

富国中证银行指数型证券投资基金
二〇一九年半年度报告
(摘要)

2019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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2019年08月27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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	富国中证银行指数型证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	489,296,158.89 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019年6月17日

注：2019年5月10日，富国中证银行指数分级证券投资基金的A份额与B份额终止上市，同日《富国中证银行指数型证券投资基金基金合同》生效，富国中证银行指数分级证券投资基金名称变更为“富国中证银行指数型证券投资基金”，场内简称由“银行分级”变更为“银行FG”。下文中涉及基金财务指标、净值表现等信息的基金合同生效日按富国中证银行指数型证券投资基金的合同生效日计算，涉及基金经理任期信息的基金合同生效日按原富国中证银行指数分级证券投资基金的合同生效日计算。

2.2 基金产品说明（转型后）

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。
业绩比较基准	95%×中证银行指数收益率+5%×银行人

	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。

2.2 基金产品说明（转型前）

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。		
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。		
下属三级基金的风险收益特征	富国银行 A 级份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征。	富国银行 B 级份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。	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。

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	富国中证银行指数分级证券投资基金		
基金简称	富国中证银行指数分级		
场内简称	银行分级		
基金主代码	161029		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 04 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		
报告期末基金份额总额	573,634,254.29 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 5 月 13 日		
下属三级基金的基金简称	富国中证银行指数分级 A	富国中证银行指数分级 B	富国中证银行指数分级
下属三级基金场内简称	银行 A 级	银行 B 级	银行分级
下属三级基金的交易代码	150241	150242	161029

报告期末下属三级基金的份额总额 (单位:份)	23,754,097.00	23,754,098.00	526,126,059.29
---------------------------	---------------	---------------	----------------

2.2 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	贺倩
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816

2.3 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

§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（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年5月10日(基金合同生效日)至2019年6月30日
本期已实现收益	13,264,679.86
本期利润	29,181,196.01
加权平均基金份额本期利润	0.0538
本期基金份额净值增长率	5.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0389
期末基金资产净值	522,252,468.07
期末基金份额净值	1.067

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。

3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日至2019年5月9日)
本期已实现收益	4,784,920.06
本期利润	75,618,254.08
加权平均基金份额本期利润	0.1260
本期基金份额净值增长率	13.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年5月9日)
期末可供分配基金份额利润	0.0132
期末基金资产净值	581,054,656.77
期末基金份额净值	1.013

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（转型后）

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	4.71%	0.93%	3.24%	0.86%	1.47%	0.07%
自基金转型日起至今	5.33%	0.92%	4.05%	0.87%	1.28%	0.05%

注：本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证银行指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$

由于本基金投资标的指数为中证银行指数，且每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，投资于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5%，因此，本基金将业绩比较基准定为 $95\% \times \text{中证银行指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$ 。

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（benchmarkt）按下列公式计算：

$$\text{benchmarkt} = 95\% * [\text{中证银行指数 } t / (\text{中证银行指数 } t-1) - 1] + 5\% * \text{银行人民币活期存款利率（税后）} / 360;$$

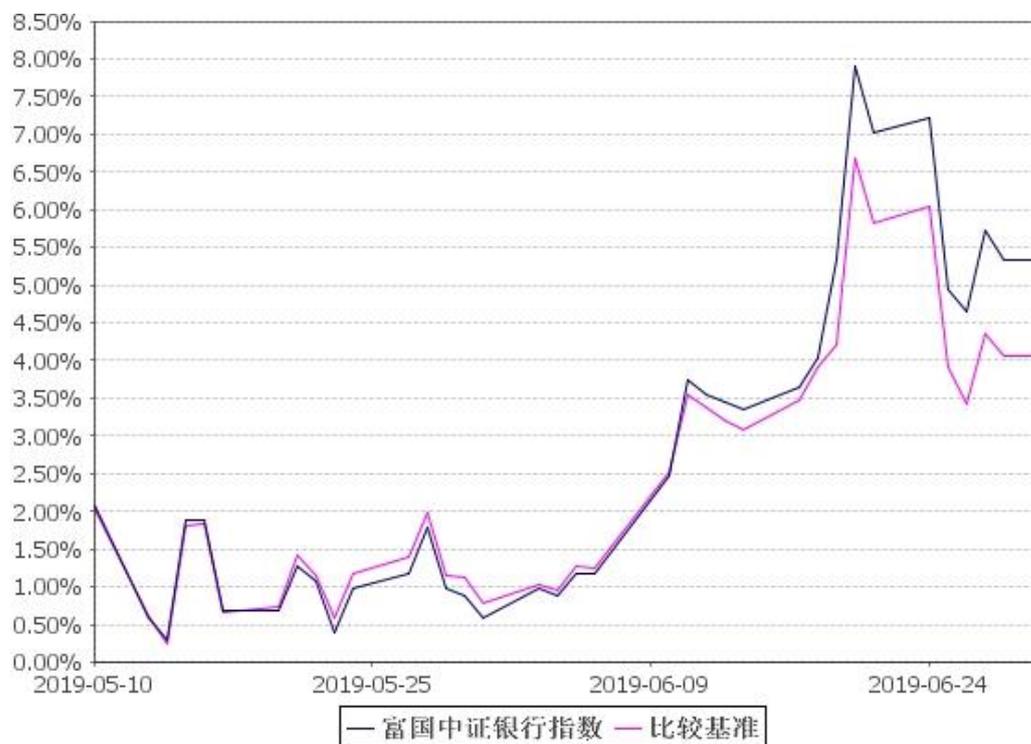
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率 (benchmarkT) 按下列公式计算:

$$\text{benchmarkT} = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

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 自基金转型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 2019 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2019 年 5 月 10 日转型, 自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期 6 个月, 从 2019 年 5 月 10 日起至 2019 年 11 月 9 日, 本期末建仓期还未结束。

3.2 基金净值表现 (转型前)

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	-6.03%	0.98%	-6.01%	1.00%	-0.02%	-0.02%
过去三个月	-2.50%	1.47%	-2.67%	1.44%	0.17%	0.03%
过去六个月	13.44%	1.45%	12.51%	1.44%	0.93%	0.01%
过去一年	14.03%	1.35%	11.29%	1.36%	2.74%	-0.01%
过去三年	23.59%	1.04%	14.52%	1.04%	9.07%	0.00%
自基金合同生效日起至转型前	10.39%	1.38%	-5.69%	1.39%	16.08%	-0.01%

注: 本基金业绩比较基准为: $95\% \times \text{中证银行指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期}$

存款利率（税后）

由于本基金投资标的指数为中证银行指数，且每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，投资于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 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为 95%×中证银行指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）。

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（benchmarkt）按下列公式计算：

$benchmarkt = 95\% * [\text{中证银行指数 } t / (\text{中证银行指数 } t-1) - 1] + 5\% * \text{银行人民币活期存款利率（税后）} / 360;$

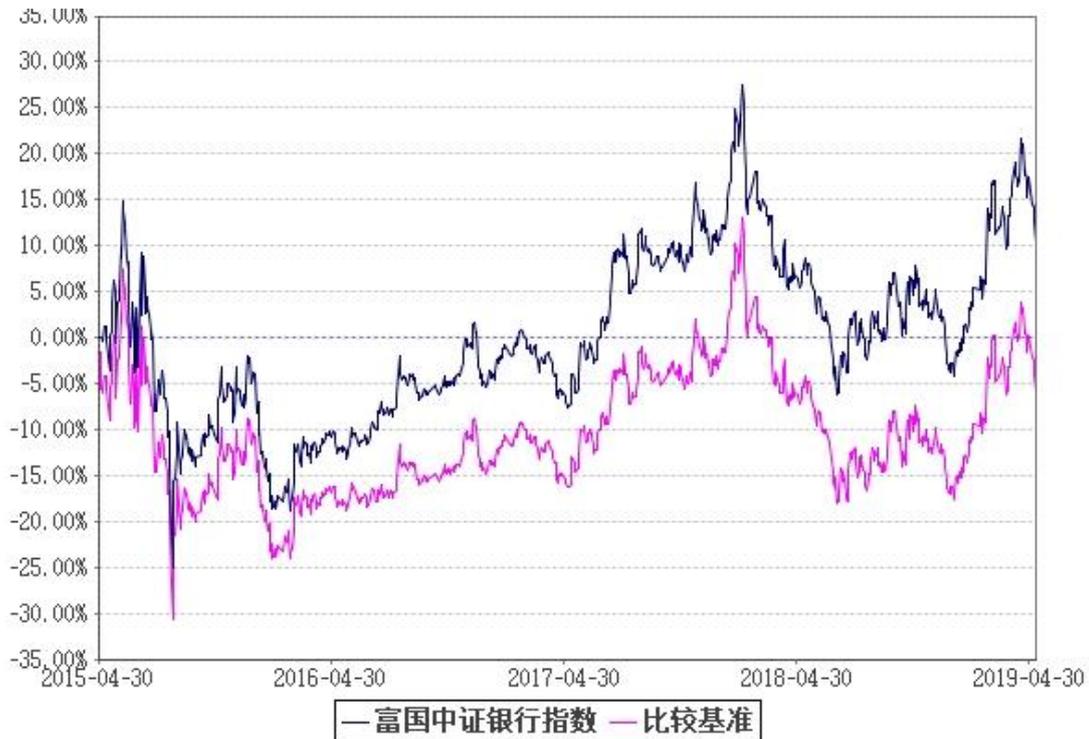
其中，t=1, 2, 3, ···, T, T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

$benchmarkT = [\prod_{t=1}^T (1 + benchmarkt)] - 1$

其中，T=2, 3, 4, ···； $\prod_{t=1}^T (1 + benchmarkt)$ 表示 t 日至 T 日的 (1+benchmarkt) 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 2019 年 5 月 9 日。

2、本基金于 2015 年 4 月 30 日成立，建仓期 6 个月，从 2015 年 4 月 30 日起至 2015 年 10 月 30 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.3 其他指标（转型前）

单位：人民币元

其他指标	本期末（2019 年 5 月 9 日）
银行 A 级与银行 B 级基金份额配比	1:1

期末转型前银行 A 级份额参考净值	1.018
期末转型前银行 A 级份额累计参考净值	1.187
期末转型前银行 B 级份额参考净值	1.008
期末转型前银行 B 级份额累计参考净值	1.008
富国银行 A 级的预计年收益率	4.50%

§ 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 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金等一百三十七只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方旻	本基金基金经理	2015-05-13	—	9	硕士，自 2010 年 2 月至 2014 年 4 月任富国基金管理有限公司定量研究员；2014 年 4 月至 2014 年 11 月任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、富国中证 500

					<p>指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理助理, 2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2015 年 5 月起任富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金及富国中证银行指数分级证券投资基金 (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) 的基金经理, 2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理, 2017 年 6 月至 2018 年 12 月任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理, 2017 年 7 月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, 2018 年 5 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2018 年 7 月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 1 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理; 兼任量化投资副总监。具有基金从业资格。</p>
王保合	本基金基金经理	2015-05-13	—	13	<p>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</p>

				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月起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月起任富国中证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；兼任量化投资部总经理。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合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证银行指数分级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》、《富国中证银行指数分级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

年初以来，受央行降准的消息刺激，投资者对流动性进一步宽松的预期再度提升，A股迎来大幅反弹。1月下旬，出于对上市公司年报计提商誉减值的担忧，市场迎来震荡调整。2月以来，随着2018年年报商誉减值风险释放完毕，A股再度大幅反弹。其中前期受商誉减值影响较大的创业板及中小板反弹力度更大。进入4月中旬，尽管公布的3月经济数据明显超出市场预期，但随着央行推迟降准，同时政治局会议也强调货币政策以托底经济为主，不做大水漫灌，市场对货币进一步宽松的预期下降，市场开始迎来调整。5月6日，由于中美贸易谈判突然生变，市场持续走弱。6月中下旬，随着中美两国领导人通电话决定双方再次展开接触，为G20见面做准备。同时美联储及欧央行也表态可能进一步宽松货币政策，以应对潜在的经济衰退风险，全球风险偏好进一步提升。总体来看，2019年上半年上证综指上涨19.45%，沪深300上涨27.07%，创业板指上涨20.87%。其中，中证银行指数2019年上半年上涨17.97%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年6月30日，本基金份额净值为1.067元；份额累计净值为1.153元；转型前报告期，本基金份额净值增长率为13.44%，同期业绩比较基准收益率为12.51%。转型后报告期，本基金份额净值增长率为5.33%，同期业绩比较基准收益率为4.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，受中美贸易摩擦的影响，预计外部环境仍面临着不确定性。国内政策在稳增长的同时，将继续推进金融供给侧改革。总体来看，国内将面临“经济退、政策进、阶段性信用收缩”的宏观。投资者对信用环境恶化反作用于经济的担忧会一直存在，但阶段性逆周期政策仍有望加大推进。进入4季度，随

着企业盈利增速由于基数原因大幅反弹，同时叠加 70 周年国庆等事件因素，市场乐观预期有望逐步发酵。

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。

4.6 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一富国基金管理有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务报表(未经审计) (转型后)

6.1 资产负债表

会计主体：富国中证银行指数型证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2019年06月30日)
资 产：	
银行存款	32,816,474.40
结算备付金	—
存出保证金	97,778.25
交易性金融资产	471,251,515.15
其中：股票投资	471,251,515.15
基金投资	—
债券投资	—
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	20,574,124.94
应收利息	5,977.48
应收股利	—
应收申购款	532,885.37
递延所得税资产	—
其他资产	32,525.22
资产总计	525,311,280.81
负债和所有者权益	本期末 (2019年06月30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	—
应付赎回款	2,151,805.09
应付管理人报酬	451,127.36
应付托管费	99,248.00
应付销售服务费	—
应付交易费用	199,593.34
应交税费	—
应付利息	—

应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	157,038.95
负债合计	3,058,812.74
所有者权益：	
实收基金	448,132,482.98
未分配利润	74,119,985.09
所有者权益合计	522,252,468.07
负债和所有者权益总计	525,311,280.81

注：报告截止日 2019 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.067 元，基金份额总额 489,296,158.89 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证银行指数型证券投资基金

本报告期：2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 5 月 10 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
一、收入	30,457,738.47
1. 利息收入	41,456.81
其中：存款利息收入	41,455.95
债券利息收入	0.86
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	—
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	14,396,751.42
其中：股票投资收益	8,128,816.45
基金投资收益	—
债券投资收益	-2,951.14
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	6,270,886.11
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	15,916,516.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	103,014.09
减：二、费用	1,276,542.46
1. 管理人报酬	802,266.28
2. 托管费	176,498.57

3. 销售服务费	—
4. 交易费用	230,344.50
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	67,433.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	29,181,196.01
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	29,181,196.01

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中证银行指数型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	本期2019年5月10日(基金合同生效日)至2019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）	525,355,668.68	55,698,988.09	581,054,656.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	29,181,196.01	29,181,196.01
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）	-77,223,185.70	-10,760,199.01	-87,983,384.71
其中：1. 基金申购款	19,389,345.32	2,736,923.53	22,126,268.85
2. 基金赎回款	-96,612,531.02	-13,497,122.54	-110,109,653.56
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）	448,132,482.98	74,119,985.09	522,252,468.07

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 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

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

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人, 基金销售机构
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
中国农业银行股份有限公司 (“农业银行”)	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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2019 年 5 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
海通证券	52,789,047.97	43.78

6.4.4.1.2 权证交易

注: 本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.3 债券交易

注: 本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.4.1.4 回购交易

注: 本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期2019年5月10日(基金合同生效日)至2019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 (%)
海通证券	49,068.22	43.78	52,578.48	26.37

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 5 月 10 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	802,266.28
其中: 支付销售机构的客户维护费	172,245.20

注: 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$

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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 5 月 10 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	176,498.57

注: 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$

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。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注: 本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注: 本报告期内本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 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未投资本基金。

6.4.4.5 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 2019 年 5 月 10 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	32,816,474.40	37,749.52

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期内本基金未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

6.4.4.7.1 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金均无其他关联方交易事项。

6.4.5 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.6 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.6.1.1 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
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股认购	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	—

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2019 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。

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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。

6.4.7 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 2019 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 471,217,645.21 元，属于第二层次的余额为人民币 33,869.94 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 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未发生变动。

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。

§ 6 半年度财务报表（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：富国中证银行指数分级证券投资基金

报告截止日：2019 年 5 月 9 日

单位：人民币元

资产	本期末 (2019 年 5 月 9 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
资产：		
银行存款	41,740,656.71	37,864,061.45
结算备付金	—	—
存出保证金	90,371.19	42,584.50
交易性金融资产	541,582,552.19	535,528,043.70
其中：股票投资	541,485,672.99	535,528,043.70
基金投资	—	—
债券投资	96,879.20	—
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	435,937.14	—
应收利息	44,506.58	7,560.06

应收股利	—	—
应收申购款	1,195,189.98	180,353.43
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	585,089,213.79	573,622,603.14
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	(2019年5月9日)	(2018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	—	—
应付赎回款	3,434,106.81	370,653.16
应付管理人报酬	150,663.20	503,685.68
应付托管费	33,145.90	110,810.85
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	270,885.98	1,047.43
应交税费	7.37	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	145,747.76	231,151.28
负债合计	4,034,557.02	1,217,348.40
所有者权益:		
实收基金	525,355,668.68	587,221,488.60
未分配利润	55,698,988.09	-14,816,233.86
所有者权益合计	581,054,656.77	572,405,254.74
负债和所有者权益总计	585,089,213.79	573,622,603.14

注：报告截止日 2019 年 05 月 09 日，基金份额净值 1.013 元，基金份额总额 573,634,254.29 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证银行指数分级证券投资基金

本报告期：2019 年 01 月 01 日至 2019 年 05 月 09 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2019年1月1日至 2019年5月9日)	上年度可比期间 (2018年01月01日至 2018年06月30日)
一、收入	78,855,565.05	-70,065,968.99
1. 利息收入	115,811.24	267,879.17
其中：存款利息收入	111,828.57	208,456.44

债券利息收入	2,448.42	169.86
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	1,534.25	59,252.87
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	7,509,326.66	16,406,549.07
其中：股票投资收益	6,588,385.73	13,311,841.69
基金投资收益	—	—
债券投资收益	908,862.33	-22,479.20
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	12,078.60	3,117,186.58
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	70,833,334.02	-87,088,909.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	397,093.13	348,512.48
减：二、费用	3,237,310.97	4,645,244.55
1. 管理人报酬	2,127,964.73	3,032,055.88
2. 托管费	468,152.26	667,052.25
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	480,184.97	676,410.78
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 税金及附加	0.75	—
7. 其他费用	161,008.26	269,725.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	75,618,254.08	-74,711,213.54
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	75,618,254.08	-74,711,213.54

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中证银行指数分级证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年05月09日

单位：人民币元

项目	本期 (2019年1月1日至2019年5月9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）	587,221,488.60	-14,816,233.86	572,405,254.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	75,618,254.08	75,618,254.08
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）	-61,865,819.92	-5,103,032.13	-66,968,852.05

其中：1. 基金申购款	193,891,692.37	26,412,278.03	220,303,970.40
2. 基金赎回款	-255,757,512.29	-31,515,310.16	-287,272,822.45
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)	525,355,668.68	55,698,988.09	581,054,656.77
项目	上年度可比期间 (2018年01月01日至2018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)	581,181,911.05	62,853,123.16	644,035,034.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-74,711,213.54	-74,711,213.54
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)	7,181,079.16	-6,156,886.14	1,024,193.02
其中：1. 基金申购款	353,242,397.20	35,135,846.04	388,378,243.24
2. 基金赎回款	-346,061,318.04	-41,292,732.18	-387,354,050.22
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)	588,362,990.21	-18,014,976.52	570,348,013.69

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 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

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

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人，基金销售机构

海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、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
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2019年1月1日至2019年5月9日）		上年度可比期间（2018年01月01日至2018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	40,005,119.24	13.64	154,749,094.73	34.20
申万宏源	85,009,225.38	28.98	—	—

6.4.4.1.2 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。

6.4.4.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2019年1月1日至2019年5月9日）		上年度可比期间（2018年01月01日至2018年06月30日）	
	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（%）
海通证券	1,137,033.00	10.94	81,936.26	17.58
申万宏源	886,734.50	8.53	—	—

6.4.4.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2019年1月1日至2019年5月9日）		上年度可比期间（2018年01月01日至2018年06月30日）	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
海通证券	—	—	27,700,000.00	16.74
申万宏源	—	—	73,200,000.00	44.23

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2019年1月1日至2019年5月9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	77,469.78	28.60	77,469.78	28.60

海通证券	37,173.64	13.72	37,173.64	13.72
关联方名称	上年度可比期间（2018年01月01日至2018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（%）
海通证券	143,951.70	34.22	76,726.04	22.82

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2019年1月1日至2019年5月9日）	上年度可比期间（2018年01月01日至2018年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	2,127,964.73	3,032,055.88
其中：支付销售机构的客户维护费	414,218.91	635,974.19

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$

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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2019年1月1日至2019年5月9日）	上年度可比期间（2018年01月01日至2018年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	468,152.26	667,052.25

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$

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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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。

6.4.4.4.2 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。

6.4.4.5 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（2019年1月1日至2019年5月9日）		上年度可比期间（2018年01月01日至2018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
中国农业银行股份有限公司	41,740,656.71	100,686.22	39,231,942.07	176,285.94

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

6.4.4.7.1 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。

6.4.5 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.6 期末（2019年5月9日）本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.6.1.1 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
300777	中简科技	2019-05-08	2019-05-16	新股认购	6.06	6.06	1,156	7,005.36	7,005.36	—
600989	宝丰能源	2019-05-07	2019-05-16	新股认购	11.12	11.12	24,356	270,838.72	270,838.72	—
603267	鸿远电子	2019-05-07	2019-05-15	新股认购	20.24	20.24	1,651	33,416.24	33,416.24	—

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2019 年 05 月 09 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。

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 05 月 09 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。

6.4.7 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2019年5月9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541,271,291.87元，属于第二层次的余额为人民币311,260.32元，属于第三层次余额为人民币0.00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未发生变动。

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（转型后）

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	471,251,515.15	89.71
	其中：股票	471,251,515.15	89.71
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	32,816,474.40	6.25
8	其他各项资产	21,243,291.26	4.04
9	合计	525,311,280.81	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	118,132.52	0.02
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	33,869.94	0.01
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	152,002.46	0.03

7.2.1.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—

B	采矿业	—	—
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	471,099,512.69	90.21
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	471,099,512.69	90.21

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	2,136,502	76,871,341.96	14.72
2	601166	兴业银行	3,498,437	63,986,412.73	12.25
3	601328	交通银行	6,597,193	40,374,821.16	7.73
4	600016	民生银行	5,967,558	37,893,993.30	7.26
5	600000	浦发银行	2,834,110	33,102,404.80	6.34
6	601398	工商银行	5,206,399	30,665,690.11	5.87
7	000001	平安银行	2,072,366	28,557,203.48	5.47
8	601169	北京银行	3,572,506	21,113,510.46	4.04
9	601988	中国银行	5,087,611	19,027,665.14	3.64
10	601229	上海银行	1,318,956	15,629,628.60	2.99

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的半年度报告正文

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.02
2	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01
3	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的半年度报告正文

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	601166	兴业银行	6,288,166.00	1.08
2	601838	成都银行	2,372,184.00	0.41
3	601997	贵阳银行	1,299,509.00	0.22
4	601577	长沙银行	691,972.00	0.12
5	002948	青岛银行	689,848.57	0.12
6	002936	郑州银行	624,113.00	0.11
7	601860	紫金银行	541,124.00	0.09
8	601988	中国银行	524,669.00	0.09
9	002955	鸿合科技	58,070.28	0.01
10	601236	红塔证券	33,869.94	0.01
11	603217	元利科技	32,096.64	0.01
12	300782	卓胜微	26,220.47	0.00
13	603915	国茂股份	26,113.05	0.00
14	603982	泉峰汽车	18,062.55	0.00
15	603863	松炆资源	16,039.40	0.00
16	300779	惠城环保	14,228.73	0.00
17	300781	因赛集团	12,017.31	0.00
18	603327	福蓉科技	11,179.35	0.00

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	600036	招商银行	25,410,227.93	4.37
2	601166	兴业银行	9,238,262.00	1.59
3	601328	交通银行	9,096,785.00	1.57
4	600016	民生银行	8,380,485.01	1.44
5	600000	浦发银行	7,222,979.48	1.24
6	601398	工商银行	6,550,026.00	1.13
7	000001	平安银行	5,856,282.00	1.01
8	601988	中国银行	4,691,026.00	0.81

9	601169	北京银行	4,574,853.98	0.79
10	601229	上海银行	3,359,844.46	0.58
11	601818	光大银行	3,288,558.00	0.57
12	002142	宁波银行	3,191,059.12	0.55
13	600919	江苏银行	2,649,149.00	0.46
14	601009	南京银行	2,599,914.52	0.45
15	601939	建设银行	2,582,038.00	0.44
16	600015	华夏银行	2,471,961.00	0.43
17	601997	贵阳银行	2,139,857.00	0.37
18	601998	中信银行	954,664.00	0.16
19	600926	杭州银行	895,547.04	0.15
20	600989	宝丰能源	404,802.72	0.07

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	13,279,483.29
卖出股票收入（成交）总额	107,554,852.93

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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，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。

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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本报告编制日前一年内，本基金持有的“工商银行”的发行主体中国工商银行银行股份有限公司（以下简称“公司”）由于存在电话销售保险过程中欺骗投保人的行为，中国保险监督管理委员会北京监管局于 2018 年 11 月 19 日对公司处以罚款 30 万元的行政处罚，并责令改正违法行为（京保监罚（2018）28 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”）由于存在未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户等违法违规事实，中国人民银行于 2018 年 7 月 26 日作出对公司合计处以 130 万元罚款、对相关责任人共处以 8 万元罚款的行政处罚（银反洗罚决字（2018）1 号）；由于存在欺骗投保人、向投保人隐瞒与合同有关的重要情况等违法违规事实，上海保监局于 2018 年 10 月 18 日对公司作出责令改正，并处 34 万元罚款的行政处罚（沪保监罚（2018）46 号）；由

于存在并购贷款占并购交易价款比例不合规；并购贷款尽职调查和风险评估不到位等违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2018 年 11 月 9 日对公司作出罚款 50 万元的行政处罚（银保监银罚决字〔2018〕13 号）；由于存在如下违法违规事实：（一）不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权、（二）未尽职调查并使用自有资金垫付承接风险资产、（三）档案管理不到位、内控管理存在严重漏洞、（四）理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模、（五）违规向土地储备机构提供融资、（六）信贷资金违规承接本行表外理财资产、（七）理财资金违规投资项目资本金、（八）部分理财产品信息披露不合规、（九）现场检查配合不力，中国银行保险监督管理委员会于 2018 年 11 月 9 日对公司作出罚款 690 万元的行政处罚（银保监银罚决字〔2018〕12 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“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”），由于存在贷款业务严重违反审慎经营规则等违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2018 年 11 月 9 日对公司处以罚款 200 万元的行政处罚（银保监银罚决字〔2018〕5 号）；由于存在：（一）内控管理严重违反审慎经营规则、（二）同业投资违规接受担保、（三）同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资、（四）本行理财产品之间风险隔离不到位、（五）个人理财资金违规投资、（六）票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用、（七）为非保本理财产品提供保本承诺。中国银行保险监督管理委员会于 2018 年 11 月 9 日对公司处以罚款 3160 万元的行政处罚（银保监银罚决字〔2018〕8 号）；由于存在以贷收贷，掩盖资产真实质量、以贷转存，虚增存贷款规模等违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会大连监管局于 2019 年 4 月 2 日对公司处以罚款人民币 100 万元的行政处罚（大银保监罚决字〔2019〕76 号）；由于存在贷后管理不到位，银行承兑汇票保证金来源审查不严格，贷款回流作银行承兑汇票保证金等违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会大连监管局于 2019 年 4 月 2 日对公司作出罚款人民币 50 万元的行政处罚（大银保监罚决字〔2019〕78 号）；由于存在贷后管理不到位，以贷收贷，掩盖资产真实质量；贴现资金回流作银行承兑汇票保证金，滚动循环签发银行承兑汇票等违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会大连监

管局于 2019 年 4 月 2 日对公司作出罚款人民币 100 万元的行政处罚（大银保监罚决字〔2019〕80 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“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”）由于存在贷前调查不到位，向环保未达标的企业提供融资；贷后管理失职，流动资金贷款被挪用等违法违规事实，天津银监局于 2018 年 6 月 28 日对公司作出罚款人民币 50 万元的行政处罚（银反洗罚决字〔2018〕2 号）。由于公司存在未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告等违法违规事实，中国人民银行于 2018 年 7 月 26 日作出对公司合计处以 140 万元罚款、对相关责任人共处以 14 万元罚款的行政处罚（津银监罚决字〔2018〕35 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“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”）由于存在未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等违法违规事实，中国人民银行于 2018 年 7 月 26 日作出对公司合计处以 170 万元罚款、对相关责任人共处以 18 万元罚款的行政处罚（银反洗罚决字〔2018〕3 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 2015 年 5 月至 2016 年 5 月期间违规向其关系人发放信用贷款等违法违规事实，中国银行业监督管理委员会上海监管局于 2018 年 10 月 8 日对公司作出责令改正，罚没合计 1091460.03 元的行政处罚（沪银监罚决字〔2018〕49 号）。由于公司存在 2017 年对某同业资金违规投向资本金不足的房地产项目合规性审查未尽职等违法违规事实，中国银行业监督管理委员会上海监管局于 2018 年 10 月 18 日对公司作出责令改正，并处罚款 50

万元的行政处罚（沪银监罚决字〔2018〕54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“招商银行”的发行主体招商银行股份有限公司（以下简称“公司”）由于存在电话销售欺骗投保人等违法违规事实，深圳保监局于2018年7月5日作出对公司罚款30万元的行政处罚（深保监罚〔2018〕23号）。

招商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3名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	97,778.25
2	应收证券清算款	20,574,124.94
3	应收股利	—
4	应收利息	5,977.48
5	应收申购款	532,885.37
6	其他应收款	—
7	待摊费用	32,525.22
8	其他	—
9	合计	21,243,291.26

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.01	认购新股

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。

§ 7 投资组合报告（转型前）

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 (%)
10	权益投资	541,485,672.99	93.19
	其中：股票	541,485,672.99	93.19
11	基金投资	—	—
12	固定收益投资	96,879.20	0.02
	其中：债券	96,879.20	0.02
	资产支持证券	—	—
13	贵金属投资	—	—
14	金融衍生品投资	—	—
15	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
16	银行存款和结算备付金合计	41,740,656.71	7.18
17	其他各项资产	1,766,004.89	0.30
18	合计	585,089,213.79	100.69

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	408,524.34	0.07
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	64,158.64	0.01
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	—	—
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	472,682.98	0.08

7.2.1.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
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	541,012,990.01	93.11
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	541,012,990.01	93.11

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	2,850,102	92,400,306.84	15.90
2	601166	兴业银行	3,666,337	66,067,392.74	11.37
3	601328	交通银行	8,081,793	48,490,758.00	8.35
4	600016	民生银行	7,301,658	44,686,146.96	7.69
5	600000	浦发银行	3,453,510	38,403,031.20	6.61
6	601398	工商银行	6,344,399	35,021,082.48	6.03
7	000001	平安银行	2,525,266	30,707,234.56	5.28
8	601169	北京银行	4,353,406	26,425,174.42	4.55
9	601988	中国银行	6,199,611	22,876,564.59	3.94
10	601229	上海银行	1,607,256	18,644,169.60	3.21

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的半年度报告正文

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600989	宝丰能源	24,356	270,838.72	0.05
2	603967	中创物流	2,518	64,158.64	0.01
3	603697	有友食品	3,383	42,152.18	0.01
4	300772	运达股份	2,336	38,871.04	0.01
5	603267	鸿远电子	1,651	33,416.24	0.01

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的半年度报告正文

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	600036	招商银行	17,561,106.99	3.07
2	601166	兴业银行	12,885,272.38	2.25
3	601328	交通银行	10,017,988.00	1.75
4	600016	民生银行	9,160,954.56	1.60
5	600000	浦发银行	7,695,330.92	1.34
6	601398	工商银行	6,878,220.36	1.20

7	000001	平安银行	6,111,299.24	1.07
8	601169	北京银行	5,325,924.00	0.93
9	601988	中国银行	4,576,365.00	0.80
10	601818	光大银行	3,775,479.58	0.66
11	601229	上海银行	3,769,899.48	0.66
12	002142	宁波银行	2,965,882.34	0.52
13	600015	华夏银行	2,915,742.00	0.51
14	600919	江苏银行	2,800,244.00	0.49
15	601939	建设银行	2,681,249.00	0.47
16	601009	南京银行	2,633,238.88	0.46
17	601128	常熟银行	2,102,749.00	0.37
18	600926	杭州银行	1,171,690.20	0.20
19	601998	中信银行	1,109,970.94	0.19
20	601997	贵阳银行	1,029,993.14	0.18

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	600036	招商银行	30,049,054.80	5.25
2	600016	民生银行	21,658,926.88	3.78
3	601166	兴业银行	21,553,227.00	3.77
4	601328	交通银行	16,371,901.95	2.86
5	600000	浦发银行	12,213,183.88	2.13
6	601398	工商银行	11,334,168.00	1.98
7	000001	平安银行	10,033,230.57	1.75
8	601169	北京银行	8,418,638.02	1.47
9	601988	中国银行	7,446,057.60	1.30
10	601818	光大银行	6,123,884.00	1.07
11	601939	建设银行	5,843,684.30	1.02
12	600015	华夏银行	5,247,304.14	0.92
13	002142	宁波银行	5,024,525.49	0.88
14	600919	江苏银行	4,932,955.72	0.86
15	601009	南京银行	3,815,569.64	0.67
16	601229	上海银行	3,403,320.97	0.59
17	601998	中信银行	1,949,167.00	0.34
18	601997	贵阳银行	1,840,062.00	0.32
19	600926	杭州银行	846,128.60	0.15
20	600908	无锡银行	589,971.00	0.10

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	111,614,733.15
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	183,082,944.41
--------------	----------------

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	96,879.20	0.02
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	96,879.20	0.02

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	110058	永鼎转债	1,010	96,879.20	0.02

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，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。

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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本报告编制日前一年内，本基金持有的“工商银行”的发行主体中国工商银行银行股份有限公司（以下简称“公司”）由于存在电话销售保险过程中欺骗投保人的行为，中国保险监督管理委员会北京监管局于 2018 年 11 月 19 日对公司处以罚款 30 万元的行政处罚，并责令改正违法行为（京保监罚（2018）28 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”）由于存在未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户等违法违规事实，中国人民银行于 2018 年 7 月 26 日作出对公司合计处以 130 万元罚款、对相关责任人共处以 8 万元罚款的行政处罚（银反洗罚决字（2018）1 号）；由于存在欺骗投保人、向投保人隐瞒与合同有关的重要情况等违法违规事实，上海保监局于 2018 年 10 月 18 日对公

司作出责令改正，并处 34 万元罚款的行政处罚（沪保监罚〔2018〕46 号）；由于存在并购贷款占并购交易价款比例不合规；并购贷款尽职调查和风险评估不到位等违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2018 年 11 月 9 日对公司作出罚款 50 万元的行政处罚（银保监银罚决字〔2018〕13 号）；由于存在如下违法违规事实：（一）不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权、（二）未尽尽职调查并使用自有资金垫付承接风险资产、（三）档案管理不到位、内控管理存在严重漏洞、（四）理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模、（五）违规向土地储备机构提供融资、（六）信贷资金违规承接本行表外理财资产、（七）理财资金违规投资项目资本金、（八）部分理财产品信息披露不合规、（九）现场检查配合不力，中国银行保险监督管理委员会于 2018 年 11 月 9 日对公司作出罚款 690 万元的行政处罚（银保监银罚决字〔2018〕12 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“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”），由于存在贷款业务严重违反审慎经营规则等违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2018 年 11 月 9 日对公司处以罚款 200 万元的行政处罚（银保监银罚决字〔2018〕5 号）；由于存在：（一）内控管理严重违反审慎经营规则、（二）同业投资违规接受担保、（三）同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资、（四）本行理财产品之间风险隔离不到位、（五）个人理财资金违规投资、（六）票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用、（七）为非保本理财产品提供保本承诺。中国银行保险监督管理委员会于 2018 年 11 月 9 日对公司处以罚款 3160 万元的行政处罚（银保监银罚决字〔2018〕8 号）；由于存在以贷收贷，掩盖资产真实质量、以贷转存，虚增存贷款规模等违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会大连监管局于 2019 年 4 月 2 日对公司处以罚款人民币 100 万元的行政处罚（大银保监罚决字〔2019〕76 号）；由于存在贷后管理不到位，银行承兑汇票保证金来源审查不严格，贷款回流作银行承兑汇票保证金等违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会大连监管局于 2019 年 4 月 2 日对公司作出罚款人民币 50 万元的行政处罚（大银保监罚决字〔2019〕78 号）；由于存在贷后管理不到位，以贷收贷，掩盖资产真实质量；贴现资金回流作银行承兑汇票保证金，滚

动循环签发银行承兑汇票等违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会大连监管局于 2019 年 4 月 2 日对公司作出罚款人民币 100 万元的行政处罚（大银保监罚决字〔2019〕80 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“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”）由于存在贷前调查不到位，向环保未达标的企业提供融资；贷后管理失职，流动资金贷款被挪用等违法违规事实，天津银监局于 2018 年 6 月 28 日对公司作出罚款人民币 50 万元的行政处罚（银反洗罚决字〔2018〕2 号）。由于公司存在未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告等违法违规事实，中国人民银行于 2018 年 7 月 26 日作出对公司合计处以 140 万元罚款、对相关责任人共处以 14 万元罚款的行政处罚（津银监罚决字〔2018〕35 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“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”）由于存在未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等违法违规事实，中国人民银行于 2018 年 7 月 26 日作出对公司合计处以 170 万元罚款、对相关责任人共处以 18 万元罚款的行政处罚（银反洗罚决字〔2018〕3 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 2015 年 5 月至 2016 年 5 月期间违规向其关系人发放信用贷款等违法违规事实，中国银行业监督管理委员会上海监管局于 2018 年 10 月 8 日对公司作出责令改正，罚没合计 1091460.03 元的行政处罚（沪银监罚决字〔2018〕49 号）。由于公司存在 2017 年对某同业资金违规投向资本金不足的房地产项目合规性审查未尽职等违法违规事实，中国银行业监督

管理委员会上海监管局于 2018 年 10 月 18 日对公司作出责令改正，并处罚款 50 万元的行政处罚（沪银监罚决字〔2018〕54 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“招商银行”的发行主体招商银行股份有限公司（以下简称“公司”）由于存在电话销售欺骗投保人等违法违规事实，深圳保监局于 2018 年 7 月 5 日作出对公司罚款 30 万元的行政处罚（深保监罚〔2018〕23 号）。

招商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 3 名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	90,371.19
2	应收证券清算款	435,937.14
3	应收股利	—
4	应收利息	44,506.58
5	应收申购款	1,195,189.98
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,766,004.89

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600989	宝丰能源	270,838.72	0.05	认购新股
2	603267	鸿远电子	33,416.24	0.01	认购新股

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（转型后）

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 (%)
16,135	30,325.14	187,613,572.01	38.34	301,682,586.88	61.66

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	杨光	2,258,000	9.12
2	穆松	1,404,575	5.68
3	王武世	916,909	3.71
4	姚桂琪	784,233	3.17
5	梁小芬	701,697	2.84
6	梁田法	564,804	2.28
7	陈斌	559,542	2.26
8	王宏	497,816	2.01
9	石国霞	497,617	2.01
10	周正龙	497,057	2.01

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理公司所有从业人员持有本基金	15,403.90	0.0031

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放 式基金	0
本基金基金经理持有本开放式 基金	0

§9 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
富国中证银行指 数分级 A	164	144,842.05	16,725,660.00	70.41	7,028,437.00	29.59
富国中证银行指 数分级 B	828	28,688.52	100.00	0.00	23,753,998.00	100.00
富国中证银行指 数分级	16,016	32,850.03	236,980,480.03	45.04	289,145,579.26	54.96
合计	17,008	33,727.32	253,706,240.03	44.23	319,928,014.26	55.77

9.2 期末上市基金前十名持有人

富国中证银行指数分级 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国太平洋财产保险—传统—普通 保险产品-013C-CT001 深	6,752,900	28.43
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司 —分红—个人分红	6,100,000	25.68
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司 —传统—普通保险产品	3,767,760	15.86
4	陈斌	845,409	3.56
5	梁小芬	803,200	3.38
6	黄健立	679,200	2.86
7	梁田法	562,125	2.37
8	石书健	496,000	2.09
9	周绍勋	433,764	1.83
10	钱中明	317,300	1.34

富国中证银行指数分级 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	杨光	2,280,000	9.60
2	穆松	1,411,300	5.94
3	王武世	921,299	3.88
4	祝海鹏	850,024	3.58
5	邓旺	577,800	2.43
6	王宏	500,200	2.11
7	石国霞	500,000	2.10
8	周正龙	499,437	2.10
9	张琪	464,902	1.96
10	周韞	461,200	1.94

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	富国中证银行指数分级 A	—	—
	富国中证银行指数分级 B	—	—
	富国中证银行指数分级	—	—
	合计	—	—

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	富国中证银行指数 分级 A	0
	富国中证银行指数 分级 B	0
	富国中证银行指数 分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富国中证银行指数 分级 A	0
	富国中证银行指数 分级 B	0
	富国中证银行指数 分级	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日(2019年05月10日)基金份额总额	573,634,254.29
基金合同生效日2019年5月10日起至报告期期末基金总申购份额	21,172,013.60
减:基金合同生效日2019年5月10日起至报告期期末基金总赎回份额	105,510,109.00
基金合同生效日2019年5月10日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	489,296,158.89

§ 9 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	富国中证银行指数分级 A	富国中证银行指数分级 B	富国中证银行指数分级
基金合同生效日(2015年04月30日)基金份额总额	—	—	2,070,718,877.49
报告期期初基金份额总额	34,267,390.00	34,267,391.00	572,669,722.39
本报告期基金总申购份额	—	—	211,672,908.36
减：本报告期基金总赎回份额	—	—	279,243,157.46
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-10,513,293.00	-10,513,293.00	21,026,586.00
报告期期末基金份额总额	23,754,097.00	23,754,098.00	526,126,059.29

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§ 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

本基金管理人于2019年2月23日发布公告，薛爱东先生自2019年2月22日起不再担任公司董事长，由陈戈先生代行公司董事长职责。

本基金管理人于2019年3月28日发布公告，裴长江先生自2019年3月27日起担任公司董事长。

2019年1月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019年4月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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（转型后）

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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
光大证券	2	47,200,841.89	39.14	98,071.00	100.00	—	—	—	—	43,871.39	39.14	—
国海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国金证券	2	2,182,498.93	1.81	—	—	—	—	—	—	1,988.64	1.77	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国信证券	1	18,414,049.71	15.27	—	—	—	—	—	—	17,148.70	15.30	—
海通证券	2	52,789,047.97	43.78	—	—	—	—	—	—	49,068.22	43.78	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
银河证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

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

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

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	9,200,829.45	3.14	—	—	—	—	—	—	8,384.39	3.10	—
光大证券	2	148,951,378.37	50.77	3,768,236.70	36.27	8,000,000.00	100.00	—	—	138,457.98	51.11	—
国海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国金证券	2	4,743,793.00	1.62	—	—	—	—	—	—	4,327.70	1.60	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	2	40,005,119.24	13.64	1,137,033.00	10.94	—	—	—	—	37,173.64	13.72	—
华泰证券	1	432,075.57	0.15	4,454,514.81	42.87	—	—	—	—	393.91	0.15	—
申万宏源	2	85,009,225.38	28.98	886,734.50	8.53	—	—	—	—	77,469.78	28.60	—
银河证券	1	5,023,141.00	1.71	143,517.50	1.38	—	—	—	—	4,678.58	1.73	—
招商证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

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

§ 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，基金管理人于 2019 年 3 月 23 日发布《关于富国中证银行指数分级证券投资基金修订基金合同的公告》，增加了“富国银行 A 份额与富国银行 B 份额的终止运作”章节的内容。基金管理人于 2019 年 4 月 4 日在指定媒介发布《关于富国中证银行指数分级证券投资基金之富国银行 A 份额和富国银行 B 份额终止运作并修改基金合同的公告》，向深圳证券交易所申请富国中证银行指数分级证券投资基金的两级子份额退市，并于 2019 年 5 月 9 日（基金折算基准日）对富国银行 A 份额和富国银行 B 份额办理向场内富国银行份额的折算业务，《富国中证银行指数型证券投资基金基金合同》于基金折算基准日次一工作日即 2019 年 5 月 10 日正式生效，《富国中证银行指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。