

富国优质企业混合型证券投资基金

二〇二一年中期报告

2021年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2021年08月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)起至 2021 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
§4	管理人报告.....	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.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6	中期财务报表(未经审计).....	14
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	16
6.4	报表附注.....	17
§7	投资组合报告.....	43
7.1	期末基金资产组合情况.....	43
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12	投资组合报告附注	49
§8	基金份额持有人信息	50
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	51
§9	开放式基金份额变动	51
§10	重大事件揭示	51
10.1	基金份额持有人大会决议	51
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4	基金投资策略的改变	52
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8	其他重大事件	55
§11	影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
§12	备查文件目录	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国优质企业混合型证券投资基金	
基金简称	富国优质企业混合	
基金主代码	011046	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年03月18日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额(单位:份)	1,571,485,977.30	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国优质企业混合 A	富国优质企业混合 C
下属分级基金的交易代码	011046	011047
报告期末下属分级基金的份额总额(单位:份)	1,491,493,968.19	79,992,009.11

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过精选个股和风险控制,力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置,根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。在股票投资方面,本基金致力于挑选出优质企业股票进行投资,在有效控制风险前提下,争取实现基金资产的长期稳健增值。从具体操作上,本基金主要采取“自下而上”的选股策略。通过定量筛选和定性分析,挑选出成长性良好且估值合理的优质企业股票进行投资;在债券投资方面,本基金将采用久期控制下的主动性投资策略;本基金的存托凭证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略和资产支持证券投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*60%+恒生中国企业指数收益率(使用估值汇率折算)*20%+中债综合全价指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。本基金投资港股通标的股票的,需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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人 姓名	赵瑛	张燕

	联系电话	021-20361818	0755-83199084
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95555
传真		021-20361616	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		裴长江	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道7088号招商银行大厦

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国优质企业混合 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年3月18日(基金合同生效日)至2021年6月30日
本期已实现收益	6,704,323.21
本期利润	26,358,612.67
加权平均基金份额本期利润	0.0168
本期加权平均净值利润率	1.68%

本期基金份额净值增长率	1.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年06月30日)
期末可供分配利润	6,843,503.18
期末可供分配基金份额利润	0.0046
期末基金资产净值	1,516,682,871.06
期末基金份额净值	1.0169
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	1.69%

(2) 富国优质企业混合 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年3月18日(基金合同生效日)至2021年6月30日
本期已实现收益	114,307.51
本期利润	1,408,519.88
加权平均基金份额本期利润	0.0146
本期加权平均净值利润率	1.46%
本期基金份额净值增长率	1.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年06月30日)
期末可供分配利润	228,518.50
期末可供分配基金份额利润	0.0029
期末基金资产净值	81,203,421.81
期末基金份额净值	1.0151
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	1.51%

注：本基金于2021年3月18日成立，自合同生效日起至本报告期末不足半年。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

(1) 富国优质企业混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.35%	0.81%	-0.91%	0.57%	0.56%	0.24%
过去三个月	1.65%	0.63%	2.04%	0.65%	-0.39%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.69%	0.58%	1.16%	0.72%	0.53%	-0.14%

(2) 富国优质企业混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.40%	0.81%	-0.91%	0.57%	0.51%	0.24%
过去三个月	1.49%	0.63%	2.04%	0.65%	-0.55%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.51%	0.58%	1.16%	0.72%	0.35%	-0.14%

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

(1) 自基金合同生效以来富国优质企业混合 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2021年6月30日。

2、本基金于 2021 年 3 月 18 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 3 月 18 日起至 2021 年 9 月 17 日，本期末建仓期还未结束。

(2) 自基金合同生效以来富国优质企业混合 C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2021 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2021 年 3 月 18 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 3 月 18 日起至 2021 年 9 月 17 日，本期末建仓期还未结束。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、

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

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金等 212 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
易智泉	本基金基金经理	2021-03-18	—	14.9	学士，曾任易方达基金管理有限公司研究员，建信基金管理有限公司研究组长，中信证券股份有限公司资产管理部高级副总裁、投资主办人，天弘基金管理有限公司资深投资经理；自 2017 年 8 月加入富国基金管理有限公司，现任富国基金权益投资部高级权益基金经理。自 2017 年 10 月至 2019 年 8 月任富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金基金经理；自 2018 年 8 月起任富国臻选成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2019 年 2 月起任富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金（原富国天源平衡混合型证券投资基金，于 2015 年 10 月 27 日更名）基金经理；自 2020 年 8 月起任富国兴泉回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；自 2020 年 9 月起任富国稳进回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；自 2021 年 3 月起任富国优质企业混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确

定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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优质企业混合型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国优质企业混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现1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

有网购服装经历的人大都体验过，卖家秀往往很漂亮，而买家秀可能逊色很多。从基金行业经验来看，权益类基金的净值增长率不等于同期基金客户的平均收益率，因为权益类基金净值存在较大的波动率，牛市猛涨，熊市跌得也不少，而申购基金的高潮往往发生在基金净值快速上涨以后，真正在低位买入基金的往往是少数人，大多数人都存在追热门的冲动，都希望自己能最快地赚钱，赚最多的钱。然而往往正是这种对热门基金的持续申购行为，导致大量资金在某些板块和个股的持续加码，或者说资金堆叠抱团，后续资金推高了重仓股的股价，从而推高某些基金的净值，部分基金过于漂亮的收益率数据往往源于此。一旦市场风格转变，热点瓦解，后续资金则成了前期资金的接盘侠。这时，再去计算规模膨胀后的客户整体收益率，用基金年报和中报里的“基金净资产收益率”或“本期利润”来观察，在近一年净值增长率为正的情况下，本期利润却可能是负值。可以看到，一些基金从几亿、几十亿的规模迅速膨胀到几百亿规模，把这种效应演绎得非常充分。

回顾来看，这一现象的本质原因是大量的资金在向少量股票索取过高而不合理的收益，最终造成结果却是少数人赚大部分人的钱，基金客户之间产生大规模的财富转移。

要避免上述问题，有两种解决思路。从基金客户的角度来看，实际收益=基金净值曲线×下注方式，两者均为矢量。所以一种方法是强制规定客户的行为：设定较长的持有期，如3年或5年，能够大幅提高客户盈利的概率，业内已有不少产品已采用这种方法。

我们的思考有所不同，矢量2不是独立变量，会受到矢量1的影响。换言之，对于开放式基金而言，客户的下注方式会受到净值曲线的影响。传统权益基金的买家秀与卖家秀之间的偏离，是由基金净值的波动和客户的申赎行为共同造就的，而申赎行为非常显著地受到基金涨跌的影响。如果能够减小基金净值的波动幅度、缩短回撤的时间长度，就能够影响客户行为和最终的投资结果：即使客户并非买在最低点，也可以在不太长的时间段内实现正收益。理论上，如果净值曲线为一条斜率为正的直线（或单调递增曲线），则无论客户何时申购、何时赎回，都会有正收益（或不导致浮亏）。正如鱼肉鲜美，而鱼刺是危险之物，我们要做的是去掉净值曲线上的鱼刺，给客户提供安全的鱼肉，消除净值曲线上的山峰，就是为客户消除风险。曲线上的山峰往往是由股价泡沫造成，因此我们认为，投资中最重要的原则就是不追捧泡沫。

无论是前期的推涨，还是今年的杀跌，趋势资金的力量都令人敬畏。在今年消费和医药调整期间，涌入市场的资金规模仍源源不断、前所未见，也因此，出现了新的热门板块，在这些板块，仍然延续着资金申购热门基金——基金加仓——股价上涨——基金净值上涨的效应。

无论市场风向如何变化，我们关注的都是那些内在价值显著低于股价的优质公司，远离肉眼可见的泡沫。今年以来，全球主要大国都提出了碳排放控制目标，并出台了实质性的产业政策，叠加疫情导致的产业卡顿，极大地改变了全球产业版图。全球史无前例的货币主义泛滥，大量热钱如洪水般涌入电动车、新能源、医药和半导体产业，股价节节高升，市场中洋溢着对相关公司的乐观预期。我们谨慎地与市场共识保持距离，并认为前方并非一片坦途，而竞争格局恶化的风险

明显提升。在本基金的投资运作中，我们看到上游产业长期缺乏资本投入，并受到各种政策或技术限制，而下游产业则得到了大量金融资本的催肥，上下游产业间的供需形势形成逆转，上游获得了强大的议价权，相关公司内在价值产生了飞跃式的提升，因此成为我们增加配置的方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值 A 级为 1.0169 元，C 级为 1.0151 元；份额累计净值 A 级为 1.0169 元，C 级为 1.0151 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为 1.69%，C 级为 1.51%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 1.16%，C 级为 1.16%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球主要经济体仍处于流动性极度泛滥的环境下，国内多个领域的政策表现出越来越强烈的取向性，并且正发生一些重要的变化，造成股票市场极度分化的局面，接近于撕裂。在很多领域，市场的定价与股票的内在价值出现了显著的偏离，我们不确定这些偏离可能会持续多久，我们在确信会发生向上修复的领域积极布局，等待时间的奖励。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国优质企业混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	本期末 (2021年06月30日)
资产：	
银行存款	168,681,347.69
结算备付金	5,381,359.65
存出保证金	279,801.06
交易性金融资产	1,468,500,212.30
其中：股票投资	1,131,983,345.70
基金投资	—
债券投资	336,516,866.60
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	—
应收利息	5,319,070.39
应收股利	9,320.64
应收申购款	561,547.15
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	1,648,732,658.88
负债和所有者权益	本期末

	(2021年06月30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	27,333,425.61
应付赎回款	19,232,604.36
应付管理人报酬	2,020,664.80
应付托管费	336,777.47
应付销售服务费	42,952.34
应付交易费用	1,768,954.19
应交税费	538.19
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	110,449.05
负债合计	50,846,366.01
所有者权益:	
实收基金	1,571,485,977.30
未分配利润	26,400,315.57
所有者权益合计	1,597,886,292.87
负债和所有者权益总计	1,648,732,658.88

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0168 元，基金份额总额 1,571,485,977.30 份。其中：富国优质企业混合 A 份额净值 1.0169 元，份额总额 1,491,493,968.19 份；富国优质企业混合 C 份额净值 1.0151 元，份额总额 79,992,009.11 份。本基金合同生效日 2021 年 03 月 18 日。

6.2 利润表

会计主体：富国优质企业混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 03 月 18 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
一、收入	39,363,813.54
1. 利息收入	2,211,670.81
其中：存款利息收入	853,815.36
债券利息收入	1,139,554.64

资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	218,300.81
证券出借利息收入	—
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	15,886,875.00
其中：股票投资收益	1,718,813.12
基金投资收益	—
债券投资收益	3,287,582.66
资产支持证券投资收益	—
贵金属投资收益	—
衍生工具投资收益	—
股利收益	10,880,479.22
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	20,948,501.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	316,765.90
减：二、费用	11,596,680.99
1. 管理人报酬	7,120,024.65
2. 托管费	1,186,670.79
3. 销售服务费	165,398.63
4. 交易费用	3,048,030.05
5. 利息支出	—
其中：卖出回购金融资产支出	—
6. 税金及附加	202.69
7. 其他费用	76,354.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	27,767,132.55
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	27,767,132.55

注：本基金合同生效日为2021年3月18日，无上年度同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国优质企业混合型证券投资基金

本报告期：2021年03月18日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期2021年3月18日(基金合同生效日)至2021年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,680,631,192.88	—	1,680,631,192.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	27,767,132.55	27,767,132.55

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）	-109,145,215.58	-1,366,816.98	-110,512,032.56
其中：1. 基金申购款	12,505,177.58	143,889.58	12,649,067.16
2. 基金赎回款	-121,650,393.16	-1,510,706.56	-123,161,099.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	1,571,485,977.30	26,400,315.57	1,597,886,292.87

注：本基金合同生效日为2021年3月18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

富国优质企业混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2020〕3307号《关于准予富国优质企业混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为管理人于2021年3月3日至2021年3月16日向社会公开募集，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_B14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3月18日生效。本基金为契约型开放式，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1,680,004,565.36元，折合基金份额1,680,004,565.36份，其中A类基金份额1,578,700,877.92份，C类基金份额101,303,687.44份。募集资金在募集期间产生利息为人民币626,627.52元，折合基金份额626,627.52份，其中A类基金份额604,839.14份，C类基金份额21,788.38份。以上收到的实收基金（本息）共计人民币1,680,631,192.88元，折合基金份额1,680,631,192.88份，其中A类基金份额1,579,305,717.06份，C类基金份额101,325,475.82份。

本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他

金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%（其中，本基金投资于港股通标的股票及存托凭证的比例占股票资产的 0%-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果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，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*60%+恒生中国企业指数收益率（使用估值汇率折算）*20%+中债综合全价指数收益率*20%

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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。

6.4.4.1 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 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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；

本基金目前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（主要系权证投资）；

(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。

6.4.4.4 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

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

卖出股票于交易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交易日结转；

(2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易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；

卖出债券于交易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

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

卖出权证于交易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交易日结转；

(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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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份额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。

6.4.4.8 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)”。

6.4.4.9 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) 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；

(9) 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；

(10) 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；

(11) 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；

(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) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红；若基金合同生效不满 3 个月，本基金可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别每一基金份额享有同等分配权，由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

5、法律法规或监管机关另有规定的，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性不利影响的前提下，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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

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，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4 企业所得税

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

5 个人所得税

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

6 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）
活期存款	168,681,347.69
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	168,681,347.69

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03月18日。无上年度同期对比数据。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,116,656,415.88	1,131,983,345.70	15,326,929.82	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	
债券	交易所市场	57,757,414.59	63,182,866.60	5,425,452.01
	银行间市场	273,137,880.00	273,334,000.00	196,120.00
	合计	330,895,294.59	336,516,866.60	5,621,572.01
资产支持证券	—	—	—	
基金	—	—	—	
其他	—	—	—	
合计	1,447,551,710.47	1,468,500,212.30	20,948,501.83	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）
应收活期存款利息	18,405.82
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	4,985.07
应收债券利息	5,295,525.20
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	154.30
合计	5,319,070.39

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）
交易所市场应付交易费用	1,766,779.19
银行间市场应付交易费用	2,175.00
合计	1,768,954.19

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	45,017.00
应付证券出借违约金	—
预提信息披露费	40,000.00
预提审计费	25,432.05
合计	110,449.05

6.4.7.9 实收基金

富国优质企业混合 A：

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额

基金合同生效日 2021 年 3 月 18 日	1,579,305,717.06	1,579,305,717.06
本期申购	9,730,639.34	9,730,639.34
本期赎回（以“-”号填列）	-97,542,388.21	-97,542,388.21
本期末	1,491,493,968.19	1,491,493,968.19

富国优质企业混合 C:

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日 2021 年 3 月 18 日	101,325,475.82	101,325,475.82
本期申购	2,774,538.24	2,774,538.24
本期赎回（以“-”号填列）	-24,108,004.95	-24,108,004.95
本期末	79,992,009.11	79,992,009.11

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）本基金合同于 2021 年 3 月 18 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 1,680,004,565.36 元（其中 A 类 1,578,700,877.92 元，C 类 101,303,687.44 元），在募集期间产生的存款利息为人民币 626,627.52 元（其中 A 类 604,839.14 元，C 类 21,788.38 元），以上实收基金（本息）合计为人民币 1,680,631,192.88 元，折合 1,680,631,192.88 份基金份额（其中 A 类 1,579,305,717.06 份基金份额，C 类 101,325,475.82 份基金份额）。

6.4.7.10 未分配利润

富国优质企业混合 A:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日 2021 年 3 月 18 日	—	—	—
本期利润	6,704,323.21	19,654,289.46	26,358,612.67
本期基金份额交易产生的变动数	139,179.97	-1,308,889.77	-1,169,709.80
其中：基金申购款	-30,765.66	144,393.08	113,627.42
基金赎回款	169,945.63	-1,453,282.85	-1,283,337.22
本期已分配利润	—	—	—
本期末	6,843,503.18	18,345,399.69	25,188,902.87

富国优质企业混合 C:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日 2021 年 3 月 18 日	—	—	—
本期利润	114,307.51	1,294,212.37	1,408,519.88
本期基金份额交易产生的变动数	114,210.99	-311,318.17	-197,107.18
其中：基金申购款	-13,224.20	43,486.36	30,262.16
基金赎回款	127,435.19	-354,804.53	-227,369.34
本期已分配利润	—	—	—
本期末	228,518.50	982,894.20	1,211,412.70

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	803,148.14
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	49,077.72
其他	1,589.50
合计	853,815.36

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	584,686,571.65
减：卖出股票成本总额	582,967,758.53
买卖股票差价收入	1,718,813.12

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	69,205,789.21
减：卖出债券(、债转股及债券到期	64,888,021.18

兑付) 成本总额	
减: 应收利息总额	1,030,185.37
买卖债券差价收入	3,287,582.66

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注: 本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注: 本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注: 本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注: 本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	10,880,479.22
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	10,880,479.22

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	20,948,501.83
股票投资	15,326,929.82
债券投资	5,621,572.01
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	20,948,501.83
----	---------------

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	287,323.70
转换费收入	29,442.20
合计	316,765.90

注：本基金合同生效日为 2021 年 03 月 18 日。无上年度同期对比数据。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	3,045,855.05
银行间市场交易费用	2,175.00
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	3,048,030.05

注：本基金合同生效日为 2021 年 03 月 18 日。无上年度同期对比数据。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	25,432.05
信息披露费	40,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	10,522.13
其他	400.00
合计	76,354.18

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
申万宏源	585,479,491.78	25.64

注：本基金合同生效日为 2021 年 03 月 18 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为 2021 年 03 月 18 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
申万宏源	8,336,900.00	6.66

注：本基金合同生效日为 2021 年 03 月 18 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.4 回购交易

注：本基金本报告期末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03月18日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2021年3月18日(基金合同生效日)至2021年6月30日			
	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
申万宏源	514,544.96	26.68	477,914.76	27.05

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03月18日。无上年度同期对比数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2021年3月18日(基金合同生效日)至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,120,024.65
其中：支付销售机构的客户维护费	3,367,713.25

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5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、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

本基金合同生效日为2021年03月18日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 18 日 (基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,186,670.79

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

本基金合同生效日为 2021 年 03 月 18 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A 级	C 级	合计
富国基金管理有限公司	—	6,346.13	6,346.13
海通证券股份有限公司	—	2,239.23	2,239.23
申万宏源西部证券	—	271.83	271.83
申万宏源证券有限公司	—	423.01	423.01
招商银行股份有限公司	—	16,486.58	16,486.58
合计	—	25,766.78	25,766.78

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性按照指定路径支付。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

本基金合同生效日为 2021 年 03 月 18 日，无上年度同期对比数据。

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：本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。本基金合同生效日为2021年03月18日，无上年度同期对比数据。

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03月18日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。本基金合同生效日为2021年03月18日，无上年末对比数据。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期2021年3月18日(基金合同生效日)至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	168,681,347.69	803,148.14

注：本基金合同生效日为2021年03月18日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。本基金合同生效日为2021年03月18日。无上年度同期对比数据。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金无其他关联方交易事项。本基金合同生效日为2021年03月18日，无上年度同期对比数据。

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（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	—
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股限售	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	—
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	—
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	—
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	—
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股限售	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	—
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	—
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	—
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股限售	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	—
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	—
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	—
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股认购	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股认购	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	—
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股认购	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	—
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股认购	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	—

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	认购新发 证券	100.00	100.00	4,650	465,000.00	465,000.00	
113626	伯特转债	2021-06-29	2021-07-21	认购新发 证券	100.00	100.00	1,970	197,000.00	197,000.00	
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	认购新发 证券	100.00	100.00	429	42,900.00	42,900.00	

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的信用债。本基金合同生效日为 2021 年 03 月 18 日。无上年度同期对比数据。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2021 年 06 月 30 日）
--------	-----------------------

AAA	41,214,679.10
AAA 以下	21,968,187.50
未评级	—
合计	63,182,866.60

注：本基金合同生效日为 2021 年 03 月 18 日。无上年度同期对比数据。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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。本基金合同生效日为 2021 年 03 月 18 日。无上年度同期对比数据。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有同业存单。本基金合同生效日为 2021 年 03 月 18 日。无上年度同期对比数据。

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。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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

单位：人民币元

本期末（2021年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	168,681,347.69	—	—	—	—	—	168,681,347.69
结算备付金	5,381,359.65	—	—	—	—	—	5,381,359.65
存出保证金	279,801.06	—	—	—	—	—	279,801.06
交易性金融资产	—	6,728,747.80	56,454,118.80	273,334,000.00	—	1,131,983,345.70	1,468,500,212.30
应收利息	—	—	—	—	—	5,319,070.39	5,319,070.39
应收股利	—	—	—	—	—	9,320.64	9,320.64
应收申购款	—	—	—	—	—	561,547.15	561,547.15
资产总计	174,342,508.40	6,728,747.80	56,454,118.80	273,334,000.00	—	1,137,873,283.88	1,648,732,658.88
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	27,333,425.61	27,333,425.61
应付赎回款	—	—	—	—	—	19,232,604.36	19,232,604.36
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,020,664.80	2,020,664.80
应付托管费	—	—	—	—	—	336,777.47	336,777.47
应付销售服务费	—	—	—	—	—	42,952.34	42,952.34
应付交易费用	—	—	—	—	—	1,768,954.19	1,768,954.19
应付税费	—	—	—	—	—	538.19	538.19
其他负债	—	—	—	—	—	110,449.05	110,449.05
负债总计	—	—	—	—	—	50,846,366.01	50,846,366.01
利率敏感度缺口	174,342,508.40	6,728,747.80	56,454,118.80	273,334,000.00	—	1,087,026,917.87	1,597,886,292.87

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。本基金合同生效日为2021年03月18日，无上年度同期对比数据。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动； 2. 利率变动范围合理。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）
		本期末（2021年06月30日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-602,121.00
	2. 基准点利率减少0.1%	602,121.00

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30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	—	256,064,282.00	—	—	256,064,282.00
应收股利	—	9,320.64	—	—	9,320.64
资产合计	—	256,073,602.64	—	—	256,073,602.64
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	—	256,073,602.64	—	—	256,073,602.64

6.4.13.4.2.2 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：元）
		本期末（2021年06月30日）
	港币相对人民币贬值 1%	-2,560,736.03
	港币相对人民币升值 1%	2,560,736.03

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

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

基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%（其中，本基金投资于港股通标的股票及存托凭证的比例占股票资产的 0%-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,131,983,345.70	70.84
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	336,516,866.60	21.06
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	1,468,500,212.30	91.90

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）
分析		本期末（2021年06月30日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	6,540,604.13
	2. 业绩比较基准减少 1%	-6,540,604.13

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币1,194,229,581.86元，属于第二层次的余额为人民币274,167,073.56元，属于第三层次余额为人民币103,556.88元。

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

本期变动人民币103,556.88元，本期末人民币103,556.88元。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,131,983,345.70	68.66
	其中：股票	1,131,983,345.70	68.66
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	336,516,866.60	20.41
	其中：债券	336,516,866.60	20.41
	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	174,062,707.34	10.56
8	其他各项资产	6,169,739.24	0.37
9	合计	1,648,732,658.88	100.00

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 221,457,512.00 元，占资产净值比例为 13.86%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 34,606,770.00 元，占资产净值比例为 2.17%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	171,003,141.90	10.70
C	制造业	503,228,097.76	31.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	125,255,902.08	7.84
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	49,173.00	0.00
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	30,477.64	0.00
J	金融业	40,992,054.30	2.57
K	房地产业	9,551,184.00	0.60
L	租赁和商务服务业	8,289,028.00	0.52
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	13,285.02	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	17,506,720.00	1.10
S	综合	—	—
	合计	875,919,063.70	54.82

7.2.2 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（%）
医疗保健	32,612,530.00	2.04
原材料	1,994,240.00	0.12
能源	31,400,600.00	1.97
信息技术	61,420,320.00	3.84
日常消费品	83,667,480.00	5.24
通信服务	30,322,032.00	1.90
公用事业	14,647,080.00	0.92
合计	256,064,282.00	16.03

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沪港通深港通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601225	陕西煤业	11,021,814	130,608,495.90	8.17
2	002158	汉钟精机	3,492,671	93,778,216.35	5.87
3	00168	青岛啤酒股份	904,000	62,882,240.00	3.94
4	00981	中芯国际	3,088,000	61,420,320.00	3.84
5	600025	华能水电	10,393,411	60,177,849.69	3.77
6	300059	东方财富	1,249,080	40,957,333.20	2.56
7	002738	中矿资源	866,100	38,454,840.00	2.41
8	600236	桂冠电力	5,812,700	36,096,867.00	2.26
9	600519	贵州茅台	15,700	32,290,190.00	2.02

10	01898	中煤能源	8,156,000	31,400,600.00	1.97
11	00700	腾讯控股	62,400	30,322,032.00	1.90
12	603185	上机数控	165,400	29,598,330.00	1.85
13	600872	中炬高新	698,155	29,336,473.10	1.84
14	600031	三一重工	942,200	27,389,754.00	1.71
15	002675	东诚药业	1,282,440	27,021,010.80	1.69
16	002110	三钢闽光	3,877,150	26,131,991.00	1.64
17	300014	亿纬锂能	240,800	25,026,344.00	1.57
18	601699	潞安环能	2,101,900	24,823,439.00	1.55
19	600782	新钢股份	4,412,300	24,620,634.00	1.54
20	601636	旗滨集团	1,304,124	24,204,541.44	1.51
21	06855	亚盛医药— B	587,000	22,957,570.00	1.44
22	02319	蒙牛乳业	532,000	20,785,240.00	1.30
23	601139	深圳燃气	3,124,800	20,498,688.00	1.28
24	300413	芒果超媒	255,200	17,506,720.00	1.10
25	002810	山东赫达	335,932	15,842,553.12	0.99
26	300357	我武生物	246,500	15,805,580.00	0.99
27	000932	华菱钢铁	2,386,500	15,750,900.00	0.99
28	600711	盛屯矿业	2,183,900	15,571,207.00	0.97
29	300119	瑞普生物	433,948	14,676,121.36	0.92
30	00916	龙源电力	1,316,000	14,647,080.00	0.92
31	688198	佰仁医疗	53,069	12,099,732.00	0.76
32	300529	健帆生物	126,000	10,881,360.00	0.68
33	688056	莱伯泰科	150,440	10,320,184.00	0.65
34	300724	捷佳伟创	88,800	10,301,688.00	0.64
35	09995	荣昌生物— B	98,000	9,654,960.00	0.60
36	000656	金科股份	1,649,600	9,551,184.00	0.60
37	600674	川投能源	686,900	8,469,477.00	0.53
38	603300	华铁应急	731,600	8,289,028.00	0.52
39	605089	味知香	84,370	7,341,877.40	0.46
40	601678	滨化股份	649,300	5,135,963.00	0.32
41	603501	韦尔股份	11,000	3,542,000.00	0.22
42	603596	伯特利	89,100	3,185,325.00	0.20
43	00336	华宝国际	128,000	1,994,240.00	0.12
44	603528	多伦科技	22,600	193,230.00	0.01
45	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.01
46	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
47	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
48	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00

49	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
50	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
51	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
52	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
53	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
54	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
55	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
56	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
57	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
58	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
59	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
60	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
61	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
62	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
63	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
64	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
65	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	601225	陕西煤业	129,917,337.60	8.13
2	002158	汉钟精机	86,559,736.16	5.42
3	300059	东方财富	76,133,820.58	4.76
4	00981	中芯国际	65,095,928.89	4.07
5	00168	青岛啤酒	63,854,773.84	4.00
6	600025	华能水电	58,195,982.32	3.64
7	000932	华菱钢铁	50,363,683.42	3.15
8	600872	中炬高新	50,363,279.00	3.15
9	00700	腾讯控股	48,734,640.77	3.05
10	600900	长江电力	38,204,520.00	2.39
11	600711	盛屯矿业	34,872,644.00	2.18
12	601636	旗滨集团	34,042,221.81	2.13
13	600519	贵州茅台	33,804,202.00	2.12
14	600031	三一重工	33,669,319.00	2.11
15	300413	芒果超媒	33,637,466.94	2.11
16	002352	顺丰控股	33,634,294.00	2.10
17	000012	南玻 A	33,178,598.92	2.08
18	300119	瑞普生物	32,719,137.40	2.05
19	01378	中国宏桥	32,139,721.39	2.01

20	01898	中煤能源	31,975,261.75	2.00
21	600236	桂冠电力	31,973,054.00	2.00

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	300059	东方财富	43,101,909.55	2.70
2	688314	康拓医疗	36,967,764.56	2.31
3	000012	南玻 A	36,894,443.03	2.31
4	600900	长江电力	36,072,833.00	2.26
5	002352	顺丰控股	34,886,693.18	2.18
6	000932	华菱钢铁	29,720,529.25	1.86
7	01378	中国宏桥	29,385,046.48	1.84
8	000933	神火股份	23,310,969.64	1.46
9	600674	川投能源	22,620,823.00	1.42
10	002044	美年健康	22,381,223.00	1.40
11	300119	瑞普生物	21,398,737.80	1.34
12	601636	旗滨集团	19,131,775.00	1.20
13	300413	芒果超媒	17,961,930.04	1.12
14	600711	盛屯矿业	16,640,744.28	1.04
15	000651	格力电器	16,467,547.00	1.03
16	603799	华友钴业	16,288,136.00	1.02
17	002202	金风科技	16,244,993.00	1.02
18	00700	腾讯控股	16,055,730.05	1.00
19	688680	海优新材	15,626,850.10	0.98
20	600219	南山铝业	15,306,143.55	0.96

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	1,699,624,174.41
卖出股票收入（成交）总额	584,686,571.65

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	273,334,000.00	17.11
	其中：政策性金融债	273,334,000.00	17.11
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）	63,182,866.60	3.95
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	336,516,866.60	21.06

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	180413	18 农发 13	1,000,000	101,290,000.00	6.34
2	190305	19 进出 05	500,000	50,340,000.00	3.15
3	110061	川投转债	311,090	40,749,679.10	2.55
4	170201	17 国开 01	300,000	30,609,000.00	1.92
5	170309	17 进出 09	300,000	30,465,000.00	1.91

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，降低投资组合的整体风险。

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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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	279,801.06
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	9,320.64
4	应收利息	5,319,070.39
5	应收申购款	561,547.15
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—

8	其他	—
9	合计	6,169,739.24

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110061	川投转债	40,749,679.10	2.55
2	110074	精达转债	6,728,747.80	0.42

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.6 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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
富国优质企业混合 A	19,916	74,889.23	1,136,799.19	0.08	1,490,357,169.00	99.92
富国优质企业混合 C	13,014	6,146.61	400,000.00	0.50	79,592,009.11	99.50
合计	32,930	47,722.02	1,536,799.19	0.10	1,569,949,178.11	99.90

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	富国优质企业混合 A	585,977.39	0.0393
	富国优质企业混合 C	10,010.00	0.0125
	合计	595,987.39	0.0379

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基 金	富国优质企业混合 A	10~50
	富国优质企业混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基 金	富国优质企业混合 A	0
	富国优质企业混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国优质企业混合 A	富国优质企业混合 C
基金合同生效日(2021年03月18日)基金 份额总额	1,579,305,717.06	101,325,475.82
基金合同生效日2021年3月18日起至报告 期末基金总申购份额	9,730,639.34	2,774,538.24
减：基金合同生效日2021年3月18日起至 报告期期末基金总赎回份额	97,542,388.21	24,108,004.95
基金合同生效日2021年3月18日起至报告 期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	1,491,493,968.19	79,992,009.11

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
东方证券	2	61,052,656.73	2.67	6,039,245.90	4.83	—	—	—	—	55,637.46	2.89	—
国金证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国泰君安	1	138,189,560.91	6.05	—	—	16,800,000.00	3.22	—	—	125,931.03	6.53	—
恒泰证券	2	8,953,351.00	0.39	—	—	—	—	—	—	8,158.35	0.42	—
华泰证券	2	250,309,239.23	10.96	42,085,506.40	33.64	—	—	—	—	228,105.69	11.83	—
申万宏源	1	585,479,491.78	25.64	8,336,900.00	6.66	—	—	—	—	514,544.96	26.68	—
信达证券	2	16,718,978.00	0.73	—	—	—	—	—	—	15,236.17	0.79	—
野村证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	2	267,573,646.18	11.72	30,865,216.47	24.67	336,800,000.00	64.56	—	—	243,840.25	12.64	—
浙商证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中金财富	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中金公司	1	106,225,598.53	4.65	—	—	—	—	—	—	96,803.23	5.02	—
中信建投	1	287,819,114.56	12.61	12,095,447.80	9.67	168,100,000.00	32.22	—	—	262,288.61	13.60	—

中信山东	1	12,303,902.30	0.54	680,209.20	0.54	—	—	—	—	11,212.86	0.58	—
中信证券	2	548,689,122.92	24.03	24,987,637.20	19.98	—	—	—	—	366,713.54	19.02	—
中银证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

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3月18日，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

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	富国优质企业混合型证券投资基金基金合同生效公告	规定披露媒介	2021年03月19日
2	富国优质企业混合型证券投资基金开放申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2021年05月21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

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 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优质企业混合型证券投资基金的文件 2、富国优质企业混合型证券投资基金基金合同 3、富国优质企业混合型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、富国优质企业混合型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）公司网址： http://www.fullgoal.com.cn 。