

富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
二〇二一年年度报告

2021 年 12 月 31 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： 2022 年 03 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 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。

本报告期自 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理.....	9
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	管理人内部有关本基金的监察稽核报告.....	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9	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.....	16
§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.....	17
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6	审计报告.....	17
6.1	审计报告基本信息.....	17
6.2	审计报告的基本内容.....	17
§7	年度财务报表.....	20
7.1	资产负债表.....	20
7.2	利润表.....	21
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4	报表附注.....	23
§8	投资组合报告.....	57
8.1	期末基金资产组合情况.....	57
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	58
8.3	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.....	60
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	74
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	76

8.6	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	76
8.7	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	76
8.8	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	76
8.9	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	76
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	76
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
8.12	投资组合报告附注	77
§9	基金份额持有人信息	79
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
9.2	期末上市基金前十名持有人	80
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
9.4	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	80
§10	开放式基金份额变动	80
§11	重大事件揭示	81
11.1	基金份额持有人大会决议	81
11.2	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	81
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
11.4	基金投资策略的改变	81
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	81
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	81
11.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	82
11.8	其他重大事件	84
§12	影响投资者决策的其他重要信息	85
12.1	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	85
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	86
§13	备查文件目录	86

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
场内简称	沪深港 500ETF
基金简称	富国中证沪港深 500ETF
基金主代码	517100
交易代码	517100
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 02 月 09 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	557,602,125.00 份
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	2021 年 3 月 2 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	本基金主要采用复制法，即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、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、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	中证沪港深 500 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（均含存托凭证），具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金投资港股通标的股票的，将承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	010-66596688
	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年 2 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-16,669,396.18

本期利润	-84,179,755.55
加权平均基金份额本期利润	-0.1344
本期加权平均净值利润率	-14.65%
本期基金份额净值增长率	-12.43%
3.1.2 期末数据和指标	2021年12月31日
期末可供分配利润	-69,311,560.22
期末可供分配基金份额利润	-0.1243
期末基金资产净值	488,290,564.78
期末基金份额净值	0.8757
3.1.3 累计期末指标	2021年12月31日
基金份额累计净值增长率	-12.43%

注：本基金于2021年2月9日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

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

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

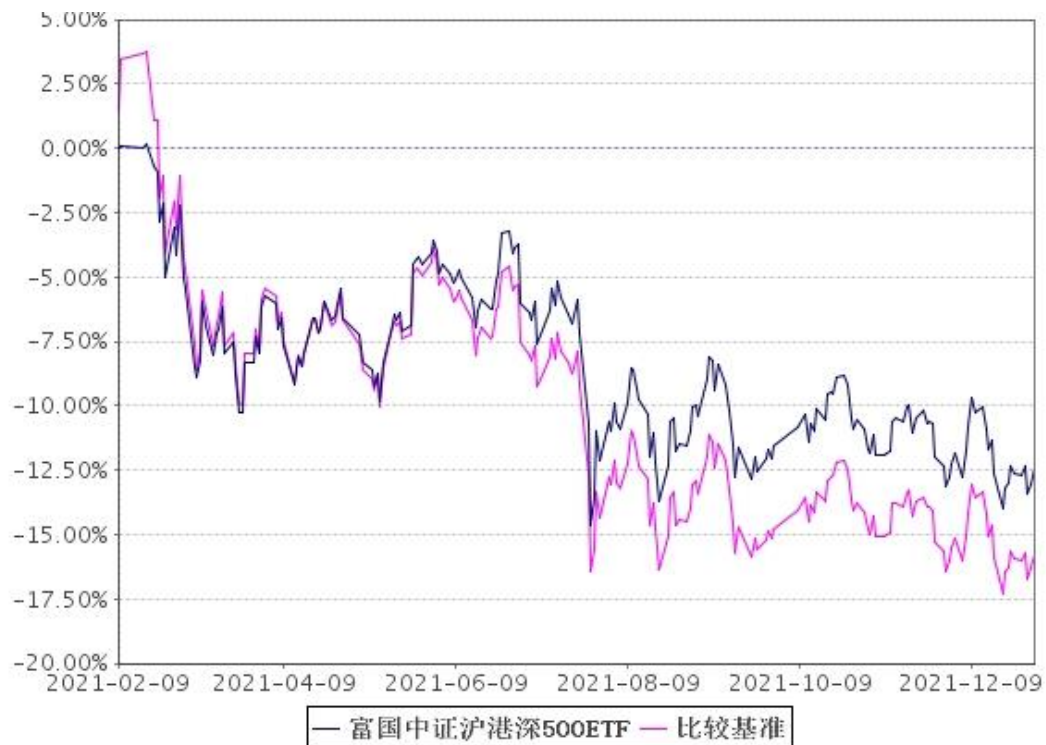
期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.02%	0.76%	-1.16%	0.76%	0.14%	0.00%
过去六个月	-8.88%	1.08%	-10.95%	1.06%	2.07%	0.02%
自基金合同生效起至今	-12.43%	1.09%	-15.77%	1.13%	3.34%	-0.04%

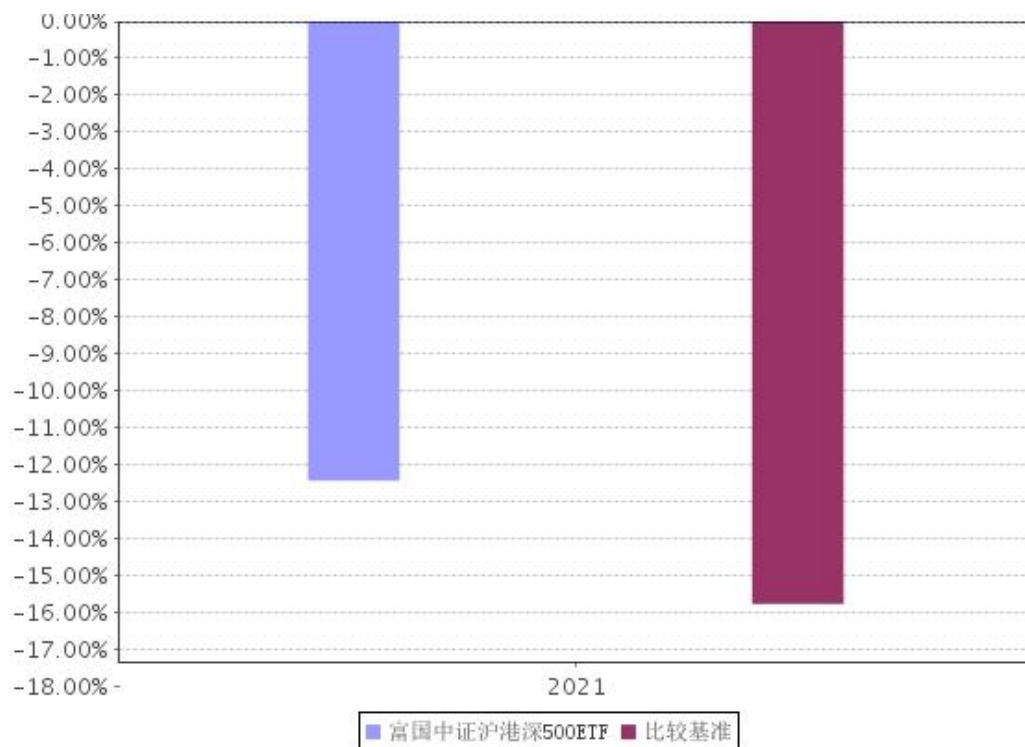
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2021年12月31日。

2、本基金于2021年2月9日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月，从2021年2月9日起至2021年8月8日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2021年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日未进行利润分配

§ 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 12 月 31 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 243 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		
张圣贤	本基金基金经理	2021-02-09	—	14.5	硕士，曾任上海申银万国证券研究所有限公司研究员；自 2015 年 3 月加入富国基金管理有限公司，历任基金经理助理、量化投资部量化投资总监助理；现任富国基金量化投资部量化投资副总监兼定量基金经理。2015 年 6 月至 2021 年 9 月任富国中证国有企业改革指数型证券投资基金（原富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金，于 2021 年 1 月 1 日更名）基金经理，2015 年 6 月起任富国中证军工指数型证券投资基金（原富国中证军工指数分级证券投资基金，于

				<p>2021年1月1日更名)、富国中证新能源汽车指数型证券投资基金(原富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金,于2021年1月1日更名)基金经理;自2015年8月起任富国中证工业4.0指数型证券投资基金(原富国中证工业4.0指数分级证券投资基金,于2021年1月1日更名)、富国中证体育产业指数型证券投资基金(原富国中证体育产业指数分级证券投资基金,于2021年1月1日更名)基金经理,2016年2月起任富国中证智能汽车指数证券投资基金(LOF)基金经理,2017年7月至2020年12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,2017年11月起任富国中证煤炭指数型证券投资基金(原富国中证煤炭指数分级证券投资基金,于2021年1月1日更名)基金经理,2020年4月起任富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2020年7月至2021年9月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,2020年12月起任富国中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、富国中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2021年2月起任富国中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2021年6月起任富国中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2021年7月起任富国中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2021年8月起任富国中证芯片产业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沪港深 500 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》、《富国中证沪港深 500 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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

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。

4.3.3 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

2021年初以来，在国内PMI向好、货币政策不急转弯、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。2季度，随着国内大宗商品如钢价、煤价迎来调整，通胀预期下降，同时美联储会议并未实质性讨论收紧购债规模，美国10年期国债利率进一步走低，市场开启反弹。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。7月初，央行宣布下调金融机构存款准备金率0.5个百分点，在相对充裕的流动

性及靓丽中报业绩的推动下，锂电池产业链、光伏、半导体等板块持续上涨，同时周期板块如有色、化工、煤炭等也表现突出。9月中旬，随着煤炭等能源价格高企，多部委对煤炭价格重视度提升，周期板块迎来调整。9月下旬，受个别地产企业信用风险暴露、限电导致经济预期回落、美国财政将触及债务上限、长假效应等因素影响，市场风险偏好大幅降低。11月中旬，随着公布的金融数据显示新增居民中长贷走强，表明房贷放款边际放松，同时部分银行加强房地产开发贷投放，提振投资者对经济的信心，地产、金融板块迎来大幅反弹。12月召开的中央经济工作会议进一步释放“稳字当头、稳中求进”的稳增长信号。随着稳增长信号落地，市场迎来休整，各板块轮换加速。

总体来看，2021年上证综指上涨4.8%，沪深300下跌5.2%，创业板指上涨12.02%，中证500指数上涨15.58%。

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2021年12月31日，本基金份额净值为0.8757元；份额累计净值为0.8757元；本报告期，本基金份额净值增长率为-12.43%，同期业绩比较基准收益率为-15.77%

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2022年，由于美联储将迎来加息和缩表周期，全球流动性可能迎来拐点，资本市场波动或将加大。从国内来看，国内“稳增长”政策积极推进，货币政策较海外更为宽松，对股市有一定提振。从行业配置来看，较前两年或需更加均衡，一方面关注低估值、稳增长板块，另一方面关注估值较为合理，同时未来几年产业有望迎来爆发的科技板块。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

本基金管理人始终将加强内部控制，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金持有人利益作为己任。在监察稽核基础性工作基础上，2021年本基金管理人着重开展了如下与监察稽核有关的工作：

（一）持续推动公司制度建设，优化内部控制体系

制度建设是内部控制的起点，2021年公司在统筹兼顾监管法规重大调整、

公司管理实际需要、公司业务创新发展的基础上，持续督导业务部门开展制度建设。

（二）夯实合规管理架构，强化合规管理职能

2021 年公司通过落实合规考核机制、专兼职人员会议机制、持续推进合规风控工作的系统化建设等，引导全员主动合规、立足本岗位持续夯实各业务、各环节的内部控制。

（三）深入解读新规，持续推进新规落地

2021 年度，公司从新规解读、制度建立、系统更新、流程改造等方面持续推进各项重要法规、通知的落地工作，并对新规落地情况开展专项检查。公司将根据持续颁布的新法规不断强化学习与执行力度。

（四）加强合规培训，全面提升合规意识

2021 年为持续提高员工合规意识及应知应会，公司紧跟新规要求、监管动态、行业热点，通过“线上+线下”的模式，公司持续开展新员工合规培训、内幕交易防控培训以及反洗钱专题培训，并结合业务部门实际需求，组织信息披露实务、适当性管理、销售合规实务、互联网直播合规管理等实务类培训。

（五）深入专项审计，抓紧第三道防线

2021 年公司在常规季度监察稽核工作外，有针对性地开展专项审计。审计范围覆盖投资研究、市场销售、运营 IT 等前、中、后台业务。在力争专项审计检查全覆盖基础上，将公司主业和监管关注作为专项审计重点。通过专项审计，有效发现现有业务流程中存在的问题缺陷；通过事后改进工作，查漏补缺，持续提高内部控制的有效性和内部风险防控能力。

（六）立足投资合规监督，系统化助力风控履职

监督投资组合的合规运作是公司风险管理的基础核心工作，2021 年公司持续推进旗下组合的投资合规风控阈值排查梳理和日常投资合规监督工作的规范化管理，进一步完善了组合合规多重监控工具互相校验、互为备份的机制，同时重点投入资源在公募基金、职业年金、社保业务、ETF 业务的精细化管控上，优化内部工作程序与分工，提升了基础投资监督工作的质量，主动发现问题，消除合规风险隐患。

（七）持续强化反洗钱工作理念，推动反洗钱工作纵深开展

公司高度重视反洗钱工作，2021 年认真贯彻落实反洗钱监管要求，牢固树

立“风险为本”的反洗钱工作理念，从完善制度体系、提升履职效能、加大科技投入等方面，多措并举，将反洗钱工作推向纵深。为提升反洗钱管理效能和反洗钱工作水平，公司持续推进新一代反洗钱系统建设，提升反洗钱履职的时效性、有效性和精确性。

（八）全面加强员工行为管理

公司建立通信管理机制，为规范公司员工执业行为，防范利益冲突和道德风险，公司定期开展专项检查。2021 年通过新进员工承诺函签署、一对一宣讲、专题合规培训、员工基本信息维护完整性检查、季度投资申报及时性检查、投资申报持仓清仓情况跟进、员工上传附件与申报维护情况抽查比对等工作，将日常管理与季度监督相结合。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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”）在富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金（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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第 60467606_B198 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）

	至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与</p>

	<p>持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披</p>

	<p>露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富国中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	蒋燕华 费泽旭
会计师事务所的地址	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
审计报告日期	2022 年 03 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 (2021 年 12 月 31 日)
资产：	
银行存款	4,858,619.81
结算备付金	37,766.96
存出保证金	33,593.55
交易性金融资产	483,737,569.31
其中：股票投资	483,737,569.31
基金投资	—
债券投资	—
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收证券清算款	71,604.98

应收利息	2,001.82
应收股利	32,677.18
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	488,773,833.61
负债和所有者权益	本期末 (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	—
应付证券清算款	40.02
应付赎回款	—
应付管理人报酬	210,486.93
应付托管费	42,097.41
应付销售服务费	—
应付交易费用	43,900.43
应交税费	31.71
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	186,712.33
负债合计	483,268.83
所有者权益:	
实收基金	557,602,125.00
未分配利润	-69,311,560.22
所有者权益合计	488,290,564.78
负债和所有者权益总计	488,773,833.61

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8757 元，基金份额总额 557,602,125.00 份。本基金合同生效日 2021 年 02 月 09 日。

7.2 利润表

会计主体：富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 02 月 09 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效 日)至 2021 年 12 月 31 日
-----	--

一、收入	-78,919,065.53
1. 利息收入	417,302.42
其中：存款利息收入	405,715.40
债券利息收入	135.49
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	11,451.53
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-12,289,996.11
其中：股票投资收益	-22,258,145.87
基金投资收益	—
债券投资收益	220,820.85
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	943.34
股利收益	9,746,385.57
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-67,510,359.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	463,987.53
减：二、费用	5,260,690.02
1. 管理人报酬	2,577,373.52
2. 托管费	515,474.71
3. 销售服务费	—
4. 交易费用	1,972,207.65
5. 利息支出	—
其中：卖出回购金融资产支出	—
6. 税金及附加	3.65
7. 其他费用	195,630.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-84,179,755.55
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-84,179,755.55

注：本基金合同生效日为2021年2月9日，无上年度同期对比数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年02月09日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2021年2月9日(基金合同生效日)至2021年12月31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）	787,102,125.00	—	787,102,125.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-84,179,755.55	-84,179,755.55
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）	-229,500,000.00	14,868,195.33	-214,631,804.67
其中：1. 基金申购款	103,500,000.00	-9,571,833.02	93,928,166.98
2. 基金赎回款	-333,000,000.00	24,440,028.35	-308,559,971.65
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）	557,602,125.00	-69,311,560.22	488,290,564.78

注：本基金合同生效日为 2021 年 2 月 9 日，无上年度同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富国中证沪港深 500 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(2020)3527号《关于准予富国中证沪港深 500 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自 2021 年 1 月 25 日至 2021 年 2 月 3 日止期间向社会公开发行人募集,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(2021)验字第 60467606_B08 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 2021 年 2 月 9 日正式生效。本基金为交易型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 787,102,125.00 元,其中以现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 783,259,000.00 元,折合基金份额 783,259,000.00 份;其中网上现金认购份额为 783,259,000.00 份,网下现金认

购份额为 0.00 份；以股票认购方式按认购期最后一日的均价计算的金额为人民币 3,843,125.00 元，折合 3,843,125.00 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 217,440.68 元，均为网上现金认购的有效认购资金在首次募集期间产生的利息，计入基金财产，不折算为投资者基金份额。与首次募集相关的资产总额为人民币 787,319,565.68 元，折合 787,102,125.00 份基金份额。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（均含存托凭证）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、港股通标的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、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、金融衍生工具（股指期货、国债期货）、货币市场工具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。

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（均含存托凭证）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。如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为中证沪港深 500 指数收益率。

7.4.2 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 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规

则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和中期报告》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 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分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 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的股票、债券等，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；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

投资者申购本基金时交付的股票于申购日计入股票投资，股票投资成本以申购日该股票收盘价确认的价值入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

投资者赎回本基金时交付的股票于赎回日确认股票差价收入，交付的股票的成成本于赎回日采用加权平均法结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 国债期货投资

买入或卖出国债期货投资于成交日确认为国债期货投资。国债期货初始合约价值按成交金额确认； 国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(6) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(7) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际

利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利

用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 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) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股指期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(12) 公允价值变动收益/（损失）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；

(13) 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，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，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入。

(14) 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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、基金每年收益分配次数没有限制，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

3、若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

4、本基金收益分配采用现金方式；

5、法律法规、监管机关、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2021年12月31日）
活期存款	4,858,619.81
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	4,858,619.81

注：本基金本报告期末未持有定期存款。本基金合同生效日为2021年02月09日。无上年度同期对比数据。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2021年12月31日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	551,247,928.68	483,737,569.31	-67,510,359.37
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	551,247,928.68	483,737,569.31	-67,510,359.37

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债，本基金合同生效日为2021年2月9日。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日。无上年度同期对比数据。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日。无上年度同期对比数据。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末(2021年12月31日)
应收活期存款利息	509.25
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	53.65
应收债券利息	—
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	1,419.49
其他	19.43
合计	2,001.82

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末(2021年12月31日)
交易所市场应付交易费用	43,900.43
银行间市场应付交易费用	—
合计	43,900.43

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末(2021年12月31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	—
预提信息披露费	110,000.00
预提审计费	60,000.00
IOPV 计算发布费	16,712.33
合计	186,712.33

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日 2021 年 2 月 9 日	787,102,125.00	787,102,125.00
本期申购	103,500,000.00	103,500,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-333,000,000.00	-333,000,000.00
本期末	557,602,125.00	557,602,125.00

注：本基金合同于 2021 年 2 月 9 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 787,102,125.00 元，其中以现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 783,259,000.00 元，折合基金份额 783,259,000.00 份；以股票认购方式按认购期最后一日的均价计算的金额为人民币 3,843,125.00 元，折合 3,843,125.00 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 217,440.68 元，计入基金财产，不折算为投资者基金份额。与首次募集相关的资产总额为人民币 787,319,565.68 元，折合 787,102,125.00 基金份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日 2021 年 2 月 9 日	—	—	—
本期利润	-16,669,396.18	-67,510,359.37	-84,179,755.55
本期基金份额交易产生的变动数	2,208,113.96	12,660,081.37	14,868,195.33
其中：基金申购款	-1,061,647.62	-8,510,185.40	-9,571,833.02
基金赎回款	3,269,761.58	21,170,266.77	24,440,028.35

本期已分配利润	—	—	—
本期末	-14,461,282.22	-54,850,278.00	-69,311,560.22

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	353,319.23
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	47,688.64
其他	4,707.53
合计	405,715.40

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-14,613,550.91
股票投资收益——赎回差价收入	-7,644,594.96
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	-22,258,145.87

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	399,961,833.95
减：卖出股票成本总额	414,575,384.86
买卖股票差价收入	-14,613,550.91

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	308,559,971.65
减: 现金支付赎回款总额	205,987,326.65
减: 赎回股票成本总额	110,217,239.96
赎回差价收入	-7,644,594.96

7.4.7.12.4 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。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注: 本基金本报告期末无股票投资收益证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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2月9日(基金合同生效日)至2021年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	1,112,558.46
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	891,600.00
减: 应收利息总额	137.61
买卖债券差价收入	220,820.85

7.4.7.13.2 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。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注: 本基金本报告期无买卖贵金属交易。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
卖出权证成交总额	971.64
减：卖出权证成本总额	—
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	28.30
买卖权证差价收入	943.34

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	9,746,385.57
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	9,746,385.57

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-67,510,359.37
股票投资	-67,510,359.37
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-67,510,359.37

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	—
替代损益	463,987.53
合计	463,987.53

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日。无上年度同期对比数据。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,972,207.65
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	1,972,207.65

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日。无上年度同期对比数据。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00
信息披露费	110,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	8,518.16
其他	17,112.33
合计	195,630.49

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国银行股份有限公司	基金托管人
山东省国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
申万宏源集团股份有限公司	基金管理人的股东的母公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
海通证券	558,522,654.30	39.10
申万宏源	35,110,736.80	2.46

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
海通证券	971.64	100.00

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
申万宏源	454,415.85	40.84
海通证券	151,251.80	13.59

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.1.4 回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.1.5 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2月9日(基金合同生效日)至2021年12月31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	31,996.39	3.81	11,519.79	26.24
海通证券	307,352.66	36.61	14,715.33	33.52

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。本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日。无上年度同期对比数据。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,577,373.52

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 0.50% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	515,474.71

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日。无上年度同期对比数据。

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

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用适用市场化期限费率从事证券出借业务。本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日。无上年度同期对比数据。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期内本基金的基金管理人未运用自有资金投资本基金。本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末（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 (%)
申万宏源证券有限公司	3,871,500.00	0.69

富国中证沪港深500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	101,448,300.00	18.19
-------------------------------	----------------	-------

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	4,858,619.81	353,319.23

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.7 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 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 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	301039	中集车辆	IPO 网下申购	20,640	143,654.40
海通证券股份有限公司	300981	中红医疗	IPO 网下申购	5,660	275,019.40
海通证券股份有限公司	688187	时代电气	IPO 网下申购	8,184	258,097.99
海通证券股份有限公司	688701	卓锦股份	IPO 网下申购	2,340	17,590.72
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 网下申购	3,652	105,776.89
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

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日。无上年度同期对比数据。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 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）和基金托管人及其关联方发行的股票中国银行（601988.SH）、中国银行（3988.HK）、中银证券（601696.SH）、中银香港（2388.HK）以及中银航空租赁（2588.HK）。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股认购	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	—
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股限售	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	—
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股限售	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	—
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新股限售	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	—
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新股限售	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	—
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新股限售	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	—
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股限售	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	—
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股限售	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	—
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	新股限售	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	—

301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股限售	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	—
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新股限售	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	—
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股限售	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	—
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股限售	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	—
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新股限售	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	—
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	新股限售	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	—
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股限售	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	—
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新股限售	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	—
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股限售	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	—
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股限售	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	—
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新股限售	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	—
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新股限售	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	—
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股限售	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	—
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	新股限售	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	—
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	新股限售	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	—
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新股限售	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	—
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股限售	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	—
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股限售	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	—
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股限售	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	—
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新股限售	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	—
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股限售	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	—
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股限售	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	—
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新股限售	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	—
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新股限售	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	—
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股限售	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	—
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	新股限售	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	—
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	新股限售	33.16	24.67	552	18,304.32	13,617.84	—
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	新股限售	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	—
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	新股限售	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	—
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	新股限售	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	—
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	新股限售	60.66	96.75	381	23,111.46	36,861.75	—
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	新股限售	86.06	94.50	194	16,695.64	18,333.00	—
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	新股限售	66.18	56.62	353	23,361.54	19,986.86	—
688211	中科微至	2021-10-18	2022-04-26	新股限售	90.20	71.32	2,138	192,847.60	152,482.16	—

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。

7.4.12.2 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	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	--------------	--------	--------	----

						价				
01114	BRILLIANC E CHI	2021年03月 31日	重大事项停牌	5.97	—	—	72,000.00	421,019.68	429,840.00	—

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	601901	方正证券	2022年01月03日	7.84	10,400	81,536.00
2	600011	华能国际	2022年01月07日	9.69	10,000	96,900.00
3	000425	徐工机械	2022年01月07日	5.99	10,000	59,900.00
4	601600	中国铝业	2022年01月07日	6.09	10,000	60,900.00
5	601618	中国中冶	2022年01月10日	3.83	10,000	38,300.00
6	601989	中国重工	2022年01月05日	4.22	10,000	42,200.00
7	000157	中联重科	2022年01月07日	7.17	10,000	71,700.00
8	601318	中国平安	2022年01月12日	50.41	10,000	504,100.00
9	600031	三一重工	2022年01月07日	22.80	10,000	228,000.00
10	600276	恒瑞医药	2022年01月03日	50.71	10,000	507,100.00
11	601919	中远海控	2022年01月13日	18.69	10,000	186,900.00
12	601766	中国中车	2022年01	6.09	10,000	60,900.00

			月 07 日			
13	000338	潍柴动力	2022 年 01 月 07 日	17.89	10,000	178,900.00
14	600028	中国石化	2022 年 01 月 03 日	4.23	10,000	42,300.00
15	601006	大秦铁路	2022 年 01 月 13 日	6.40	10,000	64,000.00
16	601669	中国电建	2022 年 01 月 07 日	8.08	10,000	80,800.00
17	300251	光线传媒	2022 年 01 月 25 日	12.85	3,000	38,550.00
18	300498	温氏股份	2022 年 01 月 07 日	19.26	2,800	53,928.00
19	300274	阳光电源	2022 年 01 月 10 日	145.80	2,500	364,500.00
20	300015	爱尔眼科	2022 年 01 月 07 日	42.28	1,500	63,420.00
21	300529	健帆生物	2022 年 01 月 04 日	53.30	1,000	53,300.00
22	300413	芒果超媒	2022 年 01 月 11 日	57.22	1,000	57,220.00
23	300628	亿联网络	2022 年 01 月 04 日	81.45	1,000	81,450.00
合计	-	-	-	-	173,200.00	3,016,804.00

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。本基金本期末未持有信用债、资产支持证券和同业存单。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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。本基金本报告期末无重大流动性风险。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 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	4,858,619.81	—	—	—	—	—	4,858,619.81
结算备付金	37,766.96	—	—	—	—	—	37,766.96
存出保证金	33,593.55	—	—	—	—	—	33,593.55
交易性金融资产	—	—	—	—	—	483,737,569.31	483,737,569.31
应收证券清算款	—	—	—	—	—	71,604.98	71,604.98
应收利息	—	—	—	—	—	2,001.82	2,001.82
应收股利	—	—	—	—	—	32,677.18	32,677.18
资产总计	4,929,980.32	—	—	—	—	483,843,853.29	488,773,833.61
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	40.02	40.02
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	210,486.93	210,486.93
应付托管费	—	—	—	—	—	42,097.41	42,097.41
应付交易费用	—	—	—	—	—	43,900.43	43,900.43
应付税费	—	—	—	—	—	31.71	31.71
其他负债	—	—	—	—	—	186,712.33	186,712.33
负债总计	—	—	—	—	—	483,268.83	483,268.83
利率敏感度缺口	4,929,980.32	—	—	—	—	483,360,584.46	488,290,564.78

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末未持有债券资产（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。本基金合同生效日为2021年02月09日，无上年度同期对比数据。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末（2021年12月31日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
交易性金融资产	—	185,224,489.50	—	—	185,224,489.50
应收股利	—	32,677.18	—	—	32,677.18
资产合计	—	185,257,166.68	—	—	185,257,166.68
以外币计价的负债					
—	—	—	—	—	—
负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	—	185,257,166.68	—	—	185,257,166.68

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化1%，其他变量不变；(2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口。	
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（2021年12月31日）
	港币相对人民币贬值1%	-1,852,571.67

	港币相对人民币升值 1%	1,852,571.67
--	--------------	--------------

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）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、港股通标的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、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、金融衍生工具（股指期货、国债期货）、货币市场工具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（均含存托凭证）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。

如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

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 12 月 31 日）
----	-----------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	483,737,569.31	99.07
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	483,737,569.31	99.07

7.4.13.4.3.2 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。基金合同生效日为 2021 年 02 月 09 日。

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 (2021 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准增加 1%	4,604,396.64
	2. 业绩比较基准减少 1%	-4,604,396.64

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 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。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 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 482,602,348.76 元，属于第二层次的余额为人民币 435,344.49 元，属于第三层次余额为人民币 699,876.06 元。

7.4.14.1.2.2 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。

7.4.14.1.2.3 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：

2021 年度转入第三层次人民币 0.00 元，转出第三层次人民币 0.00 元，当期计入损益的利得或损失总额人民币 255,352.94 元，购买人民币 444,523.12 元，卖出人民币 0.00 元，本期末人民币 699,876.06 元，本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动人民币 255,352.94 元。

7.4.14.2 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。

7.4.14.3 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	483,737,569.31	98.97

	其中：股票	483,737,569.31	98.97
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	4,896,386.77	1.00
8	其他各项资产	139,877.53	0.03
9	合计	488,773,833.61	100.00

注：本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 185,224,489.50 元，占资产净值比例为 37.93%；通过转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 3,016,804.00 元，占资产净值比例为 0.62%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

8.2.1.1 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	587,482.51	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	54,337.68	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
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	40,756.62	0.01

N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	0.00
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	8,414.64	0.00
S	综合	—	—
	合计	728,471.15	0.15

8.2.1.2 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	3,051,534.00	0.62
B	采矿业	6,077,147.00	1.24
C	制造业	178,638,403.24	36.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,576,422.00	1.35
E	建筑业	5,157,541.70	1.06
F	批发和零售业	1,535,750.60	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	7,427,593.60	1.52
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,483,142.50	2.15
J	金融业	61,482,314.52	12.59
K	房地产业	5,083,380.60	1.04
L	租赁和商务服务业	3,746,682.82	0.77
M	科学研究和技术服务业	4,656,366.60	0.95
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	183,924.00	0.04
Q	卫生和社会工作	2,667,099.48	0.55
R	文化、体育和娱乐业	1,017,306.00	0.21
S	综合	—	—
	合计	297,784,608.66	60.99

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
金融	54,171,555.00	11.09
通信服务	37,244,056.00	7.63
非日常生活消费品	30,709,345.00	6.29
房地产	13,261,618.00	2.72

信息技术	9,674,318.00	1.98
医疗保健	9,212,868.00	1.89
工业	9,003,294.00	1.84
日常消费品	8,317,953.00	1.70
公用事业	7,577,212.50	1.55
能源	3,857,640.00	0.79
原材料	2,194,630.00	0.45
合计	185,224,489.50	37.93

注：1、以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

2、以上行业分类的统计中已包含深港通投资的股票。

8.3 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

8.3.1 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	00700	腾讯控股	84,900	31,708,452.00	6.49
2	600519	贵州茅台	8,000	16,400,000.00	3.36
3	03690	美团-W	77,500	14,282,475.00	2.92
4	601318	中国平安	136,800	6,896,088.00	1.41
4	02318	中国平安	94,500	4,338,495.00	0.89
5	600036	招商银行	156,276	7,612,203.96	1.56
5	03968	招商银行	58,000	2,871,580.00	0.59
6	300750	宁德时代	17,700	10,407,600.00	2.13
7	00005	汇丰控股	261,200	10,017,020.00	2.05
8	01299	友邦保险	152,800	9,818,928.00	2.01
9	00939	建设银行	1,518,000	6,709,560.00	1.37
9	601939	建设银行	85,000	498,100.00	0.10
10	01398	工商银行	1,096,000	3,945,600.00	0.81
10	601398	工商银行	442,700	2,049,701.00	0.42
11	00388	香港交易所	16,100	5,994,674.00	1.23
12	002594	比亚迪	11,500	3,083,380.00	0.63
12	01211	比亚迪股份	11,000	2,397,670.00	0.49
13	000858	五粮液	24,600	5,477,436.00	1.12
14	601012	隆基股份	54,740	4,718,588.00	0.97
15	000333	美的集团	61,800	4,561,458.00	0.93
16	02269	药明生物	53,500	4,048,345.00	0.83
17	300059	东方财富	104,560	3,880,221.60	0.79
18	601166	兴业银行	183,700	3,497,648.00	0.72
19	01810	小米集团-W	221,000	3,414,450.00	0.70

20	600030	中信证券	107,600	2,841,716.00	0.58
20	06030	中信证券	29,000	482,560.00	0.10
21	600900	长江电力	143,600	3,259,720.00	0.67
22	03988	中国银行	1,056,000	2,428,800.00	0.50
22	601988	中国银行	266,600	813,130.00	0.17
23	600887	伊利股份	76,900	3,188,274.00	0.65
24	002415	海康威视	59,100	3,092,112.00	0.63
25	002475	立讯精密	62,400	3,070,080.00	0.63
26	603259	药明康德	25,820	3,061,735.60	0.63
27	00941	中国移动	78,000	2,984,280.00	0.61
28	00669	创科实业	23,500	2,981,915.00	0.61
29	600276	恒瑞医药	56,660	2,873,228.60	0.59
30	601888	中国中免	12,302	2,699,181.82	0.55
31	601328	交通银行	347,000	1,599,670.00	0.33
31	03328	交通银行	222,000	854,700.00	0.18
32	688981	中芯国际	24,500	1,298,255.00	0.27
32	00981	中芯国际	75,500	1,152,130.00	0.24
33	600690	海尔智家	47,900	1,431,731.00	0.29
33	06690	海尔智家	35,600	959,064.00	0.20
34	000568	泸州老窖	9,300	2,360,991.00	0.48
35	300760	迈瑞医疗	6,172	2,350,297.60	0.48
36	02331	李宁	33,500	2,337,630.00	0.48
37	601899	紫金矿业	182,100	1,766,370.00	0.36
37	02899	紫金矿业	72,000	546,480.00	0.11
38	000651	格力电器	59,900	2,218,097.00	0.45
39	601288	农业银行	443,500	1,303,890.00	0.27
39	01288	农业银行	390,000	854,100.00	0.17
40	000002	万科A	86,100	1,701,336.00	0.35
40	02202	万科企业	24,100	357,403.00	0.07
41	603501	韦尔股份	6,500	2,020,005.00	0.41
42	000001	平安银行	122,500	2,018,800.00	0.41
43	600309	万华化学	19,900	2,009,900.00	0.41
44	600809	山西汾酒	6,220	1,964,151.60	0.40
45	02382	舜宇光学科技	9,700	1,955,714.00	0.40
46	300274	阳光电源	13,200	1,924,560.00	0.39
47	002142	宁波银行	50,190	1,921,273.20	0.39
48	000725	京东方A	379,000	1,913,950.00	0.39
49	09633	农夫山泉	44,600	1,876,322.00	0.38
50	601601	中国太保	43,300	1,174,296.00	0.24
50	02601	中国太保	35,200	608,608.00	0.12

51	002714	牧原股份	33,300	1,776,888.00	0.36
52	600585	海螺水泥	30,400	1,225,120.00	0.25
52	00914	海螺水泥	16,500	525,525.00	0.11
53	600031	三一重工	75,200	1,714,560.00	0.35
54	002352	顺丰控股	24,800	1,709,216.00	0.35
55	002812	恩捷股份	6,800	1,702,720.00	0.35
56	300014	亿纬锂能	14,300	1,689,974.00	0.35
57	603288	海天味业	15,980	1,679,657.80	0.34
58	00386	中国石油化工股份	324,000	962,280.00	0.20
58	600028	中国石化	169,200	715,716.00	0.15
59	600436	片仔癀	3,800	1,661,170.00	0.34
60	00002	中电控股	25,500	1,641,945.00	0.34
61	002241	歌尔股份	30,300	1,639,230.00	0.34
62	02628	中国人寿	94,000	992,640.00	0.20
62	601628	中国人寿	21,100	634,899.00	0.13
63	02020	安踏体育	17,000	1,624,860.00	0.33
64	02333	长城汽车	39,000	854,490.00	0.17
64	601633	长城汽车	15,500	752,370.00	0.15
65	300124	汇川技术	23,150	1,588,090.00	0.33
66	601088	中国神华	41,700	939,084.00	0.19
66	01088	中国神华	43,000	642,850.00	0.13
67	600438	通威股份	34,200	1,537,632.00	0.31
68	601919	中远海控	80,040	1,495,947.60	0.31
69	600837	海通证券	121,900	1,494,494.00	0.31
70	00883	中国海洋石油	227,000	1,491,390.00	0.31
71	00016	新鸿基地产	19,000	1,469,460.00	0.30
72	002460	赣锋锂业	10,200	1,457,070.00	0.30
73	300015	爱尔眼科	34,241	1,447,709.48	0.30
74	06160	百济神州	10,800	1,421,604.00	0.29
75	600048	保利发展	90,700	1,417,641.00	0.29
76	00003	香港中华煤气	142,250	1,412,542.50	0.29
77	02319	蒙牛乳业	39,000	1,409,460.00	0.29
78	600406	国电南瑞	35,060	1,403,451.80	0.29
79	00001	长和	34,000	1,398,420.00	0.29
80	02313	申洲国际	11,400	1,397,184.00	0.29
81	601658	邮储银行	137,600	701,760.00	0.14
81	01658	邮储银行	151,000	674,970.00	0.14
82	603799	华友钴业	12,400	1,367,844.00	0.28

83	00857	中国石油股份	268,000	761,120.00	0.16
83	601857	中国石油	122,900	603,439.00	0.12
84	000063	中兴通讯	40,100	1,343,350.00	0.28
85	601668	中国建筑	265,300	1,326,500.00	0.27
86	00175	吉利汽车	75,000	1,305,750.00	0.27
87	002304	洋河股份	7,700	1,268,421.00	0.26
88	600000	浦发银行	148,500	1,266,705.00	0.26
89	600111	北方稀土	27,600	1,264,080.00	0.26
90	300122	智飞生物	10,100	1,258,460.00	0.26
91	01109	华润置地	46,000	1,233,720.00	0.25
92	01024	快手-W	20,800	1,225,328.00	0.25
93	600016	民生银行	313,500	1,222,650.00	0.25
94	002230	科大讯飞	23,200	1,218,232.00	0.25
95	600104	上汽集团	59,000	1,217,170.00	0.25
96	600745	闻泰科技	9,400	1,215,420.00	0.25
97	601816	京沪高铁	248,500	1,200,255.00	0.25
98	02688	新奥能源	10,000	1,200,200.00	0.25
99	603986	兆易创新	6,800	1,195,780.00	0.24
100	002129	中环股份	28,600	1,194,050.00	0.24
101	002049	紫光国微	5,300	1,192,500.00	0.24
102	002271	东方雨虹	22,300	1,174,764.00	0.24
103	601688	华泰证券	65,000	1,154,400.00	0.24
104	00291	华润啤酒	22,000	1,148,400.00	0.24
105	002371	北方华创	3,300	1,145,166.00	0.23
106	00011	恒生银行	9,700	1,131,699.00	0.23
107	01113	长实集团	28,000	1,125,320.00	0.23
108	02388	中银香港	53,500	1,117,615.00	0.23
109	300142	沃森生物	19,800	1,112,760.00	0.23
110	000661	长春高新	4,100	1,112,740.00	0.23
111	000100	TCL 科技	177,500	1,095,175.00	0.22
112	300498	温氏股份	56,200	1,082,412.00	0.22
113	000338	潍柴动力	60,100	1,075,189.00	0.22
114	600893	航发动力	16,800	1,066,128.00	0.22
115	002027	分众传媒	127,900	1,047,501.00	0.21
116	300450	先导智能	13,760	1,023,331.20	0.21
117	601211	国泰君安	57,100	1,021,519.00	0.21
118	600089	特变电工	47,900	1,014,043.00	0.21
119	06098	碧桂园服务	26,000	992,680.00	0.20
120	300782	卓胜微	3,000	980,400.00	0.20
121	601766	中国中车	153,900	937,251.00	0.19

122	00027	银河娱乐	28,000	924,840.00	0.19
123	600050	中国联通	235,200	924,336.00	0.19
124	000776	广发证券	37,400	919,666.00	0.19
125	600570	恒生电子	14,760	917,334.00	0.19
126	601229	上海银行	125,800	896,954.00	0.18
127	600919	江苏银行	149,500	871,585.00	0.18
128	002821	凯莱英	2,000	870,000.00	0.18
129	01093	石药集团	124,000	859,320.00	0.18
130	300347	泰格医药	6,700	856,260.00	0.18
131	00688	中国海外发 展	55,500	837,495.00	0.17
132	600660	福耀玻璃	17,700	834,378.00	0.17
133	601169	北京银行	187,200	831,168.00	0.17
134	600999	招商证券	46,900	827,785.00	0.17
135	002709	天赐材料	7,200	825,480.00	0.17
136	688599	天合光能	10,400	820,560.00	0.17
137	06618	京东健康	16,200	813,888.00	0.17
138	600905	三峡能源	108,300	813,333.00	0.17
139	600019	宝钢股份	112,700	806,932.00	0.17
140	600010	包钢股份	288,300	804,357.00	0.16
141	00066	港铁公司	23,500	804,170.00	0.16
142	601669	中国电建	96,800	782,144.00	0.16
143	600958	东方证券	52,800	778,272.00	0.16
144	01997	九龙仓置业	24,000	777,120.00	0.16
145	00006	电能实业	19,500	774,930.00	0.16
146	002311	海大集团	10,500	769,650.00	0.16
147	002410	广联达	12,000	767,760.00	0.16
148	002459	晶澳科技	8,100	750,870.00	0.15
149	600196	复星医药	15,300	748,782.00	0.15
150	06969	思摩尔国际	23,000	747,500.00	0.15
151	601390	中国中铁	128,800	745,752.00	0.15
152	01177	中国生物制 药	167,000	744,820.00	0.15
153	600588	用友网络	20,700	742,716.00	0.15
154	00968	信义光能	68,000	735,080.00	0.15
155	601985	中国核电	88,500	734,550.00	0.15
156	601877	正泰电器	13,600	732,904.00	0.15
157	000625	长安汽车	48,160	731,550.40	0.15
158	01801	信达生物	18,500	729,825.00	0.15
159	000166	申万宏源	142,300	728,576.00	0.15
160	00586	海螺创业	23,000	716,450.00	0.15

161	300408	三环集团	16,000	713,600.00	0.15
162	00268	金蝶国际	36,000	706,320.00	0.14
163	002179	中航光电	7,000	703,920.00	0.14
164	00267	中信股份	111,000	699,300.00	0.14
165	002493	荣盛石化	38,400	697,344.00	0.14
166	601818	光大银行	209,300	694,876.00	0.14
167	00960	龙湖集团	23,000	690,230.00	0.14
168	00992	联想集团	94,000	689,020.00	0.14
169	000895	双汇发展	21,800	687,790.00	0.14
170	603659	璞泰来	4,260	684,198.60	0.14
171	000538	云南白药	6,500	680,225.00	0.14
172	02618	京东物流	31,100	672,693.00	0.14
173	601377	兴业证券	67,800	669,864.00	0.14
174	02007	碧桂园	117,000	662,220.00	0.14
175	002074	国轩高科	12,900	661,125.00	0.14
176	300661	圣邦股份	2,100	648,900.00	0.13
177	300207	欣旺达	15,200	640,832.00	0.13
178	000768	中航西飞	17,500	638,750.00	0.13
179	603806	福斯特	4,820	629,251.00	0.13
180	00322	康师傅控股	48,000	628,800.00	0.13
181	600346	恒力石化	26,700	613,299.00	0.13
182	688111	金山办公	2,300	609,500.00	0.12
183	002001	新和成	19,540	608,084.80	0.12
184	601989	中国重工	144,000	607,680.00	0.12
185	01928	金沙中国有限公司	40,800	605,880.00	0.12
186	601600	中国铝业	99,100	603,519.00	0.12
187	601225	陕西煤业	49,100	599,020.00	0.12
188	601138	工业富联	50,200	598,384.00	0.12
189	300496	中科创达	4,300	595,206.00	0.12
190	000799	酒鬼酒	2,800	595,000.00	0.12
191	00868	信义玻璃	37,000	589,780.00	0.12
192	600426	华鲁恒升	18,670	584,371.00	0.12
193	002008	大族激光	10,800	583,200.00	0.12
194	01821	ESR	27,000	581,580.00	0.12
195	600460	士兰微	10,700	579,940.00	0.12
196	002202	金风科技	34,900	574,803.00	0.12
197	300433	蓝思科技	25,000	574,500.00	0.12
198	002050	三花智控	22,700	574,310.00	0.12
199	600009	上海机场	12,200	569,618.00	0.12
200	601009	南京银行	63,300	567,168.00	0.12

201	600741	华域汽车	19,900	563,170.00	0.12
202	300316	晶盛机电	8,100	562,950.00	0.12
203	600150	中国船舶	22,600	560,254.00	0.11
204	600763	通策医疗	2,800	557,200.00	0.11
205	00836	华润电力	26,000	554,840.00	0.11
206	600176	中国巨石	30,390	553,098.00	0.11
207	300413	芒果超媒	9,500	543,590.00	0.11
208	00998	中信银行	132,000	364,320.00	0.07
208	601998	中信银行	38,800	179,256.00	0.04
209	601100	恒立液压	6,600	539,880.00	0.11
210	600011	华能国际	55,600	538,764.00	0.11
211	03908	中金公司	19,200	337,536.00	0.07
211	601995	中金公司	4,100	201,023.00	0.04
212	300896	爱美客	1,000	536,110.00	0.11
213	001979	招商蛇口	40,100	534,934.00	0.11
214	002236	大华股份	22,700	532,996.00	0.11
215	600522	中天科技	31,000	525,760.00	0.11
216	300601	康泰生物	5,200	512,408.00	0.10
217	00017	新世界发展	20,000	504,400.00	0.10
218	01193	华润燃气	14,000	504,280.00	0.10
219	600760	中航沈飞	7,380	502,135.20	0.10
220	603993	洛阳钼业	89,400	498,852.00	0.10
221	300454	深信服	2,600	496,600.00	0.10
222	600584	长电科技	15,800	490,116.00	0.10
223	00012	恒基地产	18,000	488,520.00	0.10
224	06186	中国飞鹤	57,000	487,350.00	0.10
225	600989	宝丰能源	27,800	482,608.00	0.10
226	002920	德赛西威	3,400	481,134.00	0.10
227	600926	杭州银行	37,500	480,750.00	0.10
228	601006	大秦铁路	75,100	480,640.00	0.10
229	688008	澜起科技	5,700	478,059.00	0.10
230	601066	中信建投	16,300	476,775.00	0.10
231	002602	世纪华通	56,500	474,035.00	0.10
232	688036	传音控股	3,000	470,700.00	0.10
233	03323	中国建材	60,000	469,200.00	0.10
234	600132	重庆啤酒	3,100	469,092.00	0.10
235	02328	中国财险	90,000	468,900.00	0.10
236	002384	东山精密	17,300	468,830.00	0.10
237	003816	中国广核	149,300	467,309.00	0.10
238	300759	康龙化成	3,300	466,191.00	0.10
239	601117	中国化学	38,600	463,200.00	0.09

240	000977	浪潮信息	12,900	462,207.00	0.09
241	601360	三六零	36,100	459,192.00	0.09
242	000786	北新建材	12,800	458,624.00	0.09
243	00288	万洲国际	113,500	454,000.00	0.09
244	601186	中国铁建	58,200	453,960.00	0.09
245	002555	三七互娱	16,800	453,936.00	0.09
246	601233	桐昆股份	21,400	453,252.00	0.09
247	601555	东吴证券	51,090	452,657.40	0.09
248	000157	中联重科	62,700	449,559.00	0.09
249	00881	中升控股	9,000	447,390.00	0.09
250	002013	中航机电	24,600	447,228.00	0.09
251	601868	中国能建	163,800	447,174.00	0.09
252	000963	华东医药	11,100	446,220.00	0.09
253	600600	青岛啤酒	4,500	445,500.00	0.09
254	002385	大北农	41,900	439,531.00	0.09
255	00151	中国旺旺	75,000	438,750.00	0.09
256	600029	南方航空	64,100	436,521.00	0.09
257	002648	卫星化学	10,900	436,327.00	0.09
258	600015	华夏银行	77,900	436,240.00	0.09
259	000876	新希望	28,500	433,485.00	0.09
260	01929	周大福	37,800	433,188.00	0.09
261	002601	龙佰集团	15,100	431,709.00	0.09
262	600547	山东黄金	22,900	430,978.00	0.09
263	603369	今世缘	7,900	429,760.00	0.09
264	600219	南山铝业	90,700	427,197.00	0.09
265	01038	长江基建集团	10,500	426,195.00	0.09
266	603486	科沃斯	2,800	422,660.00	0.09
267	601238	广汽集团	27,600	419,244.00	0.09
268	002736	国信证券	36,500	419,020.00	0.09
269	600352	浙江龙盛	32,900	415,527.00	0.09
270	000425	徐工机械	69,300	415,107.00	0.09
271	00788	中国铁塔	592,000	414,400.00	0.08
272	000938	紫光股份	18,100	413,585.00	0.08
273	601336	新华保险	10,600	412,128.00	0.08
274	601901	方正证券	52,100	408,464.00	0.08
275	603019	中科曙光	14,700	405,279.00	0.08
276	600886	国投电力	35,200	403,744.00	0.08
277	002007	华兰生物	13,800	402,132.00	0.08
278	688012	中微公司	3,100	392,460.00	0.08
279	03888	金山软件	14,000	392,000.00	0.08

280	00004	九龙仓集团	20,000	391,600.00	0.08
281	000596	古井贡酒	1,600	390,400.00	0.08
282	300033	同花顺	2,700	390,366.00	0.08
283	603882	金域医学	3,500	389,795.00	0.08
284	09992	泡泡玛特	10,600	387,430.00	0.08
285	601800	中国交建	44,600	382,668.00	0.08
286	00083	信和置业	48,000	381,120.00	0.08
287	600298	安琪酵母	6,300	380,268.00	0.08
288	00101	恒隆地产	29,000	380,190.00	0.08
289	601799	星宇股份	1,852	378,271.00	0.08
290	002180	纳思达	7,900	377,304.00	0.08
291	300628	亿联网络	4,600	374,670.00	0.08
292	002938	鹏鼎控股	8,800	373,384.00	0.08
293	300595	欧普康视	6,500	372,905.00	0.08
294	00384	中国燃气	28,000	371,000.00	0.08
295	600383	金地集团	28,600	370,942.00	0.08
296	601916	浙商银行	105,700	369,950.00	0.08
297	000783	长江证券	49,000	369,460.00	0.08
298	01308	海丰国际	16,000	368,960.00	0.08
299	601788	光大证券	24,700	368,771.00	0.08
300	00241	阿里健康	68,000	366,520.00	0.08
301	01918	融创中国	38,000	365,940.00	0.07
302	000069	华侨城 A	51,900	365,376.00	0.07
303	601865	福莱特	6,300	365,022.00	0.07
304	01876	百威亚太	21,800	364,496.00	0.07
305	300253	卫宁健康	21,700	363,692.00	0.07
306	300003	乐普医疗	16,000	362,080.00	0.07
307	002185	华天科技	28,400	360,964.00	0.07
308	600115	中国东航	69,200	357,072.00	0.07
309	00270	粤海投资	44,000	356,400.00	0.07
310	603833	欧派家居	2,400	354,000.00	0.07
311	000301	东方盛虹	18,300	353,922.00	0.07
312	601108	财通证券	31,800	353,616.00	0.07
313	600918	中泰证券	35,200	350,944.00	0.07
314	603392	万泰生物	1,580	349,970.00	0.07
315	002252	上海莱士	51,100	348,502.00	0.07
316	600109	国金证券	30,700	347,831.00	0.07
317	300999	金龙鱼	5,500	346,115.00	0.07
318	601618	中国中冶	90,300	345,849.00	0.07
319	601111	中国国航	37,800	345,114.00	0.07
320	600183	生益科技	14,600	343,830.00	0.07

321	00425	敏实集团	12,000	336,960.00	0.07
322	00135	昆仑能源	56,000	334,880.00	0.07
323	002841	视源股份	4,100	333,740.00	0.07
324	601155	新城控股	11,400	332,082.00	0.07
325	601838	成都银行	27,400	328,800.00	0.07
326	01044	恒安国际	10,000	328,300.00	0.07
327	603589	口子窖	4,600	326,002.00	0.07
328	300529	健帆生物	6,100	325,130.00	0.07
329	603517	绝味食品	4,700	321,151.00	0.07
330	002916	深南电路	2,600	316,732.00	0.06
331	000066	中国长城	22,300	315,768.00	0.06
332	601727	上海电气	64,700	314,442.00	0.06
333	601966	玲珑轮胎	8,600	314,330.00	0.06
334	01378	中国宏桥	46,500	312,945.00	0.06
335	603160	汇顶科技	2,900	312,533.00	0.06
336	603816	顾家家居	4,000	308,640.00	0.06
337	600332	白云山	9,000	307,800.00	0.06
338	601077	渝农商行	78,300	301,455.00	0.06
339	002120	韵达股份	14,700	300,762.00	0.06
340	002624	完美世界	14,700	298,557.00	0.06
341	000728	国元证券	38,600	297,220.00	0.06
342	600038	中直股份	3,700	297,110.00	0.06
343	603899	晨光文具	4,600	296,746.00	0.06
344	00522	ASM PACIFIC	4,300	296,184.00	0.06
345	000703	恒逸石化	27,800	295,236.00	0.06
346	600362	江西铜业	13,100	292,523.00	0.06
347	300146	汤臣倍健	10,800	291,168.00	0.06
348	002791	坚朗五金	1,600	290,544.00	0.06
349	600233	圆通速递	17,400	290,232.00	0.06
350	601607	上海医药	14,600	290,102.00	0.06
351	688180	君实生物	4,300	288,014.00	0.06
352	600779	水井坊	2,400	287,976.00	0.06
353	002414	高德红外	11,860	287,130.60	0.06
354	600143	金发科技	22,800	286,824.00	0.06
355	300144	宋城演艺	19,800	283,536.00	0.06
356	300677	英科医疗	4,876	282,027.84	0.06
357	002568	百润股份	4,700	281,201.00	0.06
358	600079	人福医药	12,400	279,248.00	0.06
359	601990	南京证券	27,900	276,489.00	0.06
360	01066	威高股份	34,400	273,824.00	0.06

361	002673	西部证券	33,900	273,573.00	0.06
362	002044	美年健康	34,700	272,395.00	0.06
363	300676	华大基因	3,100	272,180.00	0.06
364	688185	康希诺	900	269,595.00	0.06
365	00853	微创医疗	11,600	269,352.00	0.06
366	600705	中航产融	67,700	268,769.00	0.06
367	00285	比亚迪电子	11,500	268,410.00	0.05
368	600061	国投资本	32,468	266,886.96	0.05
369	600188	兖矿能源	11,300	265,889.00	0.05
370	600872	中炬高新	7,000	265,790.00	0.05
371	00772	阅文集团	6,600	264,396.00	0.05
372	002600	领益智造	35,800	263,488.00	0.05
373	600845	宝信软件	4,310	262,177.30	0.05
374	000708	中信特钢	12,800	262,144.00	0.05
375	01209	华润万象生活	8,800	261,536.00	0.05
376	601878	浙商证券	19,600	258,328.00	0.05
377	00762	中国联通	80,000	255,200.00	0.05
378	601728	中国电信	58,800	254,604.00	0.05
379	00019	太古股份公司A	7,000	253,820.00	0.05
380	600161	天坛生物	8,700	251,952.00	0.05
381	603260	合盛硅业	1,900	250,743.00	0.05
382	603737	三棵树	1,800	250,470.00	0.05
383	603939	益丰药房	4,540	250,199.40	0.05
384	603338	浙江鼎力	3,100	248,806.00	0.05
385	03692	翰森制药	16,000	248,480.00	0.05
386	000860	顺鑫农业	6,500	248,170.00	0.05
387	300558	贝达药业	3,100	247,473.00	0.05
388	01999	敏华控股	24,800	245,024.00	0.05
389	600521	华海药业	11,300	244,758.00	0.05
390	688169	石头科技	300	243,900.00	0.05
391	600018	上港集团	44,200	242,216.00	0.05
392	688126	沪硅产业	9,300	240,126.00	0.05
393	02018	瑞声科技	9,500	239,210.00	0.05
394	603345	安井食品	1,400	239,092.00	0.05
395	601198	东兴证券	20,400	237,252.00	0.05
396	01972	太古地产	14,800	236,504.00	0.05
397	01691	J S 环球生活	22,000	236,280.00	0.05
398	601696	中银证券	17,500	235,375.00	0.05

399	00144	招商局港口	20,000	232,200.00	0.05
400	601216	君正集团	42,800	223,844.00	0.05
401	600369	西南证券	42,000	222,180.00	0.05
402	00884	旭辉控股集团	58,000	222,140.00	0.05
403	601162	天风证券	54,800	221,940.00	0.05
404	00817	中国金茂	112,000	220,640.00	0.05
405	600372	中航电子	9,800	219,422.00	0.04
406	00909	明源云	15,000	217,800.00	0.04
407	603185	上机数控	1,300	217,074.00	0.04
408	00656	复星国际	31,500	216,720.00	0.04
409	002508	老板电器	6,000	216,120.00	0.04
410	600606	绿地控股	48,455	210,294.70	0.04
411	600674	川投能源	16,700	208,750.00	0.04
412	688396	华润微	3,200	206,720.00	0.04
413	600118	中国卫星	7,600	206,340.00	0.04
414	01579	颐海国际	7,000	206,290.00	0.04
415	300866	安克创新	2,000	205,000.00	0.04
416	000050	深天马A	15,500	201,810.00	0.04
417	06862	海底捞	14,000	201,460.00	0.04
418	06110	滔搏	31,000	199,950.00	0.04
419	00754	合生创展集团	15,000	199,350.00	0.04
420	603707	健友股份	4,650	195,300.00	0.04
421	002024	苏宁易购	47,100	194,052.00	0.04
422	002157	正邦科技	19,900	192,234.00	0.04
423	300251	光线传媒	14,800	190,180.00	0.04
424	688363	华熙生物	1,200	186,360.00	0.04
425	601933	永辉超市	45,900	185,895.00	0.04
426	603195	公牛集团	1,100	184,030.00	0.04
427	002607	中公教育	23,400	183,924.00	0.04
428	002064	华峰化学	17,600	183,744.00	0.04
429	01313	华润水泥控股	38,000	183,160.00	0.04
430	601881	中国银河	16,300	182,397.00	0.04
431	000656	金科股份	40,500	181,440.00	0.04
432	600848	上海临港	12,080	179,629.60	0.04
433	300832	新产业	3,900	171,795.00	0.04
434	603233	大参林	4,020	169,282.20	0.03
435	01833	平安好医生	7,300	169,214.00	0.03
436	601319	中国人保	35,800	168,260.00	0.03

437	603658	安图生物	3,000	165,180.00	0.03
438	002153	石基信息	5,660	162,668.40	0.03
439	00966	中国太平	18,200	159,250.00	0.03
440	02689	玖龙纸业	23,000	157,320.00	0.03
441	300957	贝泰妮	800	153,824.00	0.03
442	002294	信立泰	5,600	152,992.00	0.03
443	002939	长城证券	11,800	152,810.00	0.03
444	600025	华能水电	22,800	150,252.00	0.03
445	603087	甘李药业	2,100	147,714.00	0.03
446	601898	中煤能源	23,100	145,299.00	0.03
447	601236	红塔证券	11,920	142,086.40	0.03
448	01030	新城发展	32,000	137,920.00	0.03
449	06993	蓝月亮集团	22,500	136,125.00	0.03
450	601231	环旭电子	8,400	134,904.00	0.03
451	603866	桃李面包	4,680	132,912.00	0.03
452	00880	澳博控股	30,000	128,700.00	0.03
453	02588	中银航空租 赁	2,700	126,036.00	0.03
454	002032	苏泊尔	2,000	124,480.00	0.03
455	000987	越秀金控	14,100	122,670.00	0.03
456	000800	一汽解放	11,800	121,422.00	0.02
457	601577	长沙银行	15,300	119,493.00	0.02
458	06666	恒大物业	54,500	117,720.00	0.02
459	601808	中海油服	7,500	112,500.00	0.02
460	605499	东鹏饮料	600	109,104.00	0.02
461	03808	中国重汽	11,000	107,910.00	0.02
462	03380	龙光集团	22,000	107,140.00	0.02
463	01128	永利澳门	19,600	102,116.00	0.02
464	06808	高鑫零售	36,000	92,160.00	0.02
465	300919	中伟股份	600	90,906.00	0.02
466	300888	稳健医疗	1,100	90,695.00	0.02
467	300979	华利集团	1,000	89,050.00	0.02
468	00293	国泰航空	17,000	88,740.00	0.02
469	06699	时代天使	400	81,564.00	0.02
470	00813	世茂集团	19,000	79,230.00	0.02
471	601698	中国卫通	5,500	79,145.00	0.02
472	01516	融创服务	12,000	78,000.00	0.02
473	03383	雅居乐集团	22,000	76,120.00	0.02
474	600299	安迪苏	5,100	62,832.00	0.01
475	300869	康泰医学	1,500	60,825.00	0.01
476	02282	美高梅中国	14,800	57,276.00	0.01

477	03333	中国恒大	25,000	32,500.00	0.01
-----	-------	------	--------	-----------	------

8.3.2 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	01114	BRILLIANCE CHI	72,000	429,840.00	0.09
2	688211	中科微至	2,138	152,482.16	0.03
3	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.01
4	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01
5	301155	海力风电	381	36,861.75	0.01
6	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.01
7	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.01
8	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
9	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
10	301189	奥尼电子	353	19,986.86	0.00
11	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
12	301166	优宁维	194	18,333.00	0.00
13	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
14	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
15	301088	戎美股份	552	13,617.84	0.00
16	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
17	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
18	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
19	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
20	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
21	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
22	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
23	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
24	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
25	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
26	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
27	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
28	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
29	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
30	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
31	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
32	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
33	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
34	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00

35	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
36	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
37	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
38	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
39	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
40	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
41	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
42	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
43	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
44	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
45	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
46	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
47	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
48	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	95,112,626.41	19.48
2	03690	美团-W	40,736,346.17	8.34
3	601318	中国平安	18,464,377.63	3.78
3	02318	中国平安	15,261,463.15	3.13
4	600519	贵州茅台	32,078,194.15	6.57
5	01299	友邦保险	26,939,655.70	5.52
6	00005	汇丰控股	21,172,065.23	4.34
7	600036	招商银行	14,341,319.71	2.94
7	03968	招商银行	6,607,582.18	1.35
8	00939	建设银行	17,013,754.73	3.48
8	601939	建设银行	1,021,033.00	0.21
9	00388	香港交易所	14,965,045.30	3.06
10	01398	工商银行	10,080,027.92	2.06
10	601398	工商银行	3,949,782.00	0.81
11	000858	五粮液	13,183,014.00	2.70
12	300750	宁德时代	11,625,780.00	2.38
13	01810	小米集团-W	10,794,380.43	2.21
14	000333	美的集团	10,222,093.00	2.09
15	02269	药明生物	8,532,675.88	1.75
16	002594	比亚迪	5,046,022.00	1.03
16	01211	比亚迪	3,416,355.38	0.70
17	601166	兴业银行	7,807,916.00	1.60

18	600276	恒瑞医药	7,604,376.97	1.56
19	00941	中国移动	7,356,645.62	1.51
20	300760	迈瑞医疗	6,903,784.79	1.41

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	38,765,392.13	7.94
2	03690	美团-W	14,311,449.86	2.93
3	01299	友邦保险	13,168,509.96	2.70
4	00005	汇丰控股	11,070,303.49	2.27
5	02318	中国平安	6,843,351.03	1.40
5	601318	中国平安	2,314,112.00	0.47
6	00939	建设银行	8,832,327.63	1.81
6	601939	建设银行	137,338.00	0.03
7	00388	香港交易所	6,876,154.87	1.41
8	01398	工商银行	5,164,114.77	1.06
8	601398	工商银行	567,740.00	0.12
9	000858	五粮液	5,718,103.00	1.17
10	03968	招商银行	3,467,276.34	0.71
10	600036	招商银行	2,057,758.00	0.42
11	300750	宁德时代	5,448,604.92	1.12
12	01810	小米集团-W	5,024,105.31	1.03
13	300760	迈瑞医疗	4,352,866.00	0.89
14	000333	美的集团	4,133,626.00	0.85
15	02269	药明生物	3,843,254.75	0.79
16	600519	贵州茅台	3,591,178.00	0.74
17	00941	中国移动	3,572,453.22	0.73
18	002594	比亚迪	2,257,406.00	0.46
18	01211	比亚迪	1,308,537.08	0.27
19	03988	中国银行	2,879,016.91	0.59
19	601988	中国银行	205,754.00	0.04
20	000651	格力电器	2,819,336.65	0.58

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。

8.4.3 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	1,039,883,212.50
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	399,961,833.95
--------------	----------------

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	02997	新城发展 权证	1,524.00	—	—

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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、国债期货相关金融衍生工具对基金投

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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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）。“招商银行”为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“建设银行”的发行主体中国建设银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：（1）占压财政存款或者资金；（2）违反账户管理规定的违法违规事实，中国人民银行于 2021 年 8 月 13 日对公司做出警告，并处罚款 388 万元的行政处罚（银罚字（2021）22 号）。为本基金跟踪标的指数的成份股。“建设银行”为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“美团-W”的发行主体美团

(Meituan)，由于自 2018 年以来，滥用其在中国境内网络餐饮外卖平台服务市场的支配地位，阻碍平台内经营者在其他竞争性平台开展经营，排除、限制了相关市场竞争，损害了平台内经营者的合法权益和消费者利益，妨碍了平台经济创新发展，且不具有正当理由，国家市场监督管理总局于 2021 年 10 月 8 日对公司做出责令停止违法行为并罚款 3,442,439,866 元的行政处罚(国市监处罚(2021)74 号)。“美团-W”为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“腾讯控股”的发行主体腾讯控股有限公司(以下简称“公司”)，由于未依法申报违法实施的经营集中，国家市场监督管理总局多次对公司作出罚款 50 万元的行政处罚。“腾讯控股”为本基金跟踪标的指数的成份股。

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 6 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	33,593.55
2	应收证券清算款	71,604.98
3	应收股利	32,677.18
4	应收利息	2,001.82
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	139,877.53

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601318	中国平安	504,100.00	0.10	转融通流通受限

8.12.5.2 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	688211	中科微至	152,482.16	0.03	新股限售
2	301050	雷电微力	54,694.42	0.01	新股限售
3	301029	怡合达	41,519.94	0.01	新股限售
4	301155	海力风电	36,861.75	0.01	新股限售

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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		富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
8,873	62,842.57	160,518,790.00	28.79	397,083,335.00	71.21	101,448,300.00	18.19

9.2 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	都邦财产保险股份有限公司—自有资金	20,000,000.00	3.59
2	BARCLAYS BANK PLC	18,647,419.00	3.34
3	于炳歧	10,000,000.00	1.79
4	张剑	5,000,000.00	0.90
5	北京中洲禾源投资咨询有限公司	4,000,000.00	0.72
6	申万宏源证券有限公司	3,871,500.00	0.69
7	中信建投证券股份有限公司	3,543,773.00	0.64
8	徐亚英	3,500,000.00	0.63
9	薛宏飞	3,500,000.00	0.63
10	陈琪	3,000,000.00	0.54
11	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	101,448,300.00	18.19

9.3 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	—	—

9.4 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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年02月09日)基金份额总额	787,102,125.00
基金合同生效日2021年2月9日起至报告期期末基金总申购份额	103,500,000.00
减：基金合同生效日2021年2月9日起至报告期期末基金总赎回份额	333,000,000.00
基金合同生效日2021年2月9日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	557,602,125.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期本基金管理人无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 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。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为 6 万元人民币, 其已提供审计服务的连续年限为 19 年。

11.6 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。

11.7 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	3	42,157,421.02	2.95	—	—	—	—	—	—	38,417.88	4.58	—
东方证券	2	9,391,974.07	0.66	—	—	—	—	—	—	8,558.57	1.02	—
广发证券	2	109,055,741.22	7.63	—	—	—	—	—	—	90,595.80	10.79	—
国盛证券	2	62,254,255.69	4.36	102,538.76	9.22	—	—	—	—	56,733.08	6.76	—
海通证券	2	558,522,654.30	39.10	151,251.80	13.59	—	—	971.64	100.00	307,352.66	36.61	—
华泰证券	2	5,669,506.45	0.40	—	—	—	—	—	—	5,166.52	0.62	—
华西证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申港证券	2	122,882,923.44	8.60	—	—	—	—	—	—	471.98	0.06	—
申万宏源	2	35,110,736.80	2.46	454,415.85	40.84	—	—	—	—	31,996.39	3.81	—
太平洋证券	2	22,345,400.06	1.56	—	—	—	—	—	—	20,363.73	2.43	—
新时代证券	2	520,926.13	0.04	—	—	—	—	—	—	474.72	0.06	—
银河证券	2	94,115,617.23	6.59	—	—	—	—	—	—	85,768.08	10.21	—
浙商证券	3	178,962,785.95	12.53	—	—	—	—	—	—	22,768.02	2.71	—
中金公司	2	84,815,066.43	5.94	—	—	—	—	—	—	77,290.72	9.21	—
中信建投	2	1,146,803.30	0.08	396,616.93	35.65	—	—	—	—	1,045.14	0.12	—

中信证券	2	101,648,472.29	7.12	7,735.12	0.70	-	-	-	-	92,632.84	11.03	-
------	---	----------------	------	----------	------	---	---	---	---	-----------	-------	---

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。本基金合同生效日为 2021 年 2 月 9 日，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	规定披露媒介	2021 年 02 月 10 日
2	关于富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金投资关联方证券的公告	规定披露媒介	2021 年 02 月 19 日
3	富国基金管理有限公司关于富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金投资关联方证券的公告	规定披露媒介	2021 年 02 月 24 日
4	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	规定披露媒介	2021 年 02 月 25 日
5	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金开放申购、赎回业务公告	规定披露媒介	2021 年 02 月 25 日
6	富国基金管理有限公司关于富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	规定披露媒介	2021 年 02 月 25 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 13 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 03 月 17 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 03 月 24 日
10	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同及托管协议的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 30 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 04 月 14 日
12	富国基金管理有限公司关于旗下基金	规定披露媒介	2021 年 04 月 20 日

	投资关联方承销期内承销证券的公告		
13	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
14	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
15	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07月02日
16	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08月31日
17	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09月09日
18	富国基金管理有限公司关于富国中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	规定披露媒介	2021年10月13日
19	关于富国中证沪港深500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	2021年11月12日
20	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所上市股票及相关风险提示的公告	规定披露媒介	2021年11月26日
21	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金2021年末及2022年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	规定披露媒介	2021年12月28日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，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》、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》、《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31日起，对旗下部分基金的基金合同及托管协议的相应条款进行修订，增加《指数基金指引》规定的相关内容并在本基金投资范围中增加存托凭证。具体可参见基金管理人于2021年3月30日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金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。

二、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2021年11月15日起将本基金的基金扩位简称由“500ETF 沪港深”变更为“沪深港500ETF”。具体可参见基金管理人于2021年11月12日发布的《关于富国中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金扩位简称变更的公告》。

三、本报告期内，根据有关法律法规规定和基金合同的约定，本基金可在符合基金合同约定的投资目标、投资策略、投资范围、资产配置比例和风险收益特征的前提下参与北交所上市股票的投资，但本基金并非必然投资于北交所上市股票。具体可参见基金管理人于2021年11月26日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所上市股票及相关风险提示的公告》及基金合同和招募说明书。

§ 13 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沪港深500交易型开放	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基

<p>式指数证券投资基金的文件</p> <p>2、富国中证沪港深 500 交易 型开放式指数证券投资基金 基金合同</p> <p>3、富国中证沪港深 500 交易 型开放式指数证券投资基金 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、富国中证沪港深 500 交易 型开放式指数证券投资基金 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>楼二座 27-30 层</p>	<p>金管理有限公司。咨询电话： 95105686、4008880688（全国 统一，免长途话费）公司网址： http://www.fullgoal.com.c n。</p>
---	--------------------	--