

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

二〇二一年中期报告

2021年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021年08月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	8
§4	管理人报告.....	10
4.1	基金管理人及基金经理.....	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	13
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.....	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5	托管人报告.....	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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	14
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.....	15
6.2	利润表.....	16
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	17
6.4	报表附注.....	18
§7	投资组合报告.....	41
7.1	期末基金资产组合情况.....	41
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12	市场中性策略执行情况	54
7.13	投资组合报告附注	55
§8	基金份额持有人信息	56
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	57
§9	开放式基金份额变动	57
§10	重大事件揭示	58
10.1	基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4	基金投资策略的改变	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8	其他重大事件	61
§11	影响投资者决策的其他重要信息	61
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	62
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	62
§12	备查文件目录	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	
基金简称	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合	
基金主代码	008835	
基金运作方式	契约型开放式。本基金每个工作日开放申购，但本基金对每份基金份额设置三个月的最短持有期限。即：自基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）至该日三个月后的对应日的期间内，投资者不能提出赎回及转换转出申请；该日三个月后的对应日之后，投资者可以提出赎回及转换转出申请。若该日三个月后实际不存在对应日的，则顺延至下一日。	
基金合同生效日	2020年02月25日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（单位：份）	1,165,233,276.46	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	008835	008836
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	934,675,949.30	230,557,327.16

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，运用股指期货等衍生工具对冲市场系统风险，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金根据对市场的判断，采用“多空对冲”等投资策略，在控制基金资产的股票系统性风险暴露的前提下，实现基金资产的保值增值。本基金采用“自下而上”的数量化选股策略，根据市场状况及变化，不定期对模型进行调整，改进模型有效性，从而取得更高的收益。同时遵循数量化选股策略，优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。本基金还将根据对证券市场走势的判断，适时利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险，并采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉绝对收益机会。债券投资策略方面，本基金基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对固定收益资产的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。本基金的存托凭证投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略详见法律文件。

业绩比较基准	中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，利用股指期货等金融工具对冲系统性风险，与股票市场的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金的实际收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	许俊
	联系电话	021-20361818	010-66594319
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95566
传真		021-20361616	010-66594942
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		裴长江	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 中国银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街1号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	富国基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层

§3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年01月01日至2021年06月30日)
本期已实现收益	67,610,474.78
本期利润	38,780,324.17
加权平均基金份额本期利润	0.0493
本期加权平均净值利润率	4.83%
本期基金份额净值增长率	4.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年06月30日)
期末可供分配利润	40,100,184.30
期末可供分配基金份额利润	0.0429
期末基金资产净值	974,776,133.60
期末基金份额净值	1.0429
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	4.29%

(2) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年01月01日至2021年06月30日)
本期已实现收益	-361,457.75
本期利润	7,695,930.73
加权平均基金份额本期利润	0.0448
本期加权平均净值利润率	4.40%
本期基金份额净值增长率	4.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年06月30日)
期末可供分配利润	8,591,871.83
期末可供分配基金份额利润	0.0373
期末基金资产净值	239,149,198.99
期末基金份额净值	1.0373
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	3.73%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.08%	0.25%	0.37%	0.01%	0.71%	0.24%
过去三个月	1.66%	0.26%	1.12%	0.01%	0.54%	0.25%
过去六个月	4.70%	0.35%	2.23%	0.01%	2.47%	0.34%
过去一年	3.16%	0.37%	4.49%	0.01%	-1.33%	0.36%
自基金合同生效起至今	4.29%	0.32%	6.06%	0.01%	-1.77%	0.31%

(2) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.05%	0.26%	0.37%	0.01%	0.68%	0.25%
过去三个月	1.56%	0.26%	1.12%	0.01%	0.44%	0.25%
过去六个月	4.49%	0.35%	2.23%	0.01%	2.26%	0.34%
过去一年	2.74%	0.37%	4.49%	0.01%	-1.75%	0.36%
自基金合同生效起至今	3.73%	0.32%	6.06%	0.01%	-2.33%	0.31%

注：本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率（税后）+3%。

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_T）按下列公式计算：

benchmark_T = 中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率（税后）/360 + 3%/360；

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：

benchmark_T = [∏_{t=1}^T (1+benchmark_t)] - 1

其中，T=2, 3, 4, ...；∏_{t=1}^T (1+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

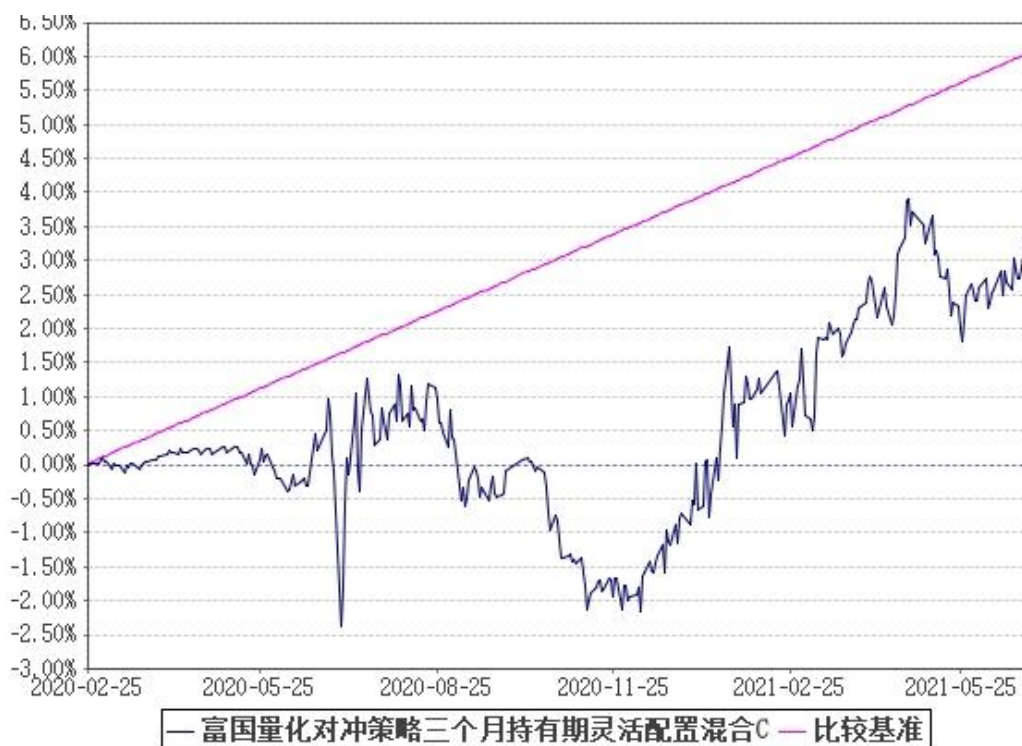
(1) 自基金合同生效以来富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2021 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2020 年 2 月 25 日成立，建仓期 6 个月，从 2020 年 2 月 25 日起至 2020 年 8 月 24 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2) 自基金合同生效以来富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2021年6月30日。

2、本基金于2020年2月25日成立，建仓期6个月，从2020年2月25日起至2020年8月24日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至2021年6月30日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基

金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3年国开行债券指数证券投资基金、富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金等212只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方旻	本基金基金经理	2020-02-25	—	11.4	硕士，自2010年2月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、量化投资部量化投资副总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼高级定量基金经理。2014年4月至2014年11月任富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、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型证券投资基金（原富国中证银行指数分级证券投资基金，于2019年5月10日更名）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月至2020年9月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月至2020年9月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。具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国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 5 次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初以来，在中欧投资协定达成、PMI 向好、货币政策不急转弯等多重利好因素的刺激下，市场风险偏好大幅提升。在美国新一轮财政刺激落地，国内公募基金发行火爆等消息的推动下，上证指数先后突破 3500、3600 点。随着美国经济复苏预期加强，美国 10 年期国债利率快速突破 1.5%，导致全球投资者对美联储货币政策提前收缩的担忧加大，使得全球股市均出现不同程度的下跌。3 月下旬，随着上市公司年报、季报预告陆续披露，部分估值相对合理的公司开始企稳反弹。同时海外疫情再度爆发，美国 10 年期国债利率升幅放缓，A 股快速杀估值阶段告一段落，前期调整较多的板块陆续迎来反弹。4 月下旬，印度疫情超预期爆发，使得货币政策收紧预期进一步降低，市场持续反弹。5 月初，商品价格再度大幅上涨，螺纹钢、铜等品种创出本轮反弹新高，钢铁、煤炭、有色等周期板块大幅上涨。市场通胀预期大幅提升，成长板块出现明显回调。5 月中旬起，国常会多次开会聚焦大宗商品价格问题，指出要高度重视大宗商品价格攀升带来的不利影响。国内相关大宗商品如钢价、煤价迎来大幅调整。随着通胀预期下降，市场风险偏好再度提升，消费、科技、医药、新能源等板块迎来大幅反弹。6 月中，美联储会议并未实质性讨论收紧购债规模，同时美国 10 年期国债利率进一步走低，因此短期流动性未受到明显影响，市场继续反弹。其中，景气度较高的新能源汽车、光伏、半导体等板块涨幅居前。总体来看，2021 年上半年上证综指上涨 3.4%，沪深 300 上涨 0.24%，创业板指上涨 17.22%，中证 500 指数上涨 6.93%。

在投资管理上，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 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值 A 级为 1.0429 元，C 级为 1.0373 元；份额累计净值 A 级为 1.0429 元，C 级为 1.0373 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为 4.70%，C 级为 4.49%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 2.23%，C 级为 2.23%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

司估值过高的风险，适当均衡配置，关注业绩与估值的匹配情况。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在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（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 中期财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国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

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	本期末 (2021年06月30日)	上年度末 (2020年12月31日)
资产：		
银行存款	82,953,498.07	30,682,202.48
结算备付金	33,693,800.52	36,299,926.79
存出保证金	109,625,063.60	113,763,355.35
交易性金融资产	991,454,610.70	1,005,520,198.27
其中：股票投资	945,488,502.22	955,752,198.27
基金投资	—	—
债券投资	45,966,108.48	49,768,000.00
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	128,952.65	5,210,364.91
应收利息	933,825.41	625,502.59
应收股利	—	—
应收申购款	27,040.91	14,916.25
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	1,218,816,791.86	1,192,116,466.64
负债和所有者权益	本期末 (2021年06月30日)	上年度末 (2020年12月31日)
负债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	—	24,659,940.20
应付赎回款	2,696,480.31	4,382,431.79
应付管理人报酬	756,268.61	818,313.17
应付托管费	189,067.17	204,578.27
应付销售服务费	78,388.53	105,338.59
应付交易费用	892,956.55	954,813.02
应交税费	0.27	1,497.80
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—

其他负债	278,297.83	192,827.60
负债合计	4,891,459.27	31,319,740.44
所有者权益：		
实收基金	1,165,233,276.46	1,166,351,112.55
未分配利润	48,692,056.13	-5,554,386.35
所有者权益合计	1,213,925,332.59	1,160,796,726.20
负债和所有者权益总计	1,218,816,791.86	1,192,116,466.64

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0418 元，基金份额总额 1,165,233,276.46 份。其中：富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A 份额净值 1.0429 元，份额总额 934,675,949.30 份；富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C 份额净值 1.0373 元，份额总额 230,557,327.16 份。

6.2 利润表

会计主体：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

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

单位：人民币元

项 目	本期 (2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2020 年 2 月 25 日(基 金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日)
一、收入	55,097,482.78	47,943,249.87
1. 利息收入	1,514,058.68	15,673,078.28
其中：存款利息收入	556,612.13	13,818,700.30
债券利息收入	584,537.69	646,790.27
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	372,908.86	1,207,587.71
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	74,179,352.44	2,596,595.35
其中：股票投资收益	126,588,862.37	-11,167,495.67
基金投资收益	—	—
债券投资收益	526,555.42	934.42
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	-59,518,077.20	-3,627,792.23
股利收益	6,582,011.85	17,390,948.83
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-20,772,762.13	29,112,216.88
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	176,833.79	561,359.36
减：二、费用	8,621,227.88	19,482,288.28

1. 管理人报酬	3,863,910.34	8,089,189.47
2. 托管费	965,977.57	2,022,297.36
3. 销售服务费	340,406.79	1,572,510.72
4. 交易费用	3,317,886.78	7,542,602.47
5. 利息支出	9,493.15	—
其中：卖出回购金融资产支出	9,493.15	—
6. 税金及附加	153.67	166,893.95
7. 其他费用	123,399.58	88,794.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	46,476,254.90	28,460,961.59
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	46,476,254.90	28,460,961.59

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2021年01月01日至2021年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,166,351,112.55	-5,554,386.35	1,160,796,726.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	46,476,254.90	46,476,254.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,117,836.09	7,770,187.58	6,652,351.49
其中：1. 基金申购款	442,305,863.58	13,242,803.08	455,548,666.66
2. 基金赎回款	-443,423,699.67	-5,472,615.50	-448,896,315.17
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）	1,165,233,276.46	48,692,056.13	1,213,925,332.59
项目	上年度可比期间(2020年2月25日(基金合同生效日) 至2020年6月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,990,813,376.70	—	2,990,813,376.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	28,460,961.59	28,460,961.59
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	-357,686,470.78	-591,078.86	-358,277,549.64

列)			
其中：1. 基金申购款	314,064,564.80	-221,821.28	313,842,743.52
2. 基金赎回款	-671,751,035.58	-369,257.58	-672,120,293.16
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）	2,633,126,905.92	27,869,882.73	2,660,996,788.65

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

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（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]2886 号文《关于准予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注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司自 2020 年 2 月 3 日至 2020 年 2 月 20 日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2020）验字第 60467606_B04 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2020 年 2 月 25 日正式生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 2,989,860,275.66 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 953,101.04 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 2,990,813,376.70 元，折合 2,990,813,376.70 份基金份额，其中 A 类基金份额 1,771,147,316.27 份，C 类基金份额 1,219,666,060.43 份。本基金为契约型开放式，每个工作日开放申购，但对每份基金份额设置三个月的最短持有期限，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金根据销售费用收取方式的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金时收取申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，不收取申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货）以及法律法规或中

国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金权益类空头头寸的价值与权益类多头头寸的价值的净风险敞口不超过基金资产净值的10%。其中:权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票及存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值;权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票及存托凭证市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。本基金股票及存托凭证资产的投资比例占基金资产的0-95%,其中,投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%。本基金投资于同业存单和银行存款的比例不超过基金资产的20%。每个交易日日终,持有的买入国债期货和股指期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%。其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等。

每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金不受中国证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第三条、第五条第(一)项、第(三)项及第(五)项的限制以及《公开募集证券投资基金参与国债期货交易指引》第三条的限制。

待基金参与融资融券和转融通证券出借业务及投资其他品种(包括但不限于:其他基金份额、期权、收益互换等)的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并控制风险的前提下,经与基金托管人协商一致后,参与融资融券业务、转融通证券出借业务及投资其他品种,以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通证券出借业务及投资其他品种的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事宜按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会决定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为:中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率(税后)+3%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和中期报告》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

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

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

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

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

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

2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征

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

4 企业所得税

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

5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）
活期存款	82,953,498.07
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	82,953,498.07

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	867,010,394.58	945,488,502.22	78,478,107.64
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	45,930,604.85	45,966,108.48
	银行间市场	—	—
	合计	45,930,604.85	45,966,108.48
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	912,940,999.43	991,454,610.70	78,513,611.27

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

金额单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）			
	名义金额	公允价值		备注(成本)
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	—	—	—	—
其他衍生工具	-890,847,733.44	—	—	—
合计	-890,847,733.44	—	—	—

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额

列报, 净额为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）
应收活期存款利息	9,850.24
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	14,981.63
应收债券利息	908,890.94
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	102.60
合计	933,825.41

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）
交易所市场应付交易费用	892,956.55
银行间市场应付交易费用	—
合计	892,956.55

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	3,585.65
应付证券出借违约金	—
预提信息披露费	170,000.00
预提审计费	104,712.18
合计	278,297.83

6.4.7.9 实收基金

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A:

金额单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	866,698,300.55	866,698,300.55
本期申购	246,204,388.47	246,204,388.47
本期赎回（以“-”号填列）	-178,226,739.72	-178,226,739.72
本期末	934,675,949.30	934,675,949.30

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C:

金额单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	299,652,812.00	299,652,812.00
本期申购	196,101,475.11	196,101,475.11
本期赎回（以“-”号填列）	-265,196,959.95	-265,196,959.95
本期末	230,557,327.16	230,557,327.16

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-32,007,561.90	28,634,832.27	-3,372,729.63
本期利润	67,610,474.78	-28,830,150.61	38,780,324.17
本期基金份额交易产生的变动数	14,532,770.67	-9,840,180.91	4,692,589.76
其中：基金申购款	12,004,007.81	-4,472,597.21	7,531,410.60
基金赎回款	2,528,762.86	-5,367,583.70	-2,838,820.84
本期已分配利润	—	—	—
本期末	50,135,683.55	-10,035,499.25	40,100,184.30

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-12,061,364.77	9,879,708.05	-2,181,656.72
本期利润	-361,457.75	8,057,388.48	7,695,930.73
本期基金份额交易产生的变	23,461,291.08	-20,383,693.26	3,077,597.82

动数			
其中：基金申购款	9,668,707.93	-3,957,315.45	5,711,392.48
基金赎回款	13,792,583.15	-16,426,377.81	-2,633,794.66
本期已分配利润	—	—	—
本期末	11,038,468.56	-2,446,596.73	8,591,871.83

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
活期存款利息收入	86,505.21
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	455,452.66
其他	14,654.26
合计	556,612.13

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
卖出股票成交总额	1,043,374,219.35
减：卖出股票成本总额	916,785,356.98
买卖股票差价收入	126,588,862.37

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（2021年01月01日至2021年06月30日）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	32,237,665.03
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	31,213,250.76
减：应收利息总额	497,858.85
买卖债券差价收入	526,555.42

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

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
股指期货投资收益	-59,518,077.20

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
股票投资产生的股利收益	6,582,011.85
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	6,582,011.85

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
1. 交易性金融资产	-31,139,859.33
股票投资	-31,094,918.57
债券投资	-44,940.76
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	10,367,097.20
权证投资	—
股指期货-套保卖出股指期货	10,367,097.20
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	-20,772,762.13

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
基金赎回费收入	154,689.25
转换费收入	22,144.54

合计	176,833.79
----	------------

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
交易所市场交易费用	3,317,886.78
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	3,317,886.78

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
审计费用	34,712.18
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	10,087.40
债券账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	123,399.58

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
申万宏源西部证券有限公司（“申万宏源西部证券”）	基金管理人的股东控制的子公司、基金代销机构
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	基金管理人的股东控制的子公司

（“申万宏源承销保荐”）

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2021年01月01日至2021年06月30日)		上年度可比期间(2020年2月25日(基金合同生效日)至2020年6月30日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
海通证券	270,828,664.59	13.73	—	—
申万宏源	217,744,107.99	11.04	197,153,722.00	3.59

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(2021年01月01日至2021年06月30日)		上年度可比期间(2020年2月25日(基金合同生效日)至2020年6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	604,762.63	1.08	—	—
海通证券	11,194,245.70	19.91	—	—

6.4.10.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2021年01月01日至2021年06月30日)		上年度可比期间(2020年2月25日(基金合同生效日)至2020年6月30日)	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)
海通证券	200,000,000.00	5.17	—	—

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	198,430.79	11.04	125,734.24	14.08
海通证券	246,809.11	13.73	178,304.63	19.97
关联方名称	上年度可比期间（2020年2月25日（基金合同生效日）至2020年6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	179,667.16	3.59	179,667.16	4.62

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（2021年01月01日至2021年06月30日）	上年度可比期间（2020年2月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	3,863,910.34	8,089,189.47
其中：支付销售机构的客户维护费	394,787.90	4,484,516.86

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）	上年度可比期间（2020年2月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日）
----	-----------------------------	---

当期发生的基金应支付的托管费	965,977.57	2,022,297.36
----------------	------------	--------------

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A级	C级	合计
富国基金管理有限公司	—	3,675.26	3,675.26
申万宏源西部证券	—	45.63	45.63
申万宏源证券有限公司	—	207.23	207.23
中国银行股份有限公司	—	96,101.85	96,101.85
合计	—	100,029.97	100,029.97

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2020年2月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A级	C级	合计
富国基金管理有限公司	—	86,086.24	86,086.24
申万宏源	—	854.95	854.95
中国银行	—	910,671.60	910,671.60
合计	—	997,612.79	997,612.79

注：本基金基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A类基金份额不收取销售服务费。本基金C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）		上年度可比期间（2020年2月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	82,953,498.07	86,505.21	11,614,664.19	449,880.78

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2021年01月01日至2021年06月30日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	300981	中红医疗	IPO网下申购	6,003	291,685.77
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	300937	药易购	IPO网下申购	2,434	29,816.50
海通证券股份有限公司	688217	睿昂基因	IPO网下申购	1,040	19,252.58
海通证券股份有限公司	688685	迈信林	IPO网下申购	2,612	23,678.04
海通证券股份有限公司	688682	霍莱沃	IPO网下申购	946	43,467.38
海通证券股份有限公司	688092	爱科科技	IPO网下申购	1,137	21,836.71
海通证券股份有限公司	688626	翔宇医疗	IPO网下	3,652	105,776.89

公司			申购		
海通证券股份有限 公司	688329	艾隆科技	IPO 网下 申购	1,846	31,186.42
海通证券股份有限 公司	688665	四方光电	IPO 网下 申购	1,687	50,066.20
海通证券股份有限 公司	688687	凯因科技	IPO 网下 申购	5,354	102,127.01

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备 注
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	—
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股限售	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	—
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	—
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股限售	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	—
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	—
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	—
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	—
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	—
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股限售	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	—
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股限售	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	—
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股限售	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	—
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股限售	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	—
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	—
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	663	31,379.79	167,049.48	—
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	—

300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	—
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	—
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	—
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股限售	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	—
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股限售	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	—
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	—
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股限售	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	—
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	—
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	—
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	—
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	—
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	—
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	—
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股限售	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	—
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	—
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	—
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	—
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股限售	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	—
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	—
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	—
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股限售	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	—
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	—
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	—
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股认购	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股认购	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	—
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股认购	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	—
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股认购	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	—
688076	诺泰生物	2021-05-12	2021-11-22	新股限售	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	—
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股认购	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	—
688195	腾景科技	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	13.60	19.87	2,693	36,624.80	53,509.91	—
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股认购	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	—
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股认购	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	—
688456	有研粉材	2021-03-10	2021-09-17	新股限售	10.62	26.50	3,396	36,065.52	89,994.00	—
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股认购	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	—
688621	阳光诺和	2021-06-11	2021-12-21	新股限售	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	—
688636	智明达	2021-03-30	2021-10-08	新股限售	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	—
688676	金盘科技	2021-03-02	2021-09-09	新股限售	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	—

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-15	2021-07-01	认购新发 证券	100.00	100.00	9,780	978,000.00	978,000.00	
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	认购新发 证券	100.00	100.00	2,910	291,000.00	291,000.00	
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	认购新发 证券	100.00	100.00	1,417	141,700.00	141,700.00	

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

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

央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不在下表进行列示。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2021年06月30日）	上年度末（2020年12月31日）
AAA	1,269,000.00	19,710,000.00
AAA以下	187,808.48	97,000.00
未评级	—	—
合计	1,456,808.48	19,807,000.00

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

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人

在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

本基金本报告期末及上年度末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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

单位：人民币元

本期末（2021年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	82,953,498.07	—	—	—	—	—	82,953,498.07
结算备付金	33,693,800.52	—	—	—	—	—	33,693,800.52
存出保证金	228,040.40	—	—	—	—	109,397,023.20	109,625,063.60
交易性金融资产	41,500,000.00	—	4,466,108.48	—	—	945,488,502.22	991,454,610.70
应收证券清算款	—	—	—	—	—	128,952.65	128,952.65
应收利息	—	—	—	—	—	933,825.41	933,825.41
应收申购款	—	—	—	—	—	27,040.91	27,040.91
资产总计	158,375,338.99	—	4,466,108.48	—	—	1,055,975,344.39	1,218,816,791.86
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	2,696,480.31	2,696,480.31
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	756,268.61	756,268.61
应付托管费	—	—	—	—	—	189,067.17	189,067.17
应付销售服务费	—	—	—	—	—	78,388.53	78,388.53
应付交易费用	—	—	—	—	—	892,956.55	892,956.55
应付税费	—	—	—	—	—	0.27	0.27
其他负债	—	—	—	—	—	278,297.83	278,297.83
负债总计	—	—	—	—	—	4,891,459.27	4,891,459.27
利率敏感度缺口	158,375,338.99	—	4,466,108.48	—	—	1,051,083,885.12	1,213,925,332.59
上年度末（2020年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	30,682,202.48	—	—	—	—	—	30,682,202.48
结算备付金	36,299,926.79	—	—	—	—	—	36,299,926.79
存出保证金	833,256.15	—	—	—	—	112,930,099.20	113,763,355.35
交易性金融资产	—	—	30,126,000.00	19,642,000.00	—	955,752,198.27	1,005,520,198.27
应收证券清算款	—	—	—	—	—	5,210,364.91	5,210,364.91
应收利息	—	—	—	—	—	625,502.59	625,502.59
应收申购款	—	—	—	—	—	14,916.25	14,916.25
资产总计	67,815,385.42	—	30,126,000.00	19,642,000.00	—	1,074,533,081.22	1,192,116,466.64
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	24,659,940.20	24,659,940.20
应付赎回款	—	—	—	—	—	4,382,431.79	4,382,431.79
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	818,313.17	818,313.17
应付托管费	—	—	—	—	—	204,578.27	204,578.27
应付销售服务费	—	—	—	—	—	105,338.59	105,338.59
应付交易费用	—	—	—	—	—	954,813.02	954,813.02
应付税费	—	—	—	—	—	1,497.80	1,497.80
其他负债	—	—	—	—	—	192,827.60	192,827.60
负债总计	—	—	—	—	—	31,319,740.44	31,319,740.44
利率敏感度缺口	67,815,385.42	—	30,126,000.00	19,642,000.00	—	1,043,213,340.78	1,160,796,726.20

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动； 2. 利率变动范围合理。		
	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）		
分析	相关风险变量的变动	本期末（2021年06月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-2,979.29	-58,076.73
	2. 基准点利率减少0.1%	2,979.29	58,076.73

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值与权益类多头头寸的价值的净风险敞口不超过基金资产净值的10%。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票及存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值；权益类多头头寸

的价值是指买入持有的股票及存托凭证市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。本基金股票及存托凭证资产的投资比例占基金资产的 0-95%，其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%。本基金投资于同业存单和银行存款的比例不超过基金资产的 20%。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2021 年 06 月 30 日）		上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	945,488,502.22	77.89	955,752,198.27	82.34
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	45,966,108.48	3.79	49,768,000.00	4.29
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	991,454,610.70	81.67	1,005,520,198.27	86.62

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2021 年 06 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	14,981,973.62	9,716,066.25
2. 业绩比较基准减少 1%	-14,981,973.62	-9,716,066.25	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负

债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币943,913,205.10元，属于第二层次的余额为人民币46,253,446.37元，属于第三层次余额为人民币1,287,959.23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2,643,004.49元，本期变动人民币-1,355,045.26元，本期末人民币1,287,959.23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	945,488,502.22	77.57
	其中：股票	945,488,502.22	77.57
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	45,966,108.48	3.77
	其中：债券	45,966,108.48	3.77
	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	116,647,298.59	9.57
8	其他各项资产	110,714,882.57	9.08
9	合计	1,218,816,791.86	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	13,320,230.18	1.10
B	采矿业	5,484,020.60	0.45
C	制造业	546,110,544.19	44.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,274,340.39	0.93
E	建筑业	18,894,106.44	1.56
F	批发和零售业	2,971,480.12	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	22,590,431.00	1.86
H	住宿和餐饮业	951,065.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,456,237.10	2.43
J	金融业	200,288,050.59	16.50
K	房地产业	29,971,680.00	2.47
L	租赁和商务服务业	26,815,146.00	2.21
M	科学研究和技术服务业	22,707,285.67	1.87
N	水利、环境和公共设施管理业	37,101.40	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	1,236,688.00	0.10
Q	卫生和社会工作	10,555,149.54	0.87
R	文化、体育和娱乐业	2,824,946.00	0.23
S	综合	—	—
	合计	945,488,502.22	77.89

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	18,199	37,429,883.30	3.08
2	600036	招商银行	581,800	31,527,742.00	2.60
3	601318	中国平安	390,471	25,099,475.88	2.07
4	601888	中国中免	74,500	22,357,450.00	1.84
5	603259	药明康德	138,428	21,676,440.52	1.79
6	601919	中远海控	590,500	18,033,870.00	1.49

7	300059	东方财富	508,972	16,689,191.88	1.37
8	300122	智飞生物	87,800	16,394,894.00	1.35
9	601166	兴业银行	788,900	16,211,895.00	1.34
10	600809	山西汾酒	35,900	16,083,200.00	1.32
11	000858	五粮液	53,430	15,916,262.70	1.31
12	603501	韦尔股份	44,900	14,457,800.00	1.19
13	603288	海天味业	110,450	14,242,527.50	1.17
14	600104	上汽集团	636,244	13,978,280.68	1.15
15	002714	牧原股份	218,874	13,311,916.68	1.10
16	600089	特变电工	943,100	12,118,835.00	1.00
17	000157	中联重科	1,278,500	11,813,340.00	0.97
18	688036	传音控股	56,000	11,732,000.00	0.97
19	000725	京东方A	1,876,000	11,706,240.00	0.96
20	603799	华友钴业	99,016	11,307,627.20	0.93
21	601636	旗滨集团	599,500	11,126,720.00	0.92
22	000656	金科股份	1,914,900	11,087,271.00	0.91
23	601012	隆基股份	124,180	11,032,151.20	0.91
24	601678	滨化股份	1,379,000	10,907,890.00	0.90
25	000001	平安银行	478,200	10,816,884.00	0.89
26	000799	酒鬼酒	41,100	10,505,160.00	0.87
27	600027	华电国际	2,999,000	10,316,560.00	0.85
28	300223	北京君正	101,900	10,283,748.00	0.85
29	002709	天赐材料	95,134	10,139,381.72	0.84
30	000776	广发证券	669,100	10,130,174.00	0.83
31	603882	金域医学	63,300	10,113,441.00	0.83
32	300529	健帆生物	114,090	9,852,812.40	0.81
33	600132	重庆啤酒	49,300	9,758,935.00	0.80
34	688099	晶晨股份	85,526	9,596,017.20	0.79
35	601377	兴业证券	979,400	9,461,004.00	0.78
36	002142	宁波银行	240,632	9,377,429.04	0.77
37	000568	泸州老窖	38,701	9,131,113.94	0.75
38	600958	东方证券	912,015	9,111,029.85	0.75
39	000651	格力电器	174,200	9,075,820.00	0.75
40	000100	TCL科技	1,167,800	8,933,670.00	0.74
41	600061	国投资本	1,046,216	8,882,373.84	0.73
42	600019	宝钢股份	1,152,900	8,808,156.00	0.73
43	603392	万泰生物	33,740	8,744,733.20	0.72
44	000333	美的集团	114,200	8,150,454.00	0.67
45	600690	海尔智家	313,707	8,128,148.37	0.67
46	300750	宁德时代	14,500	7,754,600.00	0.64
47	000933	神火股份	815,900	7,710,255.00	0.64

48	000830	鲁西化工	411,500	7,707,395.00	0.63
49	600522	中天科技	746,847	7,468,470.00	0.62
50	600039	四川路桥	1,165,800	7,309,566.00	0.60
51	601818	光大银行	1,926,600	7,282,548.00	0.60
52	300782	卓胜微	13,260	7,127,250.00	0.59
53	600390	五矿资本	1,184,100	7,080,918.00	0.58
54	000807	云铝股份	563,900	6,710,410.00	0.55
55	600111	北方稀土	320,700	6,638,490.00	0.55
56	002244	滨江集团	1,556,900	6,523,411.00	0.54
57	002511	中顺洁柔	226,100	6,229,055.00	0.51
58	002475	立讯精密	134,837	6,202,502.00	0.51
59	600845	宝信软件	121,680	6,193,512.00	0.51
60	688185	康希诺	7,700	5,988,829.00	0.49
61	000961	中南建设	1,001,900	5,931,248.00	0.49
62	600887	伊利股份	151,412	5,576,503.96	0.46
63	601390	中国中铁	1,003,900	5,260,436.00	0.43
64	600176	中国巨石	337,363	5,232,500.13	0.43
65	601009	南京银行	489,600	5,150,592.00	0.42
66	688180	君实生物	60,256	4,893,389.76	0.40
67	601186	中国铁建	645,800	4,798,294.00	0.40
68	600760	中航沈飞	75,880	4,575,564.00	0.38
69	300033	同花顺	40,500	4,567,590.00	0.38
70	300595	欧普康视	43,620	4,516,851.00	0.37
71	601881	中国银河	418,900	4,515,742.00	0.37
72	600926	杭州银行	302,500	4,461,875.00	0.37
73	300450	先导智能	74,100	4,456,374.00	0.37
74	600782	新钢股份	770,700	4,300,506.00	0.35
75	600919	江苏银行	605,100	4,296,210.00	0.35
76	002429	兆驰股份	683,200	4,147,024.00	0.34
77	002129	中环股份	107,400	4,145,640.00	0.34
78	601398	工商银行	800,800	4,140,136.00	0.34
79	002124	天邦股份	576,100	4,038,461.00	0.33
80	000488	晨鸣纸业	493,700	4,018,718.00	0.33
81	603606	东方电缆	199,000	4,007,860.00	0.33
82	600276	恒瑞医药	53,842	3,659,640.74	0.30
83	300496	中科创达	23,200	3,643,792.00	0.30
84	300014	亿纬锂能	34,800	3,616,764.00	0.30
85	002027	分众传媒	380,600	3,581,446.00	0.30
86	002415	海康威视	53,300	3,437,850.00	0.28
87	601006	大秦铁路	521,200	3,429,496.00	0.28
88	601939	建设银行	493,300	3,280,445.00	0.27

89	002382	蓝帆医疗	149,200	3,110,820.00	0.26
90	000959	首钢股份	545,500	3,065,710.00	0.25
91	603893	瑞芯微	21,200	2,956,552.00	0.24
92	688111	金山办公	7,400	2,921,520.00	0.24
93	600741	华域汽车	105,000	2,758,350.00	0.23
94	603486	科沃斯	11,700	2,668,536.00	0.22
95	002179	中航光电	31,800	2,512,836.00	0.21
96	300274	阳光电源	21,500	2,473,790.00	0.20
97	600999	招商证券	129,700	2,466,894.00	0.20
98	000550	江铃汽车	102,700	2,406,261.00	0.20
99	002230	科大讯飞	35,200	2,378,816.00	0.20
100	688396	华润微	26,117	2,377,169.34	0.20
101	600325	华发股份	337,900	2,277,446.00	0.19
102	600584	长电科技	57,300	2,159,064.00	0.18
103	600600	青岛啤酒	17,600	2,035,440.00	0.17
104	601128	常熟银行	321,400	1,992,680.00	0.16
105	603986	兆易创新	10,204	1,917,331.60	0.16
106	300896	爱美客	2,373	1,872,012.24	0.15
107	600409	三友化工	180,800	1,827,888.00	0.15
108	002007	华兰生物	48,100	1,764,308.00	0.15
109	300383	光环新网	116,300	1,673,557.00	0.14
110	300327	中颖电子	19,500	1,661,985.00	0.14
111	002241	歌尔股份	38,500	1,645,490.00	0.14
112	000069	华侨城A	218,500	1,625,640.00	0.13
113	000581	威孚高科	75,709	1,577,018.47	0.13
114	002603	以岭药业	53,700	1,565,892.00	0.13
115	600153	建发股份	192,200	1,556,820.00	0.13
116	601688	华泰证券	96,000	1,516,800.00	0.12
117	603260	合盛硅业	19,400	1,492,054.00	0.12
118	601928	凤凰传媒	203,500	1,452,990.00	0.12
119	688188	柏楚电子	3,300	1,438,800.00	0.12
120	002876	三利谱	22,200	1,436,340.00	0.12
121	601100	恒立液压	16,300	1,400,496.00	0.12
122	002460	赣锋锂业	11,400	1,380,426.00	0.11
123	600373	中文传媒	139,000	1,370,540.00	0.11
124	603267	鸿远电子	10,200	1,304,784.00	0.11
125	002607	中公教育	59,200	1,236,688.00	0.10
126	603877	太平鸟	22,300	1,190,374.00	0.10
127	601898	中煤能源	164,700	1,177,605.00	0.10
128	002594	比亚迪	4,636	1,163,636.00	0.10
129	601699	潞安环能	97,800	1,155,018.00	0.10

130	601615	明阳智能	69,662	1,127,827.78	0.09
131	603833	欧派家居	7,900	1,121,484.00	0.09
132	601598	中国外运	220,500	1,113,525.00	0.09
133	603010	万盛股份	53,100	1,113,507.00	0.09
134	601838	成都银行	87,900	1,111,056.00	0.09
135	300737	科顺股份	35,300	1,109,832.00	0.09
136	000661	长春高新	2,859	1,106,433.00	0.09
137	601857	中国石油	205,600	1,087,624.00	0.09
138	300408	三环集团	25,600	1,085,952.00	0.09
139	300783	三只松鼠	22,400	1,060,864.00	0.09
140	600707	彩虹股份	111,900	1,052,979.00	0.09
141	002050	三花智控	42,000	1,007,160.00	0.08
142	002281	光迅科技	40,800	1,003,680.00	0.08
143	600406	国电南瑞	41,760	970,502.40	0.08
144	600309	万华化学	8,800	957,616.00	0.08
145	600754	锦江酒店	16,700	951,065.00	0.08
146	002867	周大生	48,000	948,960.00	0.08
147	688202	美迪西	1,800	935,820.00	0.08
148	300433	蓝思科技	31,400	923,474.00	0.08
149	600057	厦门象屿	140,200	876,250.00	0.07
150	600143	金发科技	41,200	859,432.00	0.07
151	600188	兖州煤业	55,300	849,408.00	0.07
152	002146	荣盛发展	142,700	804,828.00	0.07
153	601877	正泰电器	24,000	801,120.00	0.07
154	601899	紫金矿业	80,300	778,107.00	0.06
155	000002	万科A	31,200	742,872.00	0.06
156	600346	恒力石化	27,800	729,472.00	0.06
157	002736	国信证券	57,000	612,750.00	0.05
158	688002	睿创微纳	6,000	598,980.00	0.05
159	300699	光威复材	7,800	592,410.00	0.05
160	601233	桐昆股份	24,500	590,205.00	0.05
161	000895	双汇发展	17,730	563,814.00	0.05
162	603678	火炬电子	8,200	553,500.00	0.05
163	000717	韶钢松山	116,300	533,817.00	0.04
164	300136	信维通信	16,949	523,385.12	0.04
165	000039	中集集团	28,600	519,948.00	0.04
166	002025	航天电器	10,100	506,717.00	0.04
167	601117	中国化学	55,000	481,800.00	0.04
168	300124	汇川技术	6,300	467,838.00	0.04
169	000012	南玻A	44,900	459,776.00	0.04
170	300482	万孚生物	6,890	445,714.10	0.04

171	300015	爱尔眼科	6,223	441,708.54	0.04
172	002916	深南电路	3,958	439,852.54	0.04
173	600011	华能国际	102,800	433,816.00	0.04
174	603444	吉比特	800	424,000.00	0.03
175	002920	德赛西威	3,800	418,304.00	0.03
176	002572	索菲亚	17,000	411,400.00	0.03
177	002311	海大集团	5,000	408,000.00	0.03
178	600779	水井坊	3,200	404,320.00	0.03
179	600803	新奥股份	23,400	386,334.00	0.03
180	300146	汤臣倍健	11,400	375,060.00	0.03
181	601336	新华保险	8,100	371,871.00	0.03
182	002463	沪电股份	23,700	366,639.00	0.03
183	601669	中国电建	92,800	359,136.00	0.03
184	601225	陕西煤业	30,300	359,055.00	0.03
185	600031	三一重工	12,124	352,444.68	0.03
186	601618	中国中冶	113,900	339,422.00	0.03
187	601668	中国建筑	71,600	332,940.00	0.03
188	601155	新城控股	8,000	332,800.00	0.03
189	002677	浙江美大	18,000	329,040.00	0.03
190	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.03
191	000671	阳光城	62,400	324,480.00	0.03
192	600383	金地集团	30,900	316,416.00	0.03
193	000401	冀东水泥	25,300	312,455.00	0.03
194	002157	正邦科技	25,400	303,530.00	0.03
195	300755	华致酒行	6,000	244,860.00	0.02
196	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.02
197	002648	卫星石化	6,000	235,140.00	0.02
198	002080	中材科技	6,900	180,573.00	0.01
199	300957	贝泰妮	663	167,049.48	0.01
200	000932	华菱钢铁	22,200	146,520.00	0.01
201	600900	长江电力	5,900	121,776.00	0.01
202	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
203	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.01
204	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.01
205	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.01
206	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
207	002555	三七互娱	3,440	82,628.80	0.01
208	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
209	300119	瑞普生物	2,301	77,819.82	0.01
210	002410	广联达	1,100	75,020.00	0.01
211	600000	浦发银行	7,500	75,000.00	0.01

212	688636	智明达	918	74,100.96	0.01
213	002434	万里扬	9,100	73,801.00	0.01
214	000975	银泰黄金	7,460	70,944.60	0.01
215	000338	潍柴动力	3,700	66,119.00	0.01
216	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
217	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.01
218	600352	浙江龙盛	4,400	60,456.00	0.00
219	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
220	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
221	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
222	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.00
223	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
224	000876	新希望	3,288	48,234.96	0.00
225	300760	迈瑞医疗	100	48,005.00	0.00
226	600507	方大特钢	6,500	44,070.00	0.00
227	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
228	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
229	600704	物产中大	3,800	29,906.00	0.00
230	600745	闻泰科技	300	29,070.00	0.00
231	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
232	300829	金丹科技	320	20,960.00	0.00
233	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
234	603317	天味食品	588	17,304.84	0.00
235	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
236	688006	杭可科技	200	17,000.00	0.00
237	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
238	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
239	002352	顺丰控股	200	13,540.00	0.00
240	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
241	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
242	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
243	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
244	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
245	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
246	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
247	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
248	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
249	601628	中国人寿	300	10,167.00	0.00
250	603906	龙蟠科技	280	9,800.00	0.00
251	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
252	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00

253	002028	思源电气	300	9,237.00	0.00
254	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
255	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
256	300777	中简科技	200	9,036.00	0.00
257	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
258	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
259	600438	通威股份	200	8,654.00	0.00
260	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
261	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
262	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
263	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
264	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
265	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
266	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
267	002568	百润股份	80	7,583.20	0.00
268	002960	青鸟消防	280	7,324.80	0.00
269	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
270	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
271	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
272	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
273	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
274	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
275	688299	长阳科技	201	5,422.98	0.00
276	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
277	600030	中信证券	200	4,988.00	0.00
278	603160	汇顶科技	36	4,666.68	0.00
279	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
280	000623	吉林敖东	300	4,647.00	0.00
281	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
282	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
283	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
284	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
285	002056	横店东磁	300	3,900.00	0.00
286	002138	顺络电子	100	3,877.00	0.00
287	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
288	603588	高能环境	260	3,764.80	0.00
289	600985	淮北矿业	300	3,663.00	0.00
290	600048	保利地产	300	3,612.00	0.00
291	603612	索通发展	200	3,594.00	0.00
292	600835	上海机电	200	3,250.00	0.00
293	002034	旺能环境	200	3,190.00	0.00

294	300498	温氏股份	200	2,874.00	0.00
295	002493	荣盛石化	148	2,555.96	0.00
296	600066	宇通客车	200	2,498.00	0.00
297	600637	东方明珠	300	2,457.00	0.00
298	002624	完美世界	100	2,391.00	0.00
299	002797	第一创业	300	2,142.00	0.00
300	603385	惠达卫浴	200	1,966.00	0.00
301	600718	东软集团	200	1,956.00	0.00
302	300593	新雷能	40	1,738.00	0.00
303	600489	中金黄金	200	1,724.00	0.00
304	300502	新易盛	53	1,656.25	0.00
305	000728	国元证券	200	1,594.00	0.00
306	600068	葛洲坝	200	1,498.00	0.00
307	601801	皖新传媒	300	1,416.00	0.00
308	000026	飞亚达	100	1,392.00	0.00
309	002641	永高股份	200	1,380.00	0.00
310	601878	浙商证券	100	1,308.00	0.00
311	600015	华夏银行	200	1,238.00	0.00
312	002563	森马服饰	100	1,195.00	0.00
313	002216	三全食品	72	1,185.84	0.00
314	600340	华夏幸福	200	1,048.00	0.00
315	601985	中国核电	200	1,012.00	0.00
316	601328	交通银行	200	980.00	0.00
317	002064	华峰化学	64	908.80	0.00
318	600028	中国石化	200	872.00	0.00
319	600050	中国联通	200	864.00	0.00
320	600023	浙能电力	200	734.00	0.00
321	600208	新湖中宝	200	608.00	0.00
322	601288	农业银行	200	606.00	0.00
323	600008	首创环保	200	602.00	0.00
324	600795	国电电力	200	486.00	0.00
325	600720	祁连山	18	189.72	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	22,372,015.30	1.93
2	002714	牧原股份	21,875,986.30	1.88
3	600036	招商银行	17,944,654.92	1.55
4	300122	智飞生物	17,429,501.00	1.50

5	601318	中国平安	16,453,420.43	1.42
6	601888	中国中免	13,894,548.93	1.20
7	603288	海天味业	13,544,487.60	1.17
8	603501	韦尔股份	12,833,048.50	1.11
9	000656	金科股份	12,387,133.00	1.07
10	601006	大秦铁路	12,359,234.00	1.06
11	000933	神火股份	11,969,626.00	1.03
12	300782	卓胜微	11,925,619.20	1.03
13	600019	宝钢股份	11,821,931.20	1.02
14	600089	特变电工	11,334,681.59	0.98
15	000157	中联重科	10,716,204.70	0.92
16	000568	泸州老窖	10,634,891.00	0.92
17	601678	滨化股份	10,346,826.68	0.89
18	600690	海尔智家	10,295,229.80	0.89
19	000776	广发证券	10,253,232.00	0.88
20	603259	药明康德	9,990,792.90	0.86

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	600519	贵州茅台	33,761,322.26	2.91
2	601318	中国平安	27,153,824.12	2.34
3	600887	伊利股份	22,224,686.80	1.91
4	600036	招商银行	20,630,226.00	1.78
5	601888	中国中免	20,619,922.64	1.78
6	000333	美的集团	20,566,542.84	1.77
7	600999	招商证券	18,611,039.96	1.60
8	601899	紫金矿业	18,423,526.00	1.59
9	002493	荣盛石化	16,820,928.91	1.45
10	002352	顺丰控股	16,046,100.00	1.38
11	300274	阳光电源	16,034,610.20	1.38
12	601166	兴业银行	15,669,835.00	1.35
13	300759	康龙化成	15,332,219.88	1.32
14	002594	比亚迪	14,285,804.20	1.23
15	000858	五粮液	14,195,101.56	1.22
16	603259	药明康德	14,103,037.86	1.21
17	600809	山西汾酒	13,572,467.80	1.17
18	600030	中信证券	13,165,890.00	1.13
19	002475	立讯精密	12,528,801.26	1.08
20	300122	智飞生物	12,081,232.50	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	937,616,579.50
卖出股票收入（成交）总额	1,043,374,219.35

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	44,509,300.00	3.67
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	1,456,808.48	0.12
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	45,966,108.48	3.79

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	019640	20 国债 10	415,000	41,500,000.00	3.42
2	019645	20 国债 15	30,000	3,009,300.00	0.25
3	113050	南银转债	12,690	1,269,000.00	0.10
4	123117	健帆转债	1,417	141,700.00	0.01
5	127036	三花转债	352	46,108.48	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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF2109	IF2109	-543.00	-841,606, 560.00	-20,230,891.6 0	—
IF2107	IF2107	-42.00	-65,409,1 20.00	-341,594.96	—
IF2112	IF2112	-3.00	-4,626,18 0.00	-221,640.00	—
公允价值变动总额合计(元)					-20,794,126 .56
股指期货投资本期收益(元)					-59,518,077 .20
股指期货投资本期公允价值变动(元)					10,367,097. 20

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

1、对冲策略

现阶段本基金将根据对证券市场走势的判断,适时利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险。

原则上本基金绝大多数时间在股票投资策略的基础上,通过构建和股票多头相匹配的股指期货空头头寸,从而对冲本基金的系统性风险,以获取精选股票的绝对收益。

2、套利策略

本基金主要采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差,捕捉绝对收益机会。同时,本基金根据市场情况的变化,灵活运用其他对冲套利策略提高资本的利用率,从而提高绝对收益,达到投资策略的多元化以进一步降低本基金收益的波动。

(1) 股指期货套利策略

股指期货套利策略是指积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系,进行套利,以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式:

①期现套利

期现套利过程中,由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动,套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

②跨期套利

跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约价差进行获利。

(2) 其他套利策略

基金经理会实时关注市场的发展，前瞻性地运用其他套利策略。

3、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、国债期货等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

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

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、国债期货等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

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 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 945,488,502.22 元，占基金资产净值的比例为 77.89%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 911,641,860.00 元，占基金资产净值的比例为 75.10%，空头合约市值占股票资产的比例为 96.42%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 67,070,785.17 元，公允价值变动损益为-20,727,821.37 元。

7.13 投资组合报告附注

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

本报告编制日前一年内，本基金持有的“兴业银行”的发行主体兴业银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保的违法违规事实，中国银保监会福建监管局于2020年8月31日对公司做出没收违法所得6,361,807.97元，并合计处以罚款15,961,807.97元的行政处罚（闽银保监罚决字〔2020〕24号）；由于存在为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；违反银行卡收单外包管理规定等5项违法违规事实，中国人民银行福州中心支行于2020年9月4日对公司做出警告，没收违法所得10,875,088.15元，并处13,824,431.23元罚款的行政处罚（福银罚字〔2020〕35号）。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“招商银行”的发行主体招商银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；理财产品之间风险隔离不到位；理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准等27项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于2021年5月17日对公司做出罚款7170万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕16号）。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余8名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.13.3 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	109,625,063.60
2	应收证券清算款	128,952.65
3	应收股利	—
4	应收利息	933,825.41
5	应收申购款	27,040.91
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	110,714,882.57

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	1,656	564,417.84	860,064,002.19	92.02	74,611,947.11	7.98
富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C	1,360	169,527.45	190,138,504.27	82.47	40,418,822.89	17.53
合计	3,016	386,350.56	1,050,202,506.46	90.13	115,030,770.00	9.87

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理公司所有从业人员持有本基金	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	687,338.59	0.0735
	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C	48,239.97	0.0209
	合计	735,578.56	0.0631

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	富国量化对冲策略 三个月持有期灵活 配置混合 A	0
	富国量化对冲策略 三个月持有期灵活 配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富国量化对冲策略 三个月持有期灵活 配置混合 A	0
	富国量化对冲策略 三个月持有期灵活 配置混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C
--	------------------------	------------------------

基金合同生效日(2020年02月25日)基金份额总额	1,771,147,316.27	1,219,666,060.43
报告期期初基金份额总额	866,698,300.55	299,652,812.00
本报告期基金总申购份额	246,204,388.47	196,101,475.11
减:本报告期基金总赎回份额	178,226,739.72	265,196,959.95
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	934,675,949.30	230,557,327.16

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	3	223,524,731.38	11.33	—	—	940,000,000.00	24.29	—	—	203,696.75	11.33	—
东方证券	2	10,233,740.71	0.52	—	—	—	—	—	—	9,326.04	0.52	—
广发证券	2	274,035,109.68	13.89	24,490,200.00	43.55	20,000,000.00	0.52	—	—	249,728.52	13.89	—
国盛证券	2	84,150,081.84	4.27	69,666.00	0.12	—	—	—	—	76,685.73	4.27	—
海通证券	2	270,828,664.59	13.73	11,194,245.70	19.91	200,000,000.00	5.17	—	—	246,809.11	13.73	—
华泰证券	2	120,521,527.47	6.11	—	—	320,000,000.00	8.27	—	—	109,830.83	6.11	—
华西证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申港证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源	2	217,744,107.99	11.04	604,762.63	1.08	—	—	—	—	198,430.79	11.04	—
太平洋证券	2	132,897,288.95	6.74	—	—	1,990,000,000.00	51.42	—	—	121,111.45	6.74	—
新时代证券	2	98,162,680.46	4.98	—	—	320,000,000.00	8.27	—	—	89,452.76	4.98	—
银河证券	2	177,154,211.79	8.98	19,698,409.04	35.03	—	—	—	—	161,440.58	8.98	—
浙商证券	3	174,618,340.44	8.85	—	—	—	—	—	—	159,133.99	8.85	—
中金公司	2	77,783,798.45	3.94	—	—	—	—	—	—	70,883.93	3.94	—
中信建投	2	57,388,124.09	2.91	—	—	50,000,000.00	1.29	—	—	52,295.81	2.91	—

中信证券	2	53,509,563.07	2.71	172,959.20	0.31	30,000,000.00	0.78	-	-	48,764.68	2.71	-
------	---	---------------	------	------------	------	---------------	------	---	---	-----------	------	---

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：华西证券（013236、51337），浙商证券（012032），申港证券（50378、012072）。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年01月21日
2	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年01月30日
3	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年02月03日
4	富国基金管理有限公司关于旗下由中国银行股份有限公司等基金托管人托管的部分基金投资范围增加存托凭证、增加C类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告	规定披露媒介	2021年03月06日
5	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年03月13日
6	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年03月17日
7	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年03月24日
8	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年04月14日
9	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年04月20日
10	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年05月06日
11	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021年05月10日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021-02-02 至 2021-05-30	200,025,000.00	-	-	200,025,000.00	17.17%
	2	2021-01-01 至 2021-06-30	434,867,930.00	-	177,434,465.00	257,433,465.00	22.09%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定自 2021 年 3 月 9 日起，在本基金投资范围中增加存托凭证，并对基金合同及托管协议的相应条款进行修订。具体可参见基金管理人于 2021 年 3 月 6 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下由中国银行股份有限公司等基金托管人托管的部分基金投资范围增加存托凭证、增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》及修订后的基金合同、托管协议。

§ 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的文件 2、富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混	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：

<p>合型证券投资基金基金合同</p> <p>3、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托管协议</p> <p>4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件</p> <p>5、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财务报表及报表附注</p> <p>6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告</p>		<p>http://www.fullgoal.com.cn</p>
---	--	--