

富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

二 0 二二年中期报告

2022 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： 中国工商银行股份有限公司

送出日期： 2022 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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	6
2.1	基金基本情况	6
2.2	基金产品说明	6
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标、基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
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	14
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6	中期财务报告（未经审计）	17
6.1	资产负债表	17
6.2	利润表	18
6.3	净资产（基金净值）变动表	19
6.4	报表附注	21
§7	投资组合报告	50
7.1	期末基金资产组合情况	50

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	51
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	72
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	73
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.....	73
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.....	74
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.....	74
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.....	74
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	74
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	74
7.12	投资组合报告附注.....	75
§8	基金份额持有人信息.....	77
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	77
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
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.....	77
§9	开放式基金份额变动.....	78
§10	重大事件揭示.....	79
10.1	基金份额持有人大会决议.....	79
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.....	79
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
10.4	基金投资策略的改变.....	79
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
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.....	79
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	80
10.8	其他重大事件.....	82
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	83
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.....	83
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	83
§12	备查文件目录.....	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	富国中证 800ETF
场内简称	A800ETF
基金主代码	515820
交易代码	515820
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 05 月 13 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（单位：份）	136,526,092.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 5 月 29 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	郭明
	联系电话	021-20361818	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95588
传真		021-20361616	010—66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验	北京市西城区复兴门内大

	区世纪大道 1196 号世纪汇 办公楼二座 27-30 层	街 55 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 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	裴长江	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披 露报纸名称	证券时报
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 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内 大街 55 号

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(2022年01月01日至2022年06月30日)
本期已实现收益	345,256.49
本期利润	-17,246,935.92
加权平均基金份额本期利润	-0.1288
本期加权平均净值利润率	-10.08%
本期基金份额净值增长率	-8.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年06月30日)
期末可供分配利润	44,723,922.98
期末可供分配基金份额利润	0.3276
期末基金资产净值	181,250,014.98
期末基金份额净值	1.3276
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	32.76%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	9.66%	1.04%	9.00%	1.05%	0.66%	-0.01%
过去三个月	6.28%	1.46%	5.20%	1.48%	1.08%	-0.02%
过去六个月	-8.81%	1.45%	-9.97%	1.46%	1.16%	-0.01%
过去一年	-6.20%	1.21%	-12.16%	1.22%	5.96%	-0.01%
自基金合同	32.76%	1.20%	14.03%	1.23%	18.73%	-0.03%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：本基金业绩比较基准根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

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2022年6月30日。

2、本基金于2020年5月13日成立，建仓期6个月，从2020年5月13日起至2020年11月12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 2022 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、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 267 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		
王乐乐	本基金基金经理	2020-05-13	—	12.1	博士，曾任上海证券有限责任公司研究员，华泰联合证券有限责任公司研究员，华泰证券股份有限公司

				<p>研究员、创新规划团队负责人；自2015年5月加入富国基金管理有限公司，历任定量基金经理、量化投资部量化投资总监助理；现任富国基金量化投资部ETF投资总监兼高级定量基金经理。2015年8月至2020年1月任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理，2016年10月至2018年7月任富国全球债券证券投资基金基金经理，2017年10月至2020年1月任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，2017年11月至2020年1月任富国中证工业4.0指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理，2018年11月至2020年5月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018年12月至2020年5月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019年3月至2020年8月任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年6月至2020年8月任富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年7月起任富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年9月起任富国中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年10月起任富国中证消费50交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年11月至2020年12月任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年11月起任富国中证科技50策略交易型开放式指数证券投资基金、富国中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019年12月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金</p>
--	--	--	--	---

					<p>基金经理，2020年1月起任富国中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020年2月起任富国中证科技50策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020年3月起任富国中证医药50交易型开放式指数证券投资基金、富国中证消费50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2020年5月起任富国中证800交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020年7月起任富国上海金交易型开放式证券投资基金、富国上海金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理，2021年5月起任富国中证800银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	--	---

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800交易型开放式指数证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证800交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市

场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的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2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

2022年伊始，随着美国加息预期升温，全球流动性面临收紧，市场风格出现切换，前期表现强势的成长赛道如新能源、锂电池、军工等板块均迎来大幅调整，稳增长板块表现较强。2月下旬，随着俄乌冲突加剧，布伦特原油价格持续走高，投资者对经济滞胀担忧加大，全球股市均出现较大幅度的调整。3月中旬，SEC将

5 家中国公司列入《外国公司问责法》的暂定清单，投资者对中概股从纳斯达克退市的担忧加剧，中概股和港股互联网公司均迎来一轮大幅回调，A 股也出现外资大幅流出的情况。随着国务院金融稳定发展委员会召开专题会议研究当前经济形势和资本市场问题，对市场关切的问题如宏观经济运行、房地产、中概股、平台经济等均做出积极务实的回应，投资者信心获得提振，A 股应声上涨。4 月以来，随着上海疫情持续扩散，汽车、半导体等产业链生产受到较大冲击，市场对于经济增长的担忧持续加大，A 股整体再次出现大幅调整。4 月底，经过短期大幅调整后，A 股投资性价比显现，同时政治局会议再次强调稳增长目标，市场信心有所恢复，A 股迎来快速反弹。进入 5 月，稳增长政策进一步发力：国务院部署稳经济一揽子措施，涉及财政、金融、消费、投资等共 6 方面 33 项措施，努力推动经济回归正常轨道、确保运行在合理区间；央行召开全系统货币信贷形势分析会，部署落实稳定信贷增长工作措施，下调五年期以上 LPR 报价 15bp。5 月、6 月国内政策环境明显改善，市场信心得到有效改善，汽车、光伏、半导体等前期受疫情影响较大的板块迎来大幅反弹，稳增长板块表现相对较弱。

总体来看，2022 年上半年上证综指下跌 6.63%，沪深 300 下跌 9.22%，创业板指下跌 15.41%，中证 500 指数下跌 12.3%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.3276 元；份额累计净值为 1.3276 元；本报告期，本基金份额净值增长率为-8.81%，同期业绩比较基准收益率为-9.97%

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，经过 5、6 月的快速上涨后，市场或将进入基本面验证期。从宏观层面来看，国内稳增长依旧稳步推进，但受美联储持续大幅加息的影响，全球或面临经济衰退预期的冲击。从资金面来看，随着复工复产的推进，前期在金融市场空转的资金或将部分流出，市场资金利率将有所提升。随着中报季来临，市场进入基本面验证期，预计波动加大，行业配置方面或需更加均衡一些。

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

1、自2022年3月15日至2022年5月23日、2022年6月2日至本报告期末（2022年6月30日），本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2、本报告期内本基金未出现资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况。

§ 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	2,859,444.15	1,564,937.80
结算备付金	—	22,510.18
存出保证金	3,801.80	7,428.18
交易性金融资产	178,601,077.20	197,327,090.97
其中：股票投资	178,576,275.03	197,067,741.47
基金投资	—	—
债券投资	24,802.17	259,349.50
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	—	152,028.63
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	75,616.24	195.30
资产总计	181,539,939.39	199,074,191.06
负债和净资产	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 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	—	—
应付清算款	0.05	—
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	20,940.23	24,937.31
应付托管费	6,980.05	8,312.42
应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—
应交税费	0.01	—

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	262,004.07	278,596.82
负债合计	289,924.41	311,846.55
净资产：		
实收基金	136,526,092.00	136,526,092.00
其他综合收益	—	—
未分配利润	44,723,922.98	62,236,252.51
净资产合计	181,250,014.98	198,762,344.51
负债和净资产总计	181,539,939.39	199,074,191.06

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3276 元，基金份额总额 136,526,092.00 份。

比较数据已根据本年《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）》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	-16,846,195.84	13,497,045.08
1.利息收入	3,339.14	3,680.90
其中：存款利息收入	3,339.14	3,624.35
债券利息收入	—	56.55
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	732,202.44	11,152,109.21
其中：股票投资收益	-1,085,390.09	9,846,465.02
基金投资收益	—	—
债券投资收益	78,290.71	43,500.56

资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	1,739,301.82	1,262,143.63
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	—	—
其他投资收益	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-17,592,192.41	2,319,992.26
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	10,454.99	21,262.71
减：二、营业总支出	400,740.08	469,275.74
1. 管理人报酬	127,396.56	119,931.48
2. 托管费	42,465.49	39,977.15
3. 销售服务费	—	—
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	0.12	0.09
8. 其他费用	230,877.91	309,367.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-17,246,935.92	13,027,769.34
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-17,246,935.92	13,027,769.34
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	-17,246,935.92	13,027,769.34

注：比较数据已根据本年《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）》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、上期期末净资产（基金净值）	136,526,092.00	62,236,252.51	198,762,344.51
加：会计政策变更	—	—	—

二、本期期初净资产（基金净值）	136,526,092.00	62,236,252.51	198,762,344.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	—	—	-17,512,329.53
（一）、综合收益总额	—	—	-17,246,935.92
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	—	-265,393.61	-265,393.61
其中：1.基金申购款	3,500,000.00	911,980.94	4,411,980.94
2.基金赎回款	-3,500,000.00	-1,177,374.55	-4,677,374.55
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
（四）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产（基金净值）	136,526,092.00	44,723,922.98	181,250,014.98
项目	上年度可比期间 (2021年01月01日至2021年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	122,526,092.00	37,694,902.73	160,220,994.73
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	122,526,092.00	37,694,902.73	160,220,994.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,500,000.00	11,732,126.32	8,232,126.32
（一）、综合收益总额	—	13,027,769.34	13,027,769.34
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,500,000.00	-1,295,643.02	-4,795,643.02
其中：1.基金申购款	7,000,000.00	2,403,089.15	9,403,089.15
2.基金赎回款	-10,500,000.00	-3,698,732.17	-14,198,732.17
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
（四）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产（基金净值）	119,026,092.00	49,427,029.05	168,453,121.05

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

富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]1833 号《关于准予富国中证 800 交易型开放式指数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向社会公开发行募集，基金合同于 2020 年 5 月 13 日正式生效，首次设立募集规模为 248,526,092.00 份基金份额。本基金为契约型，交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

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。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、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。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及

不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基

金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”

项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币1,564,937.80元，自应收利息转入的重分类金额为人民币171.28元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币1,565,109.08元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币22,510.18元，自应收利息转入的重分类金额为人民币11.11元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币22,521.29元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币7,428.18元，自应收利息转入的重分类金额为人民币3.63元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币7,431.81元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币195.30元，转出至银行存款的重分类金额为人民币171.28元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币11.11元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币3.63元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币9.28元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为

人民币 197,327,090.97 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 9.28 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 197,327,100.25 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资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。对证券投资基金在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，已纳税额从证券投资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 (2022年06月30日)
活期存款	2,859,444.15

等于：本金	2,859,211.75
加：应计利息	232.40
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	2,859,444.15

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2022年06月30日）			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	186,787,855.15	—	178,576,275.03	—
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	24,800.00	24,802.17	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	24,800.00	24,802.17	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	186,812,655.15	2.17	178,601,077.20	—

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末（2022年06月30日）
应收利息	—
其他应收款	—
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2022年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	20,722.87
其中：交易所市场	20,722.87
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	46,364.21
应付指数使用费	105,000.00
IOPV 计算发布费	29,916.99
合计	262,004.07

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	136,526,092.00	136,526,092.00
本期申购	3,500,000.00	3,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,500,000.00	-3,500,000.00
本期末	136,526,092.00	136,526,092.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	48,607,532.25	13,628,720.26	62,236,252.51
本期利润	345,256.49	—	—
本期基金份额交易产生的	-13,122.56	-252,271.05	-265,393.61

变动数			
其中：基金申购款	1,234,745.67	-322,764.73	911,980.94
基金赎回款	-1,247,868.23	70,493.68	-1,177,374.55
本期已分配利润	—	—	—
本期末	48,939,666.18	-4,215,743.20	44,723,922.98

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
活期存款利息收入	3,010.88
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	277.33
其他	50.93
合计	3,339.14

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,040,450.33
股票投资收益——赎回差价收入	-44,939.76
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	-1,085,390.09

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
卖出股票成交总额	15,724,943.50
减：卖出股票成本总额	16,714,937.84
减：交易费用	50,455.99
买卖股票差价收入	-1,040,450.33

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
赎回基金份额对价总额	4,677,374.55
减：现金支付赎回款总额	2,106,741.55
减：赎回股票成本总额	2,615,572.76
减：交易费用	—
赎回差价收入	-44,939.76

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
债券投资收益——利息收入	59.78
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	78,230.93
合计	78,290.71

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	533,700.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	455,400.00
减：应计利息总额	67.93
减：交易费用	2.00
债券投资收益-差价收入	78,230.93

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
股票投资产生的股利收益	1,739,301.82
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	1,739,301.82

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
1. 交易性金融资产	-17,592,192.41
股票投资	-17,588,842.91
债券投资	-3,349.50
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	-17,592,192.41

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
基金赎回费收入	—
替代损益	10,454.99
合计	10,454.99

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
审计费用	16,364.21
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	212.00
指数使用费	70,000.00
其他	84,301.70

合计	230,877.91
----	------------

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）		上年度可比期间（2021年01月01日至2021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	84,587.33	0.30	413,414.36	0.90
申万宏源	222,019.56	0.78	1,099,795.01	2.39

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（2022年01月01日至2022年06月30日）		上年度可比期间（2021年01月01日至2021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	21,100.38	3.95	—	—

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（2022年01月01日至2022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	203.33	0.89	140.29	0.68
海通证券	77.07	0.34	56.03	0.27
关联方名称	上年度可比期间（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	1,002.22	2.88	256.49	1.03
海通证券	376.78	1.08	45.60	0.18

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（2022年01月01日至2022年06月30日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年06月30日）
----	-----------------------------	----------------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	127,396.56	119,931.48
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	42,465.49	39,977.15

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.3 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

份额单位：份

关联方名称	本期末（2022年06月30日）		上年度末（2021年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
海通证券股份有限公司	506,000.00	0.37	—	—
申万宏源证券有限公司	1,495,800.00	1.10	2,548,200.00	1.87

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（2022年01月01日至2022年06月30日）		上年度可比期间（2021年01月01日至2021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
中国工商银行股份有限公司	2,859,444.15	3,010.88	2,771,895.08	3,237.42

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（2022年01月01日至2022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
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	688267	中触媒	IPO网下申购	860	36,214.17
海通证券股份有限公司	688062	迈威生物	IPO网下申购	4,368	152,766.43
海通证券股份有限公司	688220	翱捷科技	IPO网下申购	952	157,425.29
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	601108	财通证券	配股	4,950	33,660.00

金额单位：人民币元

上年度可比期间（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	1,330	64,624.70
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	883	40,572.61
海通证券股份有限公司	688092	爱科科技	IPO网下申购	1,137	21,836.71
海通证券股份有限公司	688626	翔宇医疗	IPO网下申购	1,331	38,551.22
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	1,518	45,050.67
海通证券股份有限公司	688687	凯因科技	IPO网下申购	3,213	61,287.65

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

为更紧密地跟踪标的指数，降低跟踪误差，经与基金托管人协商一致，本基金在报告期内根据基金合同约定的投资策略投资于基金管理人股东发行的股票海通证券（600837.SH）、基金管理人股东的母公司发行的股票申万宏源（000166.SZ）、基金托管人发行的股票工商银行（601398.SH）。

本报告期末，本基金持有海通证券 62,400 股，占基金资产净值比例 0.34%。上年度末，本基金持有海通证券 65,200 股，占基金资产净值比例 0.40%。

本报告期末，本基金持有申万宏源 58,300 股，占基金资产净值比例 0.14%。上年度末，本基金持有申万宏源 76,000 股，占基金资产净值比例 0.20%。

本报告期末，本基金持有工商银行 226,600 股，占基金资产净值比例 0.60%。上年度末，本基金持有工商银行 236,500 股，占基金资产净值比例 0.55%。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月	新股限售	55.57	30.03	127	7,057.39	3,813.81	—
301120	新特电气	2022-04-11	6个月	新股限售	13.73	15.49	736	10,105.28	11,400.64	—
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月	新股限售	37.23	25.39	175	6,515.25	4,443.25	—
301150	中一科技	2022-04-14	6个月	新股限售	163.56	82.76	46	7,523.76	3,806.96	—
301150	中一科技	2022-06-10	5个月	新股限售_转增	—	82.76	23	—	1,903.48	—
301158	德石股份	2022-01-07	6个月	新股限售	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	—
301162	国能日新	2022-04-19	6个月	新股限售	45.13	54.11	184	8,303.92	9,956.24	—
301181	标榜股份	2022-02-11	6个月	新股限售	40.25	30.59	165	6,641.25	5,047.35	—
301196	唯科科技	2022-01-04	6个月	新股限售	64.08	37.52	76	4,870.08	2,851.52	—
301200	大族数控	2022-02-18	6个月	新股限售	76.56	51.92	109	8,345.04	5,659.28	—
301201	诚达药业	2022-01-12	6个月	新股限售	72.69	71.54	121	8,795.49	8,656.34	—
301206	三元生物	2022-01-26	6个月	新股限售	109.30	45.69	79	8,634.70	3,609.51	—
301206	三元生物	2022-06-17	2个月	新股限售_转增	—	45.69	40	—	1,827.60	—
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月	新股限售	173.98	87.82	32	5,567.36	2,810.24	—
301219	腾远钴业	2022-05-24	4个月	新股限售_转增	—	87.82	26	—	2,283.32	—
688120	华海清科	2022-05-30	6个月	新股限售	136.66	217.12	542	74,069.72	117,679.04	—
688153	唯捷创芯	2022-04-01	6个月	新股限售	66.60	44.24	1,121	74,658.60	49,593.04	—
688170	德龙激光	2022-04-22	6个月	新股限售	30.18	47.04	3,375	101,857.50	158,760.00	—
688261	东微半导	2022-01-26	6个月	新股限售	130.00	230.70	634	82,420.00	146,263.80	—
688281	华秦科技	2022-02-28	6个月	新股限售	189.50	246.22	455	86,222.50	112,030.10	—
688281	华秦科技	2022-06-06	4个月	新股限售_转增	—	246.22	182	—	44,812.04	—
688325	赛微微电	2022-04-15	6个月	新股限售	74.55	53.89	1,163	86,701.65	62,674.07	—

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	受限期	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
------	------	-------	-----	--------	------	--------	--------------	--------	--------	----

113060	浙 22 转债	2022-06-15	1 个月	认购新发 证券	100.0 0	100.01	220	22,000.00	22,001.64	—
127064	杭氧转债	2022-05-19	2 个月	认购新发 证券	100.0 0	100.02	28	2,800.00	2,800.53	—

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
002670	国盛金控	2022 年 06 月 01 日	筹划重大事项	9.60	2022 年 07 月 14 日	9.99	7,600.00	77,255.42	72,960.00	—

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 2022 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 2022 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%，但标的指数成分券不受此限。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不在下表进行列示。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2022 年 06 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
AAA	22,001.64	252,461.20
AAA 以下	2,800.53	6,888.30
未评级	—	—
合计	24,802.17	259,349.50

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（2022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	2,859,444.15	—	—	—	—	—	2,859,444.15
存出保证金	3,801.80	—	—	—	—	—	3,801.80
交易性金融资产	—	—	24,802.17	—	—	178,576,275.03	178,601,077.20
其他资产	—	—	—	—	—	75,616.24	75,616.24
资产总计	2,863,245.95	—	24,802.17	—	—	178,651,891.27	181,539,939.39
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	0.05	0.05
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	20,940.23	20,940.23
应付托管费	—	—	—	—	—	6,980.05	6,980.05
应交税费	—	—	—	—	—	0.01	0.01
其他负债	—	—	—	—	—	262,004.07	262,004.07
负债总计	—	—	—	—	—	289,924.41	289,924.41
利率敏感度缺口	2,863,245.95	—	24,802.17	—	—	178,361,966.86	181,250,014.98
上年度末（2021年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,564,937.80	—	—	—	—	—	1,564,937.80
结算备付金	22,510.18	—	—	—	—	—	22,510.18
存出保证金	7,428.18	—	—	—	—	—	7,428.18
交易性金融资产	—	—	259,349.50	—	—	197,067,741.47	197,327,090.97

应收清算款	—	—	—	—	—	152,028.63	152,028.63
其他资产	—	—	—	—	—	195.30	195.30
资产总计	1,594,876.16	—	259,349.50	—	—	197,219,965.40	199,074,191.06
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	24,937.31	24,937.31
应付托管费	—	—	—	—	—	8,312.42	8,312.42
其他负债	—	—	—	—	—	278,596.82	278,596.82
负债总计	—	—	—	—	—	311,846.55	311,846.55
利率敏感度缺口	1,594,876.16	—	259,349.50	—	—	196,908,118.85	198,762,344.51

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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

本基金的投资范围主要为中证 800 指数成份股、备选成份股和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，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（2022年06月30日）		上年度末（2021年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	178,576,275.03	98.52	197,067,741.47	99.15
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	24,802.17	0.01	259,349.50	0.13
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	178,601,077.20	98.54	197,327,090.97	99.28

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：人民币元）	
		本期末（2022年06月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	1,798,499.67	1,972,136.90
2. 业绩比较基准减少 1%	-1,798,499.67	-1,972,136.90	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整

的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 (2022年06月30日)	上年度末 (2021年12月31日)
第一层次	177,735,709.38	196,343,225.01
第二层次	97,762.17	337,876.49
第三层次	767,605.65	645,989.47
合计	178,601,077.20	197,327,090.97

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会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将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 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。

6.4.15.2 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	178,576,275.03	98.37
	其中：股票	178,576,275.03	98.37
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	24,802.17	0.01
	其中：债券	24,802.17	0.01
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	2,859,444.15	1.58
8	其他各项资产	79,418.04	0.04
9	合计	181,539,939.39	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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	736,321.95	0.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	72,630.31	0.04
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—

N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	808,952.26	0.45

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	2,028,857.62	1.12
B	采矿业	5,694,867.70	3.14
C	制造业	105,701,795.57	58.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,716,982.00	2.60
E	建筑业	3,188,160.40	1.76
F	批发和零售业	1,993,944.88	1.10
G	交通运输、仓储和邮政业	4,724,586.28	2.61
H	住宿和餐饮业	89,280.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,292,633.12	4.02
J	金融业	31,075,362.69	17.15
K	房地产业	3,542,961.60	1.95
L	租赁和商务服务业	2,417,134.24	1.33
M	科学研究和技术服务业	2,594,009.68	1.43
N	水利、环境和公共设施管理业	313,131.50	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	68,901.00	0.04
Q	卫生和社会工作	1,285,712.49	0.71
R	文化、体育和娱乐业	727,865.00	0.40
S	综合	311,137.00	0.17
	合计	177,767,322.77	98.08

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	600519	贵州茅台	4,000	8,180,000.00	4.51
2	300750	宁德时代	9,000	4,806,000.00	2.65
3	600036	招商银行	80,000	3,376,000.00	1.86

4	601318	中国平安	70,000	3,268,300.00	1.80
5	601012	隆基绿能	39,172	2,610,030.36	1.44
6	000858	五粮液	12,500	2,524,125.00	1.39
7	002594	比亚迪	6,000	2,000,940.00	1.10
8	000333	美的集团	31,500	1,902,285.00	1.05
9	601166	兴业银行	93,900	1,868,610.00	1.03
10	300059	东方财富	68,427	1,738,045.80	0.96
11	600900	长江电力	73,500	1,699,320.00	0.94
12	601888	中国中免	6,268	1,460,005.24	0.81
13	603259	药明康德	13,132	1,365,596.68	0.75
14	600030	中信证券	63,025	1,365,121.50	0.75
15	600887	伊利股份	33,000	1,285,350.00	0.71
16	000568	泸州老窖	4,700	1,158,738.00	0.64
17	002415	海康威视	30,400	1,100,480.00	0.61
18	601398	工商银行	226,600	1,080,882.00	0.60
19	002475	立讯精密	31,920	1,078,576.80	0.60
20	600276	恒瑞医药	28,672	1,063,444.48	0.59
21	600809	山西汾酒	3,240	1,052,352.00	0.58
22	600438	通威股份	17,400	1,041,564.00	0.57
23	000651	格力电器	30,500	1,028,460.00	0.57
24	300760	迈瑞医疗	3,200	1,002,240.00	0.55
25	600309	万华化学	10,100	979,599.00	0.54
26	000725	京东方 A	242,500	955,450.00	0.53
27	002714	牧原股份	17,046	942,132.42	0.52
28	000001	平安银行	62,700	939,246.00	0.52
29	002142	宁波银行	25,570	915,661.70	0.51
30	002812	恩捷股份	3,600	901,620.00	0.50
31	000002	万科 A	43,800	897,900.00	0.50
32	601328	交通银行	177,600	884,448.00	0.49
33	601899	紫金矿业	93,100	868,623.00	0.48
34	002129	TCL 中环	14,600	859,794.00	0.47
35	002466	天齐锂业	6,700	836,160.00	0.46
36	000792	盐湖股份	27,900	835,884.00	0.46
37	600048	保利发展	46,400	810,144.00	0.45
38	603288	海天味业	8,886	802,938.96	0.44
39	300015	爱尔眼科	17,537	785,131.49	0.43
40	603799	华友钴业	8,190	783,127.80	0.43
41	300124	汇川技术	11,850	780,559.50	0.43
42	002460	赣锋锂业	5,100	758,370.00	0.42
43	600436	片仔癀	2,100	749,133.00	0.41
44	002304	洋河股份	4,000	732,600.00	0.40

45	600031	三一重工	38,300	729,998.00	0.40
46	601668	中国建筑	135,500	720,860.00	0.40
47	601088	中国神华	21,300	709,290.00	0.39
48	300014	亿纬锂能	7,271	708,922.50	0.39
49	002352	顺丰控股	12,600	703,206.00	0.39
50	300498	温氏股份	32,760	697,460.40	0.38
51	600089	特变电工	24,400	668,316.00	0.37
52	600690	海尔智家	24,300	667,278.00	0.37
53	002271	东方雨虹	12,900	663,963.00	0.37
54	300274	阳光电源	6,700	658,275.00	0.36
55	601816	京沪高铁	127,000	637,540.00	0.35
56	601288	农业银行	206,500	623,630.00	0.34
57	600837	海通证券	62,400	612,144.00	0.34
58	603986	兆易创新	4,300	611,503.00	0.34
59	600000	浦发银行	75,900	607,959.00	0.34
60	603501	韦尔股份	3,500	605,605.00	0.33
61	600016	民生银行	160,500	597,060.00	0.33
62	600406	国电南瑞	21,600	583,200.00	0.32
63	601919	中远海控	40,950	569,205.00	0.31
64	300122	智飞生物	5,100	566,151.00	0.31
65	688981	中芯国际	12,400	560,108.00	0.31
66	000625	长安汽车	31,954	553,443.28	0.31
67	002049	紫光国微	2,900	550,188.00	0.30
68	600585	海螺水泥	15,400	543,312.00	0.30
69	600919	江苏银行	76,300	543,256.00	0.30
70	601688	华泰证券	37,900	538,180.00	0.30
71	600104	上汽集团	30,100	536,081.00	0.30
72	002709	天赐材料	8,600	533,716.00	0.29
73	601225	陕西煤业	25,000	529,500.00	0.29
74	000063	中兴通讯	20,400	520,812.00	0.29
75	601601	中国太保	22,000	517,660.00	0.29
76	002241	歌尔股份	15,400	517,440.00	0.29
77	000661	长春高新	2,200	513,524.00	0.28
78	002371	北方华创	1,800	498,816.00	0.28
79	300142	沃森生物	10,300	498,417.00	0.27
80	600111	北方稀土	14,100	495,756.00	0.27
81	002230	科大讯飞	11,900	490,518.00	0.27
82	002459	晶澳科技	5,880	463,932.00	0.26
83	688599	天合光能	7,000	456,750.00	0.25
84	300450	先导智能	7,100	448,578.00	0.25
85	601988	中国银行	136,200	444,012.00	0.24

86	601211	国泰君安	29,100	442,320.00	0.24
87	002027	分众传媒	65,400	440,142.00	0.24
88	000338	潍柴动力	34,900	435,203.00	0.24
89	601169	北京银行	95,700	434,478.00	0.24
90	000100	TCL 科技	90,700	434,453.00	0.24
91	600660	福耀玻璃	10,300	430,643.00	0.24
92	601229	上海银行	64,300	421,165.00	0.23
93	601985	中国核电	61,000	418,460.00	0.23
94	600050	中国联通	120,200	415,892.00	0.23
95	600745	闻泰科技	4,800	408,528.00	0.23
96	601766	中国中车	78,500	408,200.00	0.23
97	601390	中国中铁	66,300	407,082.00	0.22
98	600522	中天科技	17,600	406,560.00	0.22
99	300347	泰格医药	3,500	400,575.00	0.22
100	600893	航发动力	8,600	391,386.00	0.22
101	601669	中国电建	49,500	389,565.00	0.21
102	603659	璞泰来	4,500	379,800.00	0.21
103	601658	邮储银行	70,300	378,917.00	0.21
104	601615	明阳智能	10,800	365,040.00	0.20
105	000776	广发证券	19,000	355,300.00	0.20
106	600028	中国石化	86,400	352,512.00	0.19
107	600009	上海机场	6,200	351,540.00	0.19
108	600905	三峡能源	55,500	349,095.00	0.19
109	600019	宝钢股份	57,600	346,752.00	0.19
110	600010	包钢股份	147,300	346,155.00	0.19
111	601009	南京银行	33,200	345,944.00	0.19
112	600958	东方证券	33,700	344,077.00	0.19
113	600999	招商证券	23,870	343,966.70	0.19
114	600196	复星医药	7,800	343,902.00	0.19
115	002179	中航光电	5,360	339,395.20	0.19
116	002410	广联达	6,200	337,528.00	0.19
117	601857	中国石油	62,800	332,840.00	0.18
118	601628	中国人寿	10,700	332,556.00	0.18
119	000895	双汇发展	11,200	328,160.00	0.18
120	600570	恒生电子	7,498	326,462.92	0.18
121	601818	光大银行	107,000	322,070.00	0.18
122	002311	海大集团	5,300	318,053.00	0.18
123	002050	三花智控	11,530	316,844.40	0.17
124	600256	广汇能源	29,600	311,984.00	0.17
125	300759	康龙化成	3,250	309,465.00	0.17
126	600760	中航沈飞	5,040	304,668.00	0.17

127	600346	恒力石化	13,600	302,464.00	0.17
128	300782	卓胜微	2,240	302,400.00	0.17
129	002493	荣盛石化	19,500	300,105.00	0.17
130	300896	爱美客	500	300,005.00	0.17
131	002074	国轩高科	6,500	296,400.00	0.16
132	601633	长城汽车	7,900	292,616.00	0.16
133	300496	中科创达	2,200	287,056.00	0.16
134	600926	杭州银行	19,100	286,118.00	0.16
135	300769	德方纳米	700	286,076.00	0.16
136	600460	士兰微	5,400	280,800.00	0.15
137	600426	华鲁恒升	9,530	278,276.00	0.15
138	000538	云南白药	4,600	277,794.00	0.15
139	300316	晶盛机电	4,100	277,119.00	0.15
140	001979	招商蛇口	20,400	273,972.00	0.15
141	601989	中国重工	73,600	273,056.00	0.15
142	300661	圣邦股份	1,500	273,030.00	0.15
143	002001	新和成	11,944	272,442.64	0.15
144	600176	中国巨石	15,502	269,889.82	0.15
145	000768	中航西飞	8,900	269,581.00	0.15
146	688012	中微公司	2,300	268,525.00	0.15
147	002202	金风科技	17,800	263,440.00	0.15
148	601939	建设银行	43,400	263,004.00	0.15
149	603993	洛阳钼业	45,700	261,861.00	0.14
150	600096	云天化	8,300	261,284.00	0.14
151	002821	凯莱英	900	260,100.00	0.14
152	688111	金山办公	1,300	256,256.00	0.14
153	601006	大秦铁路	38,300	252,397.00	0.14
154	601138	工业富联	25,600	251,904.00	0.14
155	002920	德赛西威	1,700	251,600.00	0.14
156	300012	华测检测	10,800	250,668.00	0.14
157	000166	申万宏源	58,300	250,107.00	0.14
158	000596	古井贡酒	1,000	249,660.00	0.14
159	600600	青岛啤酒	2,400	249,408.00	0.14
160	000963	华东医药	5,500	248,380.00	0.14
161	601877	正泰电器	6,900	246,882.00	0.14
162	600584	长电科技	9,100	245,700.00	0.14
163	600763	通策医疗	1,400	244,216.00	0.13
164	300207	欣旺达	7,700	243,320.00	0.13
165	601377	兴业证券	34,500	243,225.00	0.13
166	002497	雅化集团	7,400	241,610.00	0.13
167	601600	中国铝业	50,700	240,825.00	0.13

168	601066	中信建投	8,300	239,953.00	0.13
169	600588	用友网络	11,040	239,678.40	0.13
170	002407	多氟多	4,900	239,659.00	0.13
171	600029	南方航空	32,600	238,306.00	0.13
172	300390	天华超净	2,700	235,980.00	0.13
173	002240	盛新锂能	3,900	235,404.00	0.13
174	600383	金地集团	17,500	235,200.00	0.13
175	600741	华域汽车	10,200	234,600.00	0.13
176	601186	中国铁建	29,600	233,840.00	0.13
177	600188	兖矿能源	5,900	232,932.00	0.13
178	600085	同仁堂	4,400	232,672.00	0.13
179	601838	成都银行	14,000	232,120.00	0.13
180	000786	北新建材	6,700	231,954.00	0.13
181	603806	福斯特	3,512	230,106.24	0.13
182	600157	永泰能源	143,600	228,324.00	0.13
183	002180	纳思达	4,500	227,790.00	0.13
184	600795	国电电力	57,700	225,607.00	0.12
185	600141	兴发集团	5,100	224,349.00	0.12
186	000009	中国宝安	16,600	223,934.00	0.12
187	601111	中国国航	19,200	222,912.00	0.12
188	300408	三环集团	7,400	222,740.00	0.12
189	600885	宏发股份	5,320	222,642.00	0.12
190	000876	新希望	14,500	221,850.00	0.12
191	601117	中国化学	23,500	221,135.00	0.12
192	688005	容百科技	1,700	220,048.00	0.12
193	600132	重庆啤酒	1,500	219,900.00	0.12
194	600150	中国船舶	11,500	218,270.00	0.12
195	603019	中科曙光	7,500	217,650.00	0.12
196	600547	山东黄金	11,660	216,409.60	0.12
197	601238	广汽集团	14,200	216,408.00	0.12
198	601100	恒立液压	3,492	215,526.24	0.12
199	003816	中国广核	76,300	213,640.00	0.12
200	601800	中国交建	22,700	210,656.00	0.12
201	600989	宝丰能源	14,200	208,030.00	0.11
202	300073	当升科技	2,300	207,782.00	0.11
203	600015	华夏银行	39,600	206,316.00	0.11
204	300999	金龙鱼	3,800	205,276.00	0.11
205	603369	今世缘	4,000	204,000.00	0.11
206	600392	盛和资源	9,000	203,400.00	0.11
207	002384	东山精密	8,800	201,784.00	0.11
208	600886	国投电力	19,200	201,600.00	0.11

209	603613	国联股份	2,275	201,565.00	0.11
210	600011	华能国际	28,300	199,232.00	0.11
211	002648	卫星化学	7,700	199,045.00	0.11
212	601868	中国能建	83,800	198,606.00	0.11
213	002756	永兴材料	1,300	197,873.00	0.11
214	601788	光大证券	12,500	197,000.00	0.11
215	000157	中联重科	31,900	196,504.00	0.11
216	688396	华润微	3,300	194,931.00	0.11
217	000301	东方盛虹	11,500	194,465.00	0.11
218	600115	中国东航	35,400	194,346.00	0.11
219	300601	康泰生物	4,280	193,370.40	0.11
220	603833	欧派家居	1,280	192,870.40	0.11
221	600418	江淮汽车	11,200	192,192.00	0.11
222	300763	锦浪科技	900	191,700.00	0.11
223	002236	大华股份	11,600	190,472.00	0.11
224	000425	徐工机械	35,300	190,267.00	0.10
225	603185	上机数控	1,200	187,188.00	0.10
226	300595	欧普康视	3,260	186,439.40	0.10
227	002601	龙佰集团	9,200	184,460.00	0.10
228	300037	新宙邦	3,500	183,960.00	0.10
229	300285	国瓷材料	5,100	183,192.00	0.10
230	300628	亿联网络	2,400	182,760.00	0.10
231	600399	抚顺特钢	10,200	182,580.00	0.10
232	002008	大族激光	5,500	182,215.00	0.10
233	002555	三七互娱	8,500	180,455.00	0.10
234	600233	圆通速递	8,800	179,432.00	0.10
235	601916	浙商银行	54,000	179,280.00	0.10
236	601555	东吴证券	25,820	178,932.60	0.10
237	600765	中航重机	5,560	178,920.80	0.10
238	000938	紫光股份	9,180	178,092.00	0.10
239	601058	赛轮轮胎	15,800	178,066.00	0.10
240	002736	国信证券	18,600	178,002.00	0.10
241	601901	方正证券	26,500	177,815.00	0.10
242	000977	浪潮信息	6,700	177,416.00	0.10
243	600487	亨通光电	12,100	175,934.00	0.10
244	000983	山西焦煤	13,110	175,542.90	0.10
245	600941	中国移动	2,900	175,450.00	0.10
246	600499	科达制造	8,500	175,440.00	0.10
247	600486	扬农化工	1,300	173,264.00	0.10
248	002841	视源股份	2,300	173,236.00	0.10
249	600732	爱旭股份	5,200	171,704.00	0.09

250	000069	华侨城 A	26,400	171,336.00	0.09
251	601799	星宇股份	1,000	171,000.00	0.09
252	600219	南山铝业	46,300	170,847.00	0.09
253	603486	科沃斯	1,400	170,646.00	0.09
254	603456	九洲药业	3,300	170,610.00	0.09
255	601336	新华保险	5,300	170,607.00	0.09
256	600352	浙江龙盛	16,700	170,006.00	0.09
257	603077	和邦生物	39,900	169,974.00	0.09
258	688008	澜起科技	2,800	169,624.00	0.09
259	601995	中金公司	3,800	169,062.00	0.09
260	002268	卫士通	3,900	167,349.00	0.09
261	002385	大北农	21,400	167,134.00	0.09
262	300454	深信服	1,600	166,048.00	0.09
263	688180	君实生物	2,200	165,748.00	0.09
264	002007	华兰生物	7,200	164,160.00	0.09
265	600563	法拉电子	800	164,128.00	0.09
266	601108	财通证券	20,850	164,089.50	0.09
267	300363	博腾股份	2,100	163,779.00	0.09
268	600845	宝信软件	2,980	162,708.00	0.09
269	601618	中国中冶	46,200	161,700.00	0.09
270	600298	安琪酵母	3,300	160,875.00	0.09
271	688126	沪硅产业	7,000	160,860.00	0.09
272	300413	芒果超媒	4,800	160,128.00	0.09
273	002120	韵达股份	9,340	159,340.40	0.09
274	300529	健帆生物	3,100	157,759.00	0.09
275	300751	迈为股份	320	157,088.00	0.09
276	603882	金域医学	1,900	156,845.00	0.09
277	601360	三六零	18,400	156,768.00	0.09
278	688122	西部超导	1,700	156,740.00	0.09
279	300144	宋城演艺	10,140	155,649.00	0.09
280	000630	铜陵有色	47,600	155,176.00	0.09
281	000519	中兵红箭	5,300	154,495.00	0.09
282	603290	斯达半导	400	154,360.00	0.09
283	002252	上海莱士	26,000	154,180.00	0.09
284	603260	合盛硅业	1,300	153,348.00	0.08
285	002353	杰瑞股份	3,800	153,140.00	0.08
286	603392	万泰生物	986	153,125.80	0.08
287	600862	中航高科	5,400	151,740.00	0.08
288	688099	晶晨股份	1,500	151,500.00	0.08
289	603345	安井食品	900	151,083.00	0.08
290	000988	华工科技	6,500	150,605.00	0.08

291	300003	乐普医疗	8,100	150,417.00	0.08
292	601155	新城控股	5,900	150,037.00	0.08
293	000703	恒逸石化	14,180	149,031.80	0.08
294	601077	渝农商行	40,000	148,000.00	0.08
295	000783	长江证券	24,900	147,657.00	0.08
296	603589	口子窖	2,500	146,525.00	0.08
297	601021	春秋航空	2,500	145,875.00	0.08
298	601168	西部矿业	12,200	144,326.00	0.08
299	002625	光启技术	8,300	143,341.00	0.08
300	300146	汤臣倍健	6,600	142,890.00	0.08
301	601162	天风证券	44,800	142,464.00	0.08
302	601696	中银证券	10,700	142,310.00	0.08
303	601878	浙商证券	12,500	142,250.00	0.08
304	600332	白云山	4,500	142,155.00	0.08
305	300433	蓝思科技	12,800	141,696.00	0.08
306	603899	晨光股份	2,500	140,200.00	0.08
307	002797	第一创业	21,700	139,097.00	0.08
308	002028	思源电气	3,900	139,074.00	0.08
309	603517	绝味食品	2,400	138,768.00	0.08
310	603605	珀莱雅	840	138,751.20	0.08
311	002056	横店东磁	5,200	138,424.00	0.08
312	688777	中控技术	1,900	138,244.00	0.08
313	002602	世纪华通	28,680	138,237.60	0.08
314	600489	中金黄金	18,700	138,193.00	0.08
315	300223	北京君正	1,300	138,125.00	0.08
316	002507	涪陵榨菜	4,000	138,080.00	0.08
317	600918	中泰证券	18,000	137,700.00	0.08
318	300919	中伟股份	1,100	136,290.00	0.08
319	002185	华天科技	14,500	136,010.00	0.08
320	002938	鹏鼎控股	4,500	135,945.00	0.08
321	000932	华菱钢铁	26,700	135,903.00	0.07
322	600988	赤峰黄金	8,500	135,575.00	0.07
323	601128	常熟银行	17,700	135,228.00	0.07
324	000066	中国长城	12,400	134,168.00	0.07
325	300724	捷佳伟创	1,500	134,025.00	0.07
326	688036	传音控股	1,500	133,845.00	0.07
327	601636	旗滨集团	10,400	132,600.00	0.07
328	603939	益丰药房	2,500	132,075.00	0.07
329	600521	华海药业	5,800	131,660.00	0.07
330	688390	固德威	420	131,464.20	0.07
331	000708	中信特钢	6,500	130,975.00	0.07

332	603026	石大胜华	900	130,815.00	0.07
333	002603	以岭药业	5,380	130,734.00	0.07
334	601728	中国电信	35,000	130,550.00	0.07
335	600109	国金证券	14,400	129,600.00	0.07
336	600039	四川路桥	12,300	129,519.00	0.07
337	600183	生益科技	7,600	129,124.00	0.07
338	002326	永太科技	3,900	128,427.00	0.07
339	002078	太阳纸业	10,400	128,024.00	0.07
340	000830	鲁西化工	7,400	127,946.00	0.07
341	601607	上海医药	7,000	126,560.00	0.07
342	601865	福莱特	3,300	125,730.00	0.07
343	002624	完美世界	8,700	125,019.00	0.07
344	300033	同花顺	1,300	124,995.00	0.07
345	600546	山煤国际	6,400	124,544.00	0.07
346	600153	建发股份	9,500	124,165.00	0.07
347	300699	光威复材	2,100	123,627.00	0.07
348	688169	石头科技	200	123,340.00	0.07
349	601898	中煤能源	11,800	122,484.00	0.07
350	600018	上港集团	20,900	121,847.00	0.07
351	002916	深南电路	1,300	121,823.00	0.07
352	002422	科伦药业	6,500	121,550.00	0.07
353	000999	华润三九	2,700	121,500.00	0.07
354	000970	中科三环	6,440	120,943.20	0.07
355	600875	东方电气	7,300	120,085.00	0.07
356	600705	中航产融	34,600	119,716.00	0.07
357	601872	招商轮船	20,780	119,692.80	0.07
358	600362	江西铜业	6,700	119,461.00	0.07
359	601990	南京证券	14,300	119,262.00	0.07
360	600348	华阳股份	7,700	119,042.00	0.07
361	600497	驰宏锌锗	22,900	118,851.00	0.07
362	000831	五矿稀土	3,800	118,750.00	0.07
363	600177	雅戈尔	17,900	118,677.00	0.07
364	000738	航发控制	4,200	118,020.00	0.07
365	300088	长信科技	15,800	117,236.00	0.06
366	600549	厦门钨业	5,400	116,748.00	0.06
367	002572	索菲亚	4,200	115,500.00	0.06
368	002508	老板电器	3,200	115,296.00	0.06
369	600160	巨化股份	8,700	114,405.00	0.06
370	600859	王府井	4,400	114,312.00	0.06
371	002557	洽洽食品	2,000	113,860.00	0.06
372	603127	昭衍新药	1,000	113,800.00	0.06

373	000998	隆平高科	6,800	113,288.00	0.06
374	601699	潞安环能	7,700	112,574.00	0.06
375	002673	西部证券	17,200	112,488.00	0.06
376	600516	方大炭素	14,740	112,024.00	0.06
377	605117	德业股份	400	111,956.00	0.06
378	002138	顺络电子	4,100	111,725.00	0.06
379	000960	锡业股份	6,600	110,682.00	0.06
380	000807	云铝股份	11,200	110,656.00	0.06
381	600143	金发科技	11,600	110,432.00	0.06
382	600482	中国动力	7,000	109,970.00	0.06
383	600536	中国软件	2,700	109,593.00	0.06
384	002030	达安基因	6,372	109,534.68	0.06
385	000039	中集集团	7,900	109,415.00	0.06
386	300357	我武生物	2,100	109,263.00	0.06
387	601997	贵阳银行	18,800	109,228.00	0.06
388	300957	贝泰妮	500	108,765.00	0.06
389	002414	高德红外	8,429	108,481.23	0.06
390	002465	海格通信	11,900	108,171.00	0.06
391	300136	信维通信	6,400	107,840.00	0.06
392	002273	水晶光电	8,900	107,779.00	0.06
393	300676	华大基因	1,500	107,550.00	0.06
394	603267	鸿远电子	800	107,464.00	0.06
395	600161	天坛生物	4,420	107,317.60	0.06
396	601216	君正集团	21,800	106,384.00	0.06
397	600061	国投资本	16,556	105,296.16	0.06
398	000629	攀钢钒钛	27,700	105,260.00	0.06
399	000975	银泰黄金	10,780	104,997.20	0.06
400	000728	国元证券	16,850	104,807.00	0.06
401	300058	蓝色光标	16,000	104,480.00	0.06
402	600170	上海建工	34,400	104,232.00	0.06
403	603198	迎驾贡酒	1,600	104,224.00	0.06
404	002568	百润股份	3,460	103,938.40	0.06
405	601319	中国人保	20,500	103,730.00	0.06
406	300558	贝达药业	1,700	103,360.00	0.06
407	600704	物产中大	20,000	102,600.00	0.06
408	002092	中泰化学	13,200	102,432.00	0.06
409	601577	长沙银行	12,900	102,297.00	0.06
410	000408	藏格矿业	3,100	102,114.00	0.06
411	002294	信立泰	3,600	101,160.00	0.06
412	600079	人福医药	6,300	100,800.00	0.06
413	600739	辽宁成大	6,900	100,602.00	0.06

414	002223	鱼跃医疗	3,900	100,074.00	0.06
415	002409	雅克科技	1,800	99,918.00	0.06
416	300244	迪安诊断	3,200	99,520.00	0.05
417	300418	昆仑万维	6,200	99,200.00	0.05
418	300474	景嘉微	1,450	99,165.50	0.05
419	600415	小商品城	17,700	98,589.00	0.05
420	002372	伟星新材	4,100	98,564.00	0.05
421	600315	上海家化	2,300	98,325.00	0.05
422	002739	万达电影	7,200	98,280.00	0.05
423	002506	协鑫集成	26,400	98,208.00	0.05
424	000547	航天发展	8,200	97,908.00	0.05
425	000636	风华高科	5,200	97,708.00	0.05
426	600606	绿地控股	24,615	97,475.40	0.05
427	300253	卫宁健康	11,100	97,458.00	0.05
428	600699	均胜电子	6,200	97,402.00	0.05
429	601966	玲珑轮胎	3,800	96,406.00	0.05
430	300308	中际旭创	3,100	96,255.00	0.05
431	600655	豫园股份	10,100	95,344.00	0.05
432	600171	上海贝岭	3,800	95,114.00	0.05
433	600372	中航电子	4,900	95,011.00	0.05
434	300296	利亚德	13,000	94,900.00	0.05
435	688561	奇安信	1,700	94,860.00	0.05
436	300832	新产业	2,100	94,731.00	0.05
437	002683	广东宏大	3,400	94,622.00	0.05
438	000513	丽珠集团	2,600	94,146.00	0.05
439	600637	东方明珠	13,100	93,665.00	0.05
440	601998	中信银行	19,700	93,575.00	0.05
441	600985	淮北矿业	6,400	93,184.00	0.05
442	600867	通化东宝	9,000	93,060.00	0.05
443	601016	节能风电	19,300	92,640.00	0.05
444	600236	桂冠电力	15,200	92,568.00	0.05
445	601198	东兴证券	10,400	92,560.00	0.05
446	002156	通富微电	6,000	92,400.00	0.05
447	002299	圣农发展	4,800	92,064.00	0.05
448	600026	中远海能	8,900	91,937.00	0.05
449	603195	公牛集团	600	91,746.00	0.05
450	002065	东华软件	14,500	91,640.00	0.05
451	600380	健康元	7,400	91,390.00	0.05
452	002600	领益智造	18,200	91,364.00	0.05
453	000887	中鼎股份	5,000	91,200.00	0.05
454	600879	航天电子	14,000	90,860.00	0.05

455	002791	坚朗五金	700	90,804.00	0.05
456	600642	申能股份	15,800	89,744.00	0.05
457	600529	山东药玻	3,200	89,440.00	0.05
458	300026	红日药业	11,600	89,320.00	0.05
459	600258	首旅酒店	3,600	89,280.00	0.05
460	002408	齐翔腾达	11,000	89,210.00	0.05
461	002936	郑州银行	33,129	89,117.01	0.05
462	689009	九号公司	2,000	89,000.00	0.05
463	000750	国海证券	24,500	88,935.00	0.05
464	000623	吉林敖东	6,000	88,560.00	0.05
465	603568	伟明环保	2,650	88,430.50	0.05
466	600801	华新水泥	4,500	87,795.00	0.05
467	002203	海亮股份	7,600	87,780.00	0.05
468	000878	云南铜业	7,700	87,703.00	0.05
469	600316	洪都航空	2,900	87,696.00	0.05
470	002439	启明星辰	4,400	87,692.00	0.05
471	600673	东阳光	9,700	87,203.00	0.05
472	000729	燕京啤酒	9,000	86,940.00	0.05
473	600820	隧道股份	14,200	86,904.00	0.05
474	603160	汇顶科技	1,400	86,702.00	0.05
475	600580	卧龙电驱	6,000	86,520.00	0.05
476	601717	郑煤机	6,000	86,460.00	0.05
477	000400	许继电气	4,500	86,400.00	0.05
478	600038	中直股份	1,900	85,880.00	0.05
479	300383	光环新网	8,200	85,444.00	0.05
480	688363	华熙生物	600	85,308.00	0.05
481	600369	西南证券	21,400	84,958.00	0.05
482	002131	利欧股份	43,600	84,584.00	0.05
483	002183	怡亚通	11,700	84,357.00	0.05
484	300017	网宿科技	15,700	84,152.00	0.05
485	688256	寒武纪	1,300	84,110.00	0.05
486	600166	福田汽车	29,600	83,768.00	0.05
487	600848	上海临港	6,160	83,529.60	0.05
488	002195	二三四五	36,900	83,025.00	0.05
489	002958	青农商行	25,000	83,000.00	0.05
490	002444	巨星科技	4,400	82,896.00	0.05
491	601005	重庆钢铁	43,300	82,703.00	0.05
492	600909	华安证券	18,140	82,537.00	0.05
493	600325	华发股份	10,900	82,513.00	0.05
494	600008	首创环保	28,330	82,157.00	0.05
495	600027	华电国际	20,900	82,137.00	0.05

496	300001	特锐德	4,700	81,357.00	0.04
497	603218	日月股份	3,200	81,280.00	0.04
498	300618	寒锐钴业	1,400	81,088.00	0.04
499	600025	华能水电	11,600	81,084.00	0.04
500	002064	华峰化学	9,600	81,024.00	0.04
501	300024	机器人	8,000	80,640.00	0.04
502	000739	普洛药业	3,900	80,496.00	0.04
503	601881	中国银河	8,300	80,261.00	0.04
504	000825	太钢不锈	14,700	80,115.00	0.04
505	002500	山西证券	13,940	80,015.60	0.04
506	002926	华西证券	10,200	79,968.00	0.04
507	600271	航天信息	7,300	79,862.00	0.04
508	688185	康希诺	400	79,632.00	0.04
509	002373	千方科技	7,100	78,952.00	0.04
510	000050	深天马A	7,900	78,763.00	0.04
511	600118	中国卫星	3,900	78,312.00	0.04
512	688065	凯赛生物	700	78,260.00	0.04
513	603233	大参林	2,500	78,250.00	0.04
514	000027	深圳能源	12,200	78,202.00	0.04
515	002430	杭氧股份	2,500	78,150.00	0.04
516	603444	吉比特	200	77,600.00	0.04
517	002212	天融信	7,600	77,140.00	0.04
518	002250	联化科技	4,700	76,939.00	0.04
519	601866	中远海发	25,600	76,800.00	0.04
520	603156	养元饮品	3,380	76,793.60	0.04
521	600863	内蒙华电	21,000	76,650.00	0.04
522	600208	新湖中宝	27,600	76,176.00	0.04
523	688009	中国通号	16,600	75,198.00	0.04
524	000060	中金岭南	16,800	74,928.00	0.04
525	002249	大洋电机	12,200	74,908.00	0.04
526	603858	步长制药	3,800	74,898.00	0.04
527	300009	安科生物	7,372	74,530.92	0.04
528	601992	金隅集团	26,800	74,236.00	0.04
529	000778	新兴铸管	15,400	74,228.00	0.04
530	002152	广电运通	8,000	74,160.00	0.04
531	688521	芯原股份	1,500	74,100.00	0.04
532	300677	英科医疗	2,920	74,051.20	0.04
533	002831	裕同科技	2,500	73,875.00	0.04
534	600998	九州通	6,200	73,842.00	0.04
535	600066	宇通客车	8,500	73,525.00	0.04
536	002670	国盛金控	7,600	72,960.00	0.04

537	300070	碧水源	14,000	72,940.00	0.04
538	300482	万孚生物	1,790	72,870.90	0.04
539	300182	捷成股份	13,200	72,600.00	0.04
540	000401	冀东水泥	6,900	72,588.00	0.04
541	000021	深科技	6,200	72,168.00	0.04
542	002966	苏州银行	11,800	71,980.00	0.04
543	300251	光线传媒	7,600	71,972.00	0.04
544	002191	劲嘉股份	6,700	71,824.00	0.04
545	300168	万达信息	7,600	71,744.00	0.04
546	002985	北摩高科	1,222	71,584.76	0.04
547	600390	五矿资本	14,500	70,905.00	0.04
548	603707	健友股份	2,510	70,782.00	0.04
549	600970	中材国际	7,300	70,737.00	0.04
550	600056	中国医药	4,760	70,543.20	0.04
551	603658	安图生物	1,440	70,401.60	0.04
552	002396	星网锐捷	3,100	70,184.00	0.04
553	002128	电投能源	4,900	70,168.00	0.04
554	603885	吉祥航空	3,900	70,161.00	0.04
555	000997	新大陆	5,300	70,013.00	0.04
556	600021	上海电力	6,800	69,700.00	0.04
557	002505	鹏都农牧	20,500	69,495.00	0.04
558	600667	太极实业	9,400	69,372.00	0.04
559	600062	华润双鹤	2,700	69,282.00	0.04
560	600528	中铁工业	8,600	69,230.00	0.04
561	002244	滨江集团	8,000	69,200.00	0.04
562	002607	中公教育	11,900	68,901.00	0.04
563	002221	东华能源	7,400	68,894.00	0.04
564	000656	金科股份	24,000	68,640.00	0.04
565	000987	越秀金控	9,720	68,331.60	0.04
566	600839	四川长虹	23,700	68,256.00	0.04
567	600297	广汇汽车	26,100	68,121.00	0.04
568	600498	烽火通信	4,700	68,056.00	0.04
569	600598	北大荒	4,600	67,896.00	0.04
570	600827	百联股份	5,100	67,371.00	0.04
571	002127	南极电商	12,600	67,284.00	0.04
572	603087	甘李药业	1,400	67,158.00	0.04
573	600511	国药股份	2,500	66,950.00	0.04
574	600201	生物股份	7,300	66,868.00	0.04
575	002266	浙富控股	13,900	66,581.00	0.04
576	300866	安克创新	1,000	66,320.00	0.04
577	603712	七一二	2,100	66,150.00	0.04

578	600155	华创阳安	7,800	66,144.00	0.04
579	000930	中粮科技	7,300	65,992.00	0.04
580	002019	亿帆医药	4,700	65,706.00	0.04
581	002155	湖南黄金	5,400	65,556.00	0.04
582	600409	三友化工	8,000	65,520.00	0.04
583	000012	南玻 A	8,800	65,296.00	0.04
584	000883	湖北能源	12,700	64,897.00	0.04
585	688002	睿创微纳	1,608	63,869.76	0.04
586	600755	厦门国贸	8,500	63,750.00	0.04
587	002153	石基信息	4,000	63,480.00	0.04
588	002124	天邦食品	9,440	63,436.80	0.04
589	600718	东软集团	5,500	63,305.00	0.03
590	600959	江苏有线	19,300	62,918.00	0.03
591	000686	东北证券	9,000	62,910.00	0.03
592	002511	中顺洁柔	5,000	62,600.00	0.03
593	600060	海信视像	5,000	62,500.00	0.03
594	600566	济川药业	2,300	62,468.00	0.03
595	600282	南钢股份	19,800	62,370.00	0.03
596	600895	张江高科	5,000	62,250.00	0.03
597	600782	新钢股份	12,300	61,992.00	0.03
598	601880	辽港股份	36,300	61,710.00	0.03
599	000709	河钢股份	27,300	61,698.00	0.03
600	688188	柏楚电子	280	61,611.20	0.03
601	000581	威孚高科	3,200	61,600.00	0.03
602	000690	宝新能源	14,000	61,320.00	0.03
603	601179	中国西电	13,100	61,308.00	0.03
604	600022	山东钢铁	35,200	61,248.00	0.03
605	002939	长城证券	6,000	60,960.00	0.03
606	600535	天士力	5,800	60,958.00	0.03
607	600259	广晟有色	1,200	60,780.00	0.03
608	600064	南京高科	5,500	60,500.00	0.03
609	601778	晶科科技	11,200	60,480.00	0.03
610	002595	豪迈科技	2,700	60,318.00	0.03
611	300376	易事特	7,400	60,088.00	0.03
612	300630	普利制药	1,706	59,965.90	0.03
613	002701	奥瑞金	11,500	59,800.00	0.03
614	002002	鸿达兴业	16,100	59,731.00	0.03
615	300463	迈克生物	2,900	59,421.00	0.03
616	600500	中化国际	8,900	59,185.00	0.03
617	600037	歌华有线	6,300	59,157.00	0.03
618	000598	兴蓉环境	11,500	58,765.00	0.03

619	600808	马钢股份	15,500	58,745.00	0.03
620	600216	浙江医药	4,300	58,695.00	0.03
621	002468	申通快递	4,900	58,408.00	0.03
622	600728	佳都科技	9,000	58,140.00	0.03
623	603866	桃李面包	3,512	58,123.60	0.03
624	002532	天山铝业	8,900	58,117.00	0.03
625	600663	陆家嘴	5,600	58,016.00	0.03
626	601456	国联证券	4,700	57,669.00	0.03
627	600517	国网英大	11,100	57,609.00	0.03
628	600567	山鹰国际	20,700	57,339.00	0.03
629	002004	华邦健康	10,200	56,916.00	0.03
630	002745	木林森	5,800	56,666.00	0.03
631	603225	新凤鸣	4,900	56,546.00	0.03
632	002032	苏泊尔	1,000	56,340.00	0.03
633	000785	居然之家	12,600	56,070.00	0.03
634	002429	兆驰股份	14,600	56,064.00	0.03
635	000800	一汽解放	6,000	56,040.00	0.03
636	688208	道通科技	1,700	55,964.00	0.03
637	601958	金钼股份	6,300	55,692.00	0.03
638	600597	光明乳业	4,400	55,572.00	0.03
639	601236	红塔证券	6,080	55,510.40	0.03
640	300166	东方国信	6,000	55,320.00	0.03
641	300115	长盈精密	5,340	55,055.40	0.03
642	603927	中科软	2,340	54,568.80	0.03
643	688289	圣湘生物	1,836	54,363.96	0.03
644	601106	中国一重	17,700	54,339.00	0.03
645	601860	紫金银行	18,800	53,956.00	0.03
646	002390	信邦制药	7,800	53,898.00	0.03
647	603883	老百姓	1,586	53,733.68	0.03
648	300072	海新能源	10,600	53,636.00	0.03
649	300888	稳健医疗	800	53,200.00	0.03
650	600572	康恩贝	12,000	53,160.00	0.03
651	601808	中海油服	3,800	53,010.00	0.03
652	600398	海澜之家	11,100	52,725.00	0.03
653	601118	海南橡胶	11,000	52,580.00	0.03
654	600507	方大特钢	7,500	52,425.00	0.03
655	601718	际华集团	16,900	52,390.00	0.03
656	002368	太极股份	2,720	52,251.20	0.03
657	001914	招商积余	2,900	52,113.00	0.03
658	000540	中天金融	27,000	52,110.00	0.03
659	600737	中粮糖业	6,900	51,888.00	0.03

660	002690	美亚光电	2,370	51,381.60	0.03
661	002048	宁波华翔	3,200	51,264.00	0.03
662	600582	天地科技	10,700	51,146.00	0.03
663	000089	深圳机场	6,600	50,952.00	0.03
664	002010	传化智联	7,900	50,797.00	0.03
665	000937	冀中能源	6,800	50,728.00	0.03
666	002705	新宝股份	2,300	50,577.00	0.03
667	000559	万向钱潮	8,500	50,490.00	0.03
668	600435	北方导航	5,800	49,996.00	0.03
669	000898	鞍钢股份	15,400	49,588.00	0.03
670	600195	中牧股份	4,039	49,518.14	0.03
671	600871	石化油服	26,200	49,518.00	0.03
672	601000	唐山港	19,100	49,278.00	0.03
673	600967	内蒙一机	5,400	49,248.00	0.03
674	688006	杭可科技	700	49,042.00	0.03
675	601568	北元集团	7,660	48,564.40	0.03
676	002110	三钢闽光	7,900	48,111.00	0.03
677	000959	首钢股份	10,100	48,076.00	0.03
678	000877	天山股份	3,900	47,970.00	0.03
679	000156	华数传媒	6,000	47,820.00	0.03
680	601333	广深铁路	21,900	47,742.00	0.03
681	002281	光迅科技	2,700	47,466.00	0.03
682	600556	天下秀	5,700	46,911.00	0.03
683	002233	塔牌集团	5,300	46,905.00	0.03
684	000537	广宇发展	3,600	46,764.00	0.03
685	600811	东方集团	16,500	46,695.00	0.03
686	002925	盈趣科技	2,160	46,483.20	0.03
687	003035	南网能源	7,300	46,355.00	0.03
688	300212	易华录	2,660	46,284.00	0.03
689	603638	艾迪精密	2,240	45,920.00	0.03
690	002174	游族网络	4,700	45,919.00	0.03
691	000402	金融街	7,700	45,815.00	0.03
692	002416	爱施德	4,900	45,570.00	0.03
693	600764	中国海防	1,800	45,432.00	0.03
694	688321	微芯生物	1,800	45,342.00	0.03
695	600120	浙江东方	11,212	44,960.12	0.02
696	600446	金证股份	4,300	44,634.00	0.02
697	000488	晨鸣纸业	7,900	44,556.00	0.02
698	600126	杭钢股份	8,700	44,544.00	0.02
699	600329	达仁堂	1,800	44,244.00	0.02
700	600167	联美控股	5,900	44,191.00	0.02

701	000990	诚志股份	4,000	43,800.00	0.02
702	002081	金螳螂	8,600	43,688.00	0.02
703	601200	上海环境	4,300	43,688.00	0.02
704	002867	周大生	2,800	43,484.00	0.02
705	601098	中南传媒	4,600	43,424.00	0.02
706	000158	常山北明	7,200	43,200.00	0.02
707	600707	彩虹股份	9,200	43,056.00	0.02
708	600131	国网信通	3,200	43,040.00	0.02
709	000685	中山公用	5,600	43,008.00	0.02
710	002382	蓝帆医疗	4,500	42,975.00	0.02
711	600373	中文传媒	4,300	42,957.00	0.02
712	601611	中国核建	5,100	42,789.00	0.02
713	601608	中信重工	11,200	42,448.00	0.02
714	002146	荣盛发展	14,000	42,420.00	0.02
715	002387	维信诺	6,300	42,336.00	0.02
716	600095	湘财股份	5,500	42,295.00	0.02
717	002399	海普瑞	2,400	42,192.00	0.02
718	001965	招商公路	5,500	41,965.00	0.02
719	688029	南微医学	480	41,856.00	0.02
720	603317	天味食品	1,460	41,566.20	0.02
721	000967	盈峰环境	8,200	41,492.00	0.02
722	603000	人民网	3,700	41,440.00	0.02
723	002948	青岛银行	11,350	41,087.00	0.02
724	688088	虹软科技	1,300	41,067.00	0.02
725	000528	柳工	6,300	41,013.00	0.02
726	600376	首开股份	8,300	40,753.00	0.02
727	601187	厦门银行	6,800	40,528.00	0.02
728	300257	开山股份	2,700	40,392.00	0.02
729	002423	中粮资本	6,000	40,260.00	0.02
730	600623	华谊集团	4,800	39,840.00	0.02
731	000563	陕国投 A	12,700	39,624.00	0.02
732	601598	中国外运	10,200	39,576.00	0.02
733	600901	江苏租赁	7,700	39,501.00	0.02
734	603650	彤程新材	1,200	39,096.00	0.02
735	600307	酒钢宏兴	20,100	38,994.00	0.02
736	601825	沪农商行	6,200	38,874.00	0.02
737	600906	财达证券	4,300	38,657.00	0.02
738	601991	大唐发电	15,900	38,637.00	0.02
739	002242	九阳股份	2,100	38,556.00	0.02
740	600006	东风汽车	5,100	38,505.00	0.02
741	603228	景旺电子	1,620	37,794.60	0.02

742	000961	中南建设	12,300	37,515.00	0.02
743	600717	天津港	9,308	37,325.08	0.02
744	300979	华利集团	500	36,540.00	0.02
745	000718	苏宁环球	9,800	36,064.00	0.02
746	002434	万里扬	4,200	35,910.00	0.02
747	000671	阳光城	16,000	35,040.00	0.02
748	601928	凤凰传媒	4,900	35,035.00	0.02
749	000415	渤海租赁	15,900	34,503.00	0.02
750	605499	东鹏饮料	200	34,172.00	0.02
751	601698	中国卫通	3,000	33,930.00	0.02
752	000553	安道麦A	2,800	33,908.00	0.02
753	600968	海油发展	13,000	33,540.00	0.02
754	601969	海南矿业	3,900	33,501.00	0.02
755	000031	大悦城	8,300	33,200.00	0.02
756	600648	外高桥	2,400	32,640.00	0.02
757	600787	中储股份	5,600	31,864.00	0.02
758	600928	西安银行	8,600	31,562.00	0.02
759	600339	中油工程	10,800	31,212.00	0.02
760	002563	森马服饰	5,200	30,784.00	0.02
761	002815	崇达技术	2,400	30,744.00	0.02
762	600835	上海机电	2,200	30,206.00	0.02
763	000869	张裕A	1,000	29,740.00	0.02
764	601228	广州港	8,000	29,360.00	0.02
765	300869	康泰医学	1,000	28,260.00	0.02
766	603056	德邦股份	2,100	28,203.00	0.02
767	000062	深圳华强	2,200	27,940.00	0.02
768	601869	长飞光纤	900	27,828.00	0.02
769	002945	华林证券	1,800	27,450.00	0.02
770	600377	宁沪高速	3,200	27,424.00	0.02
771	000717	韶钢松山	7,800	27,300.00	0.02
772	000028	国药一致	900	26,811.00	0.01
773	600299	安迪苏	2,700	25,866.00	0.01
774	603379	三美股份	1,160	25,810.00	0.01
775	601139	深圳燃气	3,700	25,678.00	0.01
776	601298	青岛港	4,600	25,162.00	0.01
777	300741	华宝股份	900	25,038.00	0.01
778	688819	天能股份	700	24,206.00	0.01
779	603868	飞科电器	300	22,725.00	0.01
780	600823	世茂股份	7,300	21,754.00	0.01
781	600350	山东高速	4,000	21,000.00	0.01
782	002653	海思科	1,300	20,943.00	0.01

783	601828	美凯龙	3,450	20,907.00	0.01
784	001872	招商港口	1,300	20,280.00	0.01
785	601156	东航物流	1,000	19,800.00	0.01
786	001227	兰州银行	4,000	19,680.00	0.01
787	001289	龙源电力	900	19,584.00	0.01
788	603786	科博达	300	18,471.00	0.01
789	600927	永安期货	900	18,153.00	0.01
790	603355	莱克电气	700	17,661.00	0.01
791	601665	齐鲁银行	3,300	16,104.00	0.01
792	001203	大中矿业	1,400	15,820.00	0.01
793	603515	欧普照明	900	15,705.00	0.01
794	601003	柳钢股份	3,300	13,365.00	0.01
795	002946	新乳业	1,000	12,990.00	0.01
796	600956	新天绿能	1,000	12,320.00	0.01
797	002901	大博医疗	300	11,742.00	0.01
798	603719	良品铺子	400	11,452.00	0.01
799	600917	重庆燃气	1,100	7,942.00	0.00
800	603983	丸美股份	200	5,360.00	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	688170	德龙激光	3,375	158,760.00	0.09
2	688281	华秦科技	637	156,842.14	0.09
3	688261	东微半导	634	146,263.80	0.08
4	688120	华海清科	542	117,679.04	0.06
5	688325	赛微微电	1,163	62,674.07	0.03
6	688153	唯捷创芯	1,121	49,593.04	0.03
7	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
8	301120	新特电气	736	11,400.64	0.01
9	301162	国能日新	184	9,956.24	0.01
10	301201	诚达药业	121	8,656.34	0.00
11	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
12	301150	中一科技	69	5,710.44	0.00
13	301200	大族数控	109	5,659.28	0.00
14	301206	三元生物	119	5,437.11	0.00
15	301219	腾远钴业	58	5,093.56	0.00
16	301181	标榜股份	165	5,047.35	0.00
17	301189	奥尼电子	136	4,530.16	0.00
18	301123	奕东电子	175	4,443.25	0.00

19	300834	星辉环材	127	3,813.81	0.00
20	301196	唯科科技	76	2,851.52	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	000792	盐湖股份	888,833.00	0.45
2	600089	特变电工	626,852.00	0.32
3	002074	国轩高科	291,534.00	0.15
4	300496	中科创达	269,206.00	0.14
5	300661	圣邦股份	260,881.00	0.13
6	600096	云天化	259,874.00	0.13
7	300769	德方纳米	259,397.00	0.13
8	002920	德赛西威	247,862.00	0.12
9	600460	士兰微	243,074.00	0.12
10	300012	华测检测	239,812.00	0.12
11	002497	雅化集团	238,281.00	0.12
12	300207	欣旺达	235,479.00	0.12
13	002240	盛新锂能	233,190.00	0.12
14	002648	卫星化学	210,872.00	0.11
15	300390	天华超净	206,567.00	0.10
16	002407	多氟多	197,506.00	0.10
17	688180	君实生物	188,377.28	0.09
18	300073	当升科技	185,111.00	0.09
19	600941	中国移动	182,460.00	0.09
20	002756	永兴材料	177,549.00	0.09

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	370,521.00	0.19
2	000733	振华科技	300,241.00	0.15
3	600887	伊利股份	292,661.00	0.15
4	002340	格林美	263,756.00	0.13
5	300750	宁德时代	251,060.00	0.13
6	688223	晶科能源	248,006.55	0.12
7	688213	思特威-W	237,344.68	0.12
8	688707	振华新材	213,912.25	0.11

9	000723	美锦能源	207,107.00	0.10
10	600884	杉杉股份	186,384.00	0.09
11	601689	拓普集团	179,557.00	0.09
12	000858	五粮液	164,149.00	0.08
13	002013	中航机电	161,588.00	0.08
14	605358	立昂微	155,839.72	0.08
15	600036	招商银行	148,737.00	0.07
16	601318	中国平安	146,061.00	0.07
17	600754	锦江酒店	143,984.00	0.07
18	688349	三一重能	141,858.00	0.07
19	000333	美的集团	137,963.00	0.07
20	688062	迈威生物	135,049.52	0.07

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	16,020,866.07
卖出股票收入（成交）总额	15,724,943.50

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）	24,802.17	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	24,802.17	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	113060	浙 22 转债	220	22,001.64	0.01
2	127064	杭氧转债	28	2,800.53	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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，在风险可控的基础上，以套期保值为目的，参与国债期货的投资，以降低跟踪误差。

7.11.2 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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、国家外汇管理局福建省分局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。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。

7.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,801.80
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	—
9	合计	79,418.04

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688170	德龙激光	158,760.00	0.09	新股限售
2	688281	华秦科技	156,842.14	0.09	新股限售
3	688261	东微半导	146,263.80	0.08	新股限售
4	688120	华海清科	117,679.04	0.06	新股限售
5	688325	赛微微电	62,674.07	0.03	新股限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
192	711,073.40	132,148,892.00	96.79	4,377,200.00	3.21

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	富国基金—北京诚通金控投资有限公司—富国基金—诚通金控 1 号单一资产管理计划	110,394,100.00	80.86
2	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	14,295,900.00	10.47
3	广发证券股份有限公司	2,496,400.00	1.83
4	申万宏源证券有限公司	1,495,800.00	1.10
5	中信证券股份有限公司	1,485,610.00	1.09
6	张晓晖	1,000,000.00	0.73
7	袁洪	1,000,000.00	0.73
8	华泰证券股份有限公司	800,882.00	0.59
9	招商证券股份有限公司	674,100.00	0.49
10	海通证券股份有限公司	506,000.00	0.37

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年05月13日)基金份额总额	248,526,092.00
报告期期初基金份额总额	136,526,092.00
本报告期基金总申购份额	3,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	136,526,092.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	2	588,522.19	2.07	285,797.20	53.55	—	—	—	—	536.88	2.35	—
诚通证券	2	64,856.36	0.23	16,646.28	3.12	—	—	—	—	59.75	0.26	—
川财证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
广发证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国都证券	2	620,707.17	2.18	13,588.80	2.55	—	—	—	—	568.53	2.49	—
国海证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国元证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	84,587.33	0.30	—	—	—	—	—	—	77.07	0.34	—
华宝证券	1	216,208.83	0.76	—	—	—	—	—	—	197.03	0.86	—
华创证券	1	681,273.85	2.39	132,052.70	24.74	—	—	—	—	621.09	2.72	—
江海证券	2	198,241.84	0.70	—	—	—	—	—	—	181.57	0.79	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

上海证券	2	22,529.25	0.08	61,935.10	11.60	—	—	—	—	20.53	0.09	—
申万宏源	4	222,019.56	0.78	21,100.38	3.95	—	—	—	—	203.33	0.89	—
西部证券	2	11,535,281.61	40.50	2,580.40	0.48	—	—	—	—	10,621.26	46.47	—
招商证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	3	14,249,247.12	50.03	—	—	—	—	—	—	9,768.24	42.74	—

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。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

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公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	规定披露媒介	2022年01月01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	2022年01月07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	2022年01月07日
4	关于富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金扩位简称变更的公告	规定披露媒介	2022年01月25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	2022年02月10日
6	关于富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定披露媒介	2022年03月30日
7	富国基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	规定披露媒介	2022年06月16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	2022-01-01 至 2022-06-30	110,394,100.00	—	—	110,394,100.00	80.86%

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，经向上海证券交易所申请并获得同意，基金管理人决定自 2022 年 1 月 26 日起将本基金的基金扩位简称由“沪深 800ETF”变更为“A800ETF”。具体可参见基金管理人于 2022 年 1 月 25 日发布的《关于富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金扩位简称变更的公告》。

二、本报告期内，根据《关于上海证券交易所 ETF 申赎业务多码合一及迁移上线切换有关事项的通知》，自 2022 年 6 月 20 日起，本基金将取消申赎业务相关代码，投资者可通过 ETF 基金的证券代码（与交易使用的证券代码相同），选择申赎相关业务类型，参与 ETF 申赎业务。具体可参见基金管理人于 2022 年 6 月 16 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告》。

§ 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 800 交易型开放式指数证券投资基金的文件 2、富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同 3、富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	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） 公司地址： http://www.fullgoal.com.cn 。