

# 富国品质生活混合型证券投资基金

二〇二一年中期报告

2021年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国工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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	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.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	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的真实、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.....	13
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	14
6.4	报表附注.....	15
§7	投资组合报告.....	36
7.1	期末基金资产组合情况.....	36
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
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.....	42
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.....	42
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.....	42

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 .....	43
§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	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
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 .....	44
§9	开放式基金份额变动 .....	44
§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 .....	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
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 .....	45
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8	其他重大事件 .....	48
§11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
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 .....	48
§12	备查文件目录 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国品质生活混合型证券投资基金
基金简称	富国品质生活混合
基金主代码	006179
交易代码	006179
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年03月20日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额(单位:份)	1,291,193,394.94
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于品质生活主题相关股票，通过精选个股和风险控制，力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要投资于“品质生活”主题的股票，包括消费升级以及为满足居民品质生活需求提供加工制造服务和原材料的中上游产业等。本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例；在股票投资方面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法和“自下而上”的选股策略，通过定量筛选和基本面分析，挑选出优质的上市公司股票进行投资；在债券投资方面，本基金将采用“自上而下”的投资策略对债券类资产进行合理有效的配置，并在此框架下进行具有针对性的债券选择。本基金将根据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。本基金的中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略和衍生产品投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证消费服务领先指数收益率×65%+中证港股通大消费主题指数收益率×15%+中债综合全价指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金将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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	50,485,642.21
本期利润	173,191,122.56
加权平均基金份额本期利润	0.1494
本期加权平均净值利润率	6.75%
本期基金份额净值增长率	8.46%

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	713,712,153.95
期末可供分配基金份额利润	0.5528
期末基金资产净值	2,988,040,676.28
期末基金份额净值	2.3142
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	131.42%

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	-1.14%	0.88%	-2.09%	0.74%	0.95%	0.14%
过去三个月	10.54%	1.11%	5.41%	0.95%	5.13%	0.16%
过去六个月	8.46%	1.60%	2.67%	1.29%	5.79%	0.31%
过去一年	48.74%	1.55%	25.82%	1.21%	22.92%	0.34%
自基金合同生效起至今	131.42%	1.33%	54.75%	1.13%	76.67%	0.20%

注：本基金的业绩比较基准为：中证消费服务领先指数收益率×65%+中证港股通大消费主题指数收益率×15%+中债综合全价指数收益率×20%。本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1日收益率（benchmark<sub>t</sub>）按下列公式计算：  

$$\text{benchmark}_t = 65\% * [\text{中证消费服务领先指数}_t / (\text{中证消费服务领先指数}_{t-1}) - 1] + 15\% * [\text{中证港股通大消费主题指数}_t / (\text{中证港股通大消费主题指数}_{t-1}) - 1] + 20\% * [\text{中债综合全价指数}_t / (\text{中债综合全价指数}_{t-1}) - 1]$$
 其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$ 表示时间截至日；期间 $T$ 日收益率（benchmark<sub>T</sub>）按下列公式计算：  

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

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



注：1、截止日期为2021年6月30日。  
2、本基金于2019年3月20日成立，建仓期6个月，从2019年3月20日起至2019年9月19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		
王园园	本基金基金经理	2019-03-20	—	9.1	硕士，曾任安信证券股份有限公司研究员，国联安基金管理有限公司研究员；自2015年4月加入富国基金管理有限公司，历任行业研究员、权益基金经理；现任富国基金权益投资部权益投资总监助理兼高级权益基金经理。2017年6月起任富国消费主题混合型证券投资基金（原汉兴证券投资基金，于2014年12月12日更名）基金经理，2019年3月起任富国品质生活混合型证券投资基金基金经理，2020年3月起任富国内需增长混合型证券投资基金基金经理，2020年11月起任富国消费精选30股票型证券投资基金基金经理，2021年1月起任富国价值创造混合型证券投资基金基金经理，2021年6月起任富国高质量混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
刘莉莉	本基金前任基金经理	2019-03-20	2021-02-10	17.1	硕士，曾任中原证券股份有限公司行业研究员，平安证券有限责任公司行业研究员；自2007年4月加入富国基金管理有限公司，历任行业研究员、高级行业研究员、研究总监助理、权益研究部研究副总监、权益基金经理；现任富国基金权益投资部高级权益基金经理。2018年7月起任富国消费主题混合型证券投资基金（原汉兴证券投资基金，于2014年12月12日更名）基金经理，

					2019年1月起任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月起任富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年3月至2021年2月任富国品质生活混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间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。

#### **4.4 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**

二季度沪深 300 上涨 3.48%，创业板指上涨 26.05%，伴随着国内外流动性的平稳，二季度市场风险偏好及整体估值获得了持续提升，以新能源车、医药、科技为代表的板块表现相对较好。本基金专注的消费行业中，可选消费、新兴消费表现相对较好，必需消费、社会服务、因大宗上涨成本相对承压的相关板块表现相对靠后。二季度，本基金持续保持自下而上精选个股的思路，净值表现相对跑赢基准，但基于对去年下半年以来市场估值的持续提升，一直保持一定的关注，有意识的在控制组合整体的估值性价比，以及持仓公司的中长期投资回报，所以在二季度市场整体风险偏好提升及估值抬升的背景下，本基金表现不及创业板等板块。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.3142 元；份额累计净值为 2.3142 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 8.46%，同期业绩比较基准收益率为 2.67%

#### **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 21 年下半年，自去年以来疫情影响的低基数基本退去，国内及全球经济逐步进入到相对平稳的状态。本基金专注的消费行业，伴随着国内疫情控制相对较好，受疫情影响的社服等可选板块预计将逐渐恢复；中长期视角，国内消费仍将沿着消费升级、品牌集中度提升等方向持续的发展。考虑到消费板块整体估值已处相对较高水平，本基金在选股的过程中，除关注中长期成长性外，在当下估值背景下，个股估值性价比及安全边际也将着重考虑。中长期视角，本基金将继续保持优选行业，精选个股的操作思路，坚持寻找可持续高质量成长的优质企业，来分享企业自身成长带来的投资收益。

#### **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

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

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

本报告期内，富国品质生活混合型证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国品质生活混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国品质生活混合型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 中期财务报表(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：富国品质生活混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 (2021 年 06 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
<b>资产：</b>		
银行存款	312,311,786.84	282,518,850.96
结算备付金	18,107,558.26	2,351,356.35
存出保证金	951,122.61	160,094.64
交易性金融资产	2,664,097,856.93	1,417,401,023.83
其中：股票投资	2,654,097,856.93	1,407,273,023.83
基金投资	—	—

债券投资	10,000,000.00	10,128,000.00
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	30,082,390.54	—
应收利息	245,749.29	128,478.54
应收股利	95,998.32	44,264.54
应收申购款	4,415,249.82	18,283,703.08
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	3,030,307,712.61	1,720,887,771.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 (2021年06月30日)</b>	<b>上年度末 (2020年12月31日)</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	15,052,418.83	31,524,035.63
应付赎回款	21,959,381.63	26,432,166.47
应付管理人报酬	3,514,262.10	1,583,537.44
应付托管费	585,710.38	263,922.87
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	976,163.45	925,609.66
应交税费	—	0.09
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	179,099.94	191,024.75
负债合计	42,267,036.33	60,920,296.91
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	1,291,193,394.94	777,989,042.40
未分配利润	1,696,847,281.34	881,978,432.63
所有者权益合计	2,988,040,676.28	1,659,967,475.03
负债和所有者权益总计	3,030,307,712.61	1,720,887,771.94

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.3142 元，基金份额总额 1,291,193,394.94 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国品质生活混合型证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	本期 (2021年01月01日至 2021年06月30日)	上年度可比期间 (2020年01月01日至 2020年06月30日)
<b>一、收入</b>	199,257,709.17	57,908,536.09
1. 利息收入	716,484.62	125,187.43
其中：存款利息收入	611,835.59	47,912.02
债券利息收入	104,649.03	77,275.41
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）	70,039,770.70	29,763,970.92
其中：股票投资收益	60,117,779.24	28,209,809.95
基金投资收益	—	—
债券投资收益	130,626.68	—
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	9,791,364.78	1,554,160.97
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	122,705,480.35	27,698,165.66
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	5,795,973.50	321,212.08
<b>减：二、费用</b>	26,066,586.61	2,536,286.66
1. 管理人报酬	19,148,188.85	1,199,559.20
2. 托管费	3,191,364.83	199,926.52
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	3,627,485.08	1,047,472.16
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 税金及附加	0.07	—
7. 其他费用	99,547.78	89,328.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	173,191,122.56	55,372,249.43
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	173,191,122.56	55,372,249.43

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国品质生活混合型证券投资基金

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）	777,989,042.40	881,978,432.63	1,659,967,475.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	173,191,122.56	173,191,122.56
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）	513,204,352.54	641,677,726.15	1,154,882,078.69
其中：1. 基金申购款	1,137,912,072.66	1,421,115,029.87	2,559,027,102.53
2. 基金赎回款	-624,707,720.12	-779,437,303.72	-1,404,145,023.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	1,291,193,394.94	1,696,847,281.34	2,988,040,676.28
项目	上年度可比期间 (2020年01月01日至2020年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	162,389,401.85	18,875,924.49	181,265,326.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	55,372,249.43	55,372,249.43
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）	81,538,234.36	61,339,932.58	142,878,166.94
其中：1. 基金申购款	234,019,498.13	85,702,884.88	319,722,383.01
2. 基金赎回款	-152,481,263.77	-24,362,952.30	-176,844,216.07
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）	243,927,636.21	135,588,106.50	379,515,742.71

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
_____	_____	_____
基金管理公司负责人	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

富国品质生活混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证

券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1014号《关于准予富国量化多策略灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2019年3月20日生效，首次设立募集规模为908,172,530.96份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（权证、股指期货、国债期货等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为60%-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%），其中投资于品质生活主题相关的股票及存托凭证不低于非现金基金资产的80%；权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金业绩比较基准为：中证消费服务领先指数收益率×65%+中证港股通大消费主题指数收益率×15%+中债综合全价指数收益率×20%。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

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

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

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

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

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



#### 6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 1 印花税

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

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

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

##### 2 增值税

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

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

##### 3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

##### 4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政

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

## 5 个人所得税

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

## 6 境外投资

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2021 年 06 月 30 日）
活期存款	312,311,786.84
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	312,311,786.84

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（2021年06月30日）			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,281,751,696.40	2,654,097,856.93	372,346,160.53	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	
债券	交易所市场	—	—	
	银行间市场	9,947,610.00	10,000,000.00	52,390.00
	合计	9,947,610.00	10,000,000.00	52,390.00
资产支持证券	—	—	—	
基金	—	—	—	
其他	—	—	—	
合计	2,291,699,306.40	2,664,097,856.93	372,398,550.53	

#### 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	36,096.98
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	1,388.64
应收债券利息	208,109.59
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	154.08

合计	245,749.29
----	------------

#### 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	976,163.45
银行间市场应付交易费用	—
合计	976,163.45

#### 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	49,347.16
应付证券出借违约金	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	69,752.78
合计	179,099.94

#### 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	777,989,042.40	777,989,042.40
本期申购	1,137,912,072.66	1,137,912,072.66
本期赎回（以“-”号填列）	-624,707,720.12	-624,707,720.12
本期末	1,291,193,394.94	1,291,193,394.94

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	393,472,133.53	488,506,299.10	881,978,432.63
本期利润	50,485,642.21	122,705,480.35	173,191,122.56
本期基金份额交易产生的变动数	269,754,378.21	371,923,347.94	641,677,726.15
其中：基金申购款	606,944,354.19	814,170,675.68	1,421,115,029.87

基金赎回款	-337,189,975.98	-442,247,327.74	-779,437,303.72
本期已分配利润	—	—	—
本期末	713,712,153.95	983,135,127.39	1,696,847,281.34

#### 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	553,689.41
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	25,791.67
其他	32,354.51
合计	611,835.59

#### 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	801,860,445.62
减：卖出股票成本总额	741,742,666.38
买卖股票差价收入	60,117,779.24

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	282,646.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	152,000.00
减：应收利息总额	19.32
买卖债券差价收入	130,626.68

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
股票投资产生的股利收益	9,791,364.78
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	9,791,364.78

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
1. 交易性金融资产	122,705,480.35
股票投资	122,681,480.35
债券投资	24,000.00
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	122,705,480.35

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
基金赎回费收入	5,563,276.76
转换费收入	232,696.74
合计	5,795,973.50

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
交易所市场交易费用	3,627,485.08
银行间市场交易费用	—
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	3,627,485.08

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
审计费用	29,752.78
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	795.00
债券账户维护费	9,000.00
合计	99,547.78

#### 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

根据本基金管理人于2021年7月14日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加C类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，基金管理人经与基金托管人协商一致，决定于2021年7月16日起对旗下富国品质生活混合型证券投资基金增加收取销售服务费的C类份额，并对本基金的基金合同及托管协议做相应修改，相应内容也将在定期更新的招募说明书中一并修改。截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2021年01月01日至2021年06月30日)		上年度可比期间(2020年01月01日至2020年06月30日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
海通证券	458,655,719.86	17.21	68,332,164.71	9.53
申万宏源	21,224,048.12	0.80	46,606,504.57	6.50

###### 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

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	19,341.40	0.84	19,257.08	1.97
海通证券	333,677.22	14.55	117,723.83	12.06
关联方名称	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年06月30日)			
	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
申万宏源	42,471.62	6.61	15,257.49	5.43



海通证券	62,271.71	9.69	36,604.59	13.02
------	-----------	------	-----------	-------

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至 2021年06月30日）	上年度可比期间（2020年01月 01日至2020年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	19,148,188.85	1,199,559.20
其中：支付销售机构的客户维护费	5,048,605.52	371,430.25

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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01月 01日至2020年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	3,191,364.83	199,926.52

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期(2021年01月01日至2021年06月30日)	上年度可比期间(2020年01月01日至2020年06月30日)
基金合同生效日(2019年03月20日)持有的基金份额	—	—
期初持有的基金份额	59,329,370.33	—
期间申购/买入总份额	—	9,154,916.68
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	59,329,370.33	9,154,916.68
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.59%	3.75%

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期(2021年01月01日至2021年06月30日)		上年度可比期间(2020年01月01日至2020年06月30日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	312,311,786.84	553,689.41	109,663,105.03	38,161.16

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2021年01月01日至2021年06月30日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	688626	翔宇医疗	IPO网下申购	3,652	105,776.89
海通证券股份有限公司	688329	艾隆科技	IPO网下申购	1,846	31,186.42
海通证券股份有限公司	300981	中红医疗	IPO网下申购	6,003	291,685.77

#### 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：本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

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

##### 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	—
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	—
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	—
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	—
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	—
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股限售	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	—
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股限售	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	—
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	—

300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股限售	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	—
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	—
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	—
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	—
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	—
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	—
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	—
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	—
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	—
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	—
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股限售	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	—
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	—
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	—
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股限售	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	—
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	—
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	—
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股认购	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股认购	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	—
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股认购	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	—
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	—
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	—
688329	艾隆科技	2021-03-16	2021-09-29	新股限售	16.81	50.04	1,846	31,031.26	92,373.84	—
688626	翔宇医疗	2021-03-23	2021-10-08	新股限售	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	—

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

#### 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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

#### 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（2021年06月30日）	上年度末（2020年12月31日）
AAA	—	—
AAA 以下	—	152,000.00
未评级	—	—
合计	—	152,000.00

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的信用债。

#### 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末均无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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

单位：人民币元

本期末（2021年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	312,311,786.84	—	—	—	—	—	312,311,786.84
结算备付金	18,107,558.26	—	—	—	—	—	18,107,558.26
存出保证金	951,122.61	—	—	—	—	—	951,122.61
交易性金融资产	10,000,000.00	—	—	—	—	2,654,097,856.93	2,664,097,856.93
应收证券清算款	—	—	—	—	—	30,082,390.54	30,082,390.54
应收利息	—	—	—	—	—	245,749.29	245,749.29
应收股利	—	—	—	—	—	95,998.32	95,998.32
应收申购款	—	—	—	—	—	4,415,249.82	4,415,249.82
资产总计	341,370,467.71	—	—	—	—	2,688,937,244.90	3,030,307,712.61
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	15,052,418.83	15,052,418.83
应付赎回款	—	—	—	—	—	21,959,381.63	21,959,381.63
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	3,514,262.10	3,514,262.10
应付托管费	—	—	—	—	—	585,710.38	585,710.38
应付交易费用	—	—	—	—	—	976,163.45	976,163.45
其他负债	—	—	—	—	—	179,099.94	179,099.94
负债总计	—	—	—	—	—	42,267,036.33	42,267,036.33
利率敏感度缺口	341,370,467.71	—	—	—	—	2,646,670,208.57	2,988,040,676.28
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	282,518,850.96	—	—	—	—	—	282,518,850.96
结算备付金	2,351,356.35	—	—	—	—	—	2,351,356.35
存出保证金	160,094.64	—	—	—	—	—	160,094.64
交易性金融资产	—	—	10,128,000.00	—	—	1,407,273,023.83	1,417,401,023.83
应收利息	—	—	—	—	—	128,478.54	128,478.54
应收股利	—	—	—	—	—	44,264.54	44,264.54
应收申购款	—	—	—	—	—	18,283,703.08	18,283,703.08
资产总计	285,030,301.95	—	10,128,000.00	—	—	1,425,729,469.99	1,720,887,771.94
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	31,524,035.63	31,524,035.63
应付赎回款	—	—	—	—	—	26,432,166.47	26,432,166.47
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,583,537.44	1,583,537.44
应付托管费	—	—	—	—	—	263,922.87	263,922.87
应付交易费用	—	—	—	—	—	925,609.66	925,609.66
应付税费	—	—	—	—	—	0.09	0.09
其他负债	—	—	—	—	—	191,024.75	191,024.75
负债总计	—	—	—	—	—	60,920,296.91	60,920,296.91
利率敏感度缺口	285,030,301.95	—	10,128,000.00	—	—	1,364,809,173.08	1,659,967,475.03



#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动； 2. 利率变动范围合理。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2021年06月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-164.00	-5,044.86
	2. 基准点利率减少0.1%	164.00	5,044.86

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）				
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产					
交易性金融资产	—	336,146,351.04	—	—	336,146,351.04
应收股利	—	95,998.32	—	—	95,998.32
资产合计	—	336,242,349.36	—	—	336,242,349.36
以外币计价的负债					
负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	—	336,242,349.36	—	—	336,242,349.36
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					
交易性金融资产	—	99,261,503.29	—	—	99,261,503.29
应收股利	—	44,264.54	—	—	44,264.54
资产合计	—	99,305,767.83	—	—	99,305,767.83
以外币计价的负债					

负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	—	99,305,767.83	—	—	99,305,767.83

#### 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%	-3,362,423.49	-993,057.68
	港币相对人民币升值 1%	3,362,423.49	993,057.68

#### 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

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

基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%），其中投资于品质生活主题相关的股票及存托凭证不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的

5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）		上年度末（2020年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	2,654,097,856.93	88.82	1,407,273,023.83	84.78
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	10,000,000.00	0.33	10,128,000.00	0.61
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,664,097,856.93	89.16	1,417,401,023.83	85.39

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2021年06月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	1. 业绩比较基准增加 1%	35,152,970.51	20,199,088.25
	2. 业绩比较基准减少 1%	-35,152,970.51	-20,199,088.25

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

##### 6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

##### 6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 2,653,124,144.79 元, 属于第二层次的余额为人民币 10,139,188.00 元, 属于第三层次余额为人民币 834,524.14 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 21,081,288.45 元, 本期变动人民币-20,246,764.31 元, 本期末人民币 834,524.14 元。

#### 6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的承诺事项。

#### 6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,654,097,856.93	87.59
	其中: 股票	2,654,097,856.93	87.59
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	10,000,000.00	0.33
	其中: 债券	10,000,000.00	0.33
	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	330,419,345.10	10.90
8	其他各项资产	35,790,510.58	1.18
9	合计	3,030,307,712.61	100.00

注: 本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 238,980,392.10 元, 占

资产净值比例为 8.00%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 97,165,958.94 元，占资产净值比例为 3.25%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,439.50	0.00
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,796,332,523.89	60.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	55,583.76	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	130,351,295.68	4.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	76,644,766.63	2.57
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	142,487,480.00	4.77
M	科学研究和技术服务业	105,776,363.70	3.54
N	水利、环境和公共设施管理业	21,980.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	66,217,316.20	2.22
S	综合	—	—
	合计	2,317,951,505.89	77.57

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	47,495,159.68	1.59
非日常生活消费品	178,881,117.55	5.99
日常消费品	55,199,604.75	1.85
通信服务	54,570,469.06	1.83
合计	336,146,351.04	11.25

注：1、以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

2、以上行业分类的统计中已包含沪港通深港通投资的股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600600	青岛啤酒	1,888,802	218,439,951.30	7.31
2	600887	伊利股份	4,930,700	181,597,681.00	6.08
3	000858	五粮液	602,860	179,585,965.40	6.01
4	600519	贵州茅台	76,583	157,508,256.10	5.27
5	002511	中顺洁柔	5,197,317	143,186,083.35	4.79
6	601888	中国中免	474,800	142,487,480.00	4.77
7	300750	宁德时代	202,700	108,403,960.00	3.63
8	600754	锦江酒店	1,661,500	94,622,425.00	3.17
9	000568	泸州老窖	391,815	92,444,831.10	3.09
10	002555	三七互娱	3,189,940	76,622,358.80	2.56
11	300014	亿纬锂能	663,835	68,992,371.55	2.31
12	300413	芒果超媒	965,267	66,217,316.20	2.22
13	300759	康龙化成	288,470	62,595,105.30	2.09
14	002415	海康威视	951,741	61,387,294.50	2.05
15	300122	智飞生物	296,901	55,440,323.73	1.86
16	00700	腾讯控股	112,300	54,570,469.06	1.83
17	603659	璞泰来	386,524	52,799,178.40	1.77
18	02331	李宁	662,000	52,219,343.81	1.75
19	002812	恩捷股份	210,500	49,278,050.00	1.65
20	02382	舜宇光学科 技	232,600	47,495,159.68	1.59
21	002461	珠江啤酒	4,318,797	47,247,639.18	1.58
22	688389	普门科技	1,526,750	46,810,155.00	1.57
23	603129	春风动力	367,500	45,599,400.00	1.53
24	300601	康泰生物	292,828	43,631,372.00	1.46
25	603259	药明康德	275,760	43,181,258.40	1.45
26	603501	韦尔股份	132,200	42,568,400.00	1.42
27	03690	美团-W	151,200	40,309,682.92	1.35
28	02319	蒙牛乳业	916,000	35,784,598.90	1.20
29	600258	首旅酒店	1,497,438	35,728,870.68	1.20
30	02020	安踏体育	226,000	34,375,554.62	1.15
31	002460	赣锋锂业	272,600	33,009,134.00	1.10
32	002241	歌尔股份	746,078	31,887,373.72	1.07
33	603799	华友钴业	269,100	30,731,220.00	1.03
34	600132	重庆啤酒	147,100	29,118,445.00	0.97
35	01999	敏华控股	1,703,200	26,444,926.92	0.89
36	002653	海思科	1,067,736	22,977,678.72	0.77
37	000596	古井贡酒	88,619	21,224,250.50	0.71

38	06969	思摩尔国际	542,000	19,415,005.85	0.65
39	300782	卓胜微	30,060	16,157,250.00	0.54
40	01368	特步国际	1,249,500	15,220,973.17	0.51
41	300573	兴齐眼药	102,700	14,483,781.00	0.48
42	01585	雅迪控股	742,000	10,310,636.11	0.35
43	300979	华利集团	9,246	1,028,699.40	0.03
44	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.01
45	688329	艾隆科技	1,846	92,373.84	0.00
46	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
47	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
48	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
49	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
50	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
51	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
52	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
53	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
54	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
55	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
56	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
57	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
58	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
59	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
60	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
61	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
62	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
63	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
64	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
65	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
66	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
67	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
68	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
69	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
70	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
71	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
72	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
73	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
74	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
75	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
76	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
77	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
78	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	600887	伊利股份	103,072,986.92	6.21
2	002511	中顺洁柔	96,904,129.86	5.84
3	000858	五粮液	86,936,046.67	5.24
4	00700	腾讯控股	85,265,129.38	5.14
5	300750	宁德时代	77,714,360.50	4.68
6	002555	三七互娱	77,283,371.16	4.66
7	600600	青岛啤酒	75,434,730.96	4.54
8	601888	中国中免	59,748,501.00	3.60
9	002867	周大生	57,885,799.83	3.49
10	300601	康泰生物	55,254,173.60	3.33
11	000651	格力电器	55,042,967.45	3.32
12	02331	李宁	54,791,711.92	3.30
13	002705	新宝股份	49,725,251.80	3.00
14	000568	泸州老窖	44,236,440.00	2.66
15	603659	璞泰来	43,564,140.52	2.62
16	300014	亿纬锂能	43,564,098.13	2.62
17	02382	舜宇光学科技	42,333,256.00	2.55
18	002812	恩捷股份	41,809,954.00	2.52
19	600754	锦江酒店	41,358,923.32	2.49
20	300413	芒果超媒	40,220,031.78	2.42
21	603259	药明康德	40,144,296.09	2.42
22	600519	贵州茅台	39,956,744.45	2.41
23	02319	蒙牛乳业	35,782,862.71	2.16
24	688389	普门科技	34,651,955.14	2.09
25	002460	赣锋锂业	34,522,158.05	2.08
26	603882	金域医学	34,328,949.00	2.07

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	000651	格力电器	73,388,362.56	4.42
2	002867	周大生	47,257,090.13	2.85
3	300677	英科医疗	42,036,495.47	2.53
4	603882	金域医学	39,241,157.52	2.36
5	002007	华兰生物	37,385,500.17	2.25



6	002705	新宝股份	33,305,320.81	2.01
7	300122	智飞生物	28,991,490.18	1.75
8	300759	康龙化成	28,297,820.00	1.70
9	002812	恩捷股份	26,029,256.75	1.57
10	002304	洋河股份	25,973,717.74	1.56
11	600600	青岛啤酒	25,135,107.19	1.51
12	002352	顺丰控股	25,050,429.02	1.51
13	002594	比亚迪	24,438,708.00	1.47
14	002511	中顺洁柔	22,311,829.05	1.34
15	002475	立讯精密	22,157,500.39	1.33
16	601888	中国中免	20,304,085.90	1.22
17	03690	美团-W	20,287,405.82	1.22
18	600887	伊利股份	20,101,468.56	1.21
19	000596	古井贡酒	19,721,660.48	1.19
20	300601	康泰生物	19,436,597.00	1.17

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,865,886,019.13
卖出股票收入（成交）总额	801,860,445.62

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	10,000,000.00	0.33
	其中：政策性金融债	10,000,000.00	0.33
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）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	10,000,000.00	0.33

#### 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	200406	20 农发 06	100,000	10,000,000.00	0.33

### 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，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，由此获得股票组合产生的超额收益。本基金在运用股指期货时，将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，对冲系统性风险以及特殊情况下的流动性风险，以改善投资组合的风险收益特性。

### 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

本基金将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

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

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	951,122.61
2	应收证券清算款	30,082,390.54
3	应收股利	95,998.32
4	应收利息	245,749.29
5	应收申购款	4,415,249.82
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	35,790,510.58

### 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

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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(%)
162,717	7,935.21	505,037,538.80	39.11	786,155,856.14	60.89

### 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	3,159,124.54	0.2447

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	50~100
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(2019年03月20日)基金份额总额	908,172,530.96
报告期期初基金份额总额	777,989,042.40
本报告期基金总申购份额	1,137,912,072.66
减：本报告期基金总赎回份额	624,707,720.12
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,291,193,394.94

---

## § 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。

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

### 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	44,827,319.90	1.68	—	—	—	—	—	—	40,850.76	1.78	—
长江证券	2	81,744,336.61	3.07	—	—	—	—	—	—	74,493.03	3.25	—
东北证券	2	5,701,777.98	0.21	—	—	—	—	—	—	5,196.05	0.23	—
东方证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
东吴证券	2	540,911,631.29	20.30	—	—	—	—	—	—	492,933.18	21.50	—
东兴证券	2	88,793,426.22	3.33	—	—	—	—	—	—	80,917.50	3.53	—
广发证券	2	40,443,872.29	1.52	—	—	—	—	—	—	36,856.26	1.61	—
国盛证券	2	62,027,795.41	2.33	—	—	—	—	—	—	56,525.46	2.47	—
国泰君安	2	17,521,712.90	0.66	—	—	—	—	—	—	15,967.61	0.70	—
国信证券	2	125,374,134.85	4.70	—	—	—	—	—	—	62,687.06	2.73	—
海通证券	2	458,655,719.86	17.21	—	—	—	—	—	—	333,677.22	14.55	—
华创证券	2	43,111,544.08	1.62	—	—	—	—	—	—	39,287.70	1.71	—
华金证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华西证券	2	222,363,246.65	8.34	—	—	—	—	—	—	202,639.11	8.84	—
民生证券	2	44,360,387.42	1.66	—	—	—	—	—	—	40,425.28	1.76	—

瑞银证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源	3	21,224,048.12	0.80	—	—	—	—	—	—	19,341.40	0.84	—
太平洋证券	2	4,806,081.00	0.18	—	—	—	—	—	—	4,379.74	0.19	—
天风证券	2	342,656,136.47	12.86	—	—	—	—	—	—	312,260.41	13.62	—
西南证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
湘财证券	1	98,453.32	0.00	—	—	—	—	—	—	89.74	0.00	—
兴业证券	1	117,002.47	0.00	—	—	—	—	—	—	106.63	0.00	—
银河证券	1	82,651,420.78	3.10	—	—	—	—	—	—	75,320.52	3.29	—
英大证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	2	253,055,442.59	9.50	282,646.00	100.00	—	—	—	—	230,609.29	10.06	—
中金公司	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	2	95,535,058.17	3.58	—	—	—	—	—	—	87,060.96	3.80	—
中信建投	2	34,456,763.74	1.29	—	—	—	—	—	—	31,400.26	1.37	—
中信证券	1	54,449,563.81	2.04	—	—	—	—	—	—	49,619.26	2.16	—

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：方正证券（003773、23334）。

## 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旗下部分基金 2021 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	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富国品质生活混合型证券投资基金基金经理变更的公告	规定披露媒介	2021 年 02 月 18 日
3	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
4	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 17 日
5	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 24 日
6	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021 年 04 月 20 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品质生活混合型证券投资基金的文件 2、富国品质生活混合型证券投资基金基金合同 3、富国品质生活混合型	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：



---

证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国品质生活混合型证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告		<a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a>
---------------------------------------------------------------------------------------------	--	---------------------------------------------------------------------