

富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金

二〇二〇年中期报告

2020年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020年08月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§3	主要财务指标、基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	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	14
6.3	所有者权益(基金净值)变动表	15
6.4	报表附注	16
§7	投资组合报告	34
7.1	期末基金资产组合情况	35
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	36
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	41
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	41
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	41
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	41

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12	投资组合报告附注	42
§8	基金份额持有人信息	44
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2	期末上市基金前十名持有人	44
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	45
§9	开放式基金份额变动	45
§10	重大事件揭示	45
10.1	基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4	基金投资策略的改变	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8	其他重大事件	49
§11	影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	50
§12	备查文件目录	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	富国中证价值 ETF
场内简称	价值 100ETF
基金主代码	512040
交易代码	512040
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 07 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	175,857,935.00 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	2018 年 11 月 29 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最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	中证国信价值指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人	
名称	富国基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	赵瑛	李申
	联系电话	021-20361818	021-60637102
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话	95105686、4008880688	021-60637111	
传真	021-20361616	021-60635778	
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	北京市西城区金融大街 25 号	
办公地址	上海市浦东新区世纪大道	北京市西城区闹市口大街	

	1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	裴长江	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	35,647,713.31
本期利润	16,364,397.58
加权平均基金份额本期利润	0.0608
本期加权平均净值利润率	5.20%
本期基金份额净值增长率	5.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	42,781,123.44
期末可供分配基金份额利润	0.2433
期末基金资产净值	218,639,058.44
期末基金份额净值	1.2433
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	24.33%

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。

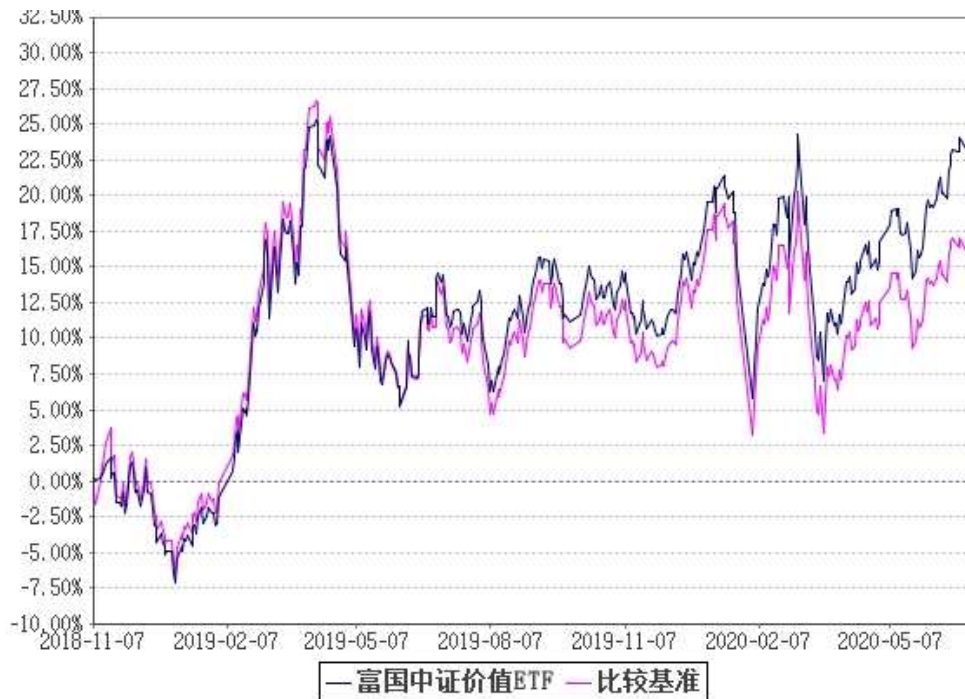
期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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	6.79%	0.76%	5.08%	0.79%	1.71%	-0.03%
过去三个月	11.99%	0.85%	9.14%	0.86%	2.85%	-0.01%
过去六个月	5.83%	1.47%	1.29%	1.51%	4.54%	-0.04%
过去一年	11.54%	1.18%	5.56%	1.21%	5.98%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	24.33%	1.26%	16.98%	1.30%	7.35%	-0.04%

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



注：1、截止日期为2020年6月30日。

2、本基金于2018年11月7日成立，建仓期6个月，从2018年11月7日起至2019年5月6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2020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一百六十八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		
曹璐迪	本基金基金经理	2020-05-20	—	3.9	硕士，自2016年7月起历任富国基金管理有限公司助理定量研究员、定量研究员；自2020年5月起任富国中证价值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联接基金基金经理。具有基金从业资格。
牛志冬	本基金前任基金经理	2018-11-07	2020-05-25	13.0	硕士，自2007年7月至2010年8月任华夏基金管理有限公司研究员；自2010年8月至2012年4月任富国基金管理有限公司基金经理助理；自2012年4月至2015年3月任富国基金管理有限公司

					<p>投资经理；自 2015 年 5 月起任富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 11 月起任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2017 年 3 月起任富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2017 年 7 月起任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2017 年 11 月至 2018 年 12 月任富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 11 月至 2020 年 5 月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018 年 12 月至 2020 年 5 月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019 年 7 月起任富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理；兼任量化投资部量化投资副总监。具有基金从业资格。</p>
王乐乐	本基金前任基金经理	2018-11-07	2020-05-25	10.1	<p>博士，自 2010 年 6 月至 2011 年 11 月在上海证券有限责任公司任研究员；自 2011 年 11 月至 2012 年 6 月在华泰联合证券有限责任公司任研究员；自 2012 年 7 月至 2015 年 5 月在华泰证券股份有限公司历任研究员、创新规划团队负责人；自 2015 年 5 月加入富国基金管理有限公司，2015 年 8 月至 2020 年 1 月任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 7 月任富国全球债券证券投资基金基金经理，2017 年 10 月至 2020 年 1 月任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，2017 年 11 月至 2020 年 1 月任富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资</p>

				<p>基金基金经理，2018年11月至2020年5月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018年12月至2020年5月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019年3月起任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年6月起任富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年7月起任富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年9月起任富国中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年10月起任富国中证消费50交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年11月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、富国中证科技50策略交易型开放式指数证券投资基金、富国中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019年12月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2020年1月起任富国中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020年2月起任富国中证科技50策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020年3月起任富国中证医药50交易型开放式指数证券投资基金、富国中证消费50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2020年5月起任富国中证800交易型开放式指数证券投资基金基金经理；兼任量化投资部ETF投资总监。具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现3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

2020 年伊始，在央行下调存款准备金率 0.5 个百分点、中美正式签订第一阶段贸易协议等消息提振下，市场乐观预期提前发酵。2 月末，受全球疫情加速蔓延的影响，美欧等发达国家股市均出现持续大幅下跌。进入 3 月，由于欧佩克谈判破裂，原油单日跌幅高达 30% 以上，同时海外疫情进一步扩散，全球资本市场恐慌性下跌，出现流动性枯竭的情况，多国股市因跌幅过大而迎来熔断。3 月下旬，各国政府及央行加大救市力度，其中美联储开启不设上限的量化宽松，大幅缓解了市场的流动性压力，市场恐慌情绪得到有效缓解。4 月初，受国内财政货币政策刺激影响，以内需为主的消费、医药等板块率先反弹。5 月下旬，全国两会如期召开，会议公布的财政扩张措施基本符合预期，但由于未公布 GDP 目标，低于部分投资者预期，因此市场出现阶段性调整。6 月初，由于美国公布的 5 月非农就业人数大幅好转，超出市场预期，美股带动全球市场大幅反弹。进入下旬，央行下调 14 天逆回购利率 20 个基点，继续释放适度宽松的货币政策信号，同时北上资金继续大幅流入，A 股整体出现明显上涨，其中创业板涨幅较大。总体来看，2020 年上半年上证综指下跌 2.15%，沪深 300 上涨 1.64%，创业板指上涨 35.6%，中证 500 指数上涨 11.33%。

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 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.2433 元；份额累计净值为 1.2433 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 5.83%，同期业绩比较基准收益率为 1.29%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，总体来看，由于全球流动性仍较为充裕，主要经济体仍将出台大规模经济刺激计划，经济仍有望逐步复苏，因此市场风险偏好仍有望延续提升。进入 4 季度，随着美国大选进入关键时刻，中美关系可能再度成为全球资本市场关注的焦点。从风格上看，随着经济逐步复苏，市场风格有望阶段性地切换，低估值的周期、蓝筹板块有望获得相对收益。从中期看，市场主线仍是科技、消费、医药等代表经济转型方向的行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 中期财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资产	本期末 (2020年06月30日)	上年度末 (2019年12月31日)
资产：		
银行存款	5,087,693.82	7,606,543.89
结算备付金	128,011.69	333,707.23
存出保证金	90,087.70	85,386.91
交易性金融资产	213,783,646.00	555,085,350.44
其中：股票投资	212,614,232.50	555,001,350.44
基金投资	—	—
债券投资	1,169,413.50	84,000.00
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	880,049.67	557,656.92
应收利息	1,585.52	2,336.59
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	75,409.89	—
资产总计	220,046,484.29	563,670,981.98
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	(2020年06月30日)	(2019年12月31日)
负债:		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	876,926.86	1,091,617.07
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	115,722.55	300,906.88
应付托管费	19,287.10	50,151.12
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	240,810.75	561,148.33
应交税费	6.25	0.10
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	154,672.34	300,000.00
负债合计	1,407,425.85	2,303,823.50
所有者权益:		
实收基金	175,857,935.00	477,857,935.00
未分配利润	42,781,123.44	83,509,223.48
所有者权益合计	218,639,058.44	561,367,158.48
负债和所有者权益总计	220,046,484.29	563,670,981.98

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2433 元，基金份额总额 175,857,935.00 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2020年01月01日至 2020年06月30日)	上年度可比期间 (2019年01月01日至 2019年06月30日)
一、收入	18,524,901.49	105,009,085.62
1. 利息收入	29,323.96	48,879.92
其中：存款利息收入	28,547.56	48,685.45
债券利息收入	776.40	194.47
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）	36,959,283.56	50,252,475.13
其中：股票投资收益	32,940,914.84	41,030,455.88
基金投资收益	—	—
债券投资收益	174,672.10	183,944.03
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	3,843,696.62	9,038,075.22
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-19,283,315.73	52,806,028.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	819,609.70	1,901,702.00
减：二、费用	2,160,503.91	3,795,355.37
1. 管理人报酬	948,960.21	1,739,283.81
2. 托管费	158,160.03	289,880.65
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	788,154.90	1,521,241.62
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 税金及附加	2.83	—
7. 其他费用	265,225.94	244,949.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	16,364,397.58	101,213,730.25
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	16,364,397.58	101,213,730.25

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (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）	477,857,935.00	83,509,223.48	561,367,158.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	16,364,397.58	16,364,397.58
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）	-302,000,000.00	-57,092,497.62	-359,092,497.62
其中：1. 基金申购款	24,000,000.00	3,396,606.20	27,396,606.20
2. 基金赎回款	-326,000,000.00	-60,489,103.82	-386,489,103.82
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）	175,857,935.00	42,781,123.44	218,639,058.44
项目	上年度可比期间 (2019年01月01日至2019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）	813,857,935.00	-40,230,935.80	773,626,999.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	101,213,730.25	101,213,730.25
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）	-283,000,000.00	-69,161.42	-283,069,161.42
其中：1. 基金申购款	323,000,000.00	49,304,116.97	372,304,116.97
2. 基金赎回款	-606,000,000.00	-49,373,278.39	-655,373,278.39
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）	530,857,935.00	60,913,633.03	591,771,568.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈 戈

林志松

徐慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国中证价值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[2018]939号《关于准予富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司自2018年10月10日至2018年10月31日止期间向社会公开发行人募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2018）验字第60467606_A02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2018年11月7日正式生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币951,857,935.00元，其中以现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币898,662,000.00元，折合898,662,000.00份基金份额；以股票认购方式按认购期最后一日的均价计算的金额为人民币53,195,935.00元，折合53,195,935.00份基金份额。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币254,774.79元，网上现金认购的有效认购资金在首次募集期间产生的利息人民币254,774.79元计入基金财产，不折算为投资者基金份额。与首次募集相关的资产总额为人民币952,112,709.79元，折合951,857,935.00份基金份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、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、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（权证、股指期货、国债期货等）、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

本基金的业绩比较基准为：中证国信价值指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

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2020

年6月30日的财务状况以及2020年1月1日至2020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。

6.4.7 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（2020年06月30日）
活期存款	5,087,693.82
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	5,087,693.82

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

6.4.7.2交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	208,617,983.59	212,614,232.50	3,996,248.91
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	1,169,413.50	88,113.50
	银行间市场	—	—
	合计	1,169,413.50	88,113.50
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	209,699,283.59	213,783,646.00	4,084,362.41

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（2020年06月30日）
应收活期存款利息	986.16
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	57.60
应收债券利息	501.26
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	40.50
合计	1,585.52

6.4.7.6其他资产

单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）
其他应收款	—
待摊费用	75,409.89
合计	75,409.89

6.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）
交易所市场应付交易费用	240,810.75
银行间市场应付交易费用	—
合计	240,810.75

6.4.7.8其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	34,809.32
应付指数使用费	35,000.00
IOPV 计算发布费	24,863.02
合计	154,672.34

6.4.7.9实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	477,857,935.00	477,857,935.00
本期申购	24,000,000.00	24,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-326,000,000.00	-326,000,000.00
本期末	175,857,935.00	175,857,935.00

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	76,247,922.83	7,261,300.65	83,509,223.48
本期利润	35,647,713.31	-19,283,315.73	16,364,397.58
本期基金份额交易产生的变动数	-59,505,650.00	2,413,152.38	-57,092,497.62
其中：基金申购款	5,347,223.58	-1,950,617.38	3,396,606.20
基金赎回款	-64,852,873.58	4,363,769.76	-60,489,103.82
本期已分配利润	—	—	—
本期末	52,389,986.14	-9,608,862.70	42,781,123.44

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
活期存款利息收入	23,091.08
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	4,704.77
其他	751.71
合计	28,547.56

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	29,263,242.03
股票投资收益——赎回差价收入	3,677,672.81
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	32,940,914.84

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
卖出股票成交总额	320,665,681.26
减：卖出股票成本总额	291,402,439.23
买卖股票差价收入	29,263,242.03

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
赎回基金份额对价总额	386,489,103.82
减：现金支付赎回款总额	180,208,602.82
减：赎回股票成本总额	202,602,828.19

赎回差价收入	3,677,672.81
--------	--------------

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	986,073.93
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	811,100.00
减：应收利息总额	301.83
买卖债券差价收入	174,672.10

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
股票投资产生的股利收益	3,843,696.62
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	3,843,696.62

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
1. 交易性金融资产	-19,283,315.73
股票投资	-19,371,429.23
债券投资	88,113.50
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-19,283,315.73

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
基金赎回费收入	—
替代损益	819,609.70
合计	819,609.70

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
交易所市场交易费用	788,154.90
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	788,154.90

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
审计费用	34,809.32
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	963.49
指数使用费	70,000.00
其他	99,453.13

合计	265,225.94
----	------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
中证价值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

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

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股票交易。

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 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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（2020年01月01日至 2020年06月30日）	上年度可比期间（2019年01月 01日至2019年06月30日）
----	---------------------------------	--------------------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	948,960.21	1,739,283.81
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2020年01月01日至 2020年06月30日)	上年度可比期间(2019年01月 01日至2019年06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	158,160.03	289,880.65

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证

券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的

证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末（2020年06月30日）		上年度末（2019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（%）
富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金	71,700,938.00	40.77	199,263,238.00	41.70

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）		上年度可比期间（2019年01月01日至2019年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	5,087,693.82	23,091.08	8,457,050.92	32,992.56

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期内本基金未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020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
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股认购	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	—
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股认购	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	—
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股认购	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	—
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股认购	16.42	16.42	6,578	108,010.76	108,010.76	—
688518	联赢激光	2020-06-12	2020-12-22	新股限售	7.81	20.83	14,111	110,206.91	293,932.13	—
688528	秦川物联	2020-06-19	2021-01-04	新股限售	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	—
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新股认购	16.21	16.21	7,507	121,688.47	121,688.47	—
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股认购	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	—

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128113	比音转债	2020-06-15	2020-07-15	认购新发 证券	100.00	100.00	1,295	129,500.00	129,500.00	

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 2020 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 2020 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2020年06月30日）	上年度末（2019年12月31日）
AAA	—	84,000.00
AAA 以下	1,169,413.50	—
未评级	—	—
合计	1,169,413.50	84,000.00

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。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎

回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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

单位：人民币元

本期末（2020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	5,087,693.82	—	—	—	—	—	5,087,693.82
结算备付金	128,011.69	—	—	—	—	—	128,011.69
存出保证金	90,087.70	—	—	—	—	—	90,087.70
交易性金融资产	—	—	1,169,413.50	—	—	212,614,232.50	213,783,646.00
应收证券清算款	—	—	—	—	—	880,049.67	880,049.67
应收利息	—	—	—	—	—	1,585.52	1,585.52
其他资产	—	—	—	—	—	75,409.89	75,409.89
资产总计	5,305,793.21	—	1,169,413.50	—	—	213,571,277.58	220,046,484.29
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	876,926.86	876,926.86
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	115,722.55	115,722.55
应付托管费	—	—	—	—	—	19,287.10	19,287.10
应付交易费用	—	—	—	—	—	240,810.75	240,810.75
应付税费	—	—	—	—	—	6.25	6.25
其他负债	—	—	—	—	—	154,672.34	154,672.34
负债总计	—	—	—	—	—	1,407,425.85	1,407,425.85
利率敏感度缺口	5,305,793.21	—	1,169,413.50	—	—	212,163,851.73	218,639,058.44
上年度末（2019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	7,606,543.89	—	—	—	—	—	7,606,543.89
结算备付金	333,707.23	—	—	—	—	—	333,707.23
存出保证金	85,386.91	—	—	—	—	—	85,386.91
交易性金融资产	—	—	84,000.00	—	—	555,001,350.44	555,085,350.44
应收证券清算款	—	—	—	—	—	557,656.92	557,656.92
应收利息	—	—	—	—	—	2,336.59	2,336.59
资产总计	8,025,638.03	—	84,000.00	—	—	555,561,343.95	563,670,981.98
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	1,091,617.07	1,091,617.07
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	300,906.88	300,906.88
应付托管费	—	—	—	—	—	50,151.12	50,151.12
应付交易费用	—	—	—	—	—	561,148.33	561,148.33
应付税费	—	—	—	—	—	0.10	0.10
其他负债	—	—	—	—	—	300,000.00	300,000.00
负债总计	—	—	—	—	—	2,303,823.50	2,303,823.50
利率敏感度缺口	8,025,638.03	—	84,000.00	—	—	553,257,520.45	561,367,158.48

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本期末未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。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（2020年06月30日）		上年度末（2019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	212,614,232.50	97.24	555,001,350.44	98.87
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,169,413.50	0.53	84,000.00	0.01
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	213,783,646.00	97.78	555,085,350.44	98.88

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（2020年06月 30日）	上年度末（2019年12月 31日）
	1. 业绩比较基准增加1%	2,134,359.11	5,555,909.41
	2. 业绩比较基准减少1%	-2,134,359.11	-5,555,909.41

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2020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212,932,934.55元，属于第二层次的余额为人民币462,321.11元，属于第三层次余额为人民币388,390.34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2,405,607.93元，本期变动人民币-2,017,217.59元，本期末人民币388,390.34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	212,614,232.50	96.62
	其中：股票	212,614,232.50	96.62
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,169,413.50	0.53
	其中：债券	1,169,413.50	0.53
	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	5,215,705.51	2.37
8	其他各项资产	1,047,132.78	0.48
9	合计	220,046,484.29	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 积极投资按行业分类的股票投资组合：

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	760,735.22	0.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	125,499.94	0.06
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	899,001.48	0.41

7.2.1.2 指数投资按行业分类的股票投资组合：

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	7,927,879.00	3.63
C	制造业	97,169,585.88	44.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,210,564.96	2.84
E	建筑业	4,018,012.00	1.84
F	批发和零售业	6,654,311.00	3.04
G	交通运输、仓储和邮政业	8,393,086.00	3.84
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,358,520.32	1.08
J	金融业	38,776,360.42	17.74
K	房地产业	31,885,640.64	14.58
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	4,030,461.80	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	2,186,250.00	1.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	2,104,559.00	0.96
S	综合	—	—
	合计	211,715,231.02	96.83

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600511	国药股份	66,160	2,690,727.20	1.23
2	600197	伊力特	134,600	2,661,042.00	1.22
3	601012	隆基股份	65,100	2,651,523.00	1.21
4	000006	深振业A	386,000	2,628,660.00	1.20
5	002832	比音勒芬	147,800	2,530,336.00	1.16

6	603298	杭叉集团	223,840	2,466,716.80	1.13
7	600282	南钢股份	751,000	2,425,730.00	1.11
8	600053	九鼎投资	80,900	2,414,056.00	1.10
9	002601	龙蟠佰利	128,400	2,375,400.00	1.09
10	300418	昆仑万维	94,492	2,358,520.32	1.08
11	000951	中国重汽	74,718	2,335,684.68	1.07
12	600606	绿地控股	376,900	2,329,242.00	1.07
13	300596	利安隆	65,600	2,284,848.00	1.05
14	603198	迎驾贡酒	104,900	2,283,673.00	1.04
15	000708	中信特钢	133,200	2,276,388.00	1.04
16	002236	大华股份	118,400	2,274,464.00	1.04
17	002648	卫星石化	136,200	2,215,974.00	1.01
18	603609	禾丰牧业	147,800	2,202,220.00	1.01
19	603588	高能环境	187,500	2,186,250.00	1.00
20	002595	豪迈科技	112,200	2,183,412.00	1.00
21	601966	玲珑轮胎	107,800	2,177,560.00	1.00
22	002677	浙江美大	192,900	2,175,912.00	1.00
23	600612	老凤祥	45,100	2,173,369.00	0.99
24	603360	百傲化学	111,000	2,156,730.00	0.99
25	600326	西藏天路	302,100	2,150,952.00	0.98
26	002664	长鹰信质	162,600	2,149,572.00	0.98
27	601229	上海银行	256,570	2,129,531.00	0.97
28	601000	唐山港	953,100	2,125,413.00	0.97
29	600466	蓝光发展	393,700	2,122,043.00	0.97
30	600325	华发股份	299,600	2,115,176.00	0.97
31	601998	中信银行	409,000	2,106,350.00	0.96
32	601858	中国科传	234,100	2,104,559.00	0.96
33	000885	城发环境	210,600	2,103,894.00	0.96
34	600273	嘉化能源	240,600	2,102,844.00	0.96
35	601006	大秦铁路	298,400	2,100,736.00	0.96
36	600340	华夏幸福	91,724	2,096,810.64	0.96
37	600452	涪陵电力	145,272	2,096,274.96	0.96
38	600188	兖州煤业	239,200	2,095,392.00	0.96
39	002146	荣盛发展	258,600	2,094,660.00	0.96
40	002145	中核钛白	463,400	2,094,568.00	0.96
41	000672	上峰水泥	88,600	2,091,846.00	0.96
42	601216	君正集团	822,300	2,088,642.00	0.96
43	600886	国投电力	265,700	2,088,402.00	0.96
44	000069	华侨城A	344,200	2,085,852.00	0.95
45	000049	德赛电池	42,520	2,083,905.20	0.95
46	600383	金地集团	152,100	2,083,770.00	0.95

47	000789	万年青	161,900	2,083,653.00	0.95
48	000036	华联控股	472,600	2,079,440.00	0.95
49	600000	浦发银行	196,300	2,076,854.00	0.95
50	603165	荣晟环保	181,100	2,073,595.00	0.95
51	601169	北京银行	423,100	2,073,190.00	0.95
52	000848	承德露露	295,660	2,069,620.00	0.95
53	600908	无锡银行	421,500	2,069,565.00	0.95
54	002233	塔牌集团	172,000	2,069,160.00	0.95
55	000333	美的集团	34,600	2,068,734.00	0.95
56	002078	太阳纸业	216,800	2,063,936.00	0.94
57	002016	世荣兆业	315,500	2,063,370.00	0.94
58	600377	宁沪高速	210,300	2,063,043.00	0.94
59	600048	保利地产	139,500	2,061,810.00	0.94
60	002191	劲嘉股份	231,400	2,061,774.00	0.94
61	601233	桐昆股份	161,500	2,060,740.00	0.94
62	600557	康缘药业	148,000	2,060,160.00	0.94
63	601988	中国银行	591,900	2,059,812.00	0.94
64	601288	农业银行	609,400	2,059,772.00	0.94
65	000065	北方国际	281,600	2,058,496.00	0.94
66	000932	华菱钢铁	546,000	2,058,420.00	0.94
67	600782	新钢股份	503,700	2,055,096.00	0.94
68	000002	万科A	78,600	2,054,604.00	0.94
69	600016	民生银行	361,800	2,051,406.00	0.94
70	300284	苏交科	275,540	2,050,017.60	0.94
71	601939	建设银行	324,400	2,046,964.00	0.94
72	000718	苏宁环球	661,900	2,045,271.00	0.94
73	300320	海达股份	388,300	2,042,458.00	0.93
74	002110	三钢闽光	305,500	2,034,630.00	0.93
75	300497	富祥药业	103,960	2,034,497.20	0.93
76	001979	招商蛇口	123,400	2,028,696.00	0.93
77	601166	兴业银行	128,500	2,027,730.00	0.93
78	600995	文山电力	269,400	2,025,888.00	0.93
79	603368	柳药股份	87,964	2,018,773.80	0.92
80	603968	醋化股份	138,600	2,002,770.00	0.92
81	002142	宁波银行	76,046	1,997,728.42	0.91
82	600801	华新水泥	84,200	1,996,382.00	0.91
83	601155	新城控股	63,900	1,996,236.00	0.91
84	603018	中设集团	203,540	1,980,444.20	0.91
85	601636	旗滨集团	334,500	1,980,240.00	0.91
86	601398	工商银行	397,200	1,978,056.00	0.90
87	002128	露天煤业	255,000	1,976,250.00	0.90

88	600919	江苏银行	348,400	1,975,428.00	0.90
89	600036	招商银行	58,500	1,972,620.00	0.90
90	601668	中国建筑	410,800	1,959,516.00	0.90
91	601601	中国太保	71,500	1,948,375.00	0.89
92	600153	建发股份	240,100	1,944,810.00	0.89
93	601088	中国神华	135,100	1,940,036.00	0.89
94	601318	中国平安	27,100	1,934,940.00	0.88
95	601009	南京银行	263,900	1,934,387.00	0.88
96	601997	贵阳银行	268,100	1,919,596.00	0.88
97	600971	恒源煤电	419,300	1,916,201.00	0.88
98	000581	威孚高科	92,600	1,914,968.00	0.88
99	300599	雄塑科技	146,100	1,913,910.00	0.88
100	002035	华帝股份	188,700	1,911,531.00	0.87

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688518	联赢激光	14,111	293,932.13	0.13
2	688568	中科星图	7,507	121,688.47	0.06
3	688377	迪威尔	6,578	108,010.76	0.05
4	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.04
5	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.04
6	603087	甘李药业	817	81,945.10	0.04
7	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
8	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.01
9	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
10	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
11	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
12	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
13	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
14	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603198	迎驾贡酒	2,548,268.68	0.45
2	002832	比音勒芬	2,543,992.42	0.45
3	000708	中信特钢	2,482,299.47	0.44
4	600053	九鼎投资	2,482,026.00	0.44

5	002601	龙蟠佰利	2,462,924.00	0.44
6	002236	大华股份	2,459,029.28	0.44
7	600282	南钢股份	2,450,385.00	0.44
8	601858	中国科传	2,436,286.00	0.43
9	000885	城发环境	2,433,736.00	0.43
10	000789	万年青	2,430,541.71	0.43
11	600612	老凤祥	2,420,643.00	0.43
12	002145	中核钛白	2,412,602.00	0.43
13	300599	雄塑科技	2,410,242.00	0.43
14	000036	华联控股	2,409,462.80	0.43
15	603968	醋化股份	2,398,917.00	0.43
16	000932	华菱钢铁	2,391,065.86	0.43
17	603165	荣晟环保	2,389,848.32	0.43
18	603588	高能环境	2,387,574.56	0.43
19	600606	绿地控股	2,386,485.00	0.43
20	002664	长鹰信质	2,384,564.00	0.42

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002271	东方雨虹	8,706,656.02	1.55
2	002262	恩华药业	7,802,074.78	1.39
3	300396	迪瑞医疗	7,752,573.60	1.38
4	002174	游族网络	7,400,642.34	1.32
5	300427	红相股份	7,281,781.00	1.30
6	000895	双汇发展	7,119,935.19	1.27
7	000034	神州数码	6,819,489.81	1.21
8	002043	兔宝宝	6,617,648.00	1.18
9	300146	汤臣倍健	6,591,128.00	1.17
10	000501	鄂武商 A	6,392,411.89	1.14
11	300497	富祥药业	6,373,175.85	1.14
12	300232	洲明科技	6,356,610.68	1.13
13	000921	海信家电	6,255,684.30	1.11
14	300418	昆仑万维	6,194,547.09	1.10
15	000498	山东路桥	6,082,514.20	1.08
16	002293	罗莱生活	6,039,096.47	1.08
17	000902	新洋丰	5,811,802.96	1.04
18	300203	聚光科技	5,775,632.23	1.03
19	002462	嘉事堂	5,530,087.48	0.99
20	300415	伊之密	5,453,299.44	0.97

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	156,400,774.31
卖出股票收入（成交）总额	320,665,681.26

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	1,169,413.50	0.53
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,169,413.50	0.53

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127016	鲁泰转债	7,418	777,035.50	0.36
2	110069	瀚蓝转债	2,100	262,878.00	0.12
3	128113	比音转债	1,295	129,500.00	0.06

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本报告编制日前一年内，本基金持有的“龙蟒佰利”的发行主体龙蟒佰利集团股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：年产 12 万吨硫酸法钛白粉生产线未经竣工环境保护验收即投入生产的违法行为，河南省生态环境厅于 2019 年 11 月 19 日对公司做出责令限期六个月改正环境违法行为并给予罚款 40 万元的行政处罚（豫环罚决字〔2019〕5 号）；由于存在：公司年产 30 万吨硫氯耦合钛材料绿色制造项目主体工程已建成，配电设施、电器仪表系统和管线工程尚未建成，未依法报批建设项目环境影响评价文件的违法事实，河南省生态环

境厅于 2019 年 12 月 26 日对公司做出责令停止建设并处以 130 万元罚款的行政处罚（豫环罚决字〔2019〕7 号）；由于存在：公司组织建设的 100 万吨/年高盐废水深度治理项目，前期已被焦作市应急管理局要求停止建设，在项目未取得建设项目安全审查书的情况下，项目仍有开工行为的违法事实，焦作市应急管理局对公司做出责令停止建设，限期改正并罚款 100 万元的行政处罚（焦安监罚【2019】72 号）。龙麟佰利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 9 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。

7.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	90,087.70
2	应收证券清算款	880,049.67
3	应收股利	—
4	应收利息	1,585.52
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	75,409.89
8	其他	—
9	合计	1,047,132.78

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的	占基金资产净	流通受限情况说明
----	------	------	---------	--------	----------

			公允价值(元)	值比例(%)	
1	688518	联赢激光	293,932.13	0.13	新股限售
2	688568	中科星图	121,688.47	0.06	新股认购
3	688377	迪威尔	108,010.76	0.05	新股认购
4	688528	秦川物联	94,458.21	0.04	新股限售
5	688600	皖仪科技	84,754.00	0.04	新股认购

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
2,756	63,809.12	79,964,502.00	45.47	95,893,433.00	54.53

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中国建设银行股份有限公司—富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金	71,700,938	40.77
2	刘月明	5,000,000	2.84
3	赵士权	4,669,594	2.66
4	国信证券股份有限公司	4,522,278	2.57
5	中信证券股份有限公司	3,516,086	2.00
6	宋娜	1,871,800	1.06
7	梁开胜	1,500,000	0.85

8	李建辉	1,462,352	0.83
9	张颖燕	1,294,000	0.74
10	顾逸飞	1,278,700	0.73

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年11月07日)基金份额总额	951,857,935.00
报告期期初基金份额总额	477,857,935.00
本报告期基金总申购份额	24,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	326,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期末基金份额总额	175,857,935.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。
本报告期本基金管理人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
渤海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
长江证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
东北证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
东财证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
方正证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
高华证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
光大证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
广发证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
国海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
国信证券	2	470,485,050.01	100.00	986,073.93	100.00	—	—	—	—	397,662.98	100.00	
海通证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
华泰证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	

平安证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金退租券商交易单元：中信建投（21566）。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于提醒投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	规定披露媒介	2020年01月11日
2	富国基金管理有限公司关于旗下部分上海证券交易所跨市场交易型开放式指数证券投资基金申赎结算模式调整的公告	规定披露媒介	2020年01月15日
3	富国基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下公募基金基金合同的公告	规定披露媒介	2020年01月20日
4	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	规定披露媒介	2020年02月03日
5	富国基金管理有限公司关于旗下部分上市基金增加扩位证券简称的公告	规定披露媒介	2020年03月16日
6	富国基金管理有限公司关于旗下部分ETF调整指数许可使用费和根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订基金合同等法律文件的公告	规定披露媒介	2020年03月25日
7	富国基金管理有限公司关于增聘富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告	规定披露媒介	2020年05月21日
8	富国基金管理有限公司关于富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更的公告	规定披露媒介	2020年05月26日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2020-01-01 至 2020-06-30	197,263,238.00	146,837,700.00	272,400,000.00	71,700,938.00	40.77%
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>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

<p>一、本报告期，根据上海证券交易所联合中国证券登记结算有限责任公司发布的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则（2020 年修订）》和有关通知，基金管理人自 2020 年 1 月 20 日起对本基金的申赎结算模式进行了调整。具体可参见基金管理人于 2020 年 1 月 15 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分上海证券交易所跨市场交易型开放式指数证券投资基金申赎结算模式调整的公告》及本基金更新的招募说明书。</p> <p>二、本报告期，根据中证指数有限公司通知，基金管理人对本基金的指数许可使用费进行调整，调整后的收费下限自 2020 年第一季度起适用。具体可参见基金管理人于 2020 年 3 月 25 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 调整指数许可使用费和根据〈公开募集证券投资基金信息披露管理办法〉修订基金合同等法律文件的公告》及本基金更新的招募说明书。</p>

§ 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金	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

<p>的文件</p> <p>2、富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同</p> <p>3、富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金托管协议</p> <p>4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件</p> <p>5、富国中证价值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、报告期内在公司网站上披露的各项公告</p>		<p>司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址：http://www.fullgoal.com.cn。</p>
----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------