月01日至2019年06月30日)	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
申万宏源	1,502,690.40	15.24	—	—
海通证券	366,401.84	3.72	—	—

6.4.10.1.4 回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	1,199,108.59	9.45	434,242.03	5.33
海通证券	1,824,421.63	14.38	1,208,516.89	14.83
关联方名称	上年度可比期间（2019年01月01日至2019年06月30日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	144,413.79	2.16	117,349.20	2.65
海通证券	366,080.71	5.47	162,913.67	3.67

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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（2020年01月01日至2020年06月30日）	上年度可比期间（2019年01月01日至2019年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	31,863,599.92	21,228,269.05
其中：支付销售机构的客户维护费	6,061,443.79	3,583,735.58

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）	上年度可比期间（2019年01月01日至2019年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	4,779,539.97	3,184,240.38

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。

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未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

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

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：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 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（2020年01月01日至2020年06月30日）		上年度可比期间（2019年01月01日至2019年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	668,646,649.18	1,872,929.30	140,567,539.21	1,021,313.69

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：本报告期内及上年度可比期间内本基金均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002131	利欧股份	2020-01-21	2020-07-21	大宗交易限售	2.86	3.79	6,320,000	18,075,200.00	23,952,800.00	—
002131	利欧股份	2020-04-20	2020-10-20	大宗交易限售	3.37	3.57	3,500,000	11,795,000.00	12,495,000.00	—
002174	游族网络	2020-03-12	2020-09-14	大宗交易限售	19.37	24.68	774,400	15,000,128.00	19,112,192.00	—
002174	游族网络	2020-06-02	2020-12-02	大宗交易限售	18.58	23.59	296,000	5,499,680.00	6,982,640.00	—
002195	二三四五	2020-03-24	2020-09-24	大宗交易限售	2.61	2.70	7,000,000	18,270,000.00	18,900,000.00	—
002195	二三四五	2020-05-25	2020-11-25	大宗交易限售	2.54	2.66	4,000,000	10,160,000.00	10,640,000.00	—
002382	蓝帆医疗	2020-04-03	2020-10-09	大宗交易限售	14.79	28.14	640,000	9,465,600.00	18,009,600.00	—
002503	搜于特	2020-02-28	2020-08-28	大宗交易限售	2.62	2.67	2,404,464	6,299,695.68	6,419,918.88	—
002505	大康农业	2020-03-31	2020-10-09	大宗交易限售	1.86	2.09	4,300,000	7,998,000.00	8,987,000.00	—
002603	以岭药业	2020-06-17	2020-12-17	大宗交易限售	29.87	27.53	478,611	14,296,110.57	13,176,160.83	—
002625	光启技术	2020-05-18	2020-11-18	大宗交易限售	7.07	6.83	710,000	5,019,700.00	4,849,300.00	—
002640	跨境通	2020-02-17	2020-08-17	大宗交易限售	5.66	6.20	1,123,648	6,359,847.68	6,966,617.60	—
300182	捷成股份	2020-03-25	2020-09-25	大宗交易限售	3.43	3.72	3,500,000	12,005,000.00	13,020,000.00	—
300296	利亚德	2020-06-24	2020-12-24	大宗交易	5.59	5.59	2,330,000	13,024,700.00	13,024,700.00	—

				限售						
300297	蓝盾股份	2020-03-27	2020-09-28	大宗交易 限售	4.27	3.79	675,000	2,882,250.00	2,558,250.00	—
300308	中际旭创	2020-02-21	2020-08-21	大宗交易 限售	63.69	61.23	280,000	17,833,200.00	17,144,400.00	—
300324	旋极信息	2020-01-09	2020-07-09	大宗交易 限售	5.43	6.58	1,565,000	8,497,950.00	10,297,700.00	—
300324	旋极信息	2020-03-25	2020-09-25	大宗交易 限售	6.84	6.23	1,462,000	10,000,080.00	9,108,260.00	—
300418	昆仑万维	2020-03-03	2020-09-03	大宗交易 限售	20.49	23.80	976,000	19,998,240.00	23,228,800.00	—
300558	贝达药业	2020-06-10	2020-12-10	大宗交易 限售	105.41	128.18	284,000	29,936,440.00	36,403,120.00	—
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股认购	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	—
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股认购	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	—
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股认购	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	—
600126	杭钢股份	2020-04-21	2020-10-21	大宗交易 限售	7.41	9.53	1,600,000	11,856,000.00	15,248,000.00	—
600126	杭钢股份	2020-05-26	2020-11-26	大宗交易 限售	7.53	9.37	1,530,000	11,520,900.00	14,336,100.00	—
600392	盛和资源	2020-02-14	2020-08-14	大宗交易 限售	6.93	6.86	1,731,600	11,999,988.00	11,878,776.00	—
600511	国药股份	2020-06-24	2020-12-24	大宗交易 限售	41.42	36.97	410,000	16,982,200.00	15,157,700.00	—
600804	鹏博士	2020-01-02	2020-07-02	大宗交易 限售	5.51	8.92	2,177,858	11,999,997.58	19,426,493.36	—
601816	京沪高铁	2020-01-08	2020-07-16	新股限售	4.88	6.17	906,536	4,423,895.68	5,593,327.12	—
603328	依顿电子	2020-01-06	2020-07-06	大宗交易 限售	10.61	10.37	565,500	5,999,955.00	5,864,235.00	—
688096	京源环保	2020-03-31	2020-10-09	新股限售	14.34	21.42	4,485	64,314.90	96,068.70	—
688106	金宏气体	2020-06-09	2020-12-16	新股限售	15.48	41.36	26,075	403,641.00	1,078,462.00	—
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股认购	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	—
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新股认购	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	—
688555	泽达易盛	2020-06-12	2020-12-23	新股限售	19.49	56.80	3,004	58,547.96	170,627.20	—
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新股认购	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	—
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股认购	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	—

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128114	正邦转债	2020-06-17	2020-07-15	认购新发 证券	100.00	100.00	934	93,400.00	93,400.00	

128115	巨星转债	2020-06-24	2020-07-16	认购新发 证券	100. 00	100.00	9,541	954,100.00	954,100.00	
--------	------	------------	------------	------------	------------	--------	-------	------------	------------	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002470	金正大	2020-06-30	重大事项停牌	2.27	2020-07-01	2.16	8,226,700	21,296,583.19	18,674,609.00	—

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有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涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不在下表进行列示。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2020年06月30日）	上年度末（2019年12月31日）
AAA	—	168,000.00
AAA以下	7,821,019.54	1,130,100.00
未评级	—	—
合计	7,821,019.54	1,298,100.00

注：本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2020年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	668,646,649.18	—	—	—	—	—	668,646,649.18
结算备付金	8,550,042.64	—	—	—	—	—	8,550,042.64
存出保证金	1,111,837.11	—	—	—	—	—	1,111,837.11
交易性金融资产	—	—	7,821,019.54	—	—	5,291,648,877.64	5,299,469,897.18
应收证券清算款	—	—	—	—	—	388,857,120.47	388,857,120.47
应收利息	—	—	—	—	—	105,856.94	105,856.94
应收申购款	1,275,131.50	—	—	—	—	32,232,199.92	33,507,331.42
资产总计	679,583,660.43	—	7,821,019.54	—	—	5,712,844,054.97	6,400,248,734.94
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	782,504,771.37	782,504,771.37
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	5,429,475.91	5,429,475.91
应付托管费	—	—	—	—	—	814,421.38	814,421.38
应付交易费用	—	—	—	—	—	8,146,875.07	8,146,875.07
应付税费	—	—	—	—	—	43.05	43.05
其他负债	—	—	—	—	—	3,349,954.27	3,349,954.27
负债总计	—	—	—	—	—	800,245,541.05	800,245,541.05
利率敏感度缺口	679,583,660.43	—	7,821,019.54	—	—	4,912,598,513.92	5,600,003,193.89
上年度末（2019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	496,466,976.38	—	—	—	—	—	496,466,976.38
结算备付金	6,961,251.60	—	—	—	—	—	6,961,251.60
存出保证金	1,082,072.23	—	—	—	—	—	1,082,072.23
交易性金融资产	—	—	1,298,100.00	—	—	5,538,909,148.97	5,540,207,248.97
应收利息	—	—	—	—	—	98,345.33	98,345.33
应收申购款	70,468,867.69	—	—	—	—	8,746,586.54	79,215,454.23
资产总计	574,979,167.90	—	1,298,100.00	—	—	5,547,754,080.84	6,124,031,348.74
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	189,191,299.01	189,191,299.01
应付赎回款	—	—	—	—	—	26,942,980.77	26,942,980.77
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	4,737,746.63	4,737,746.63
应付托管费	—	—	—	—	—	710,661.99	710,661.99
应付交易费用	—	—	—	—	—	5,554,197.28	5,554,197.28
应付税费	—	—	—	—	—	11.25	11.25
其他负债	—	—	—	—	—	542,991.34	542,991.34
负债总计	—	—	—	—	—	227,679,888.27	227,679,888.27
利率敏感度缺口	574,979,167.90	—	1,298,100.00	—	—	5,320,074,192.57	5,896,351,460.47

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本期末及上年度末均持有的交易性权益投资、可转换债券及可交换债券比例较低，因此其他价格风险因素对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。其中，股票资产投资比例不低于基金资产的90%，投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%；保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）		上年度末（2019年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	5,291,648,877.64	94.49	5,538,909,148.97	93.94
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	7,821,019.54	0.14	1,298,100.00	0.02
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	5,299,469,897.18	94.63	5,540,207,248.97	93.96

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。
----	---

	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2020年06月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	1. 业绩比较基准增加 1%	53,826,849.33	56,026,372.28
	2. 业绩比较基准减少 1%	-53,826,849.33	-56,026,372.28

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2020年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币4,915,115,705.72元，属于第二层次的余额为人民币20,227,942.77元，属于第三层次余额为人民币364,126,248.69元。

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期变动情况如下：

上年度末余额人民币251,783,759.65元，本期变动人民币112,342,489.04元，本期末人民币364,126,248.69元。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,291,648,877.64	82.68
	其中：股票	5,291,648,877.64	82.68
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	7,821,019.54	0.12
	其中：债券	7,821,019.54	0.12
	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	677,196,691.82	10.58
8	其他各项资产	423,582,145.94	6.62
9	合计	6,400,248,734.94	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 积极投资按行业分类的股票投资组合：

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	19,142,741.20	0.34
B	采矿业	—	—
C	制造业	530,854,783.78	9.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,294,273.32	0.20
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	46,710,300.00	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	23,621,526.47	0.42
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,235,566.47	0.63
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—

M	科学研究和技术服务业	58,473,119.08	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	725,332,310.32	12.95

7.2.1.2 指数投资按行业分类的股票投资组合：

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,678,037.90	0.21
B	采矿业	117,138,367.52	2.09
C	制造业	2,612,953,803.97	46.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	87,360,175.94	1.56
E	建筑业	67,849,290.00	1.21
F	批发和零售业	356,987,908.05	6.37
G	交通运输、仓储和邮政业	84,908,148.30	1.52
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	643,991,714.16	11.50
J	金融业	202,877,346.70	3.62
K	房地产业	187,678,923.24	3.35
L	租赁和商务服务业	30,976,291.90	0.55
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	38,699,695.44	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	8,950.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	99,617,396.00	1.78
S	综合	23,590,518.20	0.42
	合计	4,566,316,567.32	81.54

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300558	贝达药业	730,667	98,927,566.66	1.77
2	002439	启明星辰	2,211,839	93,052,066.73	1.66

3	300482	万孚生物	851,324	88,537,696.00	1.58
4	002414	高德红外	2,936,459	85,979,519.52	1.54
5	600511	国药股份	2,150,719	85,952,741.73	1.53
6	603233	大参林	979,519	79,556,533.18	1.42
7	000513	丽珠集团	1,627,882	78,154,614.82	1.40
8	002557	洽洽食品	1,395,322	75,612,499.18	1.35
9	600380	健康元	4,603,732	74,764,607.68	1.34
10	300271	华宇软件	2,649,415	74,739,997.15	1.33
11	600216	浙江医药	3,768,080	72,573,220.80	1.30
12	002028	思源电气	3,514,666	71,910,066.36	1.28
13	603712	七一二	1,868,300	71,705,354.00	1.28
14	600143	金发科技	5,389,200	70,975,764.00	1.27
15	000581	威孚高科	3,347,538	69,227,085.84	1.24
16	000090	天健集团	9,819,000	67,849,290.00	1.21
17	601615	明阳智能	5,144,027	64,043,136.15	1.14
18	603444	吉比特	112,980	62,027,149.80	1.11
19	002353	杰瑞股份	1,974,945	61,223,295.00	1.09
20	600845	宝信软件	965,671	57,051,842.68	1.02
21	002233	塔牌集团	4,590,300	55,221,309.00	0.99
22	600325	华发股份	7,233,900	51,071,334.00	0.91
23	002156	通富微电	2,022,221	50,656,636.05	0.90
24	600486	扬农化工	610,349	50,353,792.50	0.90
25	002368	太极股份	1,125,400	49,168,726.00	0.88
26	600466	蓝光发展	8,197,719	44,185,705.41	0.79
27	002382	蓝帆医疗	1,380,100	40,294,011.00	0.72
28	002048	宁波华翔	2,484,373	38,358,719.12	0.68
29	600529	山东药玻	635,214	36,842,412.00	0.66
30	002131	利欧股份	9,820,000	36,447,800.00	0.65
31	601966	玲珑轮胎	1,790,138	36,160,787.60	0.65
32	300315	掌趣科技	4,914,900	36,026,217.00	0.64
33	603338	浙江鼎力	468,501	35,498,320.77	0.63
34	002223	鱼跃医疗	974,750	35,480,900.00	0.63
35	600782	新钢股份	8,694,720	35,474,457.60	0.63
36	002124	天邦股份	2,723,600	34,998,260.00	0.62
37	002195	二三四五	12,730,424	34,402,491.44	0.61
38	002191	劲嘉股份	3,783,720	33,712,945.20	0.60
39	601717	郑煤机	5,721,900	33,701,991.00	0.60
40	600338	西藏珠峰	3,333,000	33,330,000.00	0.60
41	600811	东方集团	7,435,450	32,864,689.00	0.59
42	002013	中航机电	4,142,800	32,728,120.00	0.58
43	300474	景嘉微	479,500	32,270,350.00	0.58

44	601099	太平洋	10,111,100	32,052,187.00	0.57
45	000501	鄂武商A	2,032,100	31,863,328.00	0.57
46	600875	东方电气	3,526,800	31,212,180.00	0.56
47	300418	昆仑万维	1,294,400	31,176,064.00	0.56
48	002174	游族网络	1,246,100	30,677,088.00	0.55
49	000563	陕国投A	8,221,300	30,501,023.00	0.54
50	000800	一汽解放	2,766,900	29,716,506.00	0.53
51	600126	杭钢股份	3,130,000	29,584,100.00	0.53
52	002797	第一创业	4,213,800	29,159,496.00	0.52
53	603000	人民网	1,432,100	28,398,543.00	0.51
54	600862	中航高科	1,672,700	28,302,084.00	0.51
55	002839	张家港行	4,894,800	28,194,048.00	0.50
56	601233	桐昆股份	2,181,625	27,837,535.00	0.50
57	000488	晨鸣纸业	5,589,100	27,610,154.00	0.49
58	600765	中航重机	2,680,300	27,392,666.00	0.49
59	002387	维信诺	1,916,200	27,363,336.00	0.49
60	000028	国药一致	607,457	27,341,639.57	0.49
61	000400	许继电气	2,064,600	27,252,720.00	0.49
62	600446	金证股份	1,402,700	27,212,380.00	0.49
63	300618	寒锐钴业	435,800	27,028,316.00	0.48
64	002128	露天煤业	3,413,088	26,451,432.00	0.47
65	000932	华菱钢铁	6,927,620	26,117,127.40	0.47
66	000717	韶钢松山	6,840,300	25,993,140.00	0.46
67	000156	华数传媒	2,395,700	25,945,431.00	0.46
68	603707	健友股份	401,700	25,937,769.00	0.46
69	300207	欣旺达	1,366,000	25,817,400.00	0.46
70	002217	合力泰	4,820,400	25,307,100.00	0.45
71	600060	海信视像	2,028,999	24,652,337.85	0.44
72	000547	航天发展	1,782,300	24,364,041.00	0.44
73	300274	阳光电源	1,679,000	24,160,810.00	0.43
74	600008	首创股份	7,867,558	23,681,349.58	0.42
75	002064	华峰氨纶	4,612,500	23,385,375.00	0.42
76	000598	兴蓉环境	5,040,400	23,185,840.00	0.41
77	002085	万丰奥威	3,541,000	22,945,680.00	0.41
78	603659	璞泰来	222,109	22,881,669.18	0.41
79	600153	建发股份	2,770,000	22,437,000.00	0.40
80	600376	首开股份	3,767,500	22,077,550.00	0.39
81	300324	旋极信息	3,315,700	21,328,702.00	0.38
82	000528	柳工	3,325,300	20,982,643.00	0.37
83	601718	际华集团	6,316,300	20,970,116.00	0.37
84	002926	华西证券	1,969,500	20,935,785.00	0.37

85	300496	中科创达	265,800	20,652,660.00	0.37
86	300070	碧水源	2,476,662	20,110,495.44	0.36
87	002390	信邦制药	4,343,000	19,804,080.00	0.35
88	600266	城建发展	3,894,569	19,745,464.83	0.35
89	600804	鹏博士	2,177,858	19,426,493.36	0.35
90	002470	*ST金正	8,226,700	18,674,609.00	0.33
91	601200	上海环境	1,549,100	18,589,200.00	0.33
92	600582	天地科技	6,334,900	18,561,257.00	0.33
93	601000	唐山港	8,319,200	18,551,816.00	0.33
94	002244	滨江集团	4,294,500	18,337,515.00	0.33
95	600460	士兰微	1,245,800	18,288,344.00	0.33
96	000848	承德露露	2,600,000	18,200,000.00	0.33
97	000543	皖能电力	4,454,900	17,908,698.00	0.32
98	600657	信达地产	4,255,300	17,531,836.00	0.31
99	600350	山东高速	2,848,500	17,489,790.00	0.31
100	000060	中金岭南	4,685,800	17,431,176.00	0.31
101	600125	铁龙物流	3,062,900	17,090,982.00	0.31
102	600339	中油工程	7,474,500	16,967,115.00	0.30
103	002203	海亮股份	1,921,500	16,813,125.00	0.30
104	601928	凤凰传媒	2,469,420	16,792,056.00	0.30
105	600901	江苏租赁	3,159,100	16,458,911.00	0.29
106	000883	湖北能源	4,502,376	15,848,363.52	0.28
107	000158	常山北明	1,512,000	15,785,280.00	0.28
108	600026	中远海能	2,408,733	15,560,415.18	0.28
109	002807	江阴银行	3,921,440	15,411,259.20	0.28
110	002572	索菲亚	620,677	15,001,763.09	0.27
111	600348	阳泉煤业	3,535,100	14,918,122.00	0.27
112	600673	东阳光	2,142,000	14,801,220.00	0.26
113	600260	凯乐科技	1,077,200	14,563,744.00	0.26
114	002511	中顺洁柔	649,250	14,478,275.00	0.26
115	601801	皖新传媒	2,600,300	14,457,668.00	0.26
116	000813	德展健康	2,319,100	14,378,420.00	0.26
117	600704	物产中大	3,375,233	14,209,730.93	0.25
118	600155	华创阳安	1,129,200	13,539,108.00	0.24
119	601168	西部矿业	2,333,800	13,536,040.00	0.24
120	600757	长江传媒	2,647,500	13,475,775.00	0.24
121	600282	南钢股份	4,135,800	13,358,634.00	0.24
122	002603	以岭药业	478,611	13,176,160.83	0.24
123	603766	隆鑫通用	3,377,750	13,071,892.50	0.23
124	300296	利亚德	2,330,000	13,024,700.00	0.23
125	300182	捷成股份	3,500,000	13,020,000.00	0.23

126	600273	嘉化能源	1,454,200	12,709,708.00	0.23
127	600392	盛和资源	1,805,700	12,401,181.00	0.22
128	300115	长盈精密	536,990	12,270,221.50	0.22
129	600985	淮北矿业	1,531,000	11,926,490.00	0.21
130	600138	中青旅	1,196,100	11,805,507.00	0.21
131	600623	华谊集团	2,280,735	11,768,592.60	0.21
132	600739	辽宁成大	620,000	11,736,600.00	0.21
133	600166	福田汽车	6,518,600	11,733,480.00	0.21
134	002458	益生股份	764,770	11,678,037.90	0.21
135	002110	三钢闽光	1,721,600	11,465,856.00	0.20
136	603556	海兴电力	748,709	10,811,357.96	0.19
137	600316	洪都航空	672,966	10,632,862.80	0.19
138	002709	天赐材料	310,000	10,474,900.00	0.19
139	600058	五矿发展	1,707,401	10,312,702.04	0.18
140	002818	富森美	836,363	10,287,264.90	0.18
141	601598	中国外运	2,920,444	9,433,034.12	0.17
142	000402	金融街	1,353,600	8,987,904.00	0.16
143	002505	大康农业	4,300,000	8,987,000.00	0.16
144	002010	传化智联	1,633,000	8,883,520.00	0.16
145	000009	中国宝安	1,032,820	8,789,298.20	0.16
146	600909	华安证券	1,273,900	8,700,737.00	0.16
147	600507	方大特钢	1,671,800	8,676,642.00	0.15
148	601811	新华文轩	799,800	8,133,966.00	0.15
149	600827	百联股份	540,600	7,811,670.00	0.14
150	601019	山东出版	1,246,800	7,792,500.00	0.14
151	000062	深圳华强	518,800	7,543,352.00	0.13
152	002640	跨境通	1,123,648	6,966,617.60	0.12
153	600787	中储股份	1,544,900	6,782,111.00	0.12
154	000600	建投能源	1,321,200	6,724,908.00	0.12
155	002583	海能达	857,700	6,509,943.00	0.12
156	002503	搜于特	2,404,464	6,419,918.88	0.11
157	000930	中粮科技	911,400	6,224,862.00	0.11
158	002038	双鹭药业	484,200	6,202,602.00	0.11
159	000960	锡业股份	720,600	6,168,336.00	0.11
160	603517	绝味食品	86,869	6,145,113.06	0.11
161	000878	云南铜业	570,201	6,049,832.61	0.11
162	002440	闰土股份	645,145	5,896,625.30	0.11
163	603328	依顿电子	565,500	5,864,235.00	0.10
164	600639	浦东金桥	359,300	5,741,614.00	0.10
165	002416	爱施德	790,800	5,677,944.00	0.10
166	600388	龙净环保	608,486	5,354,676.80	0.10

167	600521	华海药业	146,630	4,975,155.90	0.09
168	002625	光启技术	710,000	4,849,300.00	0.09
169	002701	奥瑞金	1,082,100	4,533,999.00	0.08
170	600062	华润双鹤	297,292	3,930,200.24	0.07
171	000785	居然之家	470,500	3,726,360.00	0.07
172	002019	亿帆医药	155,700	3,576,429.00	0.06
173	300002	神州泰岳	558,600	3,457,734.00	0.06
174	002444	巨星科技	261,159	3,102,568.92	0.06
175	000807	云铝股份	693,184	3,022,282.24	0.05
176	600959	江苏有线	785,800	2,954,608.00	0.05
177	600643	爱建集团	370,030	2,941,738.50	0.05
178	002948	青岛银行	460,500	2,343,945.00	0.04
179	603806	福斯特	46,900	2,340,779.00	0.04
180	603983	丸美股份	22,783	1,960,021.49	0.04
181	002399	海普瑞	76,700	1,920,568.00	0.03
182	600779	水井坊	30,447	1,900,501.74	0.03
183	600908	无锡银行	380,400	1,867,764.00	0.03
184	601003	柳钢股份	419,700	1,859,271.00	0.03
185	002670	国盛金控	84,300	771,345.00	0.01
186	000636	风华高科	2,100	61,299.00	0.00
187	600312	平高电气	7,032	52,177.44	0.00
188	603650	彤程新材	1,200	27,924.00	0.00
189	600161	天坛生物	313	14,188.29	0.00
190	600167	联美控股	700	10,038.00	0.00
191	603882	金域医学	100	8,950.00	0.00
192	300010	立思辰	300	5,871.00	0.00
193	000975	银泰黄金	314	4,923.52	0.00
194	000983	西山煤电	1,060	3,975.00	0.00
195	603858	步长制药	100	2,885.00	0.00
196	002212	南洋股份	100	2,658.00	0.00
197	600707	彩虹股份	500	2,280.00	0.00
198	601865	福莱特	100	1,880.00	0.00
199	002273	水晶光电	100	1,714.00	0.00
200	600557	康缘药业	120	1,670.40	0.00
201	000877	天山股份	100	1,510.00	0.00
202	000738	航发控制	100	1,365.00	0.00
203	000519	中兵红箭	100	942.00	0.00
204	600642	申能股份	124	732.84	0.00
205	002266	浙富控股	130	503.10	0.00
206	002249	大洋电机	100	361.00	0.00
207	600256	广汇能源	100	270.00	0.00

208	600863	内蒙华电	100	246.00	0.00
-----	--------	------	-----	--------	------

**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	603501	韦尔股份	261,835	52,877,578.25	0.94
2	603127	昭衍新药	498,916	52,451,039.08	0.94
3	002697	红旗连锁	4,277,500	46,710,300.00	0.83
4	002241	歌尔股份	1,539,800	45,208,528.00	0.81
5	300607	拓斯达	793,879	32,302,936.51	0.58
6	002216	三全食品	1,331,833	31,830,808.70	0.57
7	603606	东方电缆	1,962,200	28,530,388.00	0.51
8	000876	新希望	931,200	27,749,760.00	0.50
9	002475	立讯精密	539,910	27,724,378.50	0.50
10	603208	江山欧派	263,373	25,652,530.20	0.46
11	603218	日月股份	1,207,620	22,099,446.00	0.39
12	300433	蓝思科技	707,550	19,839,702.00	0.35
13	600459	贵研铂业	632,500	18,854,825.00	0.34
14	603313	梦百合	781,790	18,395,518.70	0.33
15	002928	华夏航空	1,197,887	18,028,199.35	0.32
16	002531	天顺风能	2,937,000	17,563,260.00	0.31
17	002043	兔宝宝	2,041,200	17,411,436.00	0.31
18	300308	中际旭创	280,000	17,144,400.00	0.31
19	300677	英科医疗	130,600	16,690,680.00	0.30
20	002214	大立科技	530,070	14,937,372.60	0.27
21	600760	中航沈飞	443,415	14,552,880.30	0.26
22	002389	航天彩虹	997,600	13,417,720.00	0.24
23	603613	国联股份	138,960	13,062,240.00	0.23
24	002714	牧原股份	138,072	11,321,904.00	0.20
25	600027	华电国际	3,298,500	11,280,870.00	0.20
26	600063	皖维高新	3,259,960	10,627,469.60	0.19
27	000672	上峰水泥	446,800	10,548,948.00	0.19
28	600449	宁夏建材	862,500	10,539,750.00	0.19
29	300770	新媒股份	40,600	9,080,596.00	0.16
30	300498	温氏股份	358,754	7,820,837.20	0.14
31	002555	三七互娱	163,200	7,637,760.00	0.14
32	600584	长电科技	224,100	7,007,607.00	0.13
33	600764	中国海防	239,900	6,069,470.00	0.11
34	300759	康龙化成	61,200	6,022,080.00	0.11
35	000661	长春高新	13,186	5,739,865.80	0.10

36	601816	京沪高铁	906,536	5,593,327.12	0.10
37	000157	中联重科	662,900	4,262,447.00	0.08
38	603916	苏博特	132,500	3,332,375.00	0.06
39	600346	恒力石化	224,600	3,144,400.00	0.06
40	300297	蓝盾股份	675,000	2,558,250.00	0.05
41	300659	中孚信息	42,380	2,543,647.60	0.05
42	300259	新天科技	346,600	2,003,348.00	0.04
43	002605	姚记科技	36,000	1,368,000.00	0.02
44	300782	卓胜微	3,220	1,306,579.40	0.02
45	688106	金宏气体	26,075	1,078,462.00	0.02
46	002157	正邦科技	27,100	473,708.00	0.01
47	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.00
48	688555	泽达易盛	3,004	170,627.20	0.00
49	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
50	688096	京源环保	4,485	96,068.70	0.00
51	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.00
52	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.00
53	300661	圣邦股份	100	30,505.00	0.00
54	603160	汇顶科技	131	29,199.90	0.00
55	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
56	300602	飞荣达	628	20,610.96	0.00
57	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
58	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
59	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
60	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
61	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
62	600038	中直股份	100	4,107.00	0.00
63	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
64	603538	美诺华	60	3,058.80	0.00
65	002100	天康生物	100	1,610.00	0.00
66	000625	长安汽车	100	1,100.00	0.00
67	603008	XD喜临门	100	1,073.00	0.00
68	600461	洪城水业	100	637.00	0.00
69	000933	神火股份	100	415.00	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	300558	贝达药业	89,779,688.26	1.52
2	002064	华峰氨纶	89,379,188.34	1.52

3	300482	万孚生物	86,700,347.92	1.47
4	600511	国药股份	81,537,630.02	1.38
5	002557	洽洽食品	80,384,366.71	1.36
6	000513	丽珠集团	79,612,211.53	1.35
7	600216	浙江医药	76,689,340.34	1.30
8	002439	启明星辰	74,803,373.23	1.27
9	600346	恒力石化	73,630,091.58	1.25
10	300271	华宇软件	70,810,071.01	1.20
11	600026	中远海能	70,263,246.82	1.19
12	000090	天健集团	68,415,133.50	1.16
13	000581	威孚高科	65,849,292.64	1.12
14	600779	水井坊	62,592,249.21	1.06
15	601615	明阳智能	61,009,612.90	1.03
16	600466	蓝光发展	61,003,944.93	1.03
17	600380	健康元	60,329,314.02	1.02
18	002233	塔牌集团	60,046,995.20	1.02
19	000661	长春高新	59,528,294.34	1.01
20	002475	立讯精密	58,050,412.32	0.98

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600745	闻泰科技	126,411,407.38	2.14
2	300014	亿纬锂能	116,022,343.23	1.97
3	600026	中远海能	110,207,233.47	1.87
4	002463	沪电股份	103,653,217.88	1.76
5	603517	绝味食品	100,997,409.92	1.71
6	300529	健帆生物	98,952,579.71	1.68
7	300166	东方国信	90,400,876.55	1.53
8	600779	水井坊	85,525,323.81	1.45
9	000877	天山股份	84,433,140.11	1.43
10	002065	东华软件	81,019,062.86	1.37
11	000547	航天发展	79,041,397.85	1.34
12	603160	汇顶科技	77,684,285.47	1.32
13	002414	高德红外	72,236,970.00	1.23
14	000661	长春高新	71,772,283.93	1.22
15	002444	巨星科技	70,944,280.36	1.20
16	002812	恩捷股份	67,133,545.88	1.14
17	300002	神州泰岳	66,287,036.24	1.12
18	601872	招商轮船	66,157,981.03	1.12

19	600346	恒力石化	66,019,376.55	1.12
20	600511	国药股份	61,360,103.37	1.04

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,335,493,570.69
卖出股票收入（成交）总额	7,583,706,046.86

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	7,821,019.54	0.14
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	7,821,019.54	0.14

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128108	蓝帆转债	43,042	6,773,519.54	0.12
2	128115	巨星转债	9,541	954,100.00	0.02
3	128114	正邦转债	934	93,400.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	—
股指期货投资本期收益(元)	—
股指期货投资本期公允价值变动(元)	—

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计（元）	—
国债期货投资本期收益（元）	—
国债期货投资本期公允价值变动（元）	—

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本报告期本基金投资的前十名股票中没有在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	1,111,837.11
2	应收证券清算款	388,857,120.47
3	应收股利	—

4	应收利息	105,856.94
5	应收申购款	33,507,331.42
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	423,582,145.94

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300558	贝达药业	36,403,120.00	0.65	大宗交易限售
2	600511	国药股份	15,157,700.00	0.27	大宗交易限售

注：本基金本报告期末持有贝达药业（股票代码 300558）公允价值为 98,927,566.66 元，其中大宗交易限售股票部分公允价值为 36,403,120.00 元，剩余部分为正常流通股票；国药股份（股票代码 600511）公允价值为 85,952,741.73 元，其中大宗交易限售股票部分公允价值为 15,157,700.00 元，剩余部分为正常流通股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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

			(%)		(%)
403,958	7,056.05	1,074,466,461.53	37.70	1,775,882,234.01	62.30

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	建信资本管理有限责任公司	1,350,431	1.95
2	吴颖涛	1,000,000	1.44
3	丁飞	788,200	1.14
4	王勇	766,712	1.11
5	戴雯	722,337	1.04
6	李霞	660,800	0.95
7	朱碧云	475,676	0.69
8	孙选艳	403,718	0.58
9	朱凯琳	396,662	0.57
10	章晖	370,054	0.53

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	1,297,150.37	0.0455

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放 式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放 式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年10月12日)基金份额总额	455,487,249.88
报告期期初基金份额总额	3,460,588,929.82

本报告期基金总申购份额	2,095,757,967.72
减：本报告期基金总赎回份额	2,705,998,202.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	2,850,348,695.54

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。
本报告期本基金管理人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	2	811,356,762.77	5.84	—	—	—	—	—	—	739,385.46	5.83	
第一创业证券	2	656,553,004.41	4.72	131,258.60	1.33	—	—	—	—	598,314.12	4.72	
东北证券	2	1,197,071,748.26	8.61	—	—	—	—	—	—	1,090,879.53	8.60	
东方证券	2	652,157,355.72	4.69	1,144,986.30	11.61	—	—	—	—	594,308.22	4.68	
国海证券	2	1,123,110,270.42	8.08	—	—	—	—	—	—	1,023,485.19	8.07	
国联证券	1	387,987,580.29	2.79	—	—	—	—	—	—	353,570.68	2.79	
国泰君安	2	2,665,090,791.75	19.17	5,033,997.54	51.06	—	—	—	—	2,428,692.07	19.14	
海通证券	1	2,001,988,241.39	14.40	366,401.84	3.72	—	—	—	—	1,824,421.63	14.38	
华菁证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
汇丰前海	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
开源证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
申万宏源	4	1,309,209,926.99	9.42	1,502,690.40	15.24	—	—	—	—	1,199,108.59	9.45	
兴业证券	2	1,944,859,151.12	13.99	733,764.20	7.44	—	—	—	—	1,772,351.05	13.97	
浙商证券	1	222,941,326.49	1.60	568,463.04	5.77	—	—	—	—	203,166.88	1.60	
中泰证券	1	682,213,295.33	4.91	—	—	—	—	—	—	635,343.08	5.01	

中信证券	2	246,998,644.62	1.78	377,745.50	3.83	-	-	-	-	225,091.56	1.77
------	---	----------------	------	------------	------	---	---	---	---	------------	------

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金新增券商交易单元：开源证券（002114、46516）。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于提醒投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	规定披露媒介	2020年01月11日
2	富国基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下公募基金基金合同的公告	规定披露媒介	2020年01月20日
3	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	规定披露媒介	2020年02月03日
4	富国基金管理有限公司关于公司固有资金及高级管理人员投资公司旗下偏股型公募基金的公告	规定披露媒介	2020年02月04日
5	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	规定披露媒介	2020年03月17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	2020-01-01至 2020-02-13;2020-02-19至 2020-03-23;2020-06-19至 2020-06-28	788,417,071.87	-	394,926,265.73	393,490,806.14	13.81%

产品特有风险

本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20% 的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。

§ 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）的文件	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。 咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费） 公司网址： http://www.fullgoal.com.cn
2、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同		
3、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议		
4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件		
5、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）财务报表及报表附注		
6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告		