

上证综指交易型开放式指数证券投资基金  
二〇二一年年度报告

2021年12月31日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022年03月31日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核报告.....	15
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
§5	托管人报告.....	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
§6	审计报告.....	18
6.1	审计报告基本信息.....	18
6.2	审计报告的基本内容.....	18
§7	年度财务报表.....	21
7.1	资产负债表.....	21
7.2	利润表.....	22
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4	报表附注.....	24
§8	投资组合报告.....	52
8.1	期末基金资产组合情况.....	53
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	53
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	54
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61

8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	61
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	62
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	62
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	62
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	62
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
8.12	投资组合报告附注 .....	62
§9	基金份额持有人信息 .....	65
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	66
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	66
§10	开放式基金份额变动 .....	66
§11	重大事件揭示 .....	67
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	67
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	67
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
11.4	基金投资策略的改变 .....	67
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	67
11.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
11.8	其他重大事件 .....	69
§12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	70
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	70
§13	备查文件目录 .....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上证综指交易型开放式指数证券投资基金
场内简称	上证指数 ETF
基金简称	上证综指 ETF
基金主代码	510210
交易代码	510210
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2011 年 01 月 30 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	453, 192, 565. 00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 3 月 25 日

注：根据 2020 年 7 月 10 日发布的《富国基金管理有限公司关于上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金变更基金扩位简称的公告》，本基金场内简称进行了调整。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的标的指数为上证综合指数。
投资策略	本基金采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的最优化目标组合的构建、存托凭证的投资策略、其他金融工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	上证综合指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，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。同时本基金为指数型基金，跟踪上证综合指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	郭明

	联系电话	021-20361818	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95588
传真		021-20361616	010—66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		裴长江	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年	2020年	2019年
本期已实现收益	55,698,596.97	63,431,125.14	21,013,543.97

本期利润	34,741,328.36	87,246,834.68	49,306,854.41
加权平均基金份额本期利润	0.0751	1.0461	1.0086
本期加权平均净值利润率	7.31%	23.74%	27.97%
本期基金份额净值增长率	5.45%	23.45%	31.30%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2021年12月31日</b>	<b>2020年12月31日</b>	<b>2019年12月31日</b>
期末可供分配利润	196,621,688.50	161,805,143.69	47,613,428.27
期末可供分配基金份额利润	0.4339	1.6572	0.9403
期末基金资产净值	461,467,152.74	471,277,989.73	198,004,492.84
期末基金份额净值	1.018	4.827	3.910
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2021年12月31日</b>	<b>2020年12月31日</b>	<b>2019年12月31日</b>
基金份额累计净值增长率	74.20%	65.20%	33.81%

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。

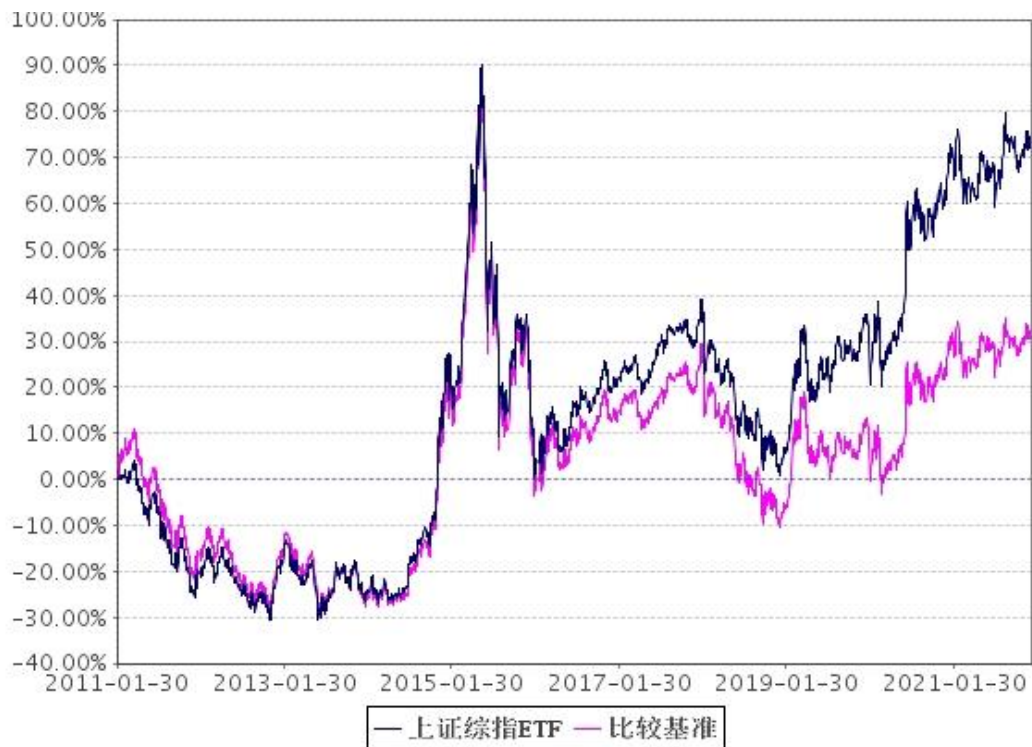
期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 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
过去三个月	1.09%	0.67%	2.01%	0.64%	-0.92%	0.03%
过去六个月	3.77%	0.84%	1.35%	0.82%	2.42%	0.02%
过去一年	5.45%	0.90%	4.80%	0.88%	0.65%	0.02%
过去三年	70.92%	1.11%	45.95%	1.12%	24.97%	-0.01%
过去五年	46.05%	1.03%	17.27%	1.06%	28.78%	-0.03%
自基金合同生效起至今	74.20%	1.28%	32.22%	1.30%	41.98%	-0.02%

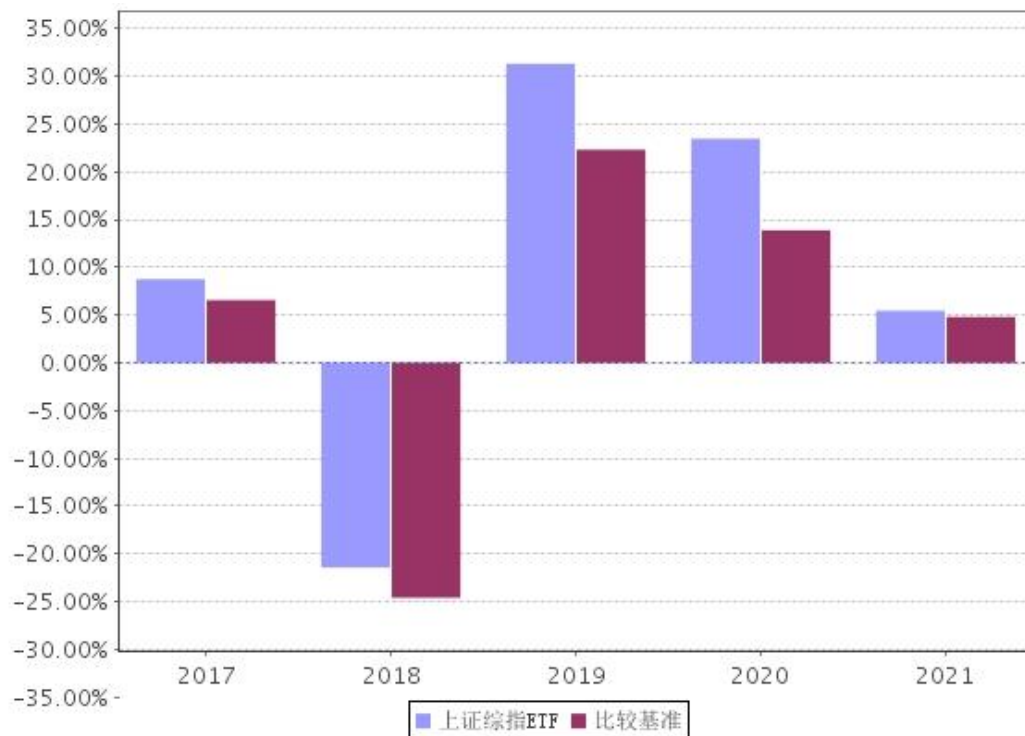
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2021年12月31日。2、本基金于2011年1月30日成立，建仓期3个月，从2011年1月30日起至2011年4月29日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。



### 3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：过往三年本基金未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

目前，公司注册资本金5.2亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、

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

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金(QDII)、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 243 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方旻	本基金基金经理	2014-11-19	—	11.9	硕士，自 2010 年 2 月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、量化投资部量化投资副总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼高级定量基金经理。2014 年 4 月至 2014 年 11 月任富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理助理，2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证 500 指数增强型证券投资

					<p>资基金(LOF)基金经理，2015年5月至2019年11月任富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金及富国中证银行指数型证券投资基金（原富国中证银行指数分级证券投资基金，于2019年5月10日更名）的基金经理，2015年10月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2017年6月至2018年12月任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2017年7月至2020年9月任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2018年5月起任富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2018年7月至2020年9月任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理，2019年1月起任富国MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金基金经理，2020年2月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。</p>
王保合	本基金基金经理	2011-03-03	—	15.5	<p>博士，自2006年7月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监、量化与海外投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部总经理，兼任富国基金量化投资部资深定量基金经理。2011年3月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2013年9月起任富国创业板指数型证券投资基金（原富国创业板指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）基金经理，2014年4月起任富国中证军工指数型证券投资基金（原富国</p>

					<p>中证军工指数分级证券投资基金，于 2021 年 1 月 1 日更名）基金经理，2015 年 4 月起任富国中证移动互联网指数型证券投资基金（原富国中证移动互联网指数分级证券投资基金，于 2021 年 1 月 1 日更名）、富国中证国有企业改革指数型证券投资基金（原富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金，于 2021 年 1 月 1 日更名）基金经理，2015 年 5 月起任富国中证全指证券公司指数型证券投资基金（原富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金，于 2021 年 1 月 1 日更名）、富国中证银行指数型证券投资基金（原富国中证银行指数分级证券投资基金，于 2019 年 5 月 10 日更名）基金经理，2017 年 9 月至 2019 年 10 月任富国丰利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月任富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019 年 3 月至 2021 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 11 月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019 年 12 月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2020 年 9 月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理。具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为上证综指交易型开放式指数证券投资

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

### **4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明**

#### **4.3.1 公平交易制度和控制方法**

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

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性

交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

#### **4.3.2 公平交易制度的执行情况**

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

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。

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

2021年初以来，在国内PMI向好、货币政策不急转弯、美国新一轮财政刺激落地、国内公募基金发行火爆等消息的推动下，上证指数先后突破3500、3600点。随着美国经济复苏预期加强，美国10年期国债利率快速突破1.5%，导致全球投资者对美联储货币政策提前收缩的担忧加大，使得全球股市均出现不同程度的下跌。2季度，随着国内大宗商品如钢价、煤价迎来调整，通胀预期下降，同时美联储会议并未实质性讨论收紧购债规模，美国10年期国债利率进一步走低，市场开启反弹。其中，景气度较高的新能源汽车、光伏、半导体等板块涨幅居前。7月初，央行宣布下调金融机构存款准备金率0.5个百分点，在相对充裕的流动性及靓丽中报业绩的推动下，锂电池产业链、光伏、半导体等板块持续上涨，同时周期板块如有色、化工、煤炭等也表现突出。9月中旬，随着煤炭等能源价格高企，多部委对煤炭价格重视度提升，周期板块迎来调整。9月下旬，受个别地产企业信用风险暴露、限电导致经济预期回落、美国财政将触及债务上限、长假

效应等因素影响，市场风险偏好大幅降低。11月中旬，随着公布的金融数据显示新增居民中长贷走强，表明房贷放款边际放松，同时部分银行加强房地产开发贷投放，提振投资者对经济的信心，地产、金融板块迎来大幅反弹。12月召开的中央经济工作会议进一步释放“稳字当头、稳中求进”的稳增长信号。随着稳增长信号落地，市场迎来休整，各板块轮换加速。

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

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

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至2021年12月31日，本基金份额净值为1.018元；份额累计净值为1.742元；本报告期，本基金份额净值增长率为5.45%，同期业绩比较基准收益率为4.80%

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

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

#### **4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告**

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

##### **（一）持续推动公司制度建设，优化内部控制体系**

制度建设是内部控制的起点，2021年公司在统筹兼顾监管法规重大调整、公司管理实际需要、公司业务创新发展的基础上，持续督导业务部门开展制度建设。

##### **（二）夯实合规管理架构，强化合规管理职能**

2021年公司通过落实合规考核机制、专兼职人员会议机制、持续推进合规

风控工作的系统化建设等，引导全员主动合规、立足本岗位持续夯实各业务、各环节的内部控制。

### （三）深入解读新规，持续推进新规落地

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

### （四）加强合规培训，全面提升合规意识

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

### （五）深入专项审计，抓紧第三道防线

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

### （六）立足投资合规监督，系统化助力风控履职

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

### （七）持续强化反洗钱工作理念，推动反洗钱工作纵深开展

公司高度重视反洗钱工作，2021 年认真贯彻落实反洗钱监管要求，牢固树立“风险为本”的反洗钱工作理念，从完善制度体系、提升履职效能、加大科技投入等方面，多措并举，将反洗钱工作推向纵深。为提升反洗钱管理效能和反洗钱工作水平，公司持续推进新一代反洗钱系统建设，提升反洗钱履职的时效性、有效性和精确性。



#### （八）全面加强员工行为管理

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——富国基金管理有限公司在本基金的投资运

作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第 60467606_B20 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	上证综指交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了上证综指交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的上证综指交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了上证综指交易型开放式指数证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于上证综指交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审

	计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>上证综指交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估上证综指交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督上证综指交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错</p>

	<p>报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对上证综指交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致上证综指交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合

	伙)	
注册会计师的姓名	蒋燕华	费泽旭
会计师事务所的地址	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼	
审计报告日期	2022 年 03 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 (2021 年 12 月 31 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
<b>资产：</b>		
银行存款	1,712,466.58	21,587,298.51
结算备付金	730,089.21	22,324.73
存出保证金	6,214.81	4,802.76
交易性金融资产	459,581,769.19	450,082,958.63
其中：股票投资	458,975,769.19	449,590,958.63
基金投资	—	—
债券投资	606,000.00	492,000.00
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	105,179.80	29,391.13
应收利息	583.63	2,332.80
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	462,136,303.22	471,729,108.56
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 (2021 年 12 月 31 日)</b>	<b>上年度末 (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	26,507.35	668.80
应付赎回款	—	—

应付管理人报酬	195,006.94	203,968.20
应付托管费	39,001.40	40,793.63
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	164,510.35	4,627.85
应交税费	—	1.22
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	244,124.44	201,059.13
负债合计	669,150.48	451,118.83
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	264,845,464.24	285,299,443.02
未分配利润	196,621,688.50	185,978,546.71
所有者权益合计	461,467,152.74	471,277,989.73
负债和所有者权益总计	462,136,303.22	471,729,108.56

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.018 元，基金份额总额 453,192,565.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日)
<b>一、收入</b>	38,327,473.52	89,915,914.58
1. 利息收入	28,431.52	55,554.56
其中：存款利息收入	22,724.29	48,010.98
债券利息收入	383.94	147.97
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	5,323.29	7,395.61
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	59,091,079.70	65,895,396.48
其中：股票投资收益	48,932,002.62	57,957,316.62
基金投资收益	—	—
债券投资收益	361,400.74	88,407.42
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—

股利收益	9,797,676.34	7,849,672.44
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-20,957,268.61	23,815,709.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	165,230.91	149,254.00
<b>减：二、费用</b>	<b>3,586,145.16</b>	<b>2,669,079.90</b>
1. 管理人报酬	2,378,134.93	1,816,756.41
2. 托管费	475,627.06	363,351.33
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	415,757.17	173,795.08
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 税金及附加	0.74	0.50
7. 其他费用	316,625.26	315,176.58
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>34,741,328.36</b>	<b>87,246,834.68</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>34,741,328.36</b>	<b>87,246,834.68</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2021年01月01日至2021年12月31日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	285,299,443.02	185,978,546.71	471,277,989.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	34,741,328.36	34,741,328.36
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）	-20,453,978.78	-24,098,186.57	-44,552,165.35
其中：1. 基金申购款	822,542,158.81	560,413,661.32	1,382,955,820.13
2. 基金赎回款	-842,996,137.59	-584,511,847.89	-1,427,507,985.48
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）	264,845,464.24	196,621,688.50	461,467,152.74
项目	上年度可比期间 (2020年01月01日至2020年12月31日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	147,965,583.73	50,038,909.11	198,004,492.84

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	87,246,834.68	87,246,834.68
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）	137,333,859.29	48,692,802.92	186,026,662.21
其中：1. 基金申购款	746,570,236.04	377,175,093.85	1,123,745,329.89
2. 基金赎回款	-609,236,376.75	-328,482,290.93	-937,718,667.68
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）	285,299,443.02	185,978,546.71	471,277,989.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陈 戈

林志松

徐 慧

—————

—————

—————

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

上证综指交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2010]1379号《关于核准上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2011年1月30日正式生效，首次设立募集规模为320,363,407.00份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在10个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于存托凭证、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。



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

本基金业绩比较基准为标的指数。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和中期报告》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2021年12月31日的财务状况以及2021年1月1日至2021年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

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

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2021年1月1日至2021年12月31日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

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

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负

债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

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

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

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

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

#### (2) 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

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

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

#### (4) 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；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用

的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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

#### **7.4.4.7 实收基金**

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

#### **7.4.4.8 损益平准金**

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

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

#### 7.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

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

(9) 股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；

(10) 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；

(11) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务

控制权时确认收入。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

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

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

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例依据以下原则确定：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；

(2) 本基金收益分配采用现金方式；

(3) 当基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配；

(4) 基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

(5) 每一基金份额享有同等分配权；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

### 1 印花税

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

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

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

### 2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问



题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

### 3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

### 4 企业所得税

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

### 5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
活期存款	1,712,466.58	21,587,298.51
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	1,712,466.58	21,587,298.51

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2021年12月31日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	447,693,723.56	458,975,769.19	11,282,045.63
贵金属投资-金交所黄	—	—	—

金合约			
债券	交易所市场	606,000.00	606,000.00
	银行间市场	—	—
	合计	606,000.00	606,000.00
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	448,299,723.56	459,581,769.19	11,282,045.63
项目	上年度末(2020年12月31日)		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	417,351,644.39	449,590,958.63	32,239,314.24
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	492,000.00	492,000.00
	银行间市场	—	—
	合计	492,000.00	492,000.00
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	417,843,644.39	450,082,958.63	32,239,314.24

注：股票投资的公允价值及股票投资的公允价值变动含可退替代款的估值增值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末(2021年12月31日)	上年度末(2020年12月31日)
应收活期存款利息	205.92	2,280.56
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	361.35	11.00

应收债券利息	13.28	38.82
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	3.08	2.42
合计	583.63	2,332.80

#### 7.4.7.6其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
交易所市场应付交易费用	164,510.35	4,627.85
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	164,510.35	4,627.85

#### 7.4.7.8其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	—	—
应付证券出借违约金	—	—
应付指数使用费	74,124.44	41,059.13
预提审计费	50,000.00	40,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	244,124.44	201,059.13

#### 7.4.7.9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12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	97,638,513.00	285,299,443.02
本期申购	2,000,000.00	5,843,994.01
本期赎回（以“-”号填列）	-19,000,000.00	-55,517,943.16
2021年01月22日基金拆分/份额折算前	80,638,513.00	235,625,493.87
基金拆分/份额折算调整	322,554,052.00	—
本期申购	1,397,500,000.00	816,698,164.80
本期赎回（以“-”号填列）	-1,347,500,000.00	-787,478,194.43
本期末	453,192,565.00	264,845,464.24

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	161,805,143.69	24,173,403.02	185,978,546.71
本期利润	55,698,596.97	-20,957,268.61	34,741,328.36
本期基金份额交易产生的变动数	-11,139,761.43	-12,958,425.14	-24,098,186.57
其中：基金申购款	586,380,758.90	-25,967,097.58	560,413,661.32
基金赎回款	-597,520,520.33	13,008,672.44	-584,511,847.89
本期已分配利润	—	—	—
本期末	206,363,979.23	-9,742,290.73	196,621,688.50

#### 7.4.7.11 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12月31日）	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）
活期存款利息收入	20,746.14	47,205.80
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	1,874.73	725.03
其他	103.42	80.15
合计	22,724.29	48,010.98

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	10,875,225.99	18,444,324.97
股票投资收益——赎回差价收入	38,056,776.63	39,512,991.65
股票投资收益——申购差价收入	—	—
合计	48,932,002.62	57,957,316.62

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
卖出股票成交总额	116,051,314.09	42,902,155.67
减：卖出股票成本总额	105,176,088.10	24,457,830.70
买卖股票差价收入	10,875,225.99	18,444,324.97

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
赎回基金份额对价总额	1,427,507,985.48	937,718,667.68
减：现金支付赎回款总额	2,518,686.48	1,206,492.68
减：赎回股票成本总额	1,386,932,522.37	896,999,183.35
赎回差价收入	38,056,776.63	39,512,991.65

#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益——申购差价收入。

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	2,494,816.30	465,522.60
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	2,133,000.00	377,000.00
减：应收利息总额	415.56	115.18
买卖债券差价收入	361,400.74	88,407.42

#### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖贵金属交易。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）
股票投资产生的股利收益	9,797,676.34	7,849,672.44
其中：证券出借权益补偿收入	—	—
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	9,797,676.34	7,849,672.44

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）
1. 交易性金融资产	-20,957,268.61	23,815,709.54
股票投资	-20,957,268.61	23,815,709.54
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	-20,957,268.61	23,815,709.54

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
基金赎回费收入	-	-
其他	41,892.31	-
替代损益	123,338.60	149,254.00
合计	165,230.91	149,254.00

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
交易所市场交易费用	415,757.17	173,795.08
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	415,757.17	173,795.08

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年12月31日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)
审计费用	50,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	414.00	342.00
指数使用费	146,211.26	154,834.58
合计	316,625.26	315,176.58

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。



#### 7.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
海通证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
山东省国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）		上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31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	5,287,185.18	1.99	—	—

##### 7.4.10.1.2 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。

##### 7.4.10.1.3 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。

##### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	4,818.87	1.99	—	—

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。本基金上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	2,378,134.93	1,816,756.41
其中：支付销售机构的客户维护费	7,284.87	7,731.87

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年12月31日）	上年度可比期间（2020年01月01日至2020年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	475,627.06	363,351.33

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末（2021年12月31日）		上期末（2020年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	168,300,100.00	37.14	47,384,400.00	48.53
申万宏源证券有限公司	6,758,760.00	1.49	—	—

#### 7.4.10.5 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12月31日)		上年度可比期间(2020年01月01日至2020年12月31日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,712,466.58	20,746.14	21,587,298.51	47,205.80

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联方交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

###### 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688248	南网科技	2021-12-14	2022-06-22	新股限售	12.24	18.90	11,763	143,979.12	222,320.70	—
688728	格科微	2021-08-11	2022-02-18	新股限售	14.38	29.31	12,246	176,097.48	358,930.26	—
688800	瑞可达	2021-07-14	2022-01-24	新股限售	15.02	133.53	1,967	29,544.34	262,653.51	—

###### 7.4.12.1.2 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	认购	期末估	数量	期末	期末	备
------	------	-------	------	------	----	-----	----	----	----	---

				限类型	价格	值单价	(单位: 张)	成本总额	估值总额	注
113052	兴业转债	2021-12-28	2022-01-14	认购新发 证券	100.0 0	100.00	6,060	606,000.00	606,000.00	—

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

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，

且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%，但标的指数成分券不受此限。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不在下表进行列示。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

#### 7.4.13.2.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
AAA	606,000.00	492,000.00
AAA 以下	—	—
未评级	—	—
合计	606,000.00	492,000.00

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

#### 7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

变现。

#### **7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

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

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### **7.4.13.4 市场风险**

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

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

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

###### **7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

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

单位：人民币元

本期末（2021年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,712,466.58	—	—	—	—	—	1,712,466.58
结算备付金	730,089.21	—	—	—	—	—	730,089.21
存出保证金	6,214.81	—	—	—	—	—	6,214.81
交易性金融资产	—	—	606,000.00	—	—	458,975,769.19	459,581,769.19
应收证券清算款	—	—	—	—	—	105,179.80	105,179.80
应收利息	—	—	—	—	—	583.63	583.63
资产总计	2,448,770.60	—	606,000.00	—	—	459,081,532.62	462,136,303.22
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	26,507.35	26,507.35
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	195,006.94	195,006.94
应付托管费	—	—	—	—	—	39,001.40	39,001.40
应付交易费用	—	—	—	—	—	164,510.35	164,510.35
其他负债	—	—	—	—	—	244,124.44	244,124.44
负债总计	—	—	—	—	—	669,150.48	669,150.48
利率敏感度缺口	2,448,770.60	—	606,000.00	—	—	458,412,382.14	461,467,152.74
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	21,587,298.51	—	—	—	—	—	21,587,298.51
结算备付金	22,324.73	—	—	—	—	—	22,324.73



存出保证金	4,802.76	—	—	—	—	—	4,802.76
交易性金融资产	—	—	492,000.00	—	—	449,590,958.63	450,082,958.63
应收证券清算款	—	—	—	—	—	29,391.13	29,391.13
应收利息	—	—	—	—	—	2,332.80	2,332.80
资产总计	21,614,426.00	—	492,000.00	—	—	449,622,682.56	471,729,108.56
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	668.80	668.80
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	203,968.20	203,968.20
应付托管费	—	—	—	—	—	40,793.63	40,793.63
应付交易费用	—	—	—	—	—	4,627.85	4,627.85
应付税费	—	—	—	—	—	1.22	1.22
其他负债	—	—	—	—	—	201,059.13	201,059.13
负债总计	—	—	—	—	—	451,118.83	451,118.83
利率敏感度缺口	21,614,426.00	—	492,000.00	—	—	449,171,563.73	471,277,989.73

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在10个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于存托凭证、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2021年12月31日）		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	458,975,769.19	99.46	449,590,958.63	95.40
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—

交易性金融资产—债券投资	606,000.00	0.13	492,000.00	0.10
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	459,581,769.19	99.59	450,082,958.63	95.50

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加1%	4,646,843.91	4,599,307.01
2. 业绩比较基准减少1%	-4,646,843.91	-4,599,307.01	

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

##### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损

---

益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 458,131,864.72 元，属于第二层次的余额为人民币 606,000.00 元，属于第三层次余额为人民币 843,904.47 元（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 447,660,774.02 元，属于第二层次的余额为人民币 938,678.43 元，属于第三层次余额为人民币 1,483,506.18 元）。

#### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

上年度末余额人民币 1,483,506.18 元，2021 年度转入第三层次人民币 0.00 元，转出第三层次人民币 870,423.74 元，当期计入损益的利得或损失总额人民币 418,739.91 元，购买人民币 349,620.94 元，卖出人民币 537,538.82 元，本期末人民币 843,904.47 元，本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动人民币 494,283.53 元。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	458,975,769.19	99.32
	其中：股票	458,975,769.19	99.32
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	606,000.00	0.13
	其中：债券	606,000.00	0.13
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	2,442,555.79	0.53
8	其他各项资产	111,978.24	0.02
9	合计	462,136,303.22	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

#### 8.2.1.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	621,583.77	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	69,749.68	0.02
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	222,320.70	0.05

N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	29,491.80	0.01
S	综合	—	—
	合计	947,859.75	0.21

### 8.2.1.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,023,269.00	0.44
B	采矿业	33,839,347.12	7.33
C	制造业	221,476,817.86	47.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,160,828.37	5.89
E	建筑业	14,514,092.84	3.15
F	批发和零售业	3,644,320.69	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	15,494,489.45	3.36
H	住宿和餐饮业	1,918,464.60	0.42
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,987,092.07	2.81
J	金融业	102,043,328.63	22.11
K	房地产业	8,208,763.53	1.78
L	租赁和商务服务业	3,927,439.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	8,360,283.28	1.81
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	815,393.00	0.18
S	综合	1,613,980.00	0.35
	合计	458,027,909.44	99.25

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	18,393	37,705,650.00	8.17
2	600036	招商银行	251,722	12,261,378.62	2.66
3	601288	农业银行	3,754,639	11,038,638.66	2.39

4	601628	中国人寿	307,525	9,253,427.25	2.01
5	601857	中国石油	1,842,558	9,046,959.78	1.96
6	601988	中国银行	2,700,970	8,237,958.50	1.79
7	601088	中国神华	327,221	7,369,016.92	1.60
8	600900	长江电力	318,795	7,236,646.50	1.57
9	601658	邮储银行	1,366,200	6,967,620.00	1.51
10	600276	恒瑞医药	126,656	6,422,725.76	1.39
11	601012	隆基股份	71,138	6,132,095.60	1.33
12	600309	万华化学	54,049	5,458,949.00	1.18
13	600030	中信证券	200,112	5,284,957.92	1.15
14	601166	兴业银行	256,370	4,881,284.80	1.06
15	601318	中国平安	90,900	4,582,269.00	0.99
16	600862	中航高科	127,100	4,545,096.00	0.98
17	601633	长城汽车	90,837	4,409,227.98	0.96
18	600346	恒力石化	182,020	4,180,999.40	0.91
19	600703	三安光电	111,140	4,174,418.40	0.90
20	600028	中国石化	948,888	4,013,796.24	0.87
21	601888	中国中免	17,900	3,927,439.00	0.85
22	600588	用友网络	109,268	3,920,535.84	0.85
23	600206	有研新材	236,698	3,877,113.24	0.84
24	603288	海天味业	36,079	3,792,263.69	0.82
25	600690	海尔智家	126,300	3,775,107.00	0.82
26	688100	威胜信息	109,172	3,758,791.96	0.81
27	601009	南京银行	418,916	3,753,487.36	0.81
28	600585	海螺水泥	90,851	3,661,295.30	0.79
29	601668	中国建筑	672,520	3,362,600.00	0.73
30	600111	北方稀土	72,850	3,336,530.00	0.72
31	600048	保利发展	200,847	3,139,238.61	0.68
32	688008	澜起科技	36,138	3,030,894.06	0.66
33	600887	伊利股份	73,048	3,028,570.08	0.66
34	600018	上港集团	548,700	3,006,876.00	0.65
35	600406	国电南瑞	72,752	2,912,262.56	0.63
36	688599	天合光能	36,400	2,871,960.00	0.62
37	603599	广信股份	72,800	2,839,200.00	0.62
38	601328	交通银行	578,520	2,666,977.20	0.58
39	601016	节能风电	401,300	2,612,463.00	0.57
40	600305	恒顺醋业	163,674	2,610,600.30	0.57
41	600188	兖矿能源	109,601	2,578,911.53	0.56
42	600999	招商证券	145,595	2,569,751.75	0.56
43	603596	伯特利	36,600	2,547,360.00	0.55
44	600000	浦发银行	291,679	2,488,021.87	0.54

45	600850	电科数字	72,817	2,485,244.21	0.54
46	688389	普门科技	107,964	2,483,172.00	0.54
47	601601	中国太保	91,300	2,476,056.00	0.54
48	603060	国检集团	127,990	2,470,207.00	0.54
49	600438	通威股份	54,200	2,436,832.00	0.53
50	603260	合盛硅业	18,200	2,401,854.00	0.52
51	600483	福能股份	145,746	2,372,744.88	0.51
52	600893	航发动力	36,300	2,303,598.00	0.50
53	600745	闻泰科技	17,700	2,288,610.00	0.50
54	601899	紫金矿业	235,400	2,283,380.00	0.49
55	600584	长电科技	73,100	2,267,562.00	0.49
56	600104	上汽集团	109,600	2,261,048.00	0.49
57	601238	广汽集团	147,740	2,244,170.60	0.49
58	601939	建设银行	382,400	2,240,864.00	0.49
59	600988	赤峰黄金	147,700	2,200,730.00	0.48
60	603859	能科科技	54,100	2,147,229.00	0.47
61	603259	药明康德	18,000	2,134,440.00	0.46
62	600741	华域汽车	73,400	2,077,220.00	0.45
63	688289	圣湘生物	35,075	2,069,425.00	0.45
64	603901	永创智能	125,922	2,027,344.20	0.44
65	603799	华友钴业	18,200	2,007,642.00	0.44
66	601111	中国国航	219,300	2,002,209.00	0.43
67	600803	新奥股份	108,938	2,000,101.68	0.43
68	601377	兴业证券	200,900	1,984,892.00	0.43
69	600367	红星发展	106,400	1,976,912.00	0.43
70	600360	华微电子	216,900	1,969,452.00	0.43
71	600089	特变电工	92,923	1,967,179.91	0.43
72	601877	正泰电器	36,482	1,966,014.98	0.43
73	600258	首旅酒店	73,420	1,918,464.60	0.42
74	601800	中国交建	219,269	1,881,328.02	0.41
75	688981	中芯国际	35,300	1,870,547.00	0.41
76	601669	中国电建	231,200	1,868,096.00	0.40
77	603667	五洲新春	106,400	1,852,424.00	0.40
78	600143	金发科技	145,906	1,835,497.48	0.40
79	603393	新天然气	73,438	1,808,777.94	0.39
80	601390	中国中铁	310,800	1,799,532.00	0.39
81	601998	中信银行	384,860	1,778,053.20	0.39
82	600624	复旦复华	256,136	1,775,022.48	0.38
83	601766	中国中车	291,264	1,773,797.76	0.38
84	600011	华能国际	182,405	1,767,504.45	0.38
85	601678	滨化股份	219,705	1,751,048.85	0.38



86	601618	中国中冶	457,084	1,750,631.72	0.38
87	600015	华夏银行	306,987	1,719,127.20	0.37
88	600547	山东黄金	90,893	1,710,606.26	0.37
89	600116	三峡水利	146,000	1,702,360.00	0.37
90	600110	诺德股份	106,400	1,697,080.00	0.37
91	603968	醋化股份	90,600	1,693,314.00	0.37
92	600085	同仁堂	36,300	1,632,774.00	0.35
93	601688	华泰证券	91,800	1,630,368.00	0.35
94	603993	洛阳钼业	291,600	1,627,128.00	0.35
95	600770	综艺股份	202,000	1,613,980.00	0.35
96	601169	北京银行	363,154	1,612,403.76	0.35
97	688222	成都先导	68,472	1,608,407.28	0.35
98	601155	新城控股	55,070	1,604,189.10	0.35
99	603328	依顿电子	200,400	1,603,200.00	0.35
100	688488	艾迪药业	102,910	1,602,308.70	0.35
101	600674	川投能源	127,201	1,590,012.50	0.34
102	601901	方正证券	200,400	1,571,136.00	0.34
103	600233	圆通速递	91,800	1,531,224.00	0.33
104	601100	恒立液压	18,400	1,505,120.00	0.33
105	601168	西部矿业	110,200	1,499,822.00	0.33
106	600118	中国卫星	55,088	1,495,639.20	0.32
107	601555	东吴证券	167,989	1,488,382.54	0.32
108	600236	桂冠电力	229,936	1,476,189.12	0.32
109	688365	光云科技	106,201	1,471,945.86	0.32
110	600109	国金证券	126,900	1,437,777.00	0.31
111	600019	宝钢股份	200,800	1,437,728.00	0.31
112	600383	金地集团	110,172	1,428,930.84	0.31
113	601336	新华保险	36,700	1,426,896.00	0.31
114	601006	大秦铁路	217,834	1,394,137.60	0.30
115	603159	上海亚虹	88,840	1,392,122.80	0.30
116	601186	中国铁建	178,400	1,391,520.00	0.30
117	600516	方大炭素	128,448	1,389,807.36	0.30
118	600006	东风汽车	202,000	1,375,620.00	0.30
119	601890	亚星锚链	145,900	1,355,411.00	0.29
120	603528	多伦科技	192,600	1,346,274.00	0.29
121	600557	康缘药业	109,296	1,337,783.04	0.29
122	601117	中国化学	108,100	1,297,200.00	0.28
123	688003	天准科技	33,560	1,275,951.20	0.28
124	600273	嘉化能源	110,200	1,275,014.00	0.28
125	600834	申通地铁	126,300	1,259,211.00	0.27
126	600332	白云山	36,700	1,255,140.00	0.27

127	688336	三生国健	67,380	1,249,899.00	0.27
128	600031	三一重工	54,657	1,246,179.60	0.27
129	601179	中国西电	220,300	1,222,665.00	0.26
130	601018	宁波港	306,900	1,218,393.00	0.26
131	600020	中原高速	371,861	1,215,985.47	0.26
132	600728	佳都科技	144,820	1,206,350.60	0.26
133	600760	中航沈飞	17,700	1,204,308.00	0.26
134	688586	江航装备	35,245	1,194,805.50	0.26
135	600061	国投资本	145,232	1,193,807.04	0.26
136	600867	通化东宝	108,533	1,189,521.68	0.26
137	600350	山东高速	228,900	1,181,124.00	0.26
138	601231	环旭电子	73,482	1,180,120.92	0.26
139	600606	绿地控股	268,015	1,163,185.10	0.25
140	600352	浙江龙盛	91,800	1,159,434.00	0.25
141	600863	内蒙华电	293,550	1,156,587.00	0.25
142	600884	杉杉股份	35,100	1,150,227.00	0.25
143	600919	江苏银行	197,120	1,149,209.60	0.25
144	603058	永吉股份	118,700	1,147,829.00	0.25
145	603688	石英股份	17,700	1,117,047.00	0.24
146	603789	星光农机	87,940	1,111,561.60	0.24
147	600487	亨通光电	73,020	1,104,062.40	0.24
148	600279	重庆港	271,200	1,103,784.00	0.24
149	601607	上海医药	55,062	1,094,081.94	0.24
150	688159	有方科技	34,300	1,083,880.00	0.23
151	601066	中信建投	36,300	1,061,775.00	0.23
152	600979	广安爱众	292,900	1,060,298.00	0.23
153	600007	中国国贸	73,042	1,051,804.80	0.23
154	600490	鹏欣资源	213,000	1,037,310.00	0.22
155	600960	渤海汽车	257,340	1,026,786.60	0.22
156	600108	亚盛集团	290,600	1,025,818.00	0.22
157	688278	特宝生物	34,273	1,003,513.44	0.22
158	600975	新五丰	146,900	997,451.00	0.22
159	603019	中科曙光	36,100	995,277.00	0.22
160	600460	士兰微	18,300	991,860.00	0.21
161	600050	中国联通	252,100	990,753.00	0.21
162	600498	烽火通信	55,100	990,698.00	0.21
163	601211	国泰君安	55,100	985,739.00	0.21
164	600663	陆家嘴	90,663	984,600.18	0.21
165	600271	航天信息	73,420	983,093.80	0.21
166	600664	哈药股份	276,552	981,759.60	0.21
167	688106	金宏气体	35,266	980,747.46	0.21

168	601128	常熟银行	145,900	964,399.00	0.21
169	600909	华安证券	177,780	961,789.80	0.21
170	601158	重庆水务	148,460	951,628.60	0.21
171	601229	上海银行	132,012	941,245.56	0.20
172	603969	银龙股份	210,734	933,551.62	0.20
173	601933	永辉超市	228,106	923,829.30	0.20
174	600688	上海石化	218,755	912,208.35	0.20
175	600196	复星医药	18,400	900,496.00	0.20
176	601882	海天精工	35,300	874,381.00	0.19
177	688108	赛诺医疗	105,786	868,503.06	0.19
178	600009	上海机场	18,402	859,189.38	0.19
179	600378	昊华科技	17,700	853,140.00	0.18
180	600183	生益科技	36,200	852,510.00	0.18
181	600326	西藏天路	127,590	822,955.50	0.18
182	600372	中航电子	36,700	821,713.00	0.18
183	601811	新华文轩	89,900	815,393.00	0.18
184	600838	上海九百	124,479	815,337.45	0.18
185	600998	九州通	55,100	811,072.00	0.18
186	600230	沧州大化	55,060	784,054.40	0.17
187	600435	北方导航	73,400	783,912.00	0.17
188	600066	宇通客车	70,836	780,612.72	0.17
189	600369	西南证券	143,200	757,528.00	0.16
190	600489	中金黄金	91,793	755,456.39	0.16
191	600758	辽宁能源	198,300	753,540.00	0.16
192	601515	东风股份	91,800	746,334.00	0.16
193	600008	首创环保	217,670	742,254.70	0.16
194	600798	宁波海运	172,400	722,356.00	0.16
195	600481	双良节能	70,500	709,230.00	0.15
196	600987	航民股份	126,413	702,856.28	0.15
197	600398	海澜之家	109,200	699,972.00	0.15
198	601368	绿城水务	127,000	683,260.00	0.15
199	601375	中原证券	137,700	676,107.00	0.15
200	603878	武进不锈	91,756	642,292.00	0.14

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688728	格科微	12,246	358,930.26	0.08
2	688800	瑞可达	1,967	262,653.51	0.06
3	688248	南网科技	11,763	222,320.70	0.05

4	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.02
5	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.01
6	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601658	邮储银行	9,799,008.00	2.08
2	603260	合盛硅业	3,727,294.00	0.79
3	688599	天合光能	3,394,525.95	0.72
4	600036	招商银行	3,165,155.00	0.67
5	688100	威胜信息	3,125,403.62	0.66
6	688389	普门科技	3,118,419.03	0.66
7	603259	药明康德	3,049,493.00	0.65
8	603596	伯特利	2,944,566.00	0.62
9	600519	贵州茅台	2,897,824.00	0.61
10	600745	闻泰科技	2,762,345.00	0.59
11	603799	华友钴业	2,747,802.00	0.58
12	688289	圣湘生物	2,695,479.06	0.57
13	688981	中芯国际	2,694,076.58	0.57
14	600206	有研新材	2,689,798.66	0.57
15	600110	诺德股份	2,670,211.00	0.57
16	603667	五洲新春	2,506,110.00	0.53
17	688222	成都先导	2,271,543.74	0.48
18	688488	艾迪药业	2,105,963.76	0.45
19	600438	通威股份	2,100,140.00	0.45
20	600367	红星发展	2,055,902.00	0.44

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

##### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600779	水井坊	9,012,425.60	1.91
2	601012	隆基股份	8,108,277.80	1.72
3	601888	中国中免	5,408,046.00	1.15
4	601318	中国平安	5,061,968.00	1.07
5	688002	睿创微纳	4,292,366.65	0.91
6	601818	光大银行	3,751,245.00	0.80
7	600459	贵研铂业	3,576,821.15	0.76

8	603060	国检集团	3,527,054.00	0.75
9	600016	民生银行	3,229,594.32	0.69
10	600036	招商银行	3,083,721.00	0.65
11	600028	中国石化	2,895,320.00	0.61
12	600900	长江电力	2,838,260.00	0.60
13	603393	新天然气	2,548,674.00	0.54
14	600104	上汽集团	2,415,566.00	0.51
15	600000	浦发银行	2,204,007.00	0.47
16	600309	万华化学	1,790,422.00	0.38
17	601998	中信银行	1,408,236.00	0.30
18	601899	紫金矿业	1,196,882.00	0.25
19	600616	金枫酒业	1,154,677.80	0.25
20	601727	上海电气	1,101,408.00	0.23

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	157,876,960.26
卖出股票收入（成交）总额	116,051,314.09

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	606,000.00	0.13
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	606,000.00	0.13

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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

					值比例 (%)
1	113052	兴业转债	6,060	606,000.00	0.13

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

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

本报告编制日前一年内，本基金持有的“招商银行”的发行主体招商银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；违规协助无

---

衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；理财产品之间风险隔离不到位；理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准等 27 项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 5 月 17 日对公司做出罚款 7170 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕16 号）。“招商银行”为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“农业银行”的发行主体中国农业银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：（1）发生重要信息系统突发事件未报告；（2）制卡数据违规明文留存；（3）生产网络、分行无线网络保护不当；（4）数据安全较粗放，存在数据泄露风险；（5）网络信息系统存在较多漏洞；（6）互联网门户网站泄露敏感信息的违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 1 月 19 日对公司做出罚款 420 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕1 号）；由于存在：（1）农业银行制定文件要求企业对公账户必须开通属于该行收费项目的动账短信通知服务，侵害客户自主选择权；（2）农业银行河南分行和新疆分行转发并执行总行强制企业对公账户开通动账短信通知服务要求，违法行为情节较为严重的事实，中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 12 月 8 日对公司做出罚款 150 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕38 号）。“农业银行”为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“中国银行”的发行主体中国银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款；违规向关系人发放信用贷款；向无资金缺口企业发放流动资金贷款；存款月末冲时点；为无真实贸易背景企业签发银行承兑汇票等 36 项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 5 月 17 日对公司做出罚没 8761.355 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕11 号）。“中国银行”为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“邮储银行”的发行主体中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：（1）违规向部分客户收取唯一账户年费和小额账户管理费；（2）未经客户同意违规办理短信收费业

务；（3）信息系统相关功能在开发、投产、维护、后评估等方面存在缺陷及不足；（4）向监管机构报送材料内容不实；（5）未在监管要求时限内报送材料；（6）未按监管要求提供保存业务办理相关凭证，中国银行保险监督管理委员会于2021年6月22日对公司做出没收违法所得11.401116万元，罚款437.677425万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕23号）；由于违反账户管理相关规定，中国人民银行于2021年8月13日对公司做出警告，并处罚款600万元的行政处罚（银罚字〔2021〕16号）；由于存在：（1）办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查的；（2）违反规定办理资本项目资金收付；（3）违反规定办理结汇、售汇业务；（4）违反外汇市场交易管理；（5）未按照规定进行国际收支统计申报；（6）未按照规定报送财务会计报告、统计报表等资料的违法违规事实，国家外汇管理局北京外汇管理部于2021年11月9日对公司做出警告，没收违法所得673625.55元，并罚款444万元的行政处罚（京汇罚〔2021〕16号）。“邮储银行”为本基金跟踪标的指数的成份股。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余6名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 8.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,214.81
2	应收证券清算款	105,179.80
3	应收股利	—
4	应收利息	583.63
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	111,978.24



### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688728	格科微	358,930.26	0.08	新股限售
2	688800	瑞可达	262,653.51	0.06	新股限售
3	688248	南网科技	222,320.70	0.05	新股限售

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
12,646	35,836.83	214,836,970.00	47.41	238,355,595.00	52.59	168,300,100.00	37.14

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行股份有限公司—富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持

有份额”和“占总份额比例”数据。

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	华西证券股份有限公司	9,000,000.00	1.99
2	申万宏源证券有限公司	6,758,760.00	1.49
3	广发证券股份有限公司	5,606,340.00	1.24
4	北京冲和资产管理有限公司—冲和资产轮动一号私募证券投资基金	5,306,100.00	1.17
5	信达证券股份有限公司	4,991,700.00	1.10
6	陈杰	4,400,000.00	0.97
7	光大证券资管—中国银行—光证资管阳光添泽1号集合资产管理计划	3,773,100.00	0.83
8	中国国际金融股份有限公司	3,408,900.00	0.75
9	华泰证券股份有限公司	3,213,600.00	0.71
10	招商证券股份有限公司	3,179,420.00	0.70
11	富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	168,300,100.00	37.14

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

## 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年01月30日)基金份额总额	320,363,407.00
报告期期初基金份额总额	97,638,513.00
本报告期基金总申购份额	1,399,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,366,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	322,554,052.00

本报告期末基金份额总额	453, 192, 565. 00
-------------	-------------------

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

本报告期本基金管理人无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为 5 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 19 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国元证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源	1	5,287,185.18	1.99	—	—	—	—	—	—	4,818.87	1.99	—
银河证券	2	260,254,122.41	98.01	2,494,816.30	100.00	17,000,000.00	100.00	—	—	237,170.36	98.01	—

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	关于上证综指交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分及相关业务安排的公告	规定披露媒介	2021年01月14日
2	关于上证综指交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分及相关业务安排的第一次提示性公告	规定披露媒介	2021年01月18日
3	关于上证综指交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分及相关业务安排的第二次提示性公告	规定披露媒介	2021年01月20日
4	富国基金管理有限公司关于上证综指交易型开放式指数证券投资基金修改基金合同的公告	规定披露媒介	2021年01月23日
5	上证综指交易型开放式指数证券投资基金开通集合申购业务的公告	规定披露媒介	2021年01月23日
6	关于上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果及恢复交易和申购、赎回的公告	规定披露媒介	2021年01月25日
7	上证综指交易型开放式指数证券投资基金集合申购清单	规定披露媒介	2021年01月26日
8	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同及托管协议的公告	规定披露媒介	2021年03月30日
9	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所上市股票及相关风险提示的公告	规定披露媒介	2021年11月26日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2021-01-01 至 2021-12-31	47,384,400.00	341,853,300.00	220,937,600.00	168,300,100.00	37.14%
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，经与基金托管人、上海证券交易所协商一致，基金管理人决定对本基金实施份额拆分，份额拆分日（2021 年 1 月 22 日）经本基金托管人中国工商银行股份有限公司复核的本基金拆分前的基金份额总额为 80,638,513.00 份，基金份额净值为 4.996 元。本基金基金份额拆分比例为 1:5，拆分后基金份额总额为 403,192,565.00 份，拆分后基金份额净值为 0.999 元，基金份额累计净值为 1.709 元。本基金管理人已按照上述拆分比例，对 2021 年 1 月 21 日（权益登记日）登记在册的各基金份额持有人的基金份额进行了拆分，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于 2021 年 1 月 22 日完成了变更登记。具体可参见基金管理人于 2021 年 1 月 14 日发布的《关于上证综指交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分及相关业务安排的公告》、2021 年 1 月 25 日发布的《关于上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果及恢复交易和申购、赎回的公告》及相关提示性公告。

二、本报告期内，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集

证券投资基金运作管理办法》和《上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人决定自 2021 年 1 月 23 日起修改基金合同和其他法律文件相关内容，在“基金份额的申购与赎回”部分增加了集合申购业务的相关约定，并自 2021 年 1 月 26 日开通集合申购业务。具体可参见基金管理人于 2021 年 1 月 23 日发布的《富国基金管理有限公司关于上证综指交易型开放式指数证券投资基金修改基金合同的公告》、《上证综指交易型开放式指数证券投资基金开通集合申购业务的公告》及修改后的基金合同和其他法律文件。

三、本报告期内，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定自 2021 年 3 月 31 日起，对旗下部分基金的基金合同及托管协议的相应条款进行修订，增加《指数基金指引》规定的相关内容。具体可参见基金管理人于 2021 年 3 月 30 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同及托管协议的公告》及修订后的基金合同、托管协议。

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

### § 13 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立上证	中国（上海）自由贸易试验区	投资者对本报告书如有疑问，

<p>综指交易型开放式指数证券投资基金的文件</p> <p>2、上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同</p> <p>3、上证综指交易型开放式指数证券投资基金托管协议</p> <p>4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件</p> <p>5、上证综指交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注</p> <p>6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告</p>	<p>世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层</p>	<p>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>。</p>
--	------------------------------------	--