

富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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 14 日(基金合同生效日)起至 2021 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 富国中证沪港深 500ETF 联接 |
| 基金主代码 | 012275 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 07 月 14 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 101,545,687.87 |
| 投资目标 | 本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。 |
| 投资策略 | <p>本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便投资者通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。本基金的资产配置策略、目标 ETF 投资策略、成份股、备选成份股（均含存托凭证）投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券（含分离交易可转债）及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略详见法律文件。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证沪港深 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为 ETF 联接基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资港股通标的股票的，将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 | 中国银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 富国中证沪港深500ETF联接A | 富国中证沪港深500ETF联接C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012275 | 012276 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 (单位:份) | 35,986,861.17 | 65,558,826.70 |

2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|--------------|--------------------------|
| 基金名称 | 富国中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金交易代码 | 517100 |
| 基金运作方式 | 契约型,交易型开放式。 |
| 基金合同生效日 | 2021年02月09日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2021年03月02日 |
| 基金管理人名称 | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国银行股份有限公司 |

2.1.2 目标基金产品概况

| | |
|--------|---|
| 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 | 富国中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金主要采用复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常市场情况下,富国中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。富国中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金的资产配置策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略详见法律文件。 |
| 业绩比较基准 | 中证沪港深500指数收益率 |

| | |
|--------|--|
| 风险收益特征 | 富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证），具有与标的指数相似的风险收益特征。富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金投资港股通标的股票的，将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。 |
|--------|--|

§ 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 | 富国中证沪港深 500ETF 联接 A 报告期(2021年07月14日-2021年09月30日) | 富国中证沪港深 500ETF 联接 C 报告期(2021年07月14日-2021年09月30日) |
|-----------------|---|---|
| 1. 本期已实现收益 | -12,168.09 | -118,520.31 |
| 2. 本期利润 | -898,215.42 | -1,730,802.41 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0168 | -0.0113 |
| 4. 期末基金资产净值 | 35,087,466.15 | 63,864,144.75 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9750 | 0.9742 |

注：本基金于 2021 年 7 月 14 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) 富国中证沪港深 500ETF 联接 A

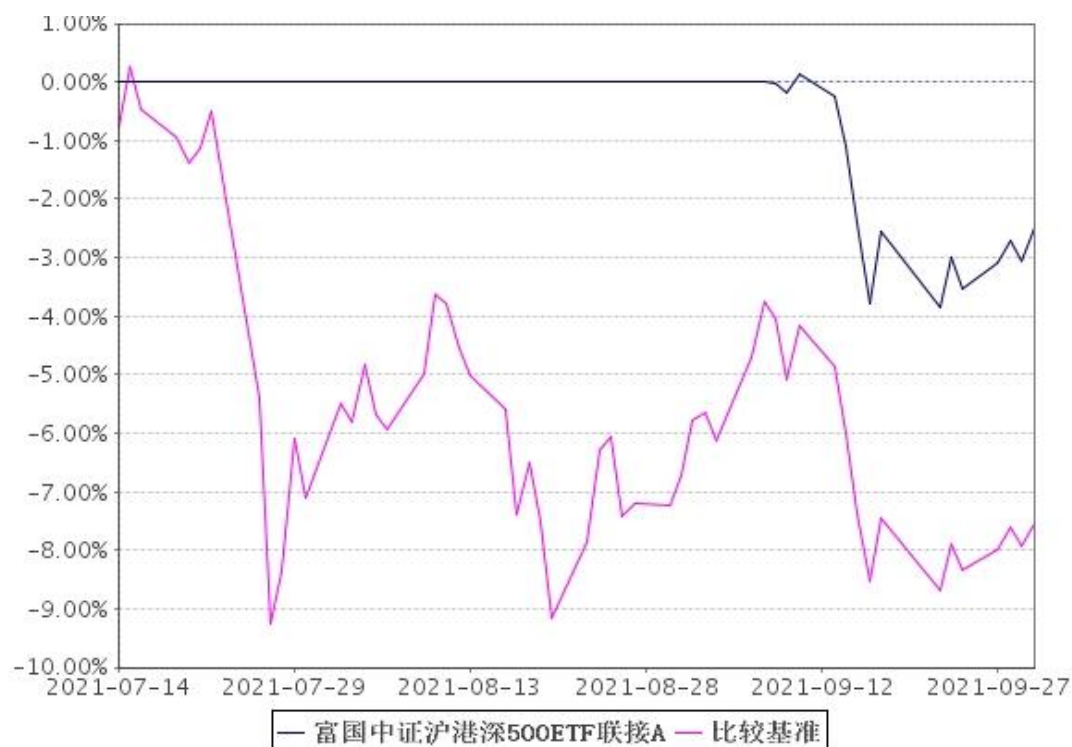
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | -2.50% | 0.43% | -7.54% | 1.25% | 5.04% | -0.82% |

(2) 富国中证沪港深 500ETF 联接 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 | -2.58% | 0.43% | -7.54% | 1.25% | 4.96% | -0.82% |

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

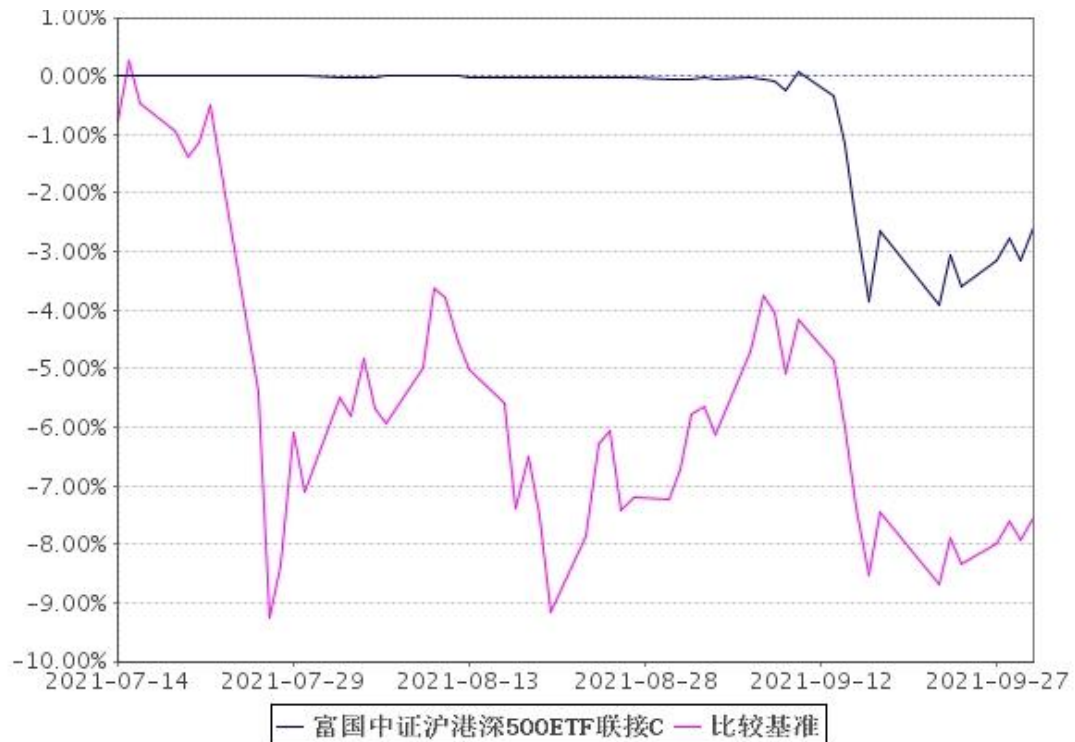
(1) 自基金合同生效以来富国中证沪港深 500ETF 联接 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2021 年 9 月 30 日。

2、本基金于 2021 年 7 月 14 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 14 日起至 2022 年 1 月 13 日，本期末建仓期还未结束。

(2) 自基金合同生效以来富国中证沪港深 500ETF 联接 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 14 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 14 日起至 2022 年 1 月 13 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 | 说明 |
|----|----|-------------|----|----|
|----|----|-------------|----|----|

| | | 任职日期 | 离任日期 | 从业年限 | |
|-----|---------|------------|------|------|--|
| 张圣贤 | 本基金基金经理 | 2021-07-14 | — | 14.3 | 硕士，曾任上海申银万国证券研究所有限公司研究员；自2015年3月加入富国基金管理有限公司，历任基金经理助理、量化投资部量化投资总监助理；现任富国基金量化投资部量化投资副总监兼定量基金经理。2015年6月至2021年9月任富国中证国有企业改革指数型证券投资基金（原富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）基金经理，2015年6月起任富国中证军工指数型证券投资基金（原富国中证军工指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）、富国中证新能源汽车指数型证券投资基金（原富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）基金经理；自2015年8月起任富国中证工业4.0指数型证券投资基金（原富国中证工业4.0指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）、富国中证体育产业指数型证券投资基金（原富国 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>中证体育产业指数分级证券投资基金，于 2021 年 1 月 1 日更名) 基金经理，2016 年 2 月起任富国中证智能汽车指数证券投资基金(LOF)基金经理，2017 年 7 月至 2020 年 12 月任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)基金经理，2017 年 11 月起任富国中证煤炭指数型证券投资基金（原富国中证煤炭指数分级证券投资基金，于 2021 年 1 月 1 日更名) 基金经理，2020 年 4 月起任富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 7 月至 2021 年 9 月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，2020 年 12 月起任富国中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、富国中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 2 月起任富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月起任富国中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金基金经</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 理, 2021 年 7 月起任富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2021 年 8 月起任富国中证芯片产业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。 |
|--|--|--|--|--|---|

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中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接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》、《富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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A级为-2.50%，C级为-2.58%，同期业绩比较基准收益率A级为-7.54%，C级为-7.54%

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 | 基金投资 | 93,335,850.00 | 94.13 |
| 3 | 固定收益投资 | — | — |
| | 其中：债券 | — | — |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 4 | 贵金属投资 | — | — |
| 5 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 6 | 买入返售金融资产 | — | — |

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 5,823,125.34 | 5.87 |
| 8 | 其他资产 | 730.67 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 99,159,706.01 | 100.00 |

5.2 期末投资目标基金明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------------|------|--------|------------|---------------|--------------|
| 1 | 富国中证沪港深500ETF | 股票型 | 交易型开放式 | 富国基金管理有限公司 | 93,335,850.00 | 94.32 |

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 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。

5.4 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

5.4.1 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。

5.4.2 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。

5.5 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。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，根据风险管理的原则，以套期保值为目的参与国债期货的投资，以降低跟踪误差。

5.11.2 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。

5.11.3 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

本基金本报告期末未持有股票资产。

5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------|
| 1 | 存出保证金 | — |
| 2 | 应收证券清算款 | — |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 730.67 |
| 5 | 应收申购款 | — |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 730.67 |

5.12.4 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。

5.12.5 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。

5.12.6 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 | 富国中证沪港深 500ETF 联接 A | 富国中证沪港深 500ETF 联接 C |
|---|---------------------|---------------------|
| 基金合同生效日 2021 年 07 月 14 日 基金份额总额 | 66,186,632.11 | 263,266,510.85 |
| 本报告期(2021 年 7 月 14 日(基金合同生效日)至 2021 年 9 月 30 日)基金 总申购份额 | 310,405.09 | 118,766.21 |
| 减：本报告期(2021 年 7 月 14 日(基金合同生效日)至 2021 年 9 月 30 日) 基金总赎回份额 | 30,510,176.03 | 197,826,450.36 |
| 本报告期(2021 年 7 月 14 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 | 35,986,861.17 | 65,558,826.70 |

§ 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。

§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中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件

2、富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同

3、富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接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