

富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）

二〇二一年中期报告

2021年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2021年08月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | | |
|-----|--|----|
| §1 | 重要提示及目录..... | 2 |
| 1.1 | 重要提示..... | 2 |
| 1.2 | 目录..... | 3 |
| §2 | 基金简介..... | 5 |
| 2.1 | 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 | 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 | 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 | 境外投资顾问和境外资产托管人..... | 6 |
| 2.5 | 信息披露方式..... | 7 |
| 2.6 | 其他相关资料..... | 7 |
| §3 | 主要财务指标、基金净值表现..... | 7 |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 | 基金净值表现..... | 8 |
| §4 | 管理人报告..... | 9 |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理..... | 9 |
| 4.2 | 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介..... | 10 |
| 4.3 | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.4 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 10 |
| 4.5 | 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明..... | 11 |
| 4.6 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 11 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 11 |
| 4.8 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| §5 | 托管人报告..... | 12 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| 5.3 | 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 12 |
| §6 | 中期财务报表(未经审计)..... | 12 |
| 6.1 | 资产负债表..... | 12 |
| 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..... | 36 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况..... | 36 |
| 7.2 | 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布..... | 36 |
| 7.3 | 期末按行业分类的权益投资组合..... | 36 |
| 7.4 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细..... | 37 |
| 7.5 | 报告期内权益投资组合的重大变动..... | 43 |
| 7.6 | 期末按债券信用等级分类的债券投资组合..... | 54 |
| 7.7 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 54 |

| | | |
|------|-----------------------------------|---------|
| 7.8 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | .54 |
| 7.9 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 | .54 |
| 7.10 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 |55 |
| 7.11 | 投资组合报告附注 |55 |
| §8 | 基金份额持有人信息 |56 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 |56 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 |56 |
| 8.3 | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 |56 |
| §9 | 开放式基金份额变动 |56 |
| §10 | 重大事件揭示 |57 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 |57 |
| 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 |57 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 |57 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 |57 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 |57 |
| 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 |57 |
| 10.7 | 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 |58 |
| 10.8 | 其他重大事件 |64 |
| §11 | 影响投资者决策的其他重要信息 |64 |
| 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 |64 |
| §12 | 备查文件目录 |64 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------------|-----------------------|
| 基金名称 | 富国红利精选混合型证券投资基金（QDII） |
| 基金简称 | 富国红利精选混合（QDII） |
| 基金主代码 | 009108 |
| 交易代码 | 009108 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020年04月23日 |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额（单位：份） | 443,432,149.65 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

注：本基金含人民币份额（份额代码：009108）及美元现汇份额（份额代码：009193），交易代码仅列示人民币份额代码。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金主要投资高股息股票，通过精选个股和严格风险控制，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 本基金投资于全球市场，包括境内市场和境外市场的高股息股票。本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例；本基金所指的红利策略是基金管理人从法律法规或监管机构允许投资的股票中，根据特定的筛选流程并结合管理人主动管理能力，精选高现金分红的上市公司股票构建的投资组合；对于境内发行的存托凭证投资，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资；本基金将进行以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，根据需要适度进行债券投资。本基金的资产支持证券投资策略和金融衍生工具投资策略详见法律文件。 |
| 业绩比较基准 | 恒生高股息率指数收益率（经汇率估值调整）*60%+中证红利指数收益率*30%+中债综合财富指数收益率*10%。 |

| | |
|--------|--|
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p> <p>本基金可通过港股通机制投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> |
|--------|--|

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|--------------------------------------|------------------------|
| 名称 | | 富国基金管理有限公司 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 赵瑛 | 张燕 |
| | 联系电话 | 021-20361818 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | public@fullgoal.com.cn | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 95105686、4008880688 | 95555 |
| 传真 | | 021-20361616 | 0755-83195201 |
| 注册地址 | | 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 邮政编码 | | 200120 | 518040 |
| 法定代表人 | | 裴长江 | 缪建民 |

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

2.5 信息披露方式

| | |
|---------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.fullgoal.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |

2.6 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021年01月01日至2021年06月30日) |
|---------------|------------------------------|
| 本期已实现收益 | 50,402,014.97 |
| 本期利润 | 79,688,657.98 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1986 |
| 本期加权平均净值利润率 | 11.19% |
| 本期基金份额净值增长率 | 22.10% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年06月30日) |
| 期末可供分配利润 | 265,426,233.50 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.5986 |
| 期末基金资产净值 | 848,789,205.50 |
| 期末基金份额净值 | 1.9141 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021年06月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 91.41% |

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。

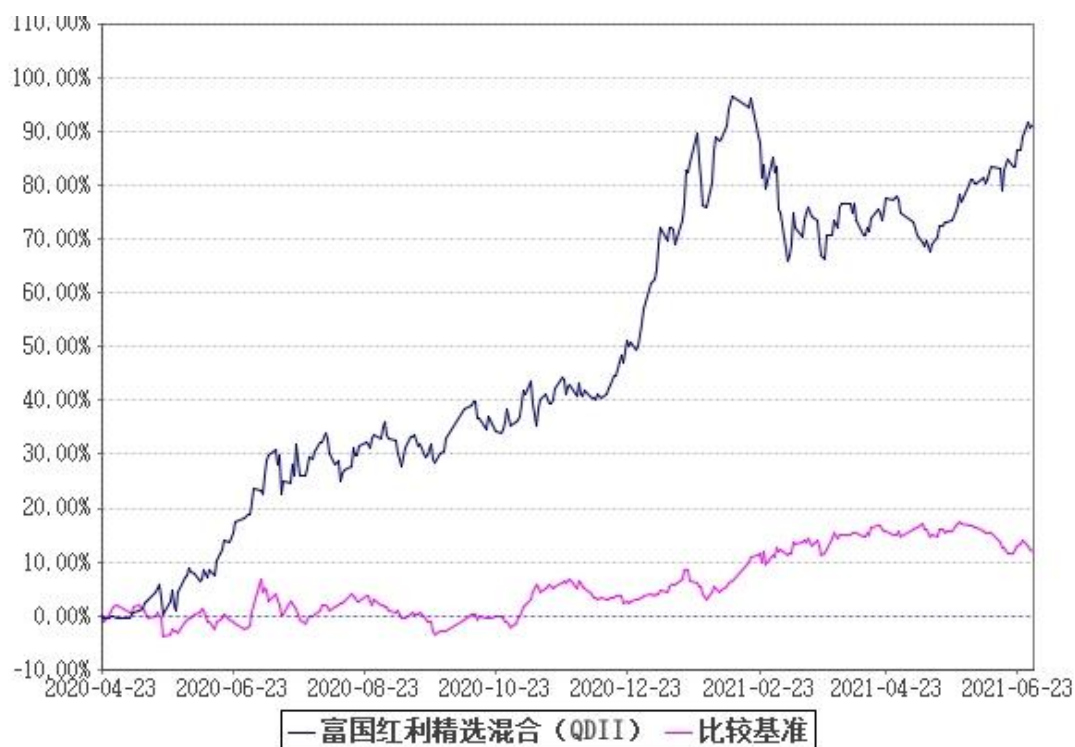
期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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 | 6.45% | 0.94% | -4.20% | 0.55% | 10.65% | 0.39% |
| 过去三个月 | 11.25% | 0.95% | -2.12% | 0.56% | 13.37% | 0.39% |
| 过去六个月 | 22.10% | 1.57% | 7.76% | 0.81% | 14.34% | 0.76% |
| 过去一年 | 60.93% | 1.58% | 14.46% | 0.86% | 46.47% | 0.72% |
| 自基金合同生效起至今 | 91.41% | 1.54% | 11.93% | 0.88% | 79.48% | 0.66% |

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



注: 1、截止日期为2021年6月30日。

2、本基金于2020年4月23日成立,建仓期6个月,从2020年4月23日起至2020年10月22日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 汪孟海 | 本基金基金经理 | 2020-04-23 | — | 11.0 | 博士，曾任中国人保资产管理股份有限公司研究员；自2014年8月加入富国基金管理有限公司，历任QDII基金经理助理、QDII基金经理、高级QDII基金经理、海外权益投资部海外权益投资副总监；现任富国基金海外权益投资部海外权益投资总监兼资深QDII基金经理。2015年10月起任富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017年12月起任富国沪港深行业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2017年12月至2021年1月任富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、富国研究 |

| | | | | | |
|-----|---------|------------|---|-----|---|
| | | | | | 优选沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年2月起任富国消费升级混合型证券投资基金基金经理，2020年4月起任富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）基金经理，2021年5月起任富国港股通策略精选混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。 |
| 王菀宜 | 本基金基金经理 | 2020-09-17 | — | 8.2 | 硕士，曾任工银国际股票研究员，摩根士丹利股票分析师，2017年4月起任富国资产管理（香港）有限公司高级研究员；自2018年7月加入富国基金管理有限公司，历任QDII投资经理；现任富国基金海外权益投资部QDII基金经理。2020年9月起任富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）基金经理。具有基金从业资格。 |

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包

括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年的一季度，市场波动较大。春节前，在流动性的推动下，AH 市场均表现出色；但是春节之后，两地市场均出现明显调整。我们保持组合的仓位中性，行业均衡。

2021 年二季度，我们整体加大了对新能源、医药的布局，降低了对互联网板块的布局。消费板块调整了结构。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.9141 元；份额累计净值为 1.9141 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 22.10%，同期业绩比较基准收益率为 7.76%

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为下半年经济会略有回落，但是基于经济的不确定性，流动性仍会保持适度的宽松。因为我们整体认为市场短期仍然偏向结构性机会。我们认为市场的焦点仍然集中在医药、消费、新能源车、光伏、军工、半导体等板块。

从操作的维度上，因为现金充裕，我们可以比较从容应对市场波动。我们认为市场的大幅波动提供了很多优质股票错杀的机会。而对于政策风险和监管风险方面，我们认为需要在未来的企业价值分析中，给予更高的权重。今年对我们是具有挑战的一年，我们非常感激投资者对我们的长期陪伴。也希望投资者对我们有信心。

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

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 中期财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 | 上年度末 |
|----|-----|------|
|----|-----|------|

| | (2021年06月30日) | (2020年12月31日) |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 资产: | | |
| 银行存款 | 124,340,802.18 | 39,722,524.03 |
| 结算备付金 | 656,131.34 | 350,642.63 |
| 存出保证金 | 57,247.54 | 35,180.79 |
| 交易性金融资产 | 734,112,795.94 | 287,460,551.67 |
| 其中: 股票投资 | 734,063,910.84 | 287,407,390.43 |
| 基金投资 | — | — |
| 债券投资 | 48,885.10 | 53,161.24 |
| 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 | 4,387,790.52 | 6,681,203.60 |
| 应收利息 | 3,863.48 | 1,030.23 |
| 应收股利 | 2,864,657.67 | 52,530.38 |
| 应收申购款 | 5,738,006.18 | 2,538,616.81 |
| 递延所得税资产 | — | — |
| 其他资产 | — | — |
| 资产总计 | 872,161,294.85 | 336,842,280.14 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 | 上年度末 |
| | (2021年06月30日) | (2020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 | 3,553,035.63 | 1,127,116.05 |
| 应付赎回款 | 18,138,135.48 | 6,308,690.15 |
| 应付管理人报酬 | 1,009,698.02 | 392,950.72 |
| 应付托管费 | 235,596.17 | 91,688.51 |
| 应付销售服务费 | — | — |
| 应付交易费用 | 254,409.30 | 157,089.26 |
| 应交税费 | — | — |
| 应付利息 | — | — |
| 应付利润 | — | — |
| 递延所得税负债 | — | — |
| 其他负债 | 181,214.75 | 156,326.16 |
| 负债合计 | 23,372,089.35 | 8,233,860.85 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 443,432,149.65 | 209,612,649.30 |
| 未分配利润 | 405,357,055.85 | 118,995,769.99 |
| 所有者权益合计 | 848,789,205.50 | 328,608,419.29 |

| | | |
|------------|----------------|----------------|
| 负债和所有者权益总计 | 872,161,294.85 | 336,842,280.14 |
|------------|----------------|----------------|

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.9141 元，基金份额总额 443,432,149.65 份。

6.2 利润表

会计主体：富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 (2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日) | 上年度可比期间 (2020 年 4 月 23 日(基 金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日) |
|----------------------------|---|---|
| 一、收入 | 92,424,495.91 | 53,508,190.21 |
| 1. 利息收入 | 64,279.98 | 29,406.91 |
| 其中：存款利息收入 | 64,263.40 | 29,406.91 |
| 债券利息收入 | 16.58 | — |
| 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） | 63,348,256.53 | 11,901,655.41 |
| 其中：股票投资收益 | 57,935,578.70 | 11,055,269.02 |
| 基金投资收益 | — | — |
| 债券投资收益 | — | — |
| 资产支持证券投资收益 | — | — |
| 贵金属投资收益 | — | — |
| 衍生工具投资收益 | — | — |
| 股利收益 | 5,412,677.83 | 846,386.39 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 29,286,643.01 | 41,602,429.71 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | -1,436,382.26 | -897,095.98 |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 1,161,698.65 | 871,794.16 |
| 减：二、费用 | 12,735,837.93 | 2,024,411.27 |
| 1. 管理人报酬 | 5,308,056.98 | 894,748.40 |
| 2. 托管费 | 1,238,546.62 | 208,774.62 |
| 3. 销售服务费 | — | — |
| 4. 交易费用 | 6,008,642.02 | 864,455.67 |
| 5. 利息支出 | — | — |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | — | — |
| 6. 税金及附加 | — | — |
| 7. 其他费用 | 180,592.31 | 56,432.58 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 79,688,657.98 | 51,483,778.94 |

| | | |
|--------------------------|---------------|---------------|
| 减：所得税费用 | — | — |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 79,688,657.98 | 51,483,778.94 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 (2021年01月01日至2021年06月30日) | | |
|--|---|-----------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 209,612,649.30 | 118,995,769.99 | 328,608,419.29 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | — | 79,688,657.98 | 79,688,657.98 |
| 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） | 233,819,500.35 | 206,672,627.88 | 440,492,128.23 |
| 其中：1. 基金申购款 | 447,741,707.67 | 370,031,408.88 | 817,773,116.55 |
| 2. 基金赎回款 | -213,922,207.32 | -163,358,781.00 | -377,280,988.32 |
| 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） | 443,432,149.65 | 405,357,055.85 | 848,789,205.50 |
| 项目 | 上年度可比期间(2020年4月23日(基金合同生效日) 至2020年6月30日) | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 399,940,741.74 | — | 399,940,741.74 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | — | 51,483,778.94 | 51,483,778.94 |
| 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） | -192,927,159.30 | -12,276,536.72 | -205,203,696.02 |
| 其中：1. 基金申购款 | 23,946,377.27 | 1,896,142.06 | 25,842,519.33 |
| 2. 基金赎回款 | -216,873,536.57 | -14,172,678.78 | -231,046,215.35 |
| 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） | 207,013,582.44 | 39,207,242.22 | 246,220,824.66 |

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

富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]277号《关于准予富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司自2020年3月30日至2020年4月17日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2020）验字第60467606_B17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2020年4月23日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币399,912,190.80元，在募集期间产生的存款利息人民币28,550.94元，以上实收基金（本息）合计为人民币399,940,741.74元，折合399,940,741.74份基金份额，其中人民币份额376,510,263.11份；美元现汇份额23,430,478.63份。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

本基金投资于境内境外市场。

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

针对境内投资，本基金可投资于国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生产品（股指期货、国债期货）；法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

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

基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为60%-95%，其中投资于本基金界定的红利精选股票及存托凭证的比例不低于非现金基金资产的80%；本基金投资于境外资产的比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终在扣除需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金投资于全球市场，包括境内市场和境外市场的高股息股票，其中主要境外市场有：香港等国家或地区。香港市场可通过合格境内机构投资者境外投资额度和港股通机制进行投资。如果法律法规对上述比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩基准为：恒生高股息率指数收益率（经汇率估值调整）*60%+中证红利指数收益率*30%+中债综合财富指数收益率*10%

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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；

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；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

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（2021年06月30日） |
|--------------|------------------|
| 活期存款 | 124,340,802.18 |
| 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 | 124,340,802.18 |

注：

| 币种 | 2021年6月30日 | | |
|----|---------------|--------|---------------|
| | 外币金额 | 折算汇率 | 折合人民币 |
| 港币 | 62,657,149.25 | 0.8321 | 52,135,760.75 |
| 美元 | 4,870,119.20 | 6.4601 | 31,461,457.04 |
| 合计 | | | 83,597,217.79 |

6.4.7.2交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2021年06月30日） | | |
|---------------|------------------|----------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 659,313,458.08 | 734,063,910.84 | 74,750,452.76 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | — | — | — |
| 债券 | 交易所市场 | 48,885.10 | 7,085.10 |
| | 银行间市场 | — | — |
| | 合计 | 48,885.10 | 7,085.10 |
| 资产支持证券 | — | — | — |
| 基金 | — | — | — |
| 其他 | — | — | — |
| 合计 | 659,355,258.08 | 734,112,795.94 | 74,757,537.86 |

6.4.7.3衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2021年06月30日） |
|------------|------------------|
| 应收活期存款利息 | 3,520.49 |
| 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 | 295.20 |
| 应收债券利息 | 21.99 |
| 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 | 25.80 |
| 合计 | 3,863.48 |

6.4.7.6其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2021年06月30日） |
|-------------|------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 254,409.30 |
| 银行间市场应付交易费用 | — |
| 合计 | 254,409.30 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2021年06月30日） |
|-------------|------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | — |
| 应付赎回费 | 46,419.56 |
| 应付证券出借违约金 | — |
| 预提信息披露费 | 60,000.00 |
| 预提审计费 | 74,795.19 |
| 合计 | 181,214.75 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期（2021年01月01日至2021年06月30日） | |
|---------------|-----------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 209,612,649.30 | 209,612,649.30 |
| 本期申购 | 447,741,707.67 | 447,741,707.67 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -213,922,207.32 | -213,922,207.32 |
| 本期末 | 443,432,149.65 | 443,432,149.65 |

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 | 84,187,306.52 | 34,808,463.47 | 118,995,769.99 |
| 本期利润 | 50,402,014.97 | 29,286,643.01 | 79,688,657.98 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 130,836,912.01 | 75,835,715.87 | 206,672,627.88 |
| 其中：基金申购款 | 258,886,566.36 | 111,144,842.52 | 370,031,408.88 |
| 基金赎回款 | -128,049,654.35 | -35,309,126.65 | -163,358,781.00 |
| 本期已分配利润 | — | — | — |
| 本期末 | 265,426,233.50 | 139,930,822.35 | 405,357,055.85 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2021年01月01日至2021年06月30日） |
|-----------|-----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 59,384.07 |
| 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 | 2,675.94 |
| 其他 | 2,203.39 |
| 合计 | 64,263.40 |

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2021年01月01日至2021年06月30日） |
|------------|-----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 2,036,304,859.10 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,978,369,280.40 |
| 买卖股票差价收入 | 57,935,578.70 |

6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

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

| | |
|---------------|--------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 5,412,677.83 |
| 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 | 5,412,677.83 |

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期（2021年01月01日至2021年06月30日） |
|------------------------|-----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 29,286,643.01 |
| 股票投资 | 29,290,919.15 |
| 债券投资 | -4,276.14 |
| 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 | 29,286,643.01 |

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2021年01月01日至2021年06月30日） |
|---------|-----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,161,698.65 |
| 合计 | 1,161,698.65 |

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2021年01月01日至2021年06月30日） |
|-----------|-----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 6,008,642.02 |
| 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 | 6,008,642.02 |

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2021年01月01日至2021年06月30日） |
|---------|-----------------------------|
| 审计费用 | 24,795.19 |
| 信息披露费 | 60,000.00 |
| 证券出借违约金 | — |

| | |
|------|------------|
| 银行费用 | 53,347.46 |
| 其他 | 42,449.66 |
| 合计 | 180,592.31 |

6.4.7.22 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|---------------------|
| 富国基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 申万宏源证券有限公司（“申万宏源”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 招商银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 香港上海汇丰银行有限公司（“汇丰银行”） | 基金境外托管行 |
| 海通国际证券有限公司（“海通香港”） | 基金管理人的股东控制的子公司 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期(2021年01月01日至2021年06月30日) | | 上年度可比期间(2020年4月23日(基金合同生效日)至2020年6月30日) | |
|-----------------------|-----------------------------|-----------------|---|-----------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) |
| 申万宏源 | 104,419,840.55 | 2.36 | 18,986,322.00 | 3.17 |
| HAITONG INTERNATIONAL | 1,067,207,688.35 | 24.09 | 0.00 | 0.00 |

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2021年01月01日至2021年06月30日） | | | |
|-----------------------|---|---------------|-----------|-----------------|
| | 佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 申万宏源 | 95,158.11 | 4.12 | 72,556.94 | 28.52 |
| HAITONG INTERNATIONAL | 533,604.00 | 23.10 | 0.00 | 0.00 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间（2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日） | | | |
| | 佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 申万宏源 | 17,302.27 | 5.02 | 17,302.27 | 32.43 |

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2021年01月01日至2021年06月30日） | 上年度可比期间（2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日） |
|-----------------|-----------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 5,308,056.98 | 894,748.40 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,735,875.07 | 370,154.30 |

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期(2021年01月01日至 2021年06月30日) | 上年度可比期间(2020年4月 23日(基金合同生效日)至2020 年6月30日) |
|----------------|---------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,238,546.62 | 208,774.62 |

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2021年01月01日至2021年06月30日） | | 上年度可比期间（2020年4月23日（基金合同生效日）至2020年6月30日） | |
|--------------|-----------------------------|-----------|---|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 香港上海汇丰银行有限公司 | 70,747,596.74 | 434.77 | 34,254,777.25 | 240.22 |
| 招商银行股份有限公司 | 53,593,205.44 | 58,949.30 | 19,067,596.10 | 28,873.88 |

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金无其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---------|------|------------|------------|--------|-------|--------|--------------|-----------|------------|----|
| 605162 | 新中港 | 2021-06-29 | 2021-07-07 | 新股认购 | 6.07 | 6.07 | 1,377 | 8,358.39 | 8,358.39 | — |
| 605287 | 德才股份 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 新股认购 | 31.56 | 31.56 | 349 | 11,014.44 | 11,014.44 | — |
| 688087 | 英科再生 | 2021-06-30 | 2021-07-09 | 新股认购 | 21.96 | 21.96 | 2,469 | 54,219.24 | 54,219.24 | — |
| 688226 | 威腾电气 | 2021-06-28 | 2021-07-07 | 新股认购 | 6.42 | 6.42 | 2,693 | 17,289.06 | 17,289.06 | — |
| 688239 | 航宇科技 | 2021-06-25 | 2021-07-05 | 新股认购 | 11.48 | 11.48 | 4,926 | 56,550.48 | 56,550.48 | — |
| 688367 | 工大高科 | 2021-06-21 | 2021-12-28 | 新股限售 | 11.53 | 17.94 | 1,717 | 19,797.01 | 30,802.98 | — |
| 688499 | 利元亨 | 2021-06-23 | 2022-01-03 | 新股限售 | 38.85 | 38.85 | 2,149 | 83,488.65 | 83,488.65 | — |
| 688601 | 力芯微 | 2021-06-18 | 2021-12-28 | 新股限售 | 36.48 | 133.69 | 1,174 | 42,827.52 | 156,952.06 | — |
| 2190 HK | 归创通桥 | 2021-06-28 | 2021-07-05 | 认购新发 | 42.70 | 35.53 | 500 | 17,764.27 | 17,764.91 | — |

| | | | | | | | | | | |
|--|--|--|--|----|--|--|--|--|--|--|
| | | | | 证券 | | | | | | |
|--|--|--|--|----|--|--|--|--|--|--|

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上上市公司公告为准。表中 2190 HK 的认购价格为港币计价，估值单价、期末成本总额及期末估值总额均为人民币计价，计算方式为按照期末汇率 0.83208 折算。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 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（2021年06月30日） | 上年度末（2020年12月31日） |
|--------|------------------|-------------------|
| AAA | — | — |
| AAA 以下 | 48,885.10 | 53,161.24 |
| 未评级 | — | — |
| 合计 | 48,885.10 | 53,161.24 |

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。本基金除在6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过合同及法规规定。本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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

单位：人民币元

| 本期末（2021年06月30日） | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|----------------|-------|-----------|------|------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 124,340,802.18 | — | — | — | — | — | 124,340,802.18 |
| 结算备付金 | 656,131.34 | — | — | — | — | — | 656,131.34 |
| 存出保证金 | 57,247.54 | — | — | — | — | — | 57,247.54 |
| 交易性金融资产 | — | — | 48,885.10 | — | — | 734,063,910.84 | 734,112,795.94 |
| 应收证券清算款 | — | — | — | — | — | 4,387,790.52 | 4,387,790.52 |
| 应收利息 | — | — | — | — | — | 3,863.48 | 3,863.48 |
| 应收股利 | — | — | — | — | — | 2,864,657.67 | 2,864,657.67 |
| 应收申购款 | 203,861.65 | — | — | — | — | 5,534,144.53 | 5,738,006.18 |
| 资产总计 | 125,258,042.71 | — | 48,885.10 | — | — | 746,854,367.04 | 872,161,294.85 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | — | — | — | — | — | 3,553,035.63 | 3,553,035.63 |
| 应付赎回款 | — | — | — | — | — | 18,138,135.48 | 18,138,135.48 |
| 应付管理人报酬 | — | — | — | — | — | 1,009,698.02 | 1,009,698.02 |
| 应付托管费 | — | — | — | — | — | 235,596.17 | 235,596.17 |
| 应付交易费用 | — | — | — | — | — | 254,409.30 | 254,409.30 |
| 其他负债 | — | — | — | — | — | 181,214.75 | 181,214.75 |
| 负债总计 | — | — | — | — | — | 23,372,089.35 | 23,372,089.35 |
| 利率敏感度缺口 | 125,258,042.71 | — | 48,885.10 | — | — | 723,482,277.69 | 848,789,205.50 |
| 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 | 39,722,524.03 | — | — | — | — | — | 39,722,524.03 |
| 结算备付金 | 350,642.63 | — | — | — | — | — | 350,642.63 |
| 存出保证金 | 35,180.79 | — | — | — | — | — | 35,180.79 |
| 交易性金融资产 | — | — | 53,161.24 | — | — | 287,407,390.43 | 287,460,551.67 |
| 应收证券清算款 | — | — | — | — | — | 6,681,203.60 | 6,681,203.60 |
| 应收利息 | — | — | — | — | — | 1,030.23 | 1,030.23 |
| 应收股利 | — | — | — | — | — | 52,530.38 | 52,530.38 |
| 应收申购款 | 70,624.44 | — | — | — | — | 2,467,992.37 | 2,538,616.81 |
| 资产总计 | 40,178,971.89 | — | 53,161.24 | — | — | 296,610,147.01 | 336,842,280.14 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | — | — | — | — | — | 1,127,116.05 | 1,127,116.05 |
| 应付赎回款 | — | — | — | — | — | 6,308,690.15 | 6,308,690.15 |
| 应付管理人报酬 | — | — | — | — | — | 392,950.72 | 392,950.72 |
| 应付托管费 | — | — | — | — | — | 91,688.51 | 91,688.51 |
| 应付交易费用 | — | — | — | — | — | 157,089.26 | 157,089.26 |
| 其他负债 | — | — | — | — | — | 156,326.16 | 156,326.16 |
| 负债总计 | — | — | — | — | — | 8,233,860.85 | 8,233,860.85 |
| 利率敏感度缺口 | 40,178,971.89 | — | 53,161.24 | — | — | 288,376,286.16 | 328,608,419.29 |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2021年06月30日） | | | | |
|---------------|-------------------|----------------|---------|---------------|----------------|
| | 美元 折合人民币 | 港币 折合人民币 | 欧元折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | | |
| 银行存款 | 31,461,457.04 | 52,135,760.75 | — | — | 83,597,217.79 |
| 交易性金融资产 | 92,088,952.06 | 524,338,016.11 | — | — | 616,426,968.17 |
| 应收股利 | — | 2,696,504.37 | — | — | 2,696,504.37 |
| 应收证券清算款 | 299,185.84 | — | — | — | 299,185.84 |
| 应收利息 | 53.04 | — | — | — | 53.04 |
| 应收申购款 | 2,748,716.35 | — | — | — | 2,748,716.35 |
| 资产合计 | 126,598,364.33 | 579,170,281.23 | — | — | 705,768,645.56 |
| 以外币计价的负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | — | 3,553,035.63 | — | — | 3,553,035.63 |
| 应付赎回款 | 2,076,044.35 | — | — | — | 2,076,044.35 |
| 其他负债 | 4,943.07 | — | — | — | 4,943.07 |
| 负债合计 | 2,080,987.42 | 3,553,035.63 | — | — | 5,634,023.05 |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 124,517,376.91 | 575,617,245.60 | — | — | 700,134,622.51 |
| 项目 | 上年度末（2020年12月31日） | | | | |
| | 美元 折合人民币 | 港币 折合人民币 | 欧元折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | | |
| 银行存款 | 11,201,472.39 | 24,659,454.93 | — | — | 35,860,927.32 |
| 交易性金融资产 | 37,837,992.98 | 203,708,201.62 | — | — | 241,546,194.60 |
| 应收股利 | 24,598.87 | 27,931.51 | — | — | 52,530.38 |
| 应收证券清算款 | — | 5,489,492.03 | — | — | 5,489,492.03 |
| 应收利息 | 12.98 | — | — | — | 12.98 |
| 应收申购款 | 1,273,234.14 | — | — | — | 1,273,234.14 |
| 资产合计 | 50,337,311.36 | 233,885,080.09 | — | — | 284,222,391.45 |
| 以外币计价的负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | 1,127,116.05 | — | — | — | 1,127,116.05 |
| 应付赎回款 | 403,586.34 | — | — | — | 403,586.34 |

| | | | | | |
|---------------|---------------|----------------|---|---|----------------|
| 其他负债 | 487.48 | — | — | — | 487.48 |
| 负债合计 | 1,531,189.87 | — | — | — | 1,531,189.87 |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 48,806,121.49 | 233,885,080.09 | — | — | 282,691,201.58 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| | | | |
|----|---|--------------------------|-------------------|
| 假设 | (1) 假设本基金的单一外币汇率变化 1%，其他变量不变；(2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元） | |
| | | 本期末(2021年06月30日) | 上年度末(2020年12月31日) |
| | 港币相对人民币贬值 1% | -5,756,172.46 | -2,338,850.80 |
| | 港币相对人民币升值 1% | 5,756,172.46 | 2,338,850.80 |
| | 美元相对人民币贬值 1% | -1,245,173.77 | -488,061.21 |
| | 美元相对人民币升值 1% | 1,245,173.77 | 488,061.21 |

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。本基金的投资范围包括但不限于在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的股票，在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含 ETF）、债券、货币市场工具、金融衍生品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要求）。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资于境内境外市场。

针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含交易型开放式指数基金 ETF）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股

票；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品。

针对境内投资，本基金可投资于国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生产品（股指期货、国债期货）；法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

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

基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中投资于本基金界定的红利精选股票及存托凭证的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金投资于境外资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金投资于全球市场，包括境内市场和境外市场的高股息股票，其中主要境外市场有：香港等国家或地区。香港市场可通过合格境内机构投资者境外投资额度和港股通机制进行投资。如果法律法规对上述比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2021年06月30日） | | 上年度末（2020年12月31日） | |
|---------------|------------------|--------------|-------------------|--------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资 | 734,063,910.84 | 86.48 | 287,407,390.43 | 87.46 |
| 交易性金融资产—基金投资 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—债券投资 | 48,885.10 | 0.01 | 53,161.24 | 0.02 |
| 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 | 734,112,795.94 | 86.49 | 287,460,551.67 | 87.48 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩

比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

| | | | |
|---------------|--|--------------------------|-------------------|
| 假设 | 1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元） | |
| | | 本期末（2021年06月30日） | 上年度末（2020年12月31日） |
| | 1. 业绩比较基准增加1% | 7,733,826.16 | 2,047,699.40 |
| 2. 业绩比较基准减少1% | -7,733,826.16 | -2,047,699.40 | |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币733,676,355.73元，属于第二层次的余额为人民币165,196.52元，属于第三层次余额为人民币271,243.69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1,714,383.21元，本期变动人民币-1,443,139.52元，本期末人民币271,243.69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 | 734,063,910.84 | 84.17 |
| | 其中：普通股 | 659,902,278.93 | 75.66 |
| | 存托凭证 | 74,161,631.91 | 8.50 |
| | 房地产信托凭证 | — | — |
| 2 | 基金投资 | — | — |
| 3 | 固定收益投资 | 48,885.10 | 0.01 |
| | 其中：债券 | 48,885.10 | 0.01 |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 4 | 金融衍生品投资 | — | — |
| | 其中：远期 | — | — |
| | 期货 | — | — |
| | 期权 | — | — |
| | 权证 | — | — |
| 5 | 买入返售金融资产 | — | — |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 6 | 货币市场工具 | — | — |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 124,996,933.52 | 14.33 |
| 8 | 其他各项资产 | 13,051,565.39 | 1.50 |
| 9 | 合计 | 872,161,294.85 | 100.00 |

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|--------|----------------|---------------|
| 中国香港 | 524,338,016.11 | 61.77 |
| 美国 | 92,088,952.06 | 10.85 |
| 中国大陆 | 117,636,942.67 | 13.86 |
| 合计 | 734,063,910.84 | 86.48 |

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|----------------|--------------|
| 日常消费品 | 131,338,784.45 | 15.47 |
| 非日常生活消费品 | 112,890,639.03 | 13.30 |
| 医疗保健 | 100,319,874.33 | 11.82 |
| 工业 | 81,731,534.92 | 9.63 |
| 通信服务 | 69,588,347.87 | 8.20 |
| 房地产 | 67,902,079.78 | 8.00 |
| 公用事业 | 61,792,380.94 | 7.28 |
| 信息技术 | 50,295,309.85 | 5.93 |
| 原材料 | 44,032,192.42 | 5.19 |
| 能源 | 7,196,410.30 | 0.85 |
| 金融 | 6,976,356.95 | 0.82 |
| 合计 | 734,063,910.84 | 86.48 |

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

7.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称 (英文) | 公司名称 (中文) | 证券 代码 | 所在证券 市场 | 所属国家 (地区) | 数量 (股) | 公允 价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) |
|----|--|--------------|----------|-------------|--------------|-----------|---------------|--------------------------|
| 1 | Towngas China Company Limited | 港华燃气 | 1083 | 香港联合交 易所 | 中国香港 | 12935000 | 61,779,360.55 | 7.28 |
| 2 | Tencent Holdings Ltd | 腾讯控股 | 700 | 香港联合交 易所 | 中国香港 | 82800 | 40,235,394.82 | 4.74 |
| 3 | Simcere Pharmaceutic al Group Limited | 先声药业 | 2096 | 香港联合交 易所 | 中国香港 | 2976000 | 34,618,255.72 | 4.08 |
| 4 | China Overseas Property Holdings Limited | 中海物业 | 2669 | 香港联合交 易所 | 中国香港 | 4745000 | 32,770,222.68 | 3.86 |
| 5 | Tsingtao Brewery Company Limited | 青岛啤酒股份 | 168 | 香港联合交 易所 | 中国香港 | 440000 | 30,607,230.72 | 3.61 |
| 6 | Zhou Hei Ya Internationa l Holdings | 周黑鸭 | 1458 | 香港联合交 易所 | 中国香港 | 3375500 | 26,148,867.03 | 3.08 |

| | | | | | | | | |
|----|---|------------------------------|--------|---------|------|---------|---------------|------|
| | Company Limited | | | | | | | |
| 7 | China Resources Beer (Holdings) Company Limited | 华润啤酒 | 291 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 417000 | 24,201,670.86 | 2.85 |
| 8 | China Mengniu Dairy Co. Ltd. | 蒙牛乳业 | 2319 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 619000 | 24,181,950.56 | 2.85 |
| 9 | Sunac Services Holdings Limited | 融创服务 | 1516 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 945000 | 22,685,205.06 | 2.67 |
| 10 | Contemporary Amperex Technology Co., Limited | 宁德时代 | 300750 | 深圳证券交易所 | 中国大陆 | 41300 | 22,087,240.00 | 2.60 |
| 11 | MORIMATSU INTERNATIONAL HOLD | MORIMATSU INTERNATIONAL HOLD | 2155 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 3171000 | 21,292,902.24 | 2.51 |
| 12 | Jiangsu Cnano Technology Co., Ltd. | 天奈科技 | 688116 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 170000 | 20,060,000.00 | 2.36 |
| 13 | Frontage Holdings Corporation | 方达控股 | 1521 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 2910000 | 19,976,160.60 | 2.35 |
| 14 | Kweichow Moutai Co., Ltd. | 贵州茅台 | 600519 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 9200 | 18,921,640.00 | 2.23 |
| 15 | Pharmaron Beijing Co., Ltd. | 康龙化成 | 3759 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 109400 | 18,843,117.26 | 2.22 |
| 16 | Ganfeng Lithium Co., Ltd. | 赣锋锂业 | 1772 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 184800 | 17,837,132.54 | 2.10 |
| 17 | Riyue Heavy Industry Co, Ltd | 日月股份 | 603218 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 584500 | 15,828,260.00 | 1.86 |
| 18 | JA Solar Technology Co., Ltd. | 晶澳科技 | 002459 | 深圳证券交易所 | 中国大陆 | 280000 | 13,720,000.00 | 1.62 |

| | | | | | | | | |
|----|---|---------------------|--------|-------------|------|---------|---------------|------|
| 19 | CSPC Pharmaceutic al Group Limited | 石药集团 | 1093 | 香港联合交 易所 | 中国香港 | 1420000 | 13,280,662.46 | 1.56 |
| 20 | Tesla, Inc. | 特斯拉 | TSLA | 美国证券交 易所 | 美国 | 3000 | 13,172,789.91 | 1.55 |
| 21 | Sea Ltd | SEA | SE | 美国证券交 易所 | 美国 | 6901 | 12,241,983.82 | 1.44 |
| 22 | SJM Holdings Limited | 澳博控股 | 880 | 香港联合交 易所 | 中国香港 | 1730000 | 12,206,946.43 | 1.44 |
| 23 | Haier Smart Home Co., Ltd. | 海尔智家 | 6690 | 香港联合交 易所 | 中国香港 | 502600 | 11,333,312.36 | 1.34 |
| 24 | ANTA Sports Products Limited | 安踏体育 | 2020 | 香港联合交 易所 | 中国香港 | 72000 | 10,951,504.13 | 1.29 |
| 25 | Meituan | 美团-W | 3690 | 香港联合交 易所 | 中国香港 | 41000 | 10,930,535.71 | 1.29 |
| 26 | Li Auto Inc. | 理想汽车 (LI AUTO) | LI | 美国证券交 易所 | 美国 | 47000 | 10,608,647.02 | 1.25 |
| 27 | S-Enjoy Service Group Co., Limited | 新城悦服务 | 1755 | 香港联合交 易所 | 中国香港 | 508000 | 9,975,640.70 | 1.18 |
| 28 | Semiconducto r Manufacturin g Internationa l Corporation | 中芯国际 | 981 | 香港联合交 易所 | 中国香港 | 455000 | 9,048,453.96 | 1.07 |
| 29 | Huazhu Group Limited | 华住 | HTHT | 美国证券交 易所 | 美国 | 26000 | 8,870,104.91 | 1.05 |
| 30 | China Resources Mixc Lifestyle Services Limited | 华润万象生活 | 1209 | 香港联合交 易所 | 中国香港 | 199200 | 8,809,630.36 | 1.04 |
| 31 | Pinduoduo Inc. | 拼多多 | PDD | 美国证券交 易所 | 美国 | 10200 | 8,369,731.40 | 0.99 |
| 32 | HUAZHU GROUP LTD | HUAZHU GROUP LTD | 2943 | 香港联合交 易所 | 中国香港 | 220500 | 7,641,677.11 | 0.90 |
| 33 | China Tourism Group Duty | 中国中免 | 601888 | 上海证券交 易所 | 中国大陆 | 25000 | 7,502,500.00 | 0.88 |

| | | | | | | | | |
|----|--|--------------|--------|---------|------|---------|--------------|------|
| | Free Corporation Limited | | | | | | | |
| 34 | Joy Spreader Interactive Technology. Ltd | 乐享互动 | 6988 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 2801000 | 7,388,179.77 | 0.87 |
| 35 | China Suntien Green Energy Corporation Limited | 新天绿色能源 | 956 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 2270000 | 7,196,410.30 | 0.85 |
| 36 | Futu Holdings Ltd | 富途控股 | FUTU | 美国证券交易所 | 美国 | 6000 | 6,941,635.85 | 0.82 |
| 37 | JinkoSolar Holding Co., Ltd. | 晶科能源 | JKS | 美国证券交易所 | 美国 | 18000 | 6,514,106.44 | 0.77 |
| 38 | Alphamab Oncology | 康宁杰瑞制药-B | 9966 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 311000 | 6,430,605.47 | 0.76 |
| 39 | Zijin Mining Group Company Limited | 紫金矿业 | 2899 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 700000 | 6,080,840.64 | 0.72 |
| 40 | NIO Inc. | 蔚来 | NIO | 美国证券交易所 | 美国 | 17500 | 6,014,353.10 | 0.71 |
| 41 | Ascentage Pharma Group International | 亚盛医药-B | 6855 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 150000 | 5,866,164.00 | 0.69 |
| 42 | Longi Green Energy Technology Co., Ltd. | 隆基股份 | 601012 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 62720 | 5,572,044.80 | 0.66 |
| 43 | Flat Glass Group Co., Ltd | 福莱特玻璃 | 6865 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 203000 | 5,405,191.68 | 0.64 |
| 44 | Baidu, Inc. | 百度 | BIDU | 美国证券交易所 | 美国 | 4000 | 5,268,857.56 | 0.62 |
| 45 | XPeng Inc. | 小鹏汽车 (XPENG) | XPEV | 美国证券交易所 | 美国 | 17000 | 4,878,279.91 | 0.57 |
| 46 | ACM Research, Inc. | ACM RESEARCH | ACMR | 美国证券交易所 | 美国 | 7200 | 4,754,530.24 | 0.56 |
| 47 | QUICK INTELLIGENT EQUIPMENT | 快克股份 | 603203 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 158880 | 4,462,939.20 | 0.53 |

| | | | | | | | | |
|----|--|--------|--------|---------|------|--------|--------------|------|
| | CO., LTD. | | | | | | | |
| 48 | Joy Inc. | 欢聚 | YY | 美国证券交易所 | 美国 | 10451 | 4,453,931.90 | 0.52 |
| 49 | Smooore International Holdings Limited | 思摩尔国际 | 6969 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 120000 | 4,298,525.28 | 0.51 |
| 50 | Xinyi Solar Holdings Limited | 信义光能 | 968 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 300000 | 4,183,698.24 | 0.49 |
| 51 | Jinke Smart Services Group Co., Ltd. | 金科服务 | 9666 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 60000 | 3,637,021.68 | 0.43 |
| 52 | Wuliangye Yibin Co., Ltd | 五粮液 | 000858 | 深圳证券交易所 | 中国大陆 | 10000 | 2,978,900.00 | 0.35 |
| 53 | Sany Heavy Industry Co., Ltd. | 三一重工 | 600031 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 100000 | 2,907,000.00 | 0.34 |
| 54 | Arcotech Solar Holding Co., Ltd. | 中信博 | 688408 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 13880 | 2,787,104.00 | 0.33 |
| 55 | Luoyang Glass Company Limited | 洛阳玻璃股份 | 1108 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 192000 | 1,635,935.85 | 0.19 |
| 56 | Aidigong Maternal & Child Health Limited | 爱帝宫 | 286 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 930000 | 936,339.62 | 0.11 |
| 57 | Hua Hong Semiconductor Limited | 华虹半导体 | 1347 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 26000 | 928,102.03 | 0.11 |
| 58 | L. K. Technology Holdings Limited | 力劲科技 | 558 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 40000 | 538,522.18 | 0.06 |
| 59 | Fuyao Glass Industry Group Co., Ltd. | 福耀玻璃 | 3606 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 7600 | 345,912.30 | 0.04 |
| 60 | 威高骨科 | 威高骨科 | 688161 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 3069 | 325,467.45 | 0.04 |
| 61 | 力芯微 | 力芯微 | 688601 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 1174 | 156,952.06 | 0.02 |

| | | | | | | | | |
|----|--|------------------------------|--------|---------|------|------|-----------|------|
| | | | | 易所 | | | | |
| 62 | 利元亨 | 利元亨 | 688499 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 2149 | 83,488.65 | 0.01 |
| 63 | 航宇科技 | 航宇科技 | 688239 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 4926 | 56,550.48 | 0.01 |
| 64 | 英科再生 | 英科再生 | 688087 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 2469 | 54,219.24 | 0.01 |
| 65 | 瑞丰银行 | 瑞丰银行 | 601528 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 2230 | 34,721.10 | 0.00 |
| 66 | New Oriental Education & Technology Group Inc. | 新东方-S | 9901 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 600 | 31,951.87 | 0.00 |
| 67 | 工大高科 | 工大高科 | 688367 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 1717 | 30,802.98 | 0.00 |
| 68 | CARSGEN THERAPEUTICS HOLDING | CARSGEN THERAPEUTICS HOLDING | 2171 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 1000 | 25,336.84 | 0.00 |
| 69 | China Yongda Automobiles Services Holdings Limited | 永达汽车 | 3669 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 2000 | 23,131.82 | 0.00 |
| 70 | ZYLOX-TONBRIDGE MEDICAL TECH | ZYLOX-TONBRIDGE MEDICAL TECH | 2190 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 500 | 17,764.91 | 0.00 |
| 71 | 威腾电气 | 威腾电气 | 688226 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 2693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 72 | 华菱线缆 | 华菱线缆 | 001208 | 深圳证券交易所 | 中国大陆 | 1754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 73 | 税友股份 | 税友股份 | 603171 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 637 | 12,230.40 | 0.00 |
| 74 | 德才股份 | 德才股份 | 605287 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 349 | 11,014.44 | 0.00 |
| 75 | Jd Health International Inc. | 京东健康 | 6618 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 100 | 9,261.05 | 0.00 |
| 76 | 新中港 | 新中港 | 605162 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 1377 | 8,358.39 | 0.00 |
| 77 | 杭州热电 | 杭州热电 | 605011 | 上海证券交易所 | 中国大陆 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 78 | CIMC Vehicles (Group) Co., | 中集车辆 | 1839 | 香港联合交易所 | 中国香港 | 500 | 3,286.72 | 0.00 |

Ltd.

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--|---------|---------------|----------------|
| 1 | Baidu, Inc. | BIDU US | 69,579,724.97 | 21.17 |
| 2 | Tencent Holdings Ltd | 700 HK | 61,252,857.65 | 18.64 |
| 3 | Zhou Hei Ya International Holdings Company Limited | 1458 HK | 50,485,476.59 | 15.36 |
| 4 | Towngas China Company Limited | 1083 HK | 47,880,672.27 | 14.57 |
| 5 | China Overseas Property Holdings Limited | 2669 HK | 47,733,734.15 | 14.53 |
| 6 | Country Garden Services Holdings Company Limited | 6098 HK | 46,661,563.64 | 14.20 |
| 7 | China Mobile Limited | 941 HK | 43,363,747.76 | 13.20 |
| 8 | Xinte Energy Co., Ltd. | 1799 HK | 42,753,815.03 | 13.01 |
| 9 | Vipshop Holdings Ltd | VIPS US | 41,139,439.06 | 12.52 |
| 10 | Sunac Services Holdings Limited | 1516 HK | 39,998,668.45 | 12.17 |
| 11 | Techtronic Industries Co. Ltd. | 669 HK | 38,767,041.85 | 11.80 |
| 12 | Tsingtao Brewery Company Limited | 168 HK | 37,996,066.60 | 11.56 |
| 13 | China Mengniu Dairy Co. Ltd. | 2319 HK | 36,614,756.98 | 11.14 |
| 14 | Meituan | 3690 HK | 34,253,255.47 | 10.42 |
| 15 | China Resources Beer (Holdings) Company Limited | 291 HK | 32,658,405.48 | 9.94 |
| 16 | Simcere Pharmaceutical Group Limited | 2096 HK | 32,016,042.81 | 9.74 |

| | | | | |
|----|---|---------|---------------|------|
| 17 | Joyy Inc. | YY US | 31,941,759.13 | 9.72 |
| 18 | China Overseas Land & Investment Ltd. | 688 HK | 31,276,816.20 | 9.52 |
| 19 | Longfor Group Holdings Limited | 960 HK | 30,107,203.53 | 9.16 |
| 20 | China Resources Land Limited | 1109 HK | 28,692,569.64 | 8.73 |
| 21 | GCL-Poly Energy Holdings Limited | 3800 HK | 27,028,717.50 | 8.23 |
| 22 | Sea Ltd | SE US | 26,288,445.56 | 8.00 |
| 23 | Pinduoduo Inc. | PDD US | 25,878,890.32 | 7.88 |
| 24 | Geely Automobile Holdings Limited | 175 HK | 25,850,719.50 | 7.87 |
| 25 | Smoore International Holdings Limited | 6969 HK | 25,758,341.29 | 7.84 |
| 26 | Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd. | 3898 HK | 25,508,060.45 | 7.76 |
| 27 | S-Enjoy Service Group Co., Limited | 1755 HK | 23,938,554.69 | 7.28 |
| 28 | Semiconductor Manufacturing International Corporation | 981 HK | 23,651,537.51 | 7.20 |
| 29 | Industrial and Commercial Bank of China Limited | 1398 HK | 22,890,820.20 | 6.97 |
| 30 | Haier Smart Home Co., Ltd. | 6690 HK | 22,422,736.89 | 6.82 |
| 31 | Hygeia Healthcare Holdings Co., Limited | 6078 HK | 22,252,963.09 | 6.77 |
| 32 | CanSino Biologics Inc. | 6185 HK | 21,883,039.04 | 6.66 |
| 33 | The Hong Kong and China Gas Co. Ltd. | 3 HK | 21,853,801.71 | 6.65 |
| 34 | SJM Holdings Limited | 880 HK | 21,701,344.94 | 6.60 |
| 35 | Cathay Media And Education Group | 1981 HK | 21,536,128.57 | 6.55 |

| | Inc. | | | |
|----|---|-----------|---------------|------|
| 36 | Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd. | 2318 HK | 21,377,502.19 | 6.51 |
| 37 | Kingsoft Cloud Holdings Ltd | KC US | 21,350,939.31 | 6.50 |
| 38 | ANTA Sports Products Limited | 2020 HK | 21,300,240.85 | 6.48 |
| 39 | Shimao Services Holdings Limited | 873 HK | 21,090,191.49 | 6.42 |
| 40 | CNOOC Limited | 883 HK | 20,413,094.09 | 6.21 |
| 41 | Tesla, Inc. | TSLA US | 20,133,894.88 | 6.13 |
| 42 | Sunny Optical Technology (Group) Company Limited | 2382 HK | 20,038,186.45 | 6.10 |
| 43 | KWG Living Group Holdings Limited | 3913 HK | 19,967,249.67 | 6.08 |
| 44 | China Datang Corporation Renewable Power Co., Limited | 1798 HK | 19,805,489.67 | 6.03 |
| 45 | Futu Holdings Ltd | FUTU US | 19,690,516.41 | 5.99 |
| 46 | Jinke Smart Services Group Co., Ltd. | 9666 HK | 19,278,467.77 | 5.87 |
| 47 | Nine Dragons Paper (Holdings) Limited | 2689 HK | 19,152,661.26 | 5.83 |
| 48 | MORIMATSU INTERNATIONAL HOLD | 2155 HK | 19,117,368.09 | 5.82 |
| 49 | Bilibili Inc. | BILI US | 18,667,535.47 | 5.68 |
| 50 | Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd. | 002304 SZ | 18,064,748.00 | 5.50 |
| 51 | Contemporary Amperex Technology Co., Limited | 300750 SZ | 18,014,292.80 | 5.48 |
| 52 | Gree Electric Appliances, Inc. | 000651 SZ | 17,849,597.00 | 5.43 |

| | | | | |
|----|--|-----------|---------------|------|
| | of Zhuhai | | | |
| 53 | China Resources Gas Group Limited | 1193 HK | 17,745,640.53 | 5.40 |
| 54 | Postal Savings Bank of China Co.,Ltd. | 1658 HK | 17,685,879.41 | 5.38 |
| 55 | Joy Spreader Interactive Technology. Ltd | 6988 HK | 17,648,268.63 | 5.37 |
| 56 | Kweichow Moutai Co.,Ltd. | 600519 SH | 17,172,656.00 | 5.23 |
| 57 | Xiaomi Corporation | 1810 HK | 16,372,954.08 | 4.98 |
| 58 | Ganfeng Lithium Co., Ltd. | 1772 HK | 16,248,703.53 | 4.94 |
| 59 | Poly Property Services Co., Ltd. | 6049 HK | 16,079,340.94 | 4.89 |
| 60 | Riyue Heavy Industry Co,Ltd | 603218 SH | 16,078,621.00 | 4.89 |
| 61 | China Longyuan Power Group Corporation Limited | 916 HK | 16,058,358.11 | 4.89 |
| 62 | Huazhu Group Limited | HTHT US | 15,279,314.22 | 4.65 |
| 63 | Frontage Holdings Corporation | 1521 HK | 15,086,562.13 | 4.59 |
| 64 | Wuxi Biologics (Cayman) Inc | 2269 HK | 14,590,795.44 | 4.44 |
| 65 | Ningbo Tuopu Group Co., Ltd. | 601689 SH | 14,516,758.58 | 4.42 |
| 66 | JinkoSolar Holding Co., Ltd. | JKS US | 14,503,563.05 | 4.41 |
| 67 | Wuliangye Yibin Co.,Ltd | 000858 SZ | 14,462,000.00 | 4.40 |
| 68 | Xinyi Electric Storage Holdings Limited | 8328 HK | 14,281,151.93 | 4.35 |
| 69 | CSPC Pharmaceutical Group Limited | 1093 HK | 14,221,130.04 | 4.33 |
| 70 | iClick | ICLK US | 14,045,383.11 | 4.27 |

| | | | | |
|----|---|-----------|---------------|------|
| | Interactive Asia Group Ltd | | | |
| 71 | Weimob Inc. | 2013 HK | 13,856,298.23 | 4.22 |
| 72 | Modern Dental Group Limited | 3600 HK | 13,810,391.69 | 4.20 |
| 73 | Sany Heavy Industry Co.,Ltd. | 600031 SH | 13,057,668.00 | 3.97 |
| 74 | China Kepei Education Group Limited | 1890 HK | 12,999,432.21 | 3.96 |
| 75 | Jiangsu Cnano Technology Co.,Ltd. | 688116 SH | 12,869,663.88 | 3.92 |
| 76 | Yalla Group Ltd | YALA US | 12,311,342.44 | 3.75 |
| 77 | Pharmaron Beijing Co., Ltd. | 3759 HK | 12,287,382.71 | 3.74 |
| 78 | Alphamab Oncology | 9966 HK | 11,569,676.49 | 3.52 |
| 79 | Aidigong Maternal & Child Health Limited | 286 HK | 11,223,963.90 | 3.42 |
| 80 | Edvantage Group Holdings Limited | 382 HK | 11,132,814.18 | 3.39 |
| 81 | Shanghai Fosun Pharmaceutical (Group) Co., Ltd. | 2196 HK | 11,132,766.95 | 3.39 |
| 82 | China Resources Mixc Lifestyle Services Limited | 1209 HK | 11,027,372.12 | 3.36 |
| 83 | Zijin Mining Group Company Limited | 2899 HK | 10,737,013.93 | 3.27 |
| 84 | Hua Hong Semiconductor Limited | 1347 HK | 10,710,977.88 | 3.26 |
| 85 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. | TSM US | 10,607,839.95 | 3.23 |
| 86 | Shenzhen International Group Holdings Ltd. | 2313 HK | 10,310,427.40 | 3.14 |
| 87 | Shanghai Junshi | 1877 HK | 9,901,878.73 | 3.01 |

| | | | | |
|-----|--|-----------|--------------|------|
| | Biosciences Co., Ltd. | | | |
| 88 | DAQO NEW ENERGY CORP. | DQ US | 9,625,605.39 | 2.93 |
| 89 | JA Solar Technology Co., Ltd. | 002459 SZ | 9,464,757.90 | 2.88 |
| 90 | RLX Technology Inc. | RLX US | 9,287,441.35 | 2.83 |
| 91 | CREE INC | CREE US | 8,754,347.05 | 2.66 |
| 92 | Sunac China Holdings Limited | 1918 HK | 8,563,135.88 | 2.61 |
| 93 | Shandong Hualu-Hengsheng Chemical Co., Ltd | 600426 SH | 8,421,669.16 | 2.56 |
| 94 | Kingsoft Corporation Limited | 3888 HK | 8,354,158.87 | 2.54 |
| 95 | Fuyao Glass Industry Group Co., Ltd. | 3606 HK | 8,261,487.41 | 2.51 |
| 96 | CMGE Technology Group Limited | 302 HK | 8,120,945.44 | 2.47 |
| 97 | KWG Group Holdings Limited | 1813 HK | 7,908,102.24 | 2.41 |
| 98 | Greentown Service Group Co. Ltd. | 2869 HK | 7,835,827.44 | 2.38 |
| 99 | Chifeng Jilong Gold Mining Co., Ltd. | 600988 SH | 7,728,579.00 | 2.35 |
| 100 | HUAZHU GROUP LTD | 2943 HK | 7,720,343.40 | 2.35 |
| 101 | China Yongda Automobiles Services Holdings Limited | 3669 HK | 7,652,870.80 | 2.33 |
| 102 | New Oriental Education & Technology Group Inc. | EDU US | 7,555,471.56 | 2.30 |
| | | 9901 HK | 72,614.55 | 0.02 |
| 103 | China Tourism Group Duty Free Corporation Limited | 601888 SH | 7,547,591.00 | 2.30 |

| | | | | |
|-----|--|-----------|--------------|------|
| 104 | China Hongqiao Group Limited | 1378 HK | 7,521,067.35 | 2.29 |
| 105 | Powerlong Commercial Management Holdings Limited | 9909 HK | 7,301,938.10 | 2.22 |
| 106 | Zhongsheng Group Holdings Ltd | 881 HK | 7,254,352.71 | 2.21 |
| 107 | Li Auto Inc. | LI US | 7,219,683.23 | 2.20 |
| 108 | Innovent Biologics, Inc. | 1801 HK | 6,970,528.90 | 2.12 |
| 109 | China Suntien Green Energy Corporation Limited | 956 HK | 6,970,204.30 | 2.12 |
| 110 | Jiangsu Goodwe Power Supply Technology Co., Ltd | 688390 SH | 6,952,519.78 | 2.12 |
| 111 | HUALI INDUSTRIAL GROUP CO -A | 300979 SZ | 6,792,318.52 | 2.07 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--|---------|---------------|----------------|
| 1 | Baidu, Inc. | BIDU US | 69,754,300.32 | 21.23 |
| 2 | Country Garden Services Holdings Company Limited | 6098 HK | 51,422,359.87 | 15.65 |
| 3 | China Mobile Limited | 941 HK | 41,094,740.26 | 12.51 |
| 4 | Vipshop Holdings Ltd | VIPS US | 39,489,986.27 | 12.02 |
| 5 | Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd. | 2318 HK | 38,042,427.26 | 11.58 |
| 6 | Techtronic Industries Co. Ltd. | 669 HK | 37,598,657.45 | 11.44 |
| 7 | Xinte Energy Co., Ltd. | 1799 HK | 36,534,349.14 | 11.12 |
| 8 | Geely Automobile Holdings Limited | 175 HK | 36,533,709.36 | 11.12 |
| 9 | Tencent Holdings Ltd | 700 HK | 35,620,899.78 | 10.84 |
| 10 | China Overseas Land & | 688 HK | 31,025,055.37 | 9.44 |

| | | | | |
|----|---|---------|---------------|------|
| | Investment Ltd. | | | |
| 11 | Jinke Smart Services Group Co., Ltd. | 9666 HK | 29,833,058.78 | 9.08 |
| 12 | Longfor Group Holdings Limited | 960 HK | 29,784,840.46 | 9.06 |
| 13 | GCL-Poly Energy Holdings Limited | 3800 HK | 28,757,968.75 | 8.75 |
| 14 | Sea Ltd | SE US | 28,492,829.59 | 8.67 |
| 15 | China Resources Land Limited | 1109 HK | 28,077,356.85 | 8.54 |
| 16 | CanSino Biologics Inc. | 6185 HK | 27,913,180.99 | 8.49 |
| 17 | Xiaomi Corporation | 1810 HK | 26,902,671.61 | 8.19 |
| 18 | Sunny Optical Technology (Group) Company Limited | 2382 HK | 26,082,133.86 | 7.94 |
| 19 | Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd. | 3898 HK | 25,456,868.91 | 7.75 |
| 20 | Zhou Hei Ya International Holdings Company Limited | 1458 HK | 25,423,555.58 | 7.74 |
| 21 | China Overseas Property Holdings Limited | 2669 HK | 24,656,909.86 | 7.50 |
| 22 | China Datang Corporation Renewable Power Co., Limited | 1798 HK | 24,022,575.95 | 7.31 |
| 23 | Haier Smart Home Co., Ltd. | 6690 HK | 23,479,677.05 | 7.15 |
| 24 | Meituan | 3690 HK | 23,187,030.13 | 7.06 |
| 25 | Sunac Services Holdings Limited | 1516 HK | 22,961,406.62 | 6.99 |
| 26 | Hygeia Healthcare Holdings Co., Limited | 6078 HK | 22,869,875.00 | 6.96 |
| 27 | Industrial and Commercial Bank of China Limited | 1398 HK | 22,813,567.62 | 6.94 |
| 28 | Kingsoft Cloud Holdings Ltd | KC US | 22,160,403.17 | 6.74 |
| 29 | The Hong Kong and China Gas Co. Ltd. | 3 HK | 22,052,959.72 | 6.71 |

| | | | | |
|----|---|-----------|---------------|------|
| 30 | Modern Dental Group Limited | 3600 HK | 21,846,068.38 | 6.65 |
| 31 | Shimao Services Holdings Limited | 873 HK | 20,882,586.10 | 6.36 |
| 32 | CNOOC Limited | 883 HK | 20,559,327.16 | 6.26 |
| 33 | China Resources Gas Group Limited | 1193 HK | 20,511,849.23 | 6.24 |
| 34 | Bilibili Inc. | BILI US | 20,476,391.27 | 6.23 |
| 35 | KWG Living Group Holdings Limited | 3913 HK | 20,198,443.68 | 6.15 |
| 36 | Cathay Media And Education Group Inc. | 1981 HK | 19,900,584.26 | 6.06 |
| 37 | Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd. | 002304 SZ | 18,640,607.00 | 5.67 |
| 38 | Xinyi Electric Storage Holdings Limited | 8328 HK | 18,413,760.49 | 5.60 |
| 39 | Postal Savings Bank of China Co., Ltd. | 1658 HK | 17,980,863.22 | 5.47 |
| 40 | Pinduoduo Inc. | PDD US | 17,821,046.82 | 5.42 |
| 41 | Semiconductor Manufacturing International Corporation | 981 HK | 17,771,924.27 | 5.41 |
| 42 | China Longyuan Power Group Corporation Limited | 916 HK | 17,633,861.13 | 5.37 |
| 43 | iClick Interactive Asia Group Ltd | ICLK US | 17,515,326.61 | 5.33 |
| 44 | Wuxi Biologics (Cayman) Inc | 2269 HK | 17,496,881.90 | 5.32 |
| 45 | Joyy Inc. | YY US | 17,406,514.06 | 5.30 |
| 46 | Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai | 000651 SZ | 17,218,599.28 | 5.24 |
| 47 | DAQO NEW ENERGY CORP. | DQ US | 17,176,439.16 | 5.23 |
| 48 | Tsingtao Brewery Company Limited | 168 HK | 16,831,150.39 | 5.12 |
| 49 | ANTA Sports Products Limited | 2020 HK | 16,825,849.49 | 5.12 |
| 50 | Huazhu Group Limited | HTHT US | 16,656,002.85 | 5.07 |
| 51 | Nine Dragons Paper | 2689 HK | 16,619,709.81 | 5.06 |

| | | | | |
|----|---|-----------|---------------|------|
| | (Holdings) Limited | | | |
| 52 | Smooore International Holdings Limited | 6969 HK | 16,335,639.83 | 4.97 |
| 53 | Zhongsheng Group Holdings Ltd | 881 HK | 16,059,898.22 | 4.89 |
| 54 | Ningbo Tuopu Group Co., Ltd. | 601689 SH | 15,927,818.50 | 4.85 |
| 55 | China Resources Mixc Lifestyle Services Limited | 1209 HK | 15,510,249.46 | 4.72 |
| 56 | Weimob Inc. | 2013 HK | 15,507,121.63 | 4.72 |
| 57 | Poly Property Services Co., Ltd. | 6049 HK | 15,197,049.84 | 4.62 |
| 58 | Pharmaron Beijing Co., Ltd. | 3759 HK | 15,101,205.51 | 4.60 |
| 59 | S-Enjoy Service Group Co., Limited | 1755 HK | 13,755,149.15 | 4.19 |
| 60 | Innovent Biologics, Inc. | 1801 HK | 13,412,620.45 | 4.08 |
| 61 | Sungrow Power Supply Co., Ltd. | 300274 SZ | 13,192,501.85 | 4.01 |
| 62 | Futu Holdings Ltd | FUTU US | 13,094,493.10 | 3.99 |
| 63 | China Kepei Education Group Limited | 1890 HK | 13,070,977.83 | 3.98 |
| 64 | China Mengniu Dairy Co. Ltd. | 2319 HK | 13,019,138.02 | 3.96 |
| 65 | CREE INC | CREE US | 12,511,111.32 | 3.81 |
| 66 | Pylon Technologies Co., Ltd. | 688063 SH | 12,364,632.32 | 3.76 |
| 67 | Shanghai Fosun Pharmaceutical (Group) Co., Ltd. | 2196 HK | 11,955,007.24 | 3.64 |
| 68 | Wuliangye Yibin Co., Ltd | 000858 SZ | 11,741,800.00 | 3.57 |
| 69 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. | TSM US | 11,613,737.37 | 3.53 |
| 70 | Aidigong Maternal & Child Health Limited | 286 HK | 11,554,840.67 | 3.52 |
| 71 | Akeso, Inc. | 9926 HK | 11,403,654.30 | 3.47 |
| 72 | Edvantage Group Holdings Limited | 382 HK | 11,169,995.67 | 3.40 |
| 73 | EVE Energy Co., Ltd. | 300014 SZ | 10,850,669.00 | 3.30 |

| | | | | |
|----|--|-----------|---------------|------|
| 74 | Shenzhou International Group Holdings Ltd. | 2313 HK | 10,750,473.11 | 3.27 |
| 75 | Shanghai Junshi Biosciences Co., Ltd. | 1877 HK | 10,478,631.94 | 3.19 |
| 76 | China Yongda Automobiles Services Holdings Limited | 3669 HK | 10,412,721.75 | 3.17 |
| 77 | Xinyi Solar Holdings Limited | 968 HK | 10,252,953.84 | 3.12 |
| 78 | Yalla Group Ltd | YALA US | 10,197,478.65 | 3.10 |
| 79 | China Resources Beer (Holdings) Company Limited | 291 HK | 9,910,146.24 | 3.02 |
| 80 | Sincere Pharmaceutical Group Limited | 2096 HK | 9,595,627.32 | 2.92 |
| 81 | RLX Technology Inc. | RLX US | 9,587,050.16 | 2.92 |
| 82 | CMGE Technology Group Limited | 302 HK | 8,788,092.42 | 2.67 |
| 83 | OPT Machine Vision Tech Co., Ltd. | 688686 SH | 8,745,684.68 | 2.66 |
| 84 | Alphamab Oncology | 9966 HK | 8,586,814.63 | 2.61 |
| 85 | Sunac China Holdings Limited | 1918 HK | 8,196,822.20 | 2.49 |
| 86 | Joy Spreader Interactive Technology. Ltd | 6988 HK | 8,173,473.70 | 2.49 |
| 87 | Greentown Service Group Co. Ltd. | 2869 HK | 8,065,190.06 | 2.45 |
| 88 | Chifeng Jilong Gold Mining Co., Ltd. | 600988 SH | 7,843,056.64 | 2.39 |
| 89 | JinkoSolar Holding Co., Ltd. | JKS US | 7,605,007.56 | 2.31 |
| 90 | Fuyao Glass Industry Group Co., Ltd. | 3606 HK | 7,578,290.21 | 2.31 |
| 91 | Kingsoft Corporation Limited | 3888 HK | 7,538,310.97 | 2.29 |
| 92 | Shandong Hualu-Hengsheng Chemical Co., Ltd | 600426 SH | 7,430,180.00 | 2.26 |
| 93 | HUALI INDUSTRIAL GROUP CO -A | 300979 SZ | 7,288,788.00 | 2.22 |

| | | | | |
|-----|--|-----------|--------------|------|
| 94 | China Hongqiao Group Limited | 1378 HK | 7,003,137.87 | 2.13 |
| 95 | Hua Hong Semiconductor Limited | 1347 HK | 6,977,198.82 | 2.12 |
| 96 | SJM Holdings Limited | 880 HK | 6,924,959.97 | 2.11 |
| 97 | Tesla, Inc. | TSLA US | 6,886,246.33 | 2.10 |
| 98 | Man Wah Holdings Limited | 1999 HK | 6,870,372.67 | 2.09 |
| 99 | KWG Group Holdings Limited | 1813 HK | 6,830,847.40 | 2.08 |
| 100 | Jiangsu Goodwe Power Supply Technology Co., Ltd | 688390 SH | 6,749,336.40 | 2.05 |
| 101 | China Yuhua Education Corporation Limited | 6169 HK | 6,737,992.31 | 2.05 |
| 102 | Powerlong Commercial Management Holdings Limited | 9909 HK | 6,661,687.40 | 2.03 |
| 103 | China Modern Dairy Holdings Ltd. | 1117 HK | 6,612,208.15 | 2.01 |

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

| | |
|------------|------------------|
| 买入成本（成交）总额 | 2,395,734,881.66 |
| 卖出收入（成交）总额 | 2,036,304,859.10 |

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 债券信用等级 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|-----------|--------------|
| AA+至 AA- | 48,885.10 | 0.01 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----|-----------|--------------|
| 1 | 128136 | 立讯转债 | 418 | 48,885.10 | 0.01 |

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

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

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

7.11.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 57,247.54 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,387,790.52 |
| 3 | 应收股利 | 2,864,657.67 |
| 4 | 应收利息 | 3,863.48 |
| 5 | 应收申购款 | 5,738,006.18 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 13,051,565.39 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|--------------|
| 1 | 128136 | 立讯转债 | 48,885.10 | 0.01 |

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|-----------|---------------|-----------|----------------|-----------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例(%) | 持有份额 | 占总份额比例(%) |
| 19,105 | 23,210.27 | 34,542,070.08 | 7.79 | 408,890,079.57 | 92.21 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例(%) |
|-------------------|--------------|-------------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本基金 | 1,397,065.75 | 0.3151 |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 10~50 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2020年04月23日)基金份额总额 | 399,940,741.74 |
| 报告期期初基金份额总额 | 209,612,649.30 |

| | |
|---------------|----------------|
| 本报告期基金总申购份额 | 447,741,707.67 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 213,922,207.32 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 443,432,149.65 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 基金交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|--------|--------------|-----------------|------|-----------------|--------|-----------------|------|-----------------|------|-----------------|-----------|---------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例(%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | |
| ABCI Securities Co. Ltd | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| ANZ | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| BNP Paribas | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| BOC HONG KONG BRANCH | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| BOCI Security Limited | 0 | 9,496,149.08 | 0.21 | — | — | — | — | — | — | — | — | 9,496.15 | 0.41 | — |
| BOCOM International | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| CCB International | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| CEB International Capital Corporation Limited | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |

| | | | | | | | | | | | | | | |
|---|---|---------------|------|---|---|---|---|---|---|---|---|-----------|------|---|
| CIMB Securities Ltd | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| CITIC BANK | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| CITIC Securities | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| CLSA | 0 | 698,607.46 | 0.02 | — | — | — | — | — | — | — | — | 6,986.07 | 0.30 | — |
| CMFU | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| CTI Capital Management | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Cathay Securities Hong Kong Limited | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| China Everbright Securities HK Limited | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| China Galaxy International Financial Holdings Limited | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| China Industrial Securities | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| China International Capital Corp LTD | 0 | 83,420,006.67 | 1.88 | — | — | — | — | — | — | — | — | 58,120.69 | 2.52 | — |
| China Merchant International | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| China Merchants Securities | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |

| | | | | | | | | | | | | | | |
|---|---|------------------|-------|---|---|---|---|---|---|---|---|------------|-------|---|
| China Renaissance | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| China Securities International | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Citigroup Global Markets Limited | 0 | 796,419,308.98 | 17.97 | — | — | — | — | — | — | — | — | 638,589.55 | 27.65 | — |
| Credit Suisse | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| DBS Vickers | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Daiwa Capital Markets HK Limited | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Deutsche Bank | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Essence International Securities | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| First Shanghai Securities | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| GF Securities HK | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Goldman Sachs | 0 | 2,010,476,436.67 | 45.37 | — | — | — | — | — | — | — | — | 639,564.14 | 27.69 | — |
| Guo Yuan Securities Hong Kong Ltd | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Guosen Securities HK Financial Holding CO LTD | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Guotai Junan Securities HK | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |

| | | | | | | | | | | | | | | |
|------------------------------------|---|------------------|-------|---|---|---|---|---|---|---|---|------------|-------|---|
| HAITONG INTERNATIONAL | 0 | 1,067,207,688.35 | 24.09 | — | — | — | — | — | — | — | — | 533,604.00 | 23.10 | — |
| HSBC | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Huatai Financial Holdings | 0 | 14,196,102.31 | 0.32 | — | — | — | — | — | — | — | — | 14,196.10 | 0.61 | — |
| ICBC International Securities | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Instinet Pacific Limited | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| JPMorgan | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Jefferies | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Macquarie Bank Limited | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Merrill Lynch | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Mizuho Securities International | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Morgan Stanley | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Nomura International | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Orient Securities HongKong Limited | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Shenwan Hongyuan Securites H.K. | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Standard Chartered Bank | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |

| | | | | | | | | | | | | | | |
|---|---|----------------|------|---|---|---|---|---|---|---|---|-----------|------|---|
| UBS Securities Asia Limited | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| UOB Kay Hian Hongkong Limited | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| Zhongtai International Securities Limited | 0 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 长城证券 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 德邦证券 | 2 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 东方证券 | 2 | 22,037,624.70 | 0.50 | — | — | — | — | — | — | — | — | 20,082.64 | 0.87 | — |
| 国金证券 | 2 | 2,491,350.55 | 0.06 | — | — | — | — | — | — | — | — | 2,270.37 | 0.10 | — |
| 国泰君安 | 1 | 22,165,935.20 | 0.50 | — | — | — | — | — | — | — | — | 20,199.38 | 0.87 | — |
| 国信证券 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 恒泰证券 | 2 | 7,456,400.00 | 0.17 | — | — | — | — | — | — | — | — | 6,795.03 | 0.29 | — |
| 华泰证券 | 2 | 46,915,327.49 | 1.06 | — | — | — | — | — | — | — | — | 42,753.68 | 1.85 | — |
| 申万宏源 | 1 | 104,419,840.55 | 2.36 | — | — | — | — | — | — | — | — | 95,158.11 | 4.12 | — |
| 信达证券 | 2 | 4,358,949.15 | 0.10 | — | — | — | — | — | — | — | — | 3,972.23 | 0.17 | — |
| 野村证券 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 招商证券 | 2 | 68,182,173.38 | 1.54 | — | — | — | — | — | — | — | — | 62,134.45 | 2.69 | — |
| 浙商证券 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 中金财富 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 中金公司 | 1 | 81,603,456.84 | 1.84 | — | — | — | — | — | — | — | — | 74,364.54 | 3.22 | — |
| 中信建投 | 1 | 7,967,124.51 | 0.18 | — | — | — | — | — | — | — | — | 7,259.77 | 0.31 | — |

| | | | | | | | | | | | | | | |
|------|---|---------------|------|---|---|---|---|---|---|---|---|-----------|------|---|
| 中信山东 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 中信证券 | 2 | 81,474,686.44 | 1.84 | — | — | — | — | — | — | — | — | 74,247.97 | 3.21 | — |
| 中银证券 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |

注：注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 信息披露方式 | 披露日期 |
|----|--|--------|------------------|
| 1 | 富国红利精选股票型证券投资基金 QDII 关于 2021 年境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定投业务的公告 | 规定披露媒介 | 2021 年 01 月 06 日 |
| 2 | 富国基金管理有限公司关于调整旗下基金最低定投金额的公告 | 规定披露媒介 | 2021 年 03 月 05 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

| 备查文件名称 | 备查文件存放地点 | 备查文件查阅方式 |
|--|--|--|
| 1、中国证监会批准设立富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）的文件 2、富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）基金合同 3、富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国红利精选混合型证券投资基金（QDII）财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊 | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 | 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址： http://www.fullgoal.com.cn 。 |

| | | |
|----------|--|--|
| 上披露的各项公告 | | |
|----------|--|--|