

富国创业板交易型开放式指数证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	富国创业板 ETF
场内简称	创业板 ETF 富国
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）	4,010,144.00
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、存托凭证投资策略、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（2021 年 07 月 01 日-2021 年 09 月 30 日）
1. 本期已实现收益	1,632,214.65
2. 本期利润	-1,202,808.19
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2183
4. 期末基金资产净值	8,781,908.54
5. 期末基金份额净值	2.1899

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。

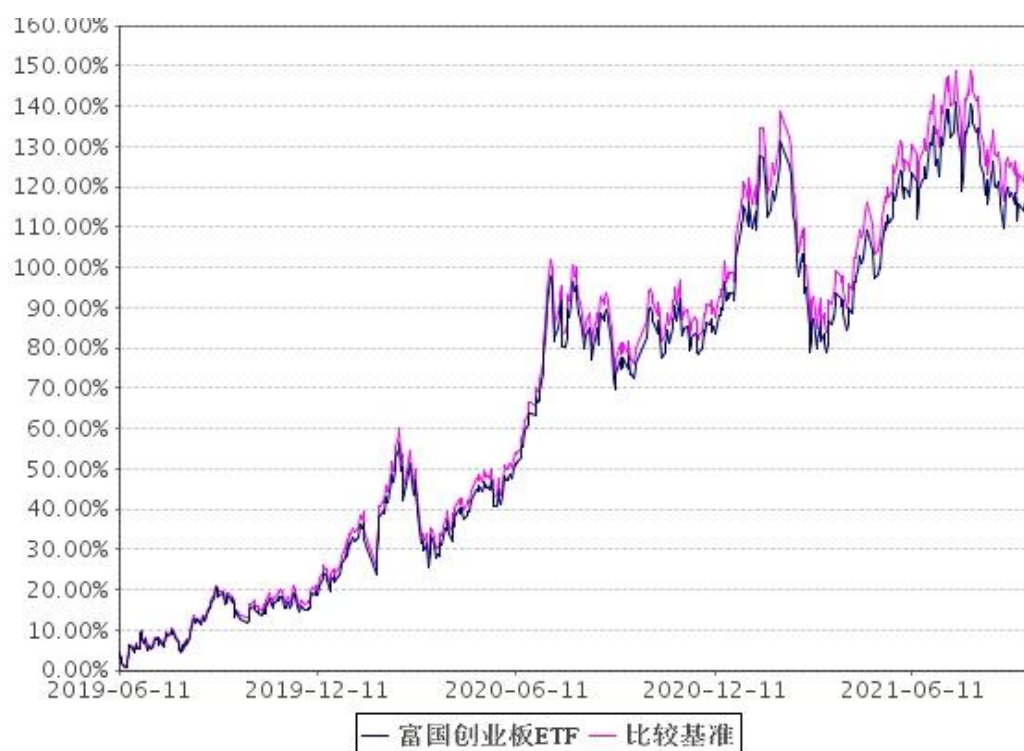
本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

## 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	-6.83%	1.84%	-6.69%	1.87%	-0.14%	-0.03%
过去六个月	16.93%	1.73%	17.62%	1.76%	-0.69%	-0.03%
过去一年	24.39%	1.82%	26.02%	1.85%	-1.63%	-0.03%
自基金合同生效起至今	118.99%	1.76%	126.69%	1.79%	-7.70%	-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 2021 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	—	5.2	硕士，自 2016 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、定量研究员；现任富国基金量化投资部定量基金经理。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 月至 2021 年 6 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，自 2020 年 8 月起任富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 3 月起任富国中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金基

				<p>金经理，2021年6月起任富国中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021年7月起任富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021年8月起任富国中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、富国中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。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，央行宣布下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点，在相对充裕的流动性及靓丽中报业绩的推动下，锂电池产业链、光伏、半导体等板块持续上涨，同时周期板块如有色、化工、煤炭等也表现突出。7月下旬，由于中小学课外培训的监管进一步加强，受教育板块大幅下跌及外资流出的影响，市场出现一定程

度的恐慌，迎来大幅调整。随着反垄断与教育政策利空靴子落地，同时相关部委对资本市场关切问题进行表态，释放维护资本市场稳定的信号，投资者情绪逐步修复，8月A股整体迎来反弹，其中周期板块如稀土、钢铁、煤炭、化工等板块表现突出。9月初，随着美联储主席鲍威尔在杰克逊霍尔会议上的讲话偏鸽派，同时美国最新非农数据大幅低于预期，投资者预计9月美联储会议开启Taper概率下降，全球股市集体走高。9月中旬，随着煤炭等能源价格高企，各地限电进一步增加，叠加多部委对煤炭价格重视度提升，周期板块迎来调整。9月下旬，受个别地产企业信用风险暴露、限电导致经济预期回落、美国财政将触及债务上限、长假效应等因素影响，市场风险偏好大幅降低，其中前期涨幅较大的个股整体回调幅度均较大。总体来看，2021年3季度上证综指下跌0.64%，沪深300下跌6.85%，创业板指下跌6.69%，中证500指数上涨4.34%，中证1000指数上涨4.54%。

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-6.83%，同期业绩比较基准收益率为-6.69%

#### 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2021年7月1日至本报告期末（2021年9月30日），本基金存在资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况。

## § 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	8,642,532.91	97.97
	其中：股票	8,642,532.91	97.97
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	179,285.43	2.03
7	其他资产	34.30	0.00
8	合计	8,821,852.64	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

注：本基金本报告期末未持有境内积极投资股票资产。

### 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	175,400.05	2.00
B	采矿业	—	—
C	制造业	6,133,388.98	69.84
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	7,688.00	0.09
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	585,204.24	6.66
J	金融业	735,962.40	8.38
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	28,100.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	463,799.00	5.28
N	水利、环境和公共设施管理业	38,073.00	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—

Q	卫生和社会工作	323,430.20	3.68
R	文化、体育和娱乐业	151,487.04	1.72
S	综合	—	—
	合计	8,642,532.91	98.41

### 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 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	2,600	1,366,898.00	15.56
2	300059	东方财富	19,320	664,028.40	7.56
3	300760	迈瑞医疗	1,100	423,962.00	4.83
4	300274	阳光电源	2,500	370,950.00	4.22
5	300015	爱尔眼科	5,503	293,860.20	3.35
6	300122	智飞生物	1,800	286,182.00	3.26
7	300014	亿纬锂能	2,883	285,503.49	3.25
8	300124	汇川技术	4,000	252,000.00	2.87
9	300142	沃森生物	3,900	246,402.00	2.81
10	300347	泰格医药	1,350	234,900.00	2.67

#### 5.3.2 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 5.3.3 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**

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**

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**

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	16.90
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	17.40
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	34.30

### 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：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 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	2,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	4,000,000.00
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	4,010,144.00

## § 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	2021-07-01 至 2021-07-25;20 21-07-27 至 2021-09-02	1,752, 178.00	2,729, 100.00	3,915, 900.00	565,378.00	14.10%
	2	2021-07-08;20 21-07-15 至 2021-08-18;20 21-08-20 至 2021-08-22;20 21-09-01 至 2021-09-30	1,193, 965.00	6,083, 200.00	6,307, 500.00	969,665.00	24.18%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期，依据《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》、《富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会。在基金托管人监督下，本基金管理人对本次大会表决进行了计票，上海市通力律师事务所对计票过程进行了见证，上海市东方公证处对计票过程及结果进行了公证。经统计，本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的基金份额持有人所代表的份额少于权益登记日基金总份额的 50%，未达到法定的会议召开条件。具体可参见基金管理人于 2021 年 9 月 7 日发布的《富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》及相关提示性公告。

二、本报告期，根据深圳证券交易所《关于深圳证券交易所基金增加扩位证券简称有关事项的通知（深证上[2021]764 号）》，经向深交所申请，基金管理人自 2021 年 8 月 23 日起新增本基金扩位证券简称“创业板 ETF 富国”。具体可参见基金管理人于 2021 年 8 月 21 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告》。

## §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  
2021 年 10 月 27 日