

富国中证银行指数型证券投资基金

二〇二〇年第3季度报告

2020年09月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2020年10月28日

## § 1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及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责任。基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。本报告财务资料未经审计。本报告期自2020年7月1日起至2020年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富国中证银行指数
场内简称	银行 FG
基金主代码	161029
交易代码	161029
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年05月10日
报告期末基金份额总额（单位：份）	446,767,954.60
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证银行指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型和交易成本模型，按照成份股在中证银行指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证银行指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。本基金的资产配置策略、股票投资组合构建、债券投资策略、金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	95%×中证银行指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年07月01日-2020年09月30日）
1. 本期已实现收益	28,383,660.47
2. 本期利润	20,059,302.23
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0470
4. 期末基金资产净值	502,046,611.35

5. 期末基金份额净值	1.124
-------------	-------

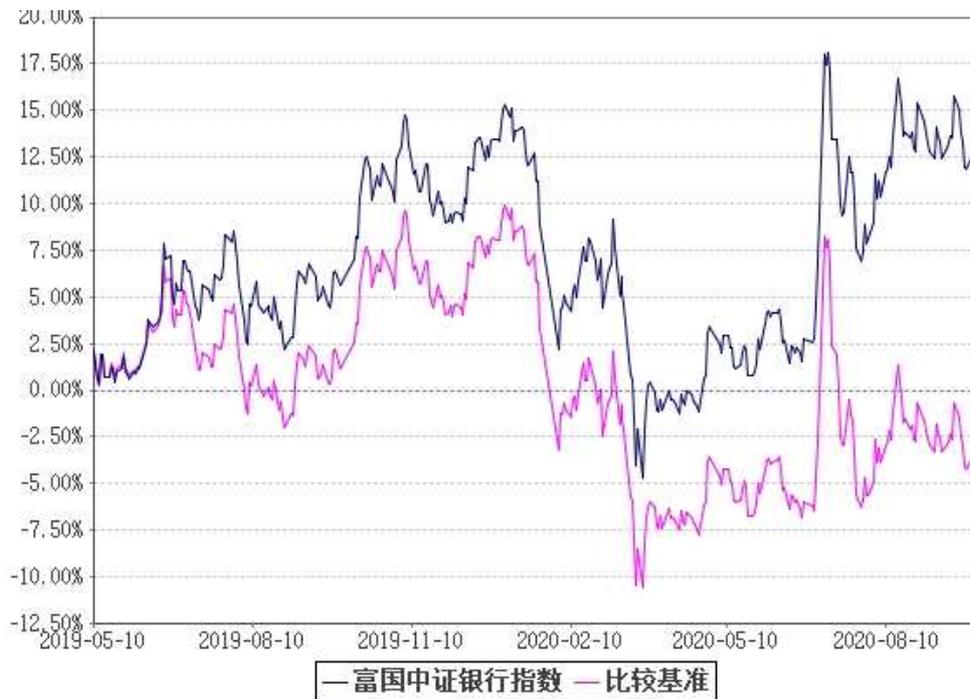
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.97%	1.53%	1.50%	1.65%	6.47%	-0.12%
过去六个月	12.18%	1.21%	2.44%	1.29%	9.74%	-0.08%
过去一年	5.05%	1.21%	-6.18%	1.26%	11.23%	-0.05%
自基金合同生效起至今	10.96%	1.12%	-5.04%	1.14%	16.00%	-0.02%

#### 3.2.2 自基金转型以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2020年9月30日。

2、本基金于2019年5月10日转型，建仓期6个月，从2019年5月10日起至2019年11月9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		
王保合	本基金基金经理	2015-05-13	—	14.2	博士，曾任富国基金管理有限公司研究员、富国沪深300增强证券投资基金基金经理助理；2011年3月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2013年9月起任富国创业板指数分

					<p>级证券投资基金基金经理，2014年4月起任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理，2015年4月起任富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金经理，2015年5月起任富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金（已于2019年5月10日变更为富国中证银行指数型证券投资基金）基金经理，2017年9月至2019年10月任富国丰利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年3月至2019年10月任富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年3月起任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年11月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年12月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2020年9月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理；兼任量化投资部总经理。具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证银行指数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》、《富国中证银行指数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 公平交易专项说明

### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析**

7月初，央行发文决定于7月1日起下调再贷款、再贴现利率 0.25 个百分点，再度释放宽松信号，同时美国公布的6月非农就业人数再次超出市场预期。在流动性宽松及经济逐步复苏的背景下，市场风险偏好明显提升，同时境外资金大幅流入，带动A股出现大幅上涨。同时，市场风格发生扩散，前期涨幅较少的大金融及周期股迎来补涨，带动上证综指接连突破 3000 至 3400 点等整数关口。7月中旬，受中芯国际上市利好兑现，美国拟加大对中国科技公司制裁力度等消息影响，A股出现大幅回调，前期涨幅较大的食品饮料、半导体等板块跌幅居前。8月下旬起，央行开展 7000 亿元中期借贷便利（MLF）操作对冲本月即将到期的 MLF，从金额上看，超额续作 1500 亿元，超出市场此前预期，受此影响 A 股迎来大幅反弹。9月起，随着美股因美国大选存在不确定性而出现大幅回调，A 股也迎来调整，其中前期涨幅较大的科技、医药、军工等板块跌幅居前。9月下旬，由于欧洲部分国家，如法国和西班牙，日新增病患人数再创新高，欧洲部分地区将再次采取封闭措施，对人员流动和经济将产生负面影响，因此导致市场进一步走弱。总体来看，2020 年 3 季度上证综指上涨 7.82%，沪深 300 上涨 10.17%，创业板指上涨 5.6%，中证 500 指数上涨 5.59%。

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

#### **4.5 报告期内基金的业绩表现**

本报告期，本基金份额净值增长率为 7.97%，同期业绩比较基准收益率为

1.50%

#### 4.6 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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	469,041,760.63	92.59
	其中：股票	469,041,760.63	92.59
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
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	银行存款和结算备付金合计	34,745,578.95	6.86
7	其他资产	2,812,194.01	0.56
8	合计	506,599,533.59	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	2,320,054.83	0.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	28,264.03	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	18,653.36	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—

I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,709.13	0.01
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	314,332.16	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	53,133.85	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	2,803,176.48	0.56

### 5.2.2 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	466,238,584.15	92.87
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	466,238,584.15	92.87

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	1,976,437	71,151,732.00	14.17
2	601166	兴业银行	2,838,459	45,784,343.67	9.12
3	601398	工商银行	7,981,699	39,269,959.08	7.82
4	000001	平安银行	2,418,686	36,691,466.62	7.31
5	601328	交通银行	6,256,893	28,406,294.22	5.66
6	600016	民生银行	4,845,358	25,680,397.40	5.12
7	600000	浦发银行	2,673,704	25,106,080.56	5.00
8	002142	宁波银行	748,810	23,572,538.80	4.70
9	601288	农业银行	6,543,100	20,741,627.00	4.13
10	601229	上海银行	2,259,723	18,394,145.22	3.66

#### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300896	C 爱美客	1,892	611,120.78	0.12
2	688586	江航装备	16,436	401,202.76	0.08
3	688222	成都先导	8,468	314,332.16	0.06
4	688516	奥特维	3,440	251,911.20	0.05
5	688330	宏力达	2,324	205,046.52	0.04

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“农业银行”的发行主体中国农业银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在可回溯制度执行不到位、可回溯基础管理不到位、部分可回溯视频质检结果未反馈给保险公司、可回溯资料不符合监管规定等违规行为，中国银行保险监督管理委员会于2020年3月9日对公司做出罚款50万元的行政处罚（银保监罚决字〔2020〕3号）；由于存在：

（1）“两会一层”境外机构管理履职不到位；（2）国别风险管理不满足监管要求；（3）信贷资金被挪用作保证金；（4）未将集团成员纳入集团客户统一授信管理等违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于2020年4月22日对公司做出罚款合计200万元的行政处罚（银保监罚决字〔2020〕11号）；由于公司监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会于2020年4月22日对公司做出罚款合计230万元的行政处罚（银保监罚决字〔2020〕12号）；由于存在：（1）向关系人发放信用贷款；（2）批量处置不良资产未公告；（3）批量处置不良资产未向监管部门报告等24项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于2020年7月13日对公司做出没收违法所得55.3万元，罚款5260.3万元，罚没合计5315.6万元的行政处罚（银保监罚决字〔2020〕36号）。农业银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“平安银行”的发行主体平安银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：（1）汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成；（2）代理保险销售的人员为非商业银行人员；（3）汽车消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平等15项违法违规事实，中国银保监会深圳监管局于2020年1月20日对公司做出罚款720万元的行政处罚（深银保监罚决字〔2020〕7号）。平安银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“民生银行”的发行主体中国民生银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：民生银行总行同业票据业务管理失控，民生银行总行违反内控指引要求计量转贴现卖断业务信用风险加权资

产，民生银行总行案件风险信息报送管理不到位等违法违规事实，北京银保监局于 2019 年 12 月 14 日对公司做出责令改正，并给与合计 700 万元罚款的行政处罚（京银保监罚决字〔2019〕56 号）；由于存在：未按规定履行客户身份识别义务，未按规定保存客户身份资料和交易记录，未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告，与身份不明的客户进行交易等违法事实，中国人民银行于 2020 年 2 月 10 日对公司做出罚款 2360 万元的行政处罚（银罚字【2020】1 号）；由于存在：（1）违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资；（2）为“四证”不全的房地产项目提供融资；（3）违规为土地储备中心提供融资等 30 项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 7 月 14 日对公司做出没收违法所得 296.47 万元，罚款 10486.47 万元，罚没合计 10782.94 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2020〕43 号）。民生银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“工商银行”的发行主体中国工商银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于公司监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 4 月 20 日对公司做出罚款合计 270 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2020〕7 号）。工商银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“交通银行”的发行主体交通银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：（1）授信审批不审慎；（2）总行对分支机构管控不力承担管理责任等违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2019 年 12 月 27 日对公司做出罚款合计 150 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2019〕24 号）；由于公司监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 4 月 20 日对公司做出罚款合计 260 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2020〕6 号）。交通银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“宁波银行”的发行主体宁波银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在设立时点性规模考核指标，股权质

押管理不合规的违法违规事实，宁波银保监局于 2019 年 12 月 5 日对公司做出罚款 40 万元，并责令公司对相关直接责任人给予纪律处分的行政处罚（甬银保监罚决字〔2019〕67 号）。宁波银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“浦发银行”的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于公司 2013 年至 2018 年间存在：（1）未按专营部门制规定开展同业业务；（2）同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；（3）延迟支付同业投资资金吸收存款等 12 项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会上海监管局于 2020 年 8 月 10 日对公司做出责令改正，并处罚款共计 2100 万元的行政处罚（沪银保监银罚决字〔2020〕12 号）。浦发银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“上海银行”的发行主体上海银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在违反支付业务规定的违法违规事实，中国人民银行上海分行于 2019 年 11 月 2 日对公司做出没收违法所得 1,762,787.61 元，并处以 1,762,787.61 元罚款，共计 3,525,575.22 元，同时对相关高级管理人员作出处罚的行政处罚（上海银罚字〔2019〕22 号）；由于公司 2014 年至 2019 年间存在：（1）违规向资本金不足、“四证”不全的房地产项目发放贷款，以其他贷款科目发放房地产开发贷款；（2）并购贷款管理严重违反审慎经营规则；（3）经营性物业贷款管理严重违反审慎经营规则等 23 项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会上海监管局于 2020 年 8 月 14 日对公司做出责令改正，没收违法所得 27.155092 万元，罚款 1625 万元，罚没合计 1652.155092 万元的行政处罚（沪银保监银罚决字〔2020〕14 号）。上海银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“兴业银行”的发行主体兴业银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保的违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会福建监管局于 2020 年 8 月 31 日对公司做出没收违法所得

6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元的行政处罚（闽银保监罚决字〔2020〕24 号）。兴业银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余 1 名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	151,150.59
2	应收证券清算款	187,128.28
3	应收股利	—
4	应收利息	6,236.30
5	应收申购款	2,467,678.84
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,812,194.01

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

### 5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688586	江航装备	401,202.76	0.08	新股限售
2	688222	成都先导	314,332.16	0.06	新股限售
3	688516	奥特维	251,911.20	0.05	新股限售
4	688330	宏力达	205,046.52	0.04	新股认购
5	300896	C 爱美客	49,052.30	0.01	新股限售

注：本基金本报告期末持有 C 爱美客（股票代码 300896）公允价值为 611,120.78 元，其中新股限售股票部分公允价值为 49,052.30 元，剩余部分为正常流通股。

### 5.11.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	332,081,364.63
报告期期间基金总申购份额	528,718,304.04
减：报告期期间基金总赎回份额	414,031,714.07
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	446,767,954.60

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	—
报告期期间买入/申购总份额	—
报告期期间卖出/赎回总份额	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	—
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	—

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国中证银行指数分级证券投资基金的文件
- 2、富国中证银行指数分级证券投资基金基金合同
- 3、富国中证银行指数分级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、富国中证银行指数分级证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、关于富国中证银行指数分级证券投资基金名称变更的公告
- 7、富国中证银行指数型证券投资基金基金合同
- 8、富国中证银行指数型证券投资基金托管协议
- 9、富国中证银行指数型证券投资基金财务报表及报表附注
- 10、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

## **9.2 存放地点**

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

## **9.3 查阅方式**

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>

富国基金管理有限公司  
2020 年 10 月 28 日