

富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）

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 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5	信息披露方式	6
2.6	其他相关资料	6
§3	主要财务指标、基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理	8
4.2	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	11
4.3	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	12
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6	中期财务报表(未经审计)	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	15
6.3	所有者权益(基金净值)变动表	15
6.4	报表附注	17
§7	投资组合报告	38
7.1	期末基金资产组合情况	38
7.2	期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布	38
7.3	期末按行业分类的权益投资组合	38
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细	39
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动	47
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	53
7.7	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	53

7.8	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	.53
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	.53
7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	.....53
7.11	投资组合报告附注	.....53
§8	基金份额持有人信息	.....54
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	.....54
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	.....54
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	.....54
§9	开放式基金份额变动	.....55
§10	重大事件揭示	.....55
10.1	基金份额持有人大会决议	.....55
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	.....55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	.....55
10.4	基金投资策略的改变	.....55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	.....55
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	.....55
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	.....56
10.8	其他重大事件	.....62
§11	影响投资者决策的其他重要信息	.....63
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	.....63
§12	备查文件目录	.....63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）
基金简称	富国蓝筹精选股票（QDII）
基金主代码	007455
交易代码	007455
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年08月02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）	1,214,331,726.82
基金合同存续期	不定期

注：本基金含人民币份额（份额代码：007455）及美元现汇份额（份额代码：010583），交易代码仅列示人民币份额代码。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于以 MSCI 中国指数为代表的中国相关蓝筹股，通过精选个股和严格风险控制，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金投资于全球市场，包括境内和境外市场。本基金通过宏观策略研究，对股票、债券、货币市场工具等的预期收益进行动态跟踪，从而决定全球资产配置比例。本基金主要投资于以 MSCI 中国指数为代表的中国相关蓝筹股，上市地点包括美国、香港、台湾、新加坡、欧洲和日本等国家或地区，通过自下而上的积极策略，精选个股。本基金的存托凭证投资策略、债券投资策略、基金投资策略、衍生品投资策略、汇率避险投资策略、中小企业私募债券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	MSCI 中国指数收益率*90%+人民币活期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金，债券型基金和货币市场基金。本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金可通过港股通机制投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
	中文	-	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		-	-
办公地址		-	-
邮政编码		-	-

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 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

## 2.6 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年01月01日至2021年06月30日)
本期已实现收益	119,932,226.53
本期利润	140,099,171.06
加权平均基金份额本期利润	0.1180
本期加权平均净值利润率	4.78%
本期基金份额净值增长率	11.28%
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	939,997,709.97
期末可供分配基金份额利润	0.7741
期末基金资产净值	3,104,642,140.42
期末基金份额净值	2.5567
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	155.67%

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.69%	0.89%	-0.31%	0.86%	4.00%	0.03%
过去三个月	8.09%	0.96%	1.41%	0.97%	6.68%	-0.01%
过去六个月	11.28%	1.67%	1.11%	1.34%	10.17%	0.33%
过去一年	42.65%	1.64%	23.01%	1.30%	19.64%	0.34%
自基金合同生效起至今	155.67%	1.60%	38.30%	1.32%	117.37%	0.28%

注：本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国指数收益率\*90%+人民币活期存款利率（税后）\*10%。

MSCI 中国指数是按照自由流通市值调整方法编制的跟踪全球成熟市场和新兴市

场中“中国概念”为主的全球性投资指数，是适合作为全球市场投资业绩比较基准的指数。

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

$$\text{benchmark}_t = [\text{MSCI 中国指数收益}_t / (\text{MSCI 中国指数收益}_{t-1} - 1)] * 90\% + [\text{人民币活期存款利率(税后)}] * 10\%;$$

其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$ 表示时间截至日；

期间 $T$ 日收益率（benchmark<sub>T</sub>）按下列公式计算：

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

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

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



注：1、截止日期为2021年6月30日。

2、本基金于2019年8月2日成立，建仓期6个月，从2019年8月2日起至2020年2月1日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于1999年4月13日获国家工商行政管理局登记注册



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

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宁君	本基金基金经理	2019-08-21	—	9.9	硕士，自 2011 年 8 月加入富国基金管理有限公司，历任助理研究员、研究员、基金经理助理、QDII 投资经理、QDII 基金经理、海外权益投资部海外权益投资总监助理；现任富国基金海外权益投资部海外权益投资副总监兼高级 QDII 基金经理。自 2018 年 9 月起任富国沪港深业绩驱动混合型证券投资基金基金经理，2019 年 8 月起任富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）基金经理，2020 年 1 月起任富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）（原富国全球顶级消费品股票型证券投资基金，于 2015 年 8 月 4 日更名为富国全球顶级消费品混合型证券投资基金；最终于 2018 年 6 月 19 日更名为富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII））基金经理，2020 年 12 月起任富国全球健康生活主题混合型证券投资

					资基金（QDII）基金经理。具有基金从业资格。
张峰	本基金基金经理	2019-08-02	—	19.7	<p>硕士，曾任摩根士丹利股票研究助理，里昂证券分析员，摩根大通执行董事，美林证券执行董事；自2009年7月加入富国基金管理有限公司，历任周期行业负责人、QDII基金经理、量化与海外投资部海外投资副总监、量化与海外投资部海外投资总监；现任富国基金总经理助理，兼任富国基金海外权益投资部总经理、资深QDII基金经理。2011年4月至2012年12月任富国全球债券证券投资基金基金经理，自2011年7月至2018年12月任富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）（原富国全球顶级消费品股票型证券投资基金，于2015年8月4日更名为富国全球顶级消费品混合型证券投资基金；最终于2018年6月19日更名为富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII））基金经理，自2012年9月起任富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金（原富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金，于2015年8月4日更名）基金经理，自2015年6月至2018年7月任富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年5月至2020年6月任富国港股通量化精选股票型证券投资基金基金经理，2018年7月至2019年11月任富国沪港深业绩驱动混合型证券投资基金基金经理，2019年3月至2020年6月任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年5月起任富国民裕进取沪港深成长精选混合型证券投资基金基金经理，2019年6月起任富国全球科技互联网股票型证券投资基金</p>

					(QDII) (原富国全球顶级消费品股票型证券投资基金, 于 2015 年 8 月 4 日更名为富国全球顶级消费品混合型证券投资基金; 最终于 2018 年 6 月 19 日更名为富国全球科技互联网股票型证券投资基金(QDII)) 基金经理, 2019 年 8 月起任富国蓝筹精选股票型证券投资基金(QDII) 基金经理, 2020 年 12 月起任富国全球健康生活主题混合型证券投资基金(QDII) 基金经理, 2021 年 3 月起任富国沪港深业绩驱动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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注: 本基金无境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期, 富国基金管理有限公司作为富国蓝筹精选股票型证券投资基金(QDII) 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》、《富国蓝筹精选股票型证券投资基金(QDII) 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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

#### **4.4.2 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。

### **4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

#### **4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

上半年的市场相当具有挑战。主要是经过19年和20年两年的牛市后，很多优质股票已经被市场充分挖掘，市场相对乐观的预期也存在调整的可能。年初市场情绪高涨情况下的资金流入也为我们的组合管理带来了挑战。

我们的策略依然是买入持有有性价比的优质成长股。虽然短期会有净值波动和调整，但长期依然追求稳健的回报。

#### **4.5.2 报告期内基金的业绩表现**

截至2021年6月30日，本基金份额净值为2.5567元；份额累计净值为2.5567元；本报告期，本基金份额净值增长率为11.28%，同期业绩比较基准收益率为1.11%

### **4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

我认为下半年的市场会明显波动性加大，同时也会非常活跃。市场经过2季度的上涨之后，很多股票的估值达到了目前能看到的极限，但股价所反应的很多对行业前景的看法也是正确的。大概率市场会在波动中分化。流动性总量的宽松，特别是国内的相对宽松，居民对权益市场的认知提升，也预示着市场即使下跌也和过去的熊市有所不同，相当长时间都会保持活跃。

我们还是会坚持原有的策略，希望能在市场波动中把握建仓机会、控制风险，为基金持有人赚取优质企业成长的价值。

### **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

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

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遵规守信、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：富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	本期末 (2021年06月30日)	上年度末 (2020年12月31日)
资产：		
银行存款	245,210,986.47	178,715,531.40
结算备付金	1,010,528.62	362,354.17
存出保证金	186,432.76	77,840.02

交易性金融资产	2,893,738,408.57	1,376,834,007.26
其中：股票投资	2,893,738,408.57	1,376,834,007.26
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	31,284,315.18	—
应收利息	6,931.28	7,218.18
应收股利	4,899,647.40	218,279.54
应收申购款	5,579,236.26	8,603,441.86
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	3,181,916,486.54	1,564,818,672.43
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>(2021年06月30日)</b>	<b>(2020年12月31日)</b>
<b>负 债：</b>		
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	28,797,613.37	78,723,653.41
应付赎回款	42,173,212.74	8,481,806.25
应付管理人报酬	4,537,541.16	1,837,288.38
应付托管费	882,299.67	357,250.52
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	652,864.39	322,073.91
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	230,814.79	169,053.66
负债合计	77,274,346.12	89,891,126.13
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,214,331,726.82	641,938,422.39
未分配利润	1,890,310,413.60	832,989,123.91
所有者权益合计	3,104,642,140.42	1,474,927,546.30
负债和所有者权益总计	3,181,916,486.54	1,564,818,672.43

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.5567 元，基金份额总额 1,214,331,726.82 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2021年01月01日至 2021年06月30日)	上年度可比期间 (2020年01月01日至 2020年06月30日)
<b>一、收入</b>	184,299,256.82	119,105,768.51
1. 利息收入	336,163.51	80,862.93
其中：存款利息收入	336,163.51	80,862.93
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	164,859,165.05	56,971,974.49
其中：股票投资收益	148,459,676.73	55,854,686.79
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	—
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	16,399,488.32	1,117,287.70
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	20,166,944.53	61,513,806.92
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-4,619,589.55	-362,918.73
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	3,556,573.28	902,042.90
<b>减：二、费用</b>	44,200,085.76	4,275,863.93
1. 管理人报酬	26,275,751.32	2,341,173.03
2. 托管费	5,109,173.87	455,228.08
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	12,592,279.21	1,376,514.34
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 税金及附加	—	—
7. 其他费用	222,881.36	102,948.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	140,099,171.06	114,829,904.58
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	140,099,171.06	114,829,904.58

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2021年01月01日至2021年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	641,938,422.39	832,989,123.91	1,474,927,546.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	140,099,171.06	140,099,171.06
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)	572,393,304.43	917,222,118.63	1,489,615,423.06
其中：1.基金申购款	982,483,881.76	1,520,680,657.78	2,503,164,539.54
2.基金赎回款	-410,090,577.33	-603,458,539.15	-1,013,549,116.48
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)	1,214,331,726.82	1,890,310,413.60	3,104,642,140.42
项目	上年度可比期间 (2020年01月01日至2020年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	147,652,344.43	25,962,599.03	173,614,943.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	114,829,904.58	114,829,904.58
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)	100,563,704.73	55,875,449.96	156,439,154.69
其中：1.基金申购款	275,028,307.80	122,980,719.19	398,009,026.99
2.基金赎回款	-174,464,603.07	-67,105,269.23	-241,569,872.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	248,216,049.16	196,667,953.57	444,884,002.73

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

富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）（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[2018]2078号文《关于准予富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）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2019年6月13日至2019年7月30日止期间向社会公开募集，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（2019）验字第60467606\_B18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2019年8月2日正式生效。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247,643,302.81元，在募集期间产生的存款利息人民币42,523.20元，以上实收基金（本息）合计为人民币247,685,826.01元，折合247,685,826.01份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

根据基金管理人于2020年11月6日发布的《关于富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）增加美元基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》，自2020年11月6日起，本基金增加美元基金份额。本基金根据申购、赎回所使用货币的不同，将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行申购、赎回的份额类别，称为人民币份额；以美元计价并进行申购、赎回的份额类别，称为美元份额。

本基金投资于境内境外市场。

针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含交易型开放式指数基金ETF）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品。

针对境内投资，本基金可投资于国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生产品（股指期货、国债期货、权证）；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）。

本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。

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80%-95%，其中投资于本基金界定的中国相关蓝筹股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除全部需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金投资于全球市场，包括境内市场和境外市场，其中主要境外市场有：美国、香港、台湾、新加坡、欧洲和日本等国家或地区。香港市场可通过合格境内机构投资者境外投资额度和港股通机制进行投资。如果法律法规对上述比例要求有变更的，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。

本基金的业绩基准为：MSCI 中国指数收益率\*90%+人民币活期存款利率（税后）\*10%。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“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，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行《企业会计准则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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《中期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和中期报告》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

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

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

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

#### **6.4.5 会计差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **6.4.6 税项**

##### **1 印花税**

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

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

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

## 2 增值税

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

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

## 3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

## 4 企业所得税

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

## 5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有

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

## 6 境外投资

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）
活期存款	245,210,986.47
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	245,210,986.47

注：

币种	2021年6月30日		
	外币金额	折算汇率	折合人民币
港币	75,437,221.70	0.8321	62,769,803.44
美元	23,335,987.51	6.4601	150,752,812.91
合计			213,522,616.35

#### 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	2,667,445,820.02	2,893,738,408.57	226,292,588.55
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	2,667,445,820.02	2,893,738,408.57	226,292,588.55

#### 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	6,392.68
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	454.70
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	—
其他	83.90
合计	6,931.28

#### 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	652,864.39
银行间市场应付交易费用	—
合计	652,864.39

#### 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	106,102.61
应付证券出借违约金	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	64,712.18
合计	230,814.79

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	641,938,422.39	641,938,422.39
本期申购	982,483,881.76	982,483,881.76
本期赎回（以“-”号填列）	-410,090,577.33	-410,090,577.33
本期末	1,214,331,726.82	1,214,331,726.82

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	424,995,425.57	407,993,698.34	832,989,123.91
本期利润	119,932,226.53	20,166,944.53	140,099,171.06
本期基金份额交易产生的变动数	395,070,057.87	522,152,060.76	917,222,118.63
其中：基金申购款	702,104,141.11	818,576,516.67	1,520,680,657.78
基金赎回款	-307,034,083.24	-296,424,455.91	-603,458,539.15
本期已分配利润	—	—	—
本期末	939,997,709.97	950,312,703.63	1,890,310,413.60

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
活期存款利息收入	275,842.98
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	6,735.05
其他	53,585.48
合计	336,163.51

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
卖出股票成交总额	4,351,301,444.91
减：卖出股票成本总额	4,202,841,768.18
买卖股票差价收入	148,459,676.73

#### 6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

##### 6.4.7.14.2 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。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 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。

##### 6.4.7.16.2 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。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
----	-----------------------------

股票投资产生的股利收益	16,399,488.32
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	16,399,488.32

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
1. 交易性金融资产	20,166,944.53
股票投资	20,166,944.53
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	20,166,944.53

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
基金赎回费收入	3,556,573.28
合计	3,556,573.28

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
交易所市场交易费用	12,592,279.21
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	12,592,279.21

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
审计费用	34,712.18
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—



银行费用	24,272.57
其他	103,896.61
合计	222,881.36

#### 6.4.7.22 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作。

#### 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
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
香港上海汇丰银行有限公司	基金境外托管行
海通国际证券有限公司（“海通香港”）	基金管理人的股东控制的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2021年01月01日至2021年06月30日)		上年度可比期间(2020年01月01日至2020年06月30日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
申万宏源	300,728,301.89	2.99	32,603,234.22	3.27
HAITONG INTERNATIONAL	2,799,147,409.16	27.85	—	—

##### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

### 6.4.10.1.4 回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

### 6.4.10.1.5 基金交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。本基金合同生效日为2019年08月02日，无上年度同期对比数据。

### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	274,054.33	5.47	216,492.99	33.16
HAITONG INTERNATIONAL	1,399,573.80	27.95	0.00	0.00
关联方名称	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年06月30日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	29,711.46	4.90	12,364.19	29.09

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

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	26,275,751.32	2,341,173.03
其中：支付销售机构的客户维护费	4,588,239.15	518,231.35

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至 2021年06月30日)	上年度可比期间(2020年01月 01日至2020年06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	5,109,173.87	455,228.08

注：基金的托管费包含基金托管人的托管费和境外托管人的托管费两部分。

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.35% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，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、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）		上年度可比期间（2020年01月01日至2020年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
香港上海汇丰银行有限公司	210,394,278.66	1,251.86	21,161,978.27	3,015.49
招商银行股份有限公司	34,816,707.81	274,591.12	47,359,880.19	62,211.94

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2021年01月01日至2021年06月30日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	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

#### 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

本基金本报告期无其他关联方交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（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	—
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	—
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	—
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	—
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	—
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	—
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	—
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	—
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	—
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	—
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股认购	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	—
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股认购	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	—
688323	瑞华泰	2021-04-21	2021-10-28	新股限售	5.97	22.78	4,513	26,942.61	102,806.14	—
688565	力源科技	2021-05-06	2021-11-15	新股限售	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	—
2190 HK	归创通桥	2021-06-28	2021-07-05	认购新发 证券	42.70	35.53	1,000	35,528.54	35,529.82	—
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	—

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。表中2190 HK的认购价格为港币计价，估值单价、期末成本总额及期末估值总额均为人民币计价，计算方式为按照期末汇率0.83208折算。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金净值的10%，持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品时，要求所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级，并且任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。

### 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合同及法规规定。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、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，并按照合同约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	245,210,986.47	—	—	—	—	—	245,210,986.47
结算备付金	1,010,528.62	—	—	—	—	—	1,010,528.62
存出保证金	186,432.76	—	—	—	—	—	186,432.76
交易性金融资产	—	—	—	—	—	2,893,738,408.57	2,893,738,408.57
应收证券清算款	—	—	—	—	—	31,284,315.18	31,284,315.18
应收利息	—	—	—	—	—	6,931.28	6,931.28
应收股利	—	—	—	—	—	4,899,647.40	4,899,647.40
应收申购款	318,515.19	—	—	—	—	5,260,721.07	5,579,236.26
资产总计	246,726,463.04	—	—	—	—	2,935,190,023.50	3,181,916,486.54
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	28,797,613.37	28,797,613.37
应付赎回款	—	—	—	—	—	42,173,212.74	42,173,212.74
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	4,537,541.16	4,537,541.16
应付托管费	—	—	—	—	—	882,299.67	882,299.67
应付交易费用	—	—	—	—	—	652,864.39	652,864.39
其他负债	—	—	—	—	—	230,814.79	230,814.79
负债总计	—	—	—	—	—	77,274,346.12	77,274,346.12
利率敏感度缺口	246,726,463.04	—	—	—	—	2,857,915,677.38	3,104,642,140.42
上年度末（2020年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计



资产							
银行存款	178,715,531.40	—	—	—	—	—	178,715,531.40
结算备付金	362,354.17	—	—	—	—	—	362,354.17
存出保证金	77,840.02	—	—	—	—	—	77,840.02
交易性金融资产	—	—	—	—	—	1,376,834,007.26	1,376,834,007.26
应收利息	—	—	—	—	—	7,218.18	7,218.18
应收股利	—	—	—	—	—	218,279.54	218,279.54
应收申购款	368,545.99	—	—	—	—	8,234,895.87	8,603,441.86
资产总计	179,524,271.58	—	—	—	—	1,385,294,400.85	1,564,818,672.43
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	78,723,653.41	78,723,653.41
应付赎回款	—	—	—	—	—	8,481,806.25	8,481,806.25
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,837,288.38	1,837,288.38
应付托管费	—	—	—	—	—	357,250.52	357,250.52
应付交易费用	—	—	—	—	—	322,073.91	322,073.91
其他负债	—	—	—	—	—	169,053.66	169,053.66
负债总计	—	—	—	—	—	89,891,126.13	89,891,126.13
利率敏感度缺口	179,524,271.58	—	—	—	—	1,295,403,274.72	1,474,927,546.30

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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					
银行存款	150,752,812.91	62,769,803.44	—	—	213,522,616.35
交易性金融资产	425,155,807.49	2,050,903,079.46	—	—	2,476,058,886.95
应收股利	92,120.51	4,807,526.89	—	—	4,899,647.40
应收证券清算款	—	31,284,315.18	—	—	31,284,315.18
应收利息	8.40	—	—	—	8.40
应收申购款	501,701.25	—	—	—	501,701.25
资产合计	576,502,450.56	2,149,764,724.97	—	—	2,726,267,175.53
以外币计价的负债					
应付证券清算款	12,039,318.27	—	—	—	12,039,318.27
应付赎回款	98,731.13	—	—	—	98,731.13
其他负债	19.83	—	—	—	19.83
负债合计	12,138,069.23	—	—	—	12,138,069.23
资产负债表外汇风险敞口净额	564,364,381.33	2,149,764,724.97	—	—	2,714,129,106.30
项目	上年度末（2020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					
银行存款	26,166,154.24	65,723,683.28	—	—	91,889,837.52
交易性金融资产	234,304,260.91	878,004,561.16	—	—	1,112,308,822.07
应收股利	2,279.54	—	—	—	2,279.54
资产合计	260,472,694.69	943,728,244.44	—	—	1,204,200,939.13
以外币计价的负债					
应付证券清算款	12,971,430.73	53,336,845.74	—	—	66,308,276.47

负债合计	12,971,430.73	53,336,845.74	—	—	66,308,276.47
资产负债表外汇风险敞口净额	247,501,263.96	890,391,398.70	—	—	1,137,892,662.66

#### 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)	上年度末(2020年12月31日)
	港币相对人民币贬值 1%	-21,497,647.25	-8,903,913.99
	港币相对人民币升值 1%	21,497,647.25	8,903,913.99
	美元相对人民币贬值 1%	-5,643,643.81	-2,475,012.64
	美元相对人民币升值 1%	5,643,643.81	2,475,012.64

#### 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。本基金主要投资于在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的股票，在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含 ETF）、债券、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。本基金为股票型基金，股票投资占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金界定的中国相关蓝筹股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除全部需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资于境内境外市场。针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含交易型开放式指数基金 ETF）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球

存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品。针对境内投资，本基金可投资于国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生产品（股指期货、国债期货、权证）；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）。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。

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 80%-95%，其中投资于本基金界定的中国相关蓝筹股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除全部需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于全球市场，包括境内市场和境外市场，其中主要境外市场有：美国、香港、台湾、新加坡、欧洲和日本等国家或地区。香港市场可通过合格境内机构投资者境外投资额度和港股通机制进行投资。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2021 年 06 月 30 日）		上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	2,893,738,408.57	93.21	1,376,834,007.26	93.35
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	2,893,738,408.57	93.21	1,376,834,007.26	93.35

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2021年06月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	33,950,474.15	14,958,698.87
2. 业绩比较基准减少 1%	-33,950,474.15	-14,958,698.87	

#### 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2,893,318,656.13元，属于第二层次的余额为人民币146,299.54元，属于第三层次余额为人民币273,452.90元。

###### 6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

###### 6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

上年度末余额人民币0.00元，本期变动人民币273,452.90元，本期末人民币273,452.90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	2,893,738,408.57	90.94
	其中：普通股	2,581,526,066.11	81.13
	存托凭证	312,212,342.46	9.81
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	246,221,515.09	7.74
8	其他各项资产	41,956,562.88	1.32
9	合计	3,181,916,486.54	100.00

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	2,050,903,079.46	66.06
中国大陆	417,679,521.62	13.45
美国	425,155,807.49	13.69
合计	2,893,738,408.57	93.21

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
医疗保健	543,716,767.59	17.51
日常消费品	513,582,318.03	16.54

通信服务	506,839,825.42	16.33
非日常生活消费品	329,203,255.42	10.60
房地产	294,412,486.65	9.48
工业	293,261,341.36	9.45
信息技术	288,485,751.06	9.29
原材料	64,954,005.19	2.09
金融	32,490,326.61	1.05
公用事业	26,792,331.24	0.86
合计	2,893,738,408.57	93.21

#### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

##### 7.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在证券 市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允 价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700	香港联合交 易所	中国香港	408000	198,261,365.76	6.39
2	China Overseas Property Holdings Limited	中海物业	2669	香港联合交 易所	中国香港	25385000	175,315,511.64	5.65
3	Hygeia Healthcare Holdings Co., Limited	海吉亚医疗	6078	香港联合交 易所	中国香港	1728400	146,693,041.34	4.72
4	Tsingtao Brewery Company Limited	青岛啤酒股份	168	香港联合交 易所	中国香港	2082000	144,827,850.82	4.66
5	China Mobile Limited	中国移动	941	香港联合交 易所	中国香港	3274500	132,281,561.36	4.26
6	Sea Ltd	SEA	SE	美国证券交 易所	美国	60057	106,537,722.38	3.43
7	Pharmaron Beijing Co., Ltd.	康龙化成	3759	香港联合交 易所	中国香港	605500	104,291,659.08	3.36
8	China Resources Beer (Holdings)	华润啤酒	291	香港联合交 易所	中国香港	1792000	104,003,343.36	3.35

	Company Limited							
9	Zhou Hei Ya International Holdings Company Limited	周黑鸭	1458	香港联合交易所	中国香港	12782500	99,021,742.81	3.19
10	Li Auto Inc.	理想汽车 (LI AUTO)	LI	美国证券交易所	美国	320000	72,229,086.08	2.33
11	CARSGEN THERAPEUTICS HOLDING	CARSGEN THERAPEUTICS HOLDING	2171	香港联合交易所	中国香港	2607500	66,065,799.87	2.13
12	Contemporary Amperex Technology Co., Limited	宁德时代	300750	深圳证券交易所	中国大陆	123500	66,047,800.00	2.13
13	Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd.	中车时代电气	3898	香港联合交易所	中国香港	1692600	64,644,578.11	2.08
14	ACM Research, Inc.	ACM RESEARCH	ACMR	美国证券交易所	美国	96954	64,023,711.77	2.06
15	Ganfeng Lithium Co., Ltd.	赣锋锂业	1772	香港联合交易所	中国香港	652200	62,951,178.82	2.03
16	Kweichow Moutai Co., Ltd.	贵州茅台	600519	上海证券交易所	中国大陆	29356	60,376,485.20	1.94
17	MORIMATSU INTERNATIONAL HOLD	MORIMATSU INTERNATIONAL HOLD	2155	香港联合交易所	中国香港	8713000	58,506,798.23	1.88
18	Sunac Services Holdings Limited	融创服务	1516	香港联合交易所	中国香港	2406000	57,757,252.25	1.86
19	Luxshare Precision Industry Co., Ltd.	立讯精密	002475	深圳证券交易所	中国大陆	1229914	56,576,044.00	1.82
20	Shanghai Fudan Microelectronics Group	上海复旦	1385	香港联合交易所	中国香港	3400000	54,714,252.48	1.76



	CO., LTD.							
21	Remegen Co., Ltd.	荣昌生物-B	9995	香港联合交易所	中国香港	491000	48,372,471.55	1.56
22	Li Ning Co. Ltd.	李宁	2331	香港联合交易所	中国香港	600000	47,328,710.40	1.52
23	EC Healthcare	医思健康	2138	香港联合交易所	中国香港	4017000	46,727,665.73	1.51
24	Zhongsheng Group Holdings Ltd	中升控股	881	香港联合交易所	中国香港	841500	45,232,617.67	1.46
25	China Resources Land Limited	华润置地	1109	香港联合交易所	中国香港	1668000	43,649,751.89	1.41
26	Riyue Heavy Industry Co, Ltd	日月股份	603218	上海证券交易所	中国大陆	1499317	40,601,504.36	1.31
27	Vipshop Holdings Ltd	唯品会	VIPS	美国证券交易所	美国	311841	40,451,642.81	1.30
28	Yalla Group Ltd	YALLA	YALA	美国证券交易所	美国	303401	39,180,415.99	1.26
29	Tesla, Inc.	特斯拉	TSLA	美国证券交易所	美国	8000	35,127,439.76	1.13
30	Toly Bread Co., Ltd.	桃李面包	603866	上海证券交易所	中国大陆	1072124	33,450,268.80	1.08
31	Futu Holdings Ltd	富途控股	FUTU	美国证券交易所	美国	28083	32,490,326.61	1.05
32	ANGELALIGN TECHNOLOGY INC	ANGELALIGN TECHNOLOGY INC	6699	香港联合交易所	中国香港	93800	31,266,471.06	1.01
33	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	蒙牛乳业	2319	香港联合交易所	中国香港	791000	30,901,329.40	1.00
34	XinYi Glass Holdings Limited	信义玻璃	868	香港联合交易所	中国香港	1154000	30,390,973.13	0.98
35	Longi Green Energy Technology Co., Ltd.	隆基股份	601012	上海证券交易所	中国大陆	338857	30,104,055.88	0.97
36	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock	洋河股份	002304	深圳证券交易所	中国大陆	144200	29,878,240.00	0.96

	Co., Ltd.							
37	Sincere Pharmaceutical Group Limited	先声药业	2096	香港联合交易所	中国香港	2431000	28,278,554.99	0.91
38	Joincare Pharmaceutical Group Industry Co., Ltd.	健康元	600380	上海证券交易所	中国大陆	1990000	27,322,700.00	0.88
39	Haier Smart Home Co., Ltd.	海尔智家	6690	香港联合交易所	中国香港	1169400	26,369,230.94	0.85
40	S-Enjoy Service Group Co., Limited	新城悦服务	1755	香港联合交易所	中国香港	1281000	25,155,109.73	0.81
41	Changzhou Almaden Co., Ltd.	亚玛顿	002623	深圳证券交易所	中国大陆	589600	24,934,184.00	0.80
42	Raytron Technology Co., Ltd	睿创微纳	688002	上海证券交易所	中国大陆	241224	24,081,391.92	0.78
43	Innovent Biologics, Inc.	信达生物	1801	香港联合交易所	中国香港	303000	22,829,487.73	0.74
44	The Hong Kong and China Gas Co. Ltd.	香港中华煤气	3	香港联合交易所	中国香港	2233600	22,413,918.69	0.72
45	Joy Inc.	欢聚	YY	美国证券交易所	美国	50000	21,308,639.85	0.69
46	CSPC Pharmaceutical Group Limited	石药集团	1093	香港联合交易所	中国香港	1914000	17,900,836.59	0.58
47	Chinasoft International Ltd.	中国软件国际	354	香港联合交易所	中国香港	1500000	17,673,379.20	0.57
48	China Resources Mixc Lifestyle Services Limited	华润万象生活	1209	香港联合交易所	中国香港	386400	17,088,560.09	0.55

49	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO., LTD.	福斯特	603806	上海证券交 易所	中国大陆	150000	15,769,500.00	0.51
50	SJM Holdings Limited	澳博控股	880	香港联合交 易所	中国香港	2093000	14,768,288.37	0.48
51	Staar Surgical Co	STAAR SURGICAL	STAA	美国证券交 易所	美国	14000	13,792,313.50	0.44
52	Alphamab Oncology	康宁杰瑞制药-B	9966	香港联合交 易所	中国香港	642000	13,274,754.70	0.43
53	Yihai Internationa l Holding Ltd.	颐海国际	1579	香港联合交 易所	中国香港	255000	11,065,207.86	0.36
54	Cathay Media And Education Group Inc.	华夏视听教育	1981	香港联合交 易所	中国香港	1883000	8,460,755.86	0.27
55	WuXi Apptec Co.,Ltd.	药明康德	2359	香港联合交 易所	中国香港	39980	6,031,227.04	0.19
56	Aidigong Maternal & Child Health Limited	爱帝宫	286	香港联合交 易所	中国香港	5492000	5,529,437.87	0.18
57	Shanghai Kindly Medical Instruments Co., Ltd.	康德莱医械	1501	香港联合交 易所	中国香港	137200	4,360,964.56	0.14
58	Xinyi Energy Holdings Limited	信义能源	3868	香港联合交 易所	中国香港	1078000	4,153,027.77	0.13
59	Hefei Meyer Optoelectron ic Technology Inc.	美亚光电	002690	深圳证券交 易所	中国大陆	72000	4,014,720.00	0.13
60	Ascentage Pharma Group Internationa l	亚盛医药-B	6855	香港联合交 易所	中国香港	60000	2,346,465.60	0.08
61	Joinn Laboratories (China) Co.,Ltd.	昭衍新药	6127	香港联合交 易所	中国香港	18620	1,936,666.20	0.06

62	Binjiang Service Group Co. Ltd.	滨江服务	3316	香港联合交易所	中国香港	61000	1,707,969.01	0.06
63	皓元医药	皓元医药	688131	上海证券交易所	中国大陆	3855	1,334,562.45	0.04
64	Changsha Broad Homes Industrial Group Co., Ltd.	远大住工	2163	香港联合交易所	中国香港	92100	1,252,208.84	0.04
65	Tiangong International Company Limited	天工国际	826	香港联合交易所	中国香港	448000	1,233,874.79	0.04
66	Yidu Tech Inc.	医渡科技	2158	香港联合交易所	中国香港	26100	886,065.35	0.03
67	Xd Inc.	心动公司	2400	香港联合交易所	中国香港	14200	809,364.22	0.03
68	Pop Mart International Group Limited	泡泡玛特	9992	香港联合交易所	中国香港	9800	627,887.57	0.02
69	Yincheng Life Service Co., Ltd.	银城生活服务	1922	香港联合交易所	中国香港	142000	601,410.78	0.02
70	新益昌	新益昌	688383	上海证券交易所	中国大陆	2701	380,868.01	0.01
71	诺泰生物	诺泰生物	688076	上海证券交易所	中国大陆	4984	339,958.64	0.01
72	New Oriental Education & Technology Group Inc.	新东方-S	9901	香港联合交易所	中国香港	6200	330,169.34	0.01
73	凯立新材	凯立新材	688269	上海证券交易所	中国大陆	1941	270,808.32	0.01
74	奥精医疗	奥精医疗	688613	上海证券交易所	中国大陆	2617	237,597.43	0.01
75	Zai Lab Limited	再鼎医药-SB	9688	香港联合交易所	中国香港	200	226,991.42	0.01
76	力芯微	力芯微	688601	上海证券交易所	中国大陆	1174	216,133.40	0.01
77	Ak Medical Holdings	爱康医疗	1789	香港联合交易所	中国香港	18000	205,190.93	0.01

	Limited							
78	百川畅银	百川畅银	300614	深圳证券交易所	中国大陆	3283	176,700.30	0.01
79	博力威	博力威	688345	上海证券交易所	中国大陆	2332	171,518.60	0.01
80	东威科技	东威科技	688700	上海证券交易所	中国大陆	3049	162,755.62	0.01
81	志特新材	志特新材	300986	深圳证券交易所	中国大陆	2632	103,429.84	0.00
82	瑞华泰	瑞华泰	688323	上海证券交易所	中国大陆	4513	102,806.14	0.00
83	嘉益股份	嘉益股份	301004	深圳证券交易所	中国大陆	3115	90,654.98	0.00
84	睿昂基因	睿昂基因	688217	上海证券交易所	中国大陆	1040	86,736.00	0.00
85	致远新能	致远新能	300985	深圳证券交易所	中国大陆	2945	83,877.45	0.00
86	三孚新科	三孚新科	688359	上海证券交易所	中国大陆	2213	78,561.50	0.00
87	迈信林	迈信林	688685	上海证券交易所	中国大陆	2612	67,781.40	0.00
88	申菱环境	申菱环境	301018	深圳证券交易所	中国大陆	7811	64,753.19	0.00
89	奇德新材	奇德新材	300995	深圳证券交易所	中国大陆	1909	57,368.52	0.00
90	航宇科技	航宇科技	688239	上海证券交易所	中国大陆	4926	56,550.48	0.00
91	泰福泵业	泰福泵业	300992	深圳证券交易所	中国大陆	1998	55,828.42	0.00
92	英科再生	英科再生	688087	上海证券交易所	中国大陆	2469	54,219.24	0.00
93	晶雪节能	晶雪节能	301010	深圳证券交易所	中国大陆	2172	50,480.96	0.00
94	煜邦电力	煜邦电力	688597	上海证券交易所	中国大陆	3907	49,306.34	0.00
95	正弦电气	正弦电气	688395	上海证券交易所	中国大陆	1627	44,465.91	0.00
96	China Feihe Limited	中国飞鹤	6186	香港联合交易所	中国香港	3000	41,836.98	0.00
97	Times Neighborhood Holdings Limited	时代邻里	9928	香港联合交易所	中国香港	7385	40,925.11	0.00

98	工大高科	工大高科	688367	上海证券交易所	中国大陆	1717	37,035.69	0.00
99	ZYLOX-TONBRIDGE MEDICAL TECH	ZYLOX-TONBRIDGE MEDICAL TECH	2190	香港联合交易所	中国香港	1000	35,529.82	0.00
100	九丰能源	九丰能源	605090	上海证券交易所	中国大陆	1090	35,326.90	0.00
101	力源科技	力源科技	688565	上海证券交易所	中国大陆	2464	34,496.00	0.00
102	Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Company Limited	同仁堂国药	3613	香港联合交易所	中国香港	3000	32,001.80	0.00
103	Beijing Chunlizhengda Medical Instruments Co., Ltd.	春立医疗	1858	香港联合交易所	中国香港	750	16,256.76	0.00
104	佳禾食品	佳禾食品	605300	上海证券交易所	中国大陆	576	16,012.80	0.00
105	ZTO Express (Cayman) Inc.	中通快递	ZTO	美国证券交易所	美国	74	14,508.74	0.00
106	Microport Cardioflow Medtech Corporation	心通医疗-B	2160	香港联合交易所	中国香港	1000	13,596.19	0.00
107	税友股份	税友股份	603171	上海证券交易所	中国大陆	637	12,230.40	0.00
108	福莱新材	福莱新材	605488	上海证券交易所	中国大陆	416	11,103.04	0.00
109	绿田机械	绿田机械	605259	上海证券交易所	中国大陆	295	10,516.75	0.00
110	中金辐照	中金辐照	300962	深圳证券交易所	中国大陆	576	9,429.12	0.00
111	深水海纳	深水海纳	300961	深圳证券交易所	中国大陆	394	8,695.58	0.00
112	通业科技	通业科技	300960	深圳证券交易所	中国大陆	234	5,396.04	0.00
113	杭州热电	杭州热电	605011	上海证券交易所	中国大陆	525	4,662.00	0.00

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holdings Ltd	700 HK	221,118,076.80	14.99
2	Vipshop Holdings Ltd	VIPS US	192,854,377.91	13.08
3	China Mobile Limited	941 HK	182,691,560.48	12.39
4	Pinduoduo Inc.	PDD US	157,028,101.00	10.65
5	CanSino Biologics Inc.	6185 HK	143,662,064.81	9.74
6	China Overseas Property Holdings Limited	2669 HK	138,239,829.71	9.37
7	China Resources Land Limited	1109 HK	134,656,200.82	9.13
8	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	128,571,359.42	8.72
9	Tsingtao Brewery Company Limited	168 HK	125,298,281.10	8.50
10	RLX Technology Inc.	RLX US	124,327,069.02	8.43
11	Sea Ltd	SE US	123,506,698.30	8.37
12	Baidu, Inc.	BIDU US	121,131,625.20	8.21
13	Hygeia Healthcare Holdings Co., Limited	6078 HK	120,037,400.76	8.14
14	Smoore International Holdings Limited	6969 HK	118,190,079.49	8.01
15	Techtronic Industries Co. Ltd.	669 HK	115,061,702.44	7.80
16	China Longyuan Power Group Corporation Limited	916 HK	107,089,200.70	7.26
17	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	2319 HK	99,100,020.89	6.72
18	Meituan	3690 HK	98,502,392.91	6.68

19	Yalla Group Ltd	YALA US	95,779,510.18	6.49
20	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	94,640,095.08	6.42
21	China Resources Beer (Holdings) Company Limited	291 HK	89,938,452.21	6.10
22	Jinke Smart Services Group Co., Ltd.	9666 HK	84,055,162.26	5.70
23	Innovent Biologics, Inc.	1801 HK	83,998,555.69	5.70
24	Kweichow Moutai Co., Ltd.	600519 SH	80,682,965.00	5.47
25	Futu Holdings Ltd	FUTU US	76,554,028.16	5.19
26	Zhou Hei Ya International Holdings Company Limited	1458 HK	75,251,610.09	5.10
27	Contemporary Amperex Technology Co., Limited	300750 SZ	74,666,891.00	5.06
28	Pharmaron Beijing Co., Ltd.	3759 HK	68,660,485.52	4.66
29	Agora, Inc.	API US	66,783,172.49	4.53
30	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	66,552,186.34	4.51
31	Shenzhen International Group Holdings Ltd.	2313 HK	65,832,133.17	4.46
32	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	002304 SZ	64,563,373.17	4.38
33	CARSGEN THERAPEUTICS HOLDING	2171 HK	64,041,033.40	4.34
34	MORIMATSU INTERNATIONAL HOLD	2155 HK	63,067,536.71	4.28



35	Longi Green Energy Technology Co., Ltd.	601012 SH	60,372,675.25	4.09
36	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	TSM US	59,539,454.82	4.04
37	Ganfeng Lithium Co., Ltd.	1772 HK	58,878,146.84	3.99
38	Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd.	3898 HK	57,669,571.77	3.91
39	Li Auto Inc.	LI US	57,399,852.43	3.89
40	ACM Research, Inc.	ACMR US	54,718,871.12	3.71
41	XinYi Glass Holdings Limited	868 HK	53,233,961.76	3.61
42	Shanghai Fudan Microelectronics Group CO.,LTD.	1385 HK	53,180,257.90	3.61
43	SJM Holdings Limited	880 HK	51,038,627.28	3.46
44	Zhongsheng Group Holdings Ltd	881 HK	50,063,864.24	3.39
45	ANTA Sports Products Limited	2020 HK	49,720,252.67	3.37
46	Haier Smart Home Co., Ltd.	6690 HK	48,115,406.63	3.26
47	Sunac Services Holdings Limited	1516 HK	47,051,216.65	3.19
48	EC Healthcare	2138 HK	45,944,423.92	3.12
49	Anhui Gujing Distillery Company Limited	000596 SZ	45,381,165.90	3.08
50	Li Ning Co. Ltd.	2331 HK	44,083,047.57	2.99
51	Weimob Inc.	2013 HK	43,940,039.07	2.98
52	Luxshare Precision Industry Co., Ltd.	002475 SZ	43,916,286.05	2.98
53	Xiaomi Corporation	1810 HK	42,316,152.31	2.87
54	Cathay Media And	1981 HK	41,155,567.52	2.79

	Education Group Inc.			
55	Xd Inc.	2400 HK	40,386,027.07	2.74
56	BYD Company Limited	1211 HK	39,284,344.63	2.66
57	The Hong Kong and China Gas Co. Ltd.	3 HK	39,284,211.38	2.66
58	Zijin Mining Group Company Limited	2899 HK	38,212,837.14	2.59
59	WuXi Apptec Co., Ltd.	2359 HK	38,198,183.27	2.59
60	Toly Bread Co., Ltd.	603866 SH	38,008,441.39	2.58
61	Joyy Inc.	YY US	36,277,080.33	2.46
62	China Resources Mixc Lifestyle Services Limited	1209 HK	34,983,613.87	2.37
63	Staar Surgical Co	STAA US	33,043,777.16	2.24
64	ANGELALIGN TECHNOLOGY INC	6699 HK	32,116,747.80	2.18
65	Tesla, Inc.	TSLA US	31,976,156.99	2.17
66	China Hongqiao Group Limited	1378 HK	31,225,580.60	2.12
67	Ping An Bank Co., Ltd.	000001 SZ	30,081,278.00	2.04
68	Tencent Music Entertainment Group	TME US	29,642,892.42	2.01

### 7.5.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Vipshop Holdings Ltd	VIPS US	186,340,400.73	12.63
2	CanSino Biologics Inc.	6185 HK	164,302,881.81	11.14
3	Pinduoduo Inc.	PDD US	156,625,470.03	10.62
4	Techtronic Industries Co. Ltd.	669 HK	150,060,412.39	10.17
5	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	149,199,175.86	10.12
6	Baidu, Inc.	BIDU US	135,393,921.79	9.18

7	Meituan	3690 HK	133,271,440.27	9.04
8	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	124,001,070.96	8.41
9	ANTA Sports Products Limited	2020 HK	116,836,482.64	7.92
10	Jinke Smart Services Group Co., Ltd.	9666 HK	114,254,053.68	7.75
11	Smooore International Holdings Limited	6969 HK	111,333,985.98	7.55
12	RLX Technology Inc.	RLX US	110,052,886.81	7.46
13	China Longyuan Power Group Corporation Limited	916 HK	83,269,653.53	5.65
14	Tencent Holdings Ltd	700 HK	80,485,552.49	5.46
15	China Resources Land Limited	1109 HK	78,722,572.28	5.34
16	Haier Smart Home Co., Ltd.	6690 HK	74,307,488.54	5.04
17	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	2319 HK	72,746,650.58	4.93
18	Shenzhen International Group Holdings Ltd.	2313 HK	70,420,651.82	4.77
19	WuXi Apptec Co., Ltd.	2359 HK	69,209,671.36	4.69
20	Xiaomi Corporation	1810 HK	67,787,358.50	4.60
21	Sea Ltd	SE US	64,550,452.71	4.38
22	China Resources Mixc Lifestyle Services Limited	1209 HK	64,536,743.88	4.38
23	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	63,022,593.63	4.27
24	Weimob Inc.	2013 HK	62,650,751.83	4.25
25	Joyy Inc.	YY US	62,534,118.98	4.24
26	Hygeia Healthcare Holdings Co., Limited	6078 HK	60,465,428.45	4.10
27	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	TSM US	59,458,858.48	4.03
28	XinYi Glass Holdings Limited	868 HK	56,712,740.54	3.85
29	Zijin Mining Group Company Limited	2899 HK	55,918,340.05	3.79

30	Staar Surgical Co	STAA US	55,000,775.70	3.73
31	Agora, Inc.	API US	54,801,448.40	3.72
32	BYD Company Limited	1211 HK	54,129,982.22	3.67
33	Innovent Biologics, Inc.	1801 HK	52,918,224.52	3.59
34	Futu Holdings Ltd	FUTU US	51,652,458.54	3.50
35	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	2382 HK	45,609,755.81	3.09
36	Xd Inc.	2400 HK	45,151,288.69	3.06
37	DAQO NEW ENERGY CORP.	DQ US	44,200,473.00	3.00
38	Flat Glass Group Co., Ltd	6865 HK	43,412,133.15	2.94
39	Anhui Gujing Distillery Company Limited	000596 SZ	42,494,948.78	2.88
40	Kweichow Moutai Co., Ltd.	600519 SH	41,834,338.38	2.84
41	China Tourism Group Duty Free Corporation Limited	601888 SH	36,086,332.70	2.45
42	Albemarle Corp	ALB US	36,008,240.61	2.44
43	New Oriental Education & Technology Group Inc.	9901 HK	34,960,155.20	2.37
44	Pop Mart International Group Limited	9992 HK	33,995,170.75	2.31
45	Contemporary Amperex Technology Co., Limited	300750 SZ	33,039,340.00	2.24
46	Longi Green Energy Technology Co., Ltd.	601012 SH	32,655,046.00	2.21
47	China Hongqiao Group Limited	1378 HK	31,838,185.27	2.16
48	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	002304 SZ	30,972,812.82	2.10
49	JD.com, Inc.	9618 HK	30,648,344.94	2.08

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	5,699,579,224.96
------------	------------------

卖出收入（成交）总额	4,351,301,444.91
------------	------------------

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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	186,432.76
2	应收证券清算款	31,284,315.18
3	应收股利	4,899,647.40
4	应收利息	6,931.28
5	应收申购款	5,579,236.26
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—

8	其他	—
9	合计	41,956,562.88

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.11.5 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。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
90,014	13,490.48	622,216,905.38	51.24	592,114,821.44	48.76

#### 8.2 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	2,288,153.86	0.1884

#### 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	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放	>100

式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年08月02日)基金份额总额	247,685,826.01
报告期期初基金份额总额	641,938,422.39
本报告期基金总申购份额	982,483,881.76
减：本报告期基金总赎回份额	410,090,577.33
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,214,331,726.82

## § 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		基金交易		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(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
ABCI Securities Co. Ltd	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
ANZ	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
BNP Paribas	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
BOC HONG KONG BRANCH	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
BOCI Security Limited	0	20,144,099.83	0.20	—	—	—	—	—	—	—	—	20,144.10	0.40	—
BOCOM International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CCB International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CEB International Capital Corporation Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—



CIMB Securities Ltd	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CITIC BANK	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CITIC Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CLSA	0	1,802,350.18	0.02	—	—	—	—	—	—	—	—	18,023.50	0.36	—
CMFU	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
CTI Capital Management	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Cathay Securities Hong Kong Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Everbright Securities HK Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Galaxy International Financial Holdings Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Industrial Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China International Capital Corp LTD	0	40,760,151.88	0.41	—	—	—	—	—	—	—	—	59,771.93	1.19	—
China Merchant International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Merchants Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

China Renaissance	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Securities International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Citigroup Global Markets Limited	0	1,373,161,264.70	13.66	—	—	—	—	—	—	—	—	1,103,257.01	22.03	—
Credit Suisse	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
DBS Vickers	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Daiwa Capital Markets HK Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsche Bank	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Essence International Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
First Shanghai Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
GF Securities HK	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Goldman Sachs	0	4,652,235,550.46	46.29	—	—	—	—	—	—	—	—	1,347,811.52	26.91	—
Guo Yuan Securities Hong Kong Ltd	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Guosen Securities HK Financial Holding CO LTD	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Guotai Junan Securities HK	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

HAITONG INTERNATIONAL	0	2,799,147,409.16	27.85	—	—	—	—	—	—	—	—	1,399,573.80	27.95	—
HSBC	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Huatai Financial Holdings	0	7,956,202.58	0.08	—	—	—	—	—	—	—	—	7,956.21	0.16	—
ICBC International Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Instinet Pacific Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
JPMorgan	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Jefferies	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Macquarie Bank Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Merrill Lynch	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Mizuho Securities International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Morgan Stanley	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Nomura International	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Orient Securities HongKong Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Shenwan Hongyuan Securites H.K.	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Standard Chartered Bank	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

UBS Securities Asia Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
UOB Kay Hian Hongkong Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Zhongtai International Securities Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
东方证券	2	66,437,222.71	0.66	—	—	—	—	—	—	—	—	60,544.34	1.21	—
国金证券	2	11,423,371.34	0.11	—	—	—	—	—	—	—	—	10,410.19	0.21	—
国泰君安	1	36,086,332.70	0.36	—	—	—	—	—	—	—	—	32,886.40	0.66	—
国信证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
恒泰证券	2	14,894,634.75	0.15	—	—	—	—	—	—	—	—	13,572.93	0.27	—
华泰证券	2	140,858,566.13	1.40	—	—	—	—	—	—	—	—	128,365.30	2.56	—
申万宏源	1	300,728,301.89	2.99	—	—	—	—	—	—	—	—	274,054.33	5.47	—
信达证券	2	29,736,602.72	0.30	—	—	—	—	—	—	—	—	27,099.18	0.54	—
野村证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	2	241,235,205.48	2.40	—	—	—	—	—	—	—	—	219,836.59	4.39	—
浙商证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中金财富	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中金公司	1	188,037,459.94	1.87	—	—	—	—	—	—	—	—	171,358.29	3.42	—
中信建投	1	78,786,628.00	0.78	—	—	—	—	—	—	—	—	71,797.04	1.43	—

中信山东	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	2	45,899,769.73	0.46	—	—	—	—	—	—	—	—	41,826.99	0.84	—
中银证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：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。

## 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	富国蓝筹精选股票型证券投资基金 QDII 关于 2021 年境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定投业务的公告	规定披露媒介	2021 年 01 月 06 日
2	关于富国蓝筹精选股票型证券投资基金 QDII 暂停大额申购、定投业务的公告	规定披露媒介	2021 年 01 月 14 日
3	关于富国蓝筹精选股票型证券投资基金 QDII 暂停大额申购、定投业务的公告	规定披露媒介	2021 年 01 月 22 日
4	关于富国蓝筹精选股票型证券投资基金 QDII 暂停大额申购、定投业务的公告	规定披露媒介	2021 年 01 月 29 日
5	关于富国蓝筹精选股票型证券投资基金 QDII 暂停大额申购、定投业务的公告	规定披露媒介	2021 年 02 月 06 日
6	关于富国蓝筹精选股票型证券投资基金 QDII 暂停大额申购、定投业务的公告	规定披露媒介	2021 年 02 月 24 日
7	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金最低定投金额的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 05 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 05 月 06 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 05 月 10 日
10	关于富国蓝筹精选股票型证券投资基金 QDII 暂停大额申购、定投业务的公告	规定披露媒介	2021 年 06 月 04 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蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）的文件	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。
2、富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）基金合同		
3、富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）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、富国蓝筹精选股票型证券投资基金（QDII）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		