

富国腾享回报 6 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金
二 0 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： 交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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 29 日（基金合同生效日）起至 2021 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式	
基金主代码	012270	
基金运作方式	契约型开放式。每个交易日开放申购，每份基金份额设定 6 个月的滚动运作期。	
基金合同生效日	2021 年 07 月 29 日	
报告期末基金份额总额（单位：份）	68,597,098.88	
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争为基金份额持有人提供长期稳定和超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金的大类资产配置策略将作为“自下而上”选股的补充，目的是帮助基金把握市场整体的系统性机会或规避市场整体的系统性风险。其基本原理为比较和分析各大类资产的预期收益和风险（包括股票、存托凭证、债券、货币市场工具、金融衍生品和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种），以确定投资组合中各类资产的配置比例。在债券投资方面，本基金将采用久期控制下的主动性投资策略，在严格控制整体资产风险的基础上，根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合整体框架；在股票投资方面，本基金将精选基本面良好、有长期投资价值的优质企业；本基金的存托凭证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略和资产支持证券投资策略详见法律文件。	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×80%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+沪深 300 指数收益率×15%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 A	富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	012270	012271
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	41,481,689.47	27,115,409.41

§ 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	富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 A 报告期（2021 年 07 月 29 日- 2021 年 09 月 30 日）	富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 C 报告期（2021 年 07 月 29 日- 2021 年 09 月 30 日）
1. 本期已实现收益	495,748.25	309,837.54
2. 本期利润	364,019.82	223,791.16
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0088	0.0083
4. 期末基金资产净值	41,845,709.29	27,339,200.57
5. 期末基金份额净值	1.0088	1.0083

注：本基金于 2021 年 7 月 29 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。

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

(1) 富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 A

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
自基金合同生效起至今	0.88%	0.11%	0.21%	0.22%	0.67%	-0.11%

(2) 富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 C

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
自基金合同生效起至今	0.83%	0.11%	0.21%	0.22%	0.62%	-0.11%

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

(1) 自基金合同生效以来富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 A 基金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 2021 年 9 月 30 日。

2、本基金于 2021 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 2021 年 7 月 29 日起至 2022 年 1 月 28 日，本期末建仓期还未结束。

(2) 自基金合同生效以来富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 C 基金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2021年9月30日。

2、本基金于2021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2021年7月29日起至2022年1月28日，本期末建仓期还未结束。

§ 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		
张洋	本基金基金经理	2021-07-29	—	10.2	硕士，曾任招商银行总行交易员，招商银行总行投资经理，平安银行总行投资经理；自2020年3月加入富国基金管理

				<p>有限公司，现任富国基金固定收益投资部固定收益基金经理。2020年5月起任富国汇利回报两年定期开放债券型证券投资基金（原富国汇利回报分级债券型证券投资基金，于2017年12月11日更名）、富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2020年6月至2021年9月任富国中债1-5年国开行债券指数证券投资基金基金经理，2020年8月起任富国长江经济带纯债债券型证券投资基金基金经理，2020年9月起任富国荣利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2020年10月起任富国颐利纯债债券型证券投资基金基金经理，2020年12月起任富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2021年7月起任富国腾享回报6个月滚动持有混合型发起式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腾享回报 6 个月滚动持有混合型发起式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》、《富国腾享回报 6 个月滚动持有混合型发起式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

2021 年三季度，受到局部疫情爆发和供给端制约等因素的影响，国内主要经济指标均明显转弱，工业增加值和社会消费品零售总额下行较为明显，制造业 PMI 跌破 50 的荣枯线。货币政策方面，央行于 7 月初全面降准 0.5%，大幅超出市场预期，降准后，债券收益率快速下行，十年期国债收益率曾最低下行至 2.80% 左右，但降准后回购市场利率总体保持稳定，投资者对货币政策宽松的预期逐渐修正后，债券收益率有所回升。股票市场方面，三季度结构性行情较为明显，中证 500 指数明显跑赢沪深 300 指数。报告期内，本基金注重大类资产配置，择机调整债券和股票仓位，适时调整组合久期，持续优化股票持仓，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 A 级为 0.88%，C 级为 0.83%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 0.21%，C 级为 0.21%

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	2,216,982.14	3.07
	其中：股票	2,216,982.14	3.07
2	固定收益投资	64,200,235.80	88.81
	其中：债券	64,200,235.80	88.81
	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	3,700,000.00	5.12
	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	1,507,994.15	2.09
7	其他资产	665,211.52	0.92
8	合计	72,290,423.61	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 158,073.14 元，占资产净值比例为 0.23%。

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	1,595,458.00	2.31
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	143,770.00	0.21
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	182,161.00	0.26

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	137,520.00	0.20
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	2,058,909.00	2.98

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（%）
医疗保健	158,073.14	0.23
合计	158,073.14	0.23

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 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

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	002493	荣盛石化	17,000	319,600.00	0.46
2	601012	隆基股份	3,800	313,424.00	0.45
3	603596	伯特利	6,200	277,450.00	0.40
4	603901	永创智能	20,000	274,600.00	0.40
5	002466	天齐锂业	2,600	264,108.00	0.38
6	300059	东方财富	5,300	182,161.00	0.26
7	02269	药明生物	1,500	158,073.14	0.23
8	002371	北方华创	400	146,276.00	0.21
9	002352	顺丰控股	2,200	143,770.00	0.21
10	603259	药明康德	900	137,520.00	0.20

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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	35,311,400.00	51.04
	其中：政策性金融债	20,318,000.00	29.37
4	企业债券	21,693,800.00	31.36
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	5,500,050.00	7.95
7	可转债（可交换债）	1,694,985.80	2.45
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	64,200,235.80	92.80

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	210210	21 国开 10	200,000	20,318,000.00	29.37
2	175105	20 京发 01	50,000	5,065,000.00	7.32
3	152985	21 京投 01	50,000	4,993,500.00	7.22
4	175361	20 茅台 01	45,000	4,492,800.00	6.49
5	2180069	21 乌镇债	40,000	4,104,400.00	5.93

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，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，降低投资组合的整体风险。

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

本基金投资国债期货将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、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平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

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“20 邮储银行永续债”的发行主体中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：（1）同业投资业务接受第三方金融机构信用担保；（2）买入返售项下的金融资产不符合监管规定；（3）信贷资产收益权转让业务接受交易对手兜底承诺；（4）同业投资按照穿透原则对应至最终债务人未纳入统一授信管理等 26 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 日对公司做出罚款 4550 万元的行政处罚（银保监罚决字（2020）72 号）；由于存在：（1）违规向部分客户收取唯一账户年费和小额账户管理费；（2）未经客户同意违规办理短信收费业务；（3）信息系统相关功能在开发、投产、维护、后评估等方面存在缺陷及不足；（4）向监管机构报送材料内容不实；（5）未在监管要求时限内报送材料；（6）未按监管要求提供保存业务办理相关凭证，中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 6 月 22 日对公司做出没收违法所得 11.401116 万元，罚款 437.677425 万元的行政处罚（银保监罚决字（2021）23 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。

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	2,002.48
2	应收证券清算款	44,998.20
3	应收股利	—
4	应收利息	618,210.84
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	665,211.52

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	132018	G 三峡 EB1	196,260.00	0.28
2	128049	华源转债	168,400.00	0.24
3	127028	英特转债	161,355.00	0.23
4	132009	17 中油 EB	158,010.00	0.23
5	127027	靖远转债	123,140.00	0.18
6	113610	灵康转债	113,180.00	0.16
7	128073	哈尔转债	112,690.00	0.16
8	132015	18 中油 EB	104,810.00	0.15
9	113567	君禾转债	103,371.80	0.15
10	128105	长集转债	91,728.00	0.13
11	113011	光大转债	79,709.00	0.12
12	123057	美联转债	60,770.00	0.09
13	127026	超声转债	54,530.00	0.08
14	128076	金轮转债	32,967.00	0.05

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：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

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

项目	富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 A	富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 C
基金合同生效日 2021 年 07 月 29 日基金份额总额	41,481,689.47	27,115,409.41
本报告期(2021 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2021 年 9 月 30 日)基金总申购份额	—	—
减：本报告期(2021 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2021 年 9 月 30 日)基金总赎回份额	—	—
本报告期(2021 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2021 年 9 月 30 日)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	41,481,689.47	27,115,409.41

§ 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	10,005,417.21
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	10,005,417.21
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	14.59

注：买入/申购含红利再投资、转换入份额；卖出/赎回含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位：份

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
----	------	------	-------------	-------------	------

1	基金成立	2021-07-26	10,005,417.21	10,001,000.00	—
合计			10,005,417.21	10,001,000.00	

注：A类基金份额申购适用固定费用1000元

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数 (份)	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数 (份)	发起份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	10,005,417.21	14.59	10,005,417.21	14.59	3年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,005,417.21	14.59	10,005,417.21	14.59	3年

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国腾享回报6个月滚动持有混合型发起式证券投资基金的文件
- 2、富国腾享回报6个月滚动持有混合型发起式证券投资基金基金合同
- 3、富国腾享回报6个月滚动持有混合型发起式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、富国腾享回报6个月滚动持有混合型发起式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

10.2 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

10.3 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