

富国科创板两年定期开放混合型证券投资基金

二〇二一年第1季度报告

2021年03月31日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2021年04月22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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 4 月 20 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	富国科创板两年定期开放混合
场内简称	富国科创板
基金主代码	506003
交易代码	506003
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020年07月29日
报告期末基金份额总额（单位：份）	2,966,257,460.26
投资目标	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	本基金主要采用资产配置策略、战略配售策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等投资策略。在封闭期内，本基金将积极关注并深入分析和论证科创板战略配售股票的投资机会，通过综合分析行业景气度、企业的基本面、估值水平等多方面的因素，结合未来市场走势判断，精选科创板战略配售股票。战略配售股票锁定期结束后，本基金可对股票的投资价值做出判断，结合市场环境，在有效识别和防范风险的前提下，选择适当的退出时机，力争获取较高的投资回报。科创板上市企业具有较为明显的行业特征，以科技创新企业为主，较少受到宏观经济波动的影响，其投资价值主要通过行业空间、竞争格局的分析来挖掘。在投资策略上，本基金采取自下而上的精选个股策略，从公司提供的产品和服务的研究入手，测算市场空间，分析公司商业模式的壁垒和竞争格局。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率*70%+恒生港股通指数收益率（使用估值汇率折算）*10%+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，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资港股通标的股票的，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。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§ 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（2021年01月01日-2021年03月31日）
1. 本期已实现收益	29,962,759.88
2. 本期利润	-331,927,223.48
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1119
4. 期末基金资产净值	2,489,861,929.92
5. 期末基金份额净值	0.8394

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	-11.76%	2.03%	-3.93%	1.81%	-7.83%	0.22%
过去六个月	-8.91%	1.84%	9.30%	1.47%	-18.21%	0.37%
自基金合同生效起至今	-16.06%	1.69%	7.20%	1.38%	-23.26%	0.31%

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2021年3月31日。

2、本基金于2020年7月29日成立，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2020年7月29日起至2021年1月28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		
李元博	本基金基金经理	2020-07-29	—	11.62	硕士，自2009年8月至2010年12月在湘财证券有限责任公司任研究员；自2010年12月至2011年9月在天治基金管理有限公司任研究员；自2011年9月至2015年7月在汇丰晋信基金管理有限公司任

					研究员、基金经理；2015年7月加入富国基金管理有限公司，2015年11月起任富国高新技术产业混合型证券投资基金（原富国高新技术产业股票型证券投资基金，于2015年7月21日更名）基金经理，2016年6月起任富国创新科技混合型证券投资基金基金经理，2019年5月起任富国科技创新灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年6月起任富国科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020年7月起任富国创新趋势股票型证券投资基金、富国科创板两年定期开放混合型证券投资基金基金经理；兼任权益投资部权益投资副总监。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科创板两年定期开放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》、《富国科创板两年定期开放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 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

根据投资契约的限制，本基金主要的投资范围在科创板。本基金的投资思路是在符合投资范围的行业中，寻找长期成长空间大的公司长期投资，针对中短期的机会进行阶段性的投资。

在一季度中，我们主要的配置方向在医药、机械、半导体行业，包括了医疗器械、半导体设备和材料、自动化装备领域。其中半导体行业的整体估值高，市场在2月下旬到3月份的下跌中，组合的回撤幅度比较大。按照本基金的框架，长期以较高仓位进行运作，在市场波动的时候组合波动性较大，这一点请各位投资者注意。本基金在组合构建过程中淡化择时，在市场波动率上升时组合不可避免的会面临回撤的风险。

对于今年的市场，我们判断是宽幅震荡。得出这个判断是基于两方面的因素，第一是经济的复苏带来企业盈利的增长，第二是经济复苏带来宽松货币政策的退出。所以总体来看，市场是处于估值收缩同时盈利扩张的状态。由于有盈利的支撑，我们并不认为今年是单边的熊市，存在较多个股选择的机会。本基金积极在科技行业中寻找优质的个股进行投资，但需要降低收益率目标，这一点请投资者格外注意。

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-11.76%，同期业绩比较基准收益率为-3.93%

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	2,351,443,467.64	92.31
	其中：股票	2,351,443,467.64	92.31
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	193,957,713.65	7.61

7	其他资产	1,896,911.93	0.07
8	合计	2,547,298,093.22	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 161,716,990.40 元，占资产净值比例为 6.50%。

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	1,879,578,165.70	75.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,036.12	0.00
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	14,425,809.00	0.58
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	293,248,803.80	11.78
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	2,402,280.20	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	47,382.42	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	—	—
S	综合	—	—
	合计	2,189,726,477.24	87.95

5.2.2 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	161,716,990.40	6.50
合计	161,716,990.40	6.50

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投资的股票。

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	688002	睿创微纳	2,646,707	234,762,910.90	9.43
2	688686	奥普特	869,533	206,774,947.40	8.30
3	688036	传音控股	985,394	206,321,795.72	8.29
4	688608	恒玄科技	742,246	175,904,879.54	7.06
5	688023	安恒信息	626,754	163,378,284.82	6.56
6	01810	小米集团 -W	7,346,800	159,866,368.00	6.42
7	688016	心脉医疗	395,031	114,705,151.47	4.61
8	688019	安集科技	602,135	112,587,202.30	4.52
9	688095	福昕软件	482,541	107,278,515.12	4.31
10	688389	普门科技	2,877,667	67,251,077.79	2.70

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，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。

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

本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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。

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	1,868,481.87
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	28,430.06
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,896,911.93

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

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	688023	安恒信息	42,644,500.00	1.71	大宗交易限售

注：本基金本报告期末持有安恒信息（股票代码 688023）公允价值为 163,378,284.82 元，其中大宗交易限售股票部分公允价值为 42,644,500.00 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	2,966,257,460.26
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	2,966,257,460.26

§ 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，经中国证券登记结算有限责任公司同意，投资者自 2021 年 1 月 29 日起可以通过本基金的销售机构办理本基金份额跨系统转托管业务。具体可参见基金管理人于 2021 年 1 月 28 日发布的《关于富国科创板两年定期开放混合型证券投资基金开通跨系统转托管业务公告》。

§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科创板两年定期开放混合型证券投资基金的文件
- 2、富国科创板两年定期开放混合型证券投资基金基金合同
- 3、富国科创板两年定期开放混合型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、富国科创板两年定期开放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

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
2021 年 04 月 22 日