

富国绿色纯债一年定期开放债券型证券投资基金

二〇二一年第3季度报告

2021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

送出日期：2021年10月27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 2021 年 10 月 25 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 7 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富国绿色纯债一年定开债券
基金主代码	005383
交易代码	005383
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2018年01月26日
报告期末基金份额总额（单位：份）	270,814,908.73
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，力争为持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金通过投资发行人致力于推动绿色产业发展或募集资金主要用于绿色项目或支持绿色产业发展的债券来开展绿色投资。本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。一方面根据整体资产配置要求通过积极的投资策略主动寻找风险中蕴藏的投资机会，发掘价格被低估的且符合流动性要求的合适投资品种；另一方面通过风险预算管理、平均剩余期限控制和个券信用等级限定等方式有效控制投资风险，从而在一定的风险限制范围内达到风险收益最佳配比。本基金在绿色债券的投资中，主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整，并开展资产支持证券投资。
业绩比较基准	中国债券综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。
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（2021年07月01日- 2021年09月30日）
1. 本期已实现收益	2,952,523.98
2. 本期利润	3,539,472.15
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0131

4. 期末基金资产净值	303,011,302.04
5. 期末基金份额净值	1.1189

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。

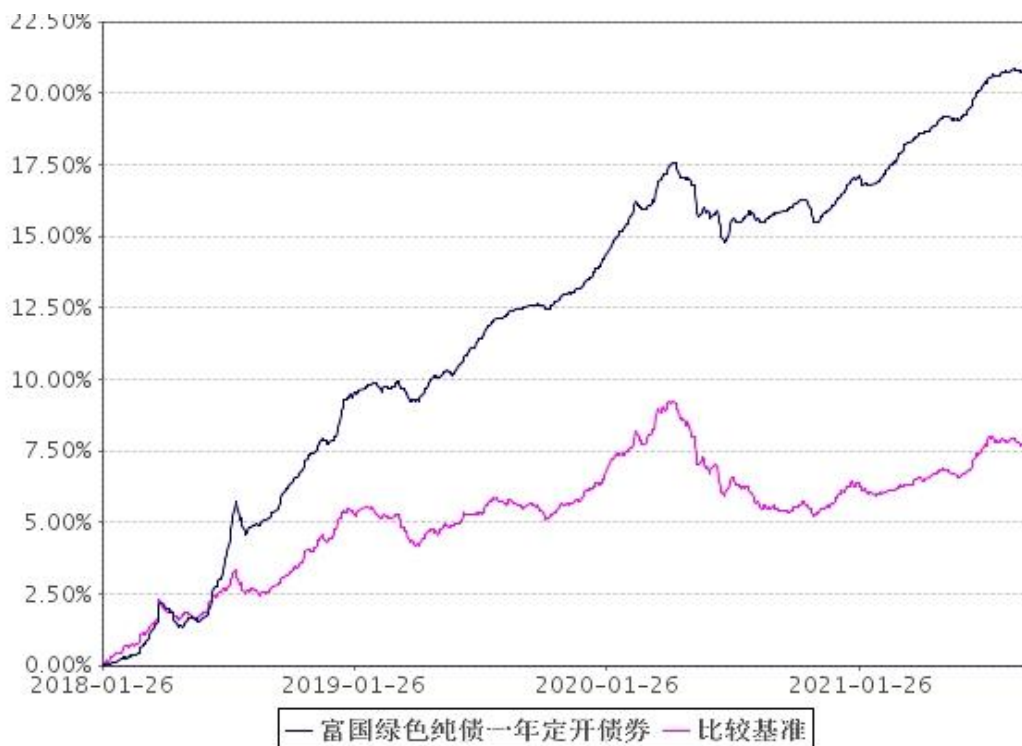
本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 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	1.18%	0.04%	0.83%	0.06%	0.35%	-0.02%
过去六个月	2.24%	0.03%	1.28%	0.05%	0.96%	-0.02%
过去一年	4.23%	0.04%	2.13%	0.04%	2.10%	0.00%
过去三年	14.62%	0.05%	4.80%	0.07%	9.82%	-0.02%
自基金合同生效起至今	20.73%	0.06%	7.67%	0.07%	13.06%	-0.01%

#### 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9月30日。

2、本基金于2018年1月26日成立，建仓期6个月，从2018年1月26日起至2018年7月25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		
朱梦娜	本基金基金经理	2019-03-13	—	9.3	硕士，曾任中国国际金融股份有限公司研究员；自2017年4月加入富国基金管理有限公司，历任固定收益基金经理助理；现任富国基金固定收益投

				<p>资部固定收益基金经理。2019年2月起任富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金（已于2019年8月28日变更为富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金）、富国景利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2019年3月起任富国绿色纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2019年5月至2019年11月任富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2019年9月起任富国投资级信用债债券型证券投资基金基金经理，2019年11月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2019年11月起任富国汇远纯债三年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020年1月起任富国汇优纯债63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2021年7月起任富国汇鑫金融债三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。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绿色纯债一年定期开放债券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》、《富国绿色纯债一年定期开放债券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，以为投资者减少和分散风险、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**

进入 2021 年下半年，央行于 7 月初宣布全面降准 0.5%，降准时点和降准力度均超出市场预期，10 年期国债收益率在此后 1 个月时间内从 3.10%附近下行至 2.80%的年内低点，下行幅度较为可观。降准主要目的在于实施跨周期调节，降低实体融资成本，降准释放的资金部分用于对冲下半年大量 MLF 到期，货币市场流动性整体将保持宽松稳定。下半年以来国内经济存在下行压力，地产和城投行业再融资受约束，传统托底经济的地产和基建投资表现冷淡，能耗双控背景下大宗商品价格快速上涨，PPI 同比进一步攀高。目前国内政策着力促进经济结构转型，强调跨周期调节，因而政策实施更加精细化，也更注重总量政策和监管政策配合来应对。进入 8 月中下旬，监管指导银行理财加快净值化转型，金融次级类债券的利差猛烈走扩，随之也带动了信用债市场出现明显的调整，利率债收益率也底部小幅回升。本基金报告期内继续优化持仓结构，突出绿色债券投资风格，封闭期内积极调整组合持仓结构，采取适当的杠杆策略增厚组合收益，报告期内净值有所增长。

#### **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 1.18%，同期业绩比较基准收益率为 0.83%



#### 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	—	—
	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	399,465,350.00	98.60
	其中：债券	399,465,350.00	98.60
	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	640,751.64	0.16
7	其他资产	5,021,810.78	1.24
8	合计	405,127,912.42	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票资产。

#### 5.3 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

##### 5.3.1 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

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	19,795,000.00	6.53
2	央行票据	—	—
3	金融债券	35,650,000.00	11.77
	其中：政策性金融债	20,274,000.00	6.69
4	企业债券	31,903,150.00	10.53
5	企业短期融资券	71,176,200.00	23.49
6	中期票据	240,941,000.00	79.52
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	399,465,350.00	131.83

### 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

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	132100034	21 雅砻江 GN002(碳中和 债)	200,000	20,200,000.00	6.67
2	102101719	21 铁塔股份 MTN001	200,000	19,942,000.00	6.58
3	102101795	21 宝钢 MTN001(可持续 挂钩)	200,000	19,860,000.00	6.55
4	132100100	21 南昌轨交 GN004	110,000	10,969,200.00	3.62
5	101900752	19 粤智产 MTN001	100,000	10,320,000.00	3.41

## **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**

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**

本基金根据基金合同约定, 不允许投资股指期货.

## **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**

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“21 国开 10”的发行主体国家开发银行（以下简称“公司”），由于存在违反银行交易记录管理规定的行为，国家

外汇管理局北京外汇管理部于 2020 年 10 月 26 日对公司做出罚款 60 万元的行政处罚(京汇罚(2020)32 号);由于存在为违规的政府购买服务项目提供融资;项目资本金管理不到位,棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况;违规变相发放土地储备贷款等 24 项违法违规事实,中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 25 日对公司作出罚款 4880 万元的行政处罚(银保监罚决字(2020)67 号)。

本报告编制日前一年内,本基金持有的“19 建设银行永续债”的发行主体中国建设银行股份有限公司(以下简称“公司”),由于存在:(1)占压财政存款或者资金;(2)违反账户管理规定的违法违规事实,中国人民银行于 2021 年 8 月 13 日对公司做出警告,并处罚款 388 万元的行政处罚(银罚字(2021)22 号)。

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 8 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。

股票不属于本基金的投资范围,故本项不适用。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,217.14
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	5,007,593.64
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,021,810.78

#### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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	270,814,908.73
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	270,814,908.73

## § 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	2021-07-01 至 2021-09-30	109,649,885.04	-	-	109,649,885.04	40.49%
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，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《富国绿色纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人决定自 2021 年 7 月 30 日起将本基金基金管理人的管理费年费率由 0.60%调整为 0.50%；将基金托管人的托管费年费率由 0.20%调整为 0.10%，并相应修改基金合同和其他法律文件相关内容。具体可参见基金管理人于 2021 年 7 月 28 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国绿色纯债一年定期开放债券型证券投资基金调整管理费率 and 托管费率并修改基金合同的公告》及修改后的基金合同等法律文件。

## § 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绿色纯债一年定期开放债券型证券投资基金的文件
- 2、富国绿色纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同

- 3、富国绿色纯债一年定期开放债券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、富国绿色纯债一年定期开放债券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 10 月 27 日