

富国创业板交易型开放式指数证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。基金托管人中国建设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	富国创业板 ETF
场内简称	创业 100
基金主代码	159971
交易代码	159971
基金运作方式	契约型，交易型开放式。
基金合同生效日	2019 年 06 月 11 日
报告期末基金份额总额（单位：份）	6,010,144.00
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.20%，年跟踪误差不超过 2%。组合复制策略方面，本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。本基金的组合复制策略、替代性策略、衍生品投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	创业板指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

## § 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	210,628.26
2. 本期利润	502,810.65
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0837
4. 期末基金资产净值	10,580,944.89
5. 期末基金份额净值	1.7605

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	4.99%	2.06%	5.60%	2.10%	-0.61%	-0.04%
过去六个月	36.83%	1.77%	37.55%	1.80%	-0.72%	-0.03%
过去一年	56.25%	1.83%	58.20%	1.87%	-1.95%	-0.04%
自基金合同生效起至今	76.05%	1.72%	79.88%	1.75%	-3.83%	-0.03%

#### 3.2.2 自基金合同生效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 6 月 11 日成立，建仓期 6 个月，从 2019 年 6 月 11 日起至 2019 年 12 月 10 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		
曹璐迪	本基金基金经理	2020-08-06	—	4.2	硕士，自 2016 年 7 月起历任富国基金管理有限公司助理定量研究员、定量研究员；自 2020 年 5 月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金、富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2020 年 8 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、富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
王乐乐	本基金前任基金经理	2019-06-11	2020-08-06	10.3	博士，自 2010 年 6 月至 2011 年 11 月在上海证券有限责任公司任研究员；自 2011 年 11 月至 2012 年 6 月在华泰联合证券有限责任公司任研究员；自 2012 年 7 月至 2015 年 5 月在华泰证券股份有限公司历任研究员、创新规划团队负责人；自 2015 年 5 月加入富国基金管理有限公司，2015 年 8 月至 2020 年 1 月任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金

				<p>经理,2016年10月至2018年7月任富国全球债券证券投资基金基金经理,2017年10月至2020年1月任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,2017年11月至2020年1月任富国中证工业4.0指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理,2018年11月至2020年5月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2018年12月至2020年5月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理,2019年3月至2020年8月任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年6月至2020年8月任富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年7月起任富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年9月起任富国中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年10月起任富国中证消费50交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年11月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金、富国中证科技50策略交易型开放式指数证券投资基金、富国中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理,2019年12月起任</p>
--	--	--	--	---

				富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2020年1月起任富国中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020年2月起任富国中证科技50策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020年3月起任富国中证医药50交易型开放式指数证券投资基金、富国中证消费50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2020年5月起任富国中证800交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020年7月起任富国上海金交易型开放式证券投资基金、富国上海金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理；兼任量化投资部ETF投资总监。具有基金从业资格。
--	--	--	--	--

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遵规守信情况说明

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

### **4.3 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 4.99%，同期业绩比较基准收益率为 5.60%

#### **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**

1、本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2、自 2020 年 7 月 1 日至本报告期末（2020 年 9 月 30 日），本基金存在资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况，基金管理人已向中国证监会报告此情形并将采取适当措施。

## § 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	10,498,153.09	99.03
	其中：股票	10,498,153.09	99.03
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	102,987.78	0.97
7	其他资产	334.11	0.00
8	合计	10,601,474.98	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	6,325.55	0.06
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	—	—
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	6,325.55	0.06

### 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	430,507.10	4.07
B	采矿业	—	—
C	制造业	6,095,448.87	57.61
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	10,594.00	0.10
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	1,605,110.47	15.17
J	金融业	777,219.00	7.35
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	70,368.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	320,145.00	3.03
N	水利、环境和公共设施管理业	60,900.00	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	687,724.18	6.50
R	文化、体育和娱乐业	433,810.92	4.10
S	综合	—	—
	合计	10,491,827.54	99.16

### 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	300750	宁德时代	3,500	732,200.00	6.92
2	300059	东方财富	26,400	633,336.00	5.99
3	300760	迈瑞医疗	1,700	591,600.00	5.59
4	300498	温氏股份	21,315	416,495.10	3.94
5	300015	爱尔眼科	7,404	380,713.68	3.60
6	300142	沃森生物	6,400	325,632.00	3.08
7	300122	智飞生物	2,300	320,413.00	3.03
8	300124	汇川技术	5,000	289,500.00	2.74
9	300014	亿纬锂能	5,383	266,458.50	2.52
10	300601	康泰生物	1,300	236,613.00	2.24

### 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	003006	百亚股份	341	6,325.55	0.06

### 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，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。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

根据基金合同，本基金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。

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。

### 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	323.21
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	10.90
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	334.11

#### 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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

#### 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	6,010,144.00
报告期期间基金总申购份额	—
减：报告期期间基金总赎回份额	—

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	6,010,144.00

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020-07-01 至 2020-08-23; 2020-08-28 至 2020-09-30	2,414,765.00	3,830,400.00	4,447,500.00	1,797,665.00	29.91%

#### 产品特有风险

本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，经向深圳证券交易所申请并获得同意，基金管理人就富国创业板

交易型开放式指数证券投资基金的基金场内简称进行变更,变更后的场内简称为“创业 100”,具体可参见基金管理人于 2020 年 7 月 3 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国创业板交易型开放式指数证券投资基金变更基金场内简称的公告》。

## **§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创业板交易型开放式指数证券投资基金的文件
- 2、富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、富国创业板交易型开放式指数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、富国创业板交易型开放式指数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

### **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