

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资  
基金

二〇二一年第 2 季度报告

2021 年 06 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

报告送出日期： 2021 年 07 月 21 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 7 月 19 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 4 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合	
基金主代码	008835	
基金运作方式	<p>契约型开放式。本基金每个工作日开放申购，但本基金对每份基金份额设置三个月的最短持有期限。即：自基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）至该日三个月后的对应日的期间内，投资者不能提出赎回及转换转出申请；该日三个月后的对应日之后，投资者可以提出赎回及转换转出申请。若该日三个月后实际不存在对应日的，则顺延至下一日。</p>	
基金合同生效日	2020年02月25日	
报告期末基金份额总额（单位：份）	1,165,233,276.46	
投资目标	<p>在严格控制风险的基础上，运用股指期货等衍生工具对冲市场系统风险，追求基金资产的长期稳健增值。</p>	
投资策略	<p>本基金根据对市场的判断，采用“多空对冲”等投资策略，在控制基金资产的股票系统性风险暴露的前提下，实现基金资产的保值增值。本基金采用“自下而上”的数量化选股策略，根据市场状况及变化，不定期对模型进行调整，改进模型有效性，从而取得更高的收益。同时遵循数量化选股策略，优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。本基金还将根据对证券市场走势的判断，适时利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险，并采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉绝对收益机会。债券投资策略方面，本基金基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对固定收益资产的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。本基金的存托凭证投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略详见法律文件。</p>	
业绩比较基准	<p>中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率(税后)+3%</p>	
风险收益特征	<p>本基金为特殊的混合型基金，利用股指期货等金融工具对冲系统性风险，与股票市场的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金的实际收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。</p>	
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	富国量化对冲策略三个	富国量化对冲策略三个月持有

金简称	月持有期灵活配置混合 A	期灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	008835	008836
报告期末下属分级基金的份额总额 (单位:份)	934,675,949.30	230,557,327.16

### § 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	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A 报告期(2021年04月01日-2021年06月30日)	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C 报告期(2021年04月01日-2021年06月30日)
1. 本期已实现收益	1,564,386.68	-801,667.74
2. 本期利润	14,955,447.75	2,091,735.26
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0191	0.0109
4. 期末基金资产净值	974,776,133.60	239,149,198.99
5. 期末基金份额净值	1.0429	1.0373

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

###### (1) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 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
过去三个月	1.66%	0.26%	1.12%	0.01%	0.54%	0.25%
过去六个月	4.70%	0.35%	2.23%	0.01%	2.47%	0.34%
过去一年	3.16%	0.37%	4.49%	0.01%	-1.33%	0.36%
自基金合同生效起至今	4.29%	0.32%	6.06%	0.01%	-1.77%	0.31%

## (2) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 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
过去三个月	1.56%	0.26%	1.12%	0.01%	0.44%	0.25%
过去六个月	4.49%	0.35%	2.23%	0.01%	2.26%	0.34%
过去一年	2.74%	0.37%	4.49%	0.01%	-1.75%	0.36%
自基金合同生效起至今	3.73%	0.32%	6.06%	0.01%	-2.33%	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

(1) 自基金合同生效以来富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 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 6 月 30 日。

2、本基金于 2020 年 2 月 25 日成立，建仓期 6 个月，从 2020 年 2 月 25 日起至 2020 年 8 月 24 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2) 自基金合同生效以来富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 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6月30日。

2、本基金于2020年2月25日成立，建仓期6个月，从2020年2月25日起至2020年8月24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		
方旻	本基金基金经理	2020-02-25	—	11.4	硕士，自2010年2月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、量化投资部量化投资副总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼高级定量基金经理。2014年4月至2014年11

				<p>月任富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理助理, 2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2015 年 5 月至 2019 年 11 月任富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金及富国中证银行指数型证券投资基金 (原富国中证银行指数分级证券投资基金, 于 2019 年 5 月 10 日更名) 的基金经理, 2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理, 2017 年 6 月至 2018 年 12 月任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理, 2017 年 7 月至 2020 年 9 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, 2018 年 5 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2018 年 7 月至 2020 年 9 月任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 1 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理, 2020 年 2 月起任富国量化对冲策略三个月持</p>
--	--	--	--	---

					有期灵活配置混合型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量化对冲策略三个月持有期灵活配置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》、《富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现5次同日反向交易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**

4月以来，随着公布的1季度GDP数据环比低于季节性，餐饮、制造业投资修复偏慢，投资者对于货币政策收紧预期担忧减弱，市场迎来反弹。4月下旬，印度疫情超预期爆发，使得货币政策收紧预期进一步降低，市场持续反弹。5月初，商品价格再度大幅上涨，螺纹钢、铜等品种创出本轮反弹新高，钢铁、煤炭、有色等周期板块大幅上涨。市场通胀预期大幅提升，成长板块出现明显回调。5月中旬起，国常会多次开会聚焦大宗商品价格问题，指出要高度重视大宗商品价格攀升带来的不利影响。国内相关大宗商品如钢价、煤价迎来大幅调整。随着通胀预期下降，市场风险偏好再度提升，消费、科技、医药、新能源等板块迎来大幅反弹。6月中，美联储会议并未实质性讨论收紧购债规模，同时美国10年期国债利率进一步走低，因此短期流动性未受到明显影响，市场继续反弹。其中，景气度较高的新能源汽车、光伏、半导体等板块涨幅居前。总体来看，2021年2季度上证综指上涨4.34%，沪深300上涨3.48%，创业板指上涨26.05%，中证500指数上涨8.86%。

在投资管理上，我们坚持采取主动量化策略进行投资和风险管理，积极获取

超额收益率。

#### 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 1.66%，C 级为 1.56%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 1.12%，C 级为 1.12%

#### 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	945,488,502.22	77.57
	其中：股票	945,488,502.22	77.57
2	固定收益投资	45,966,108.48	3.77
	其中：债券	45,966,108.48	3.77
	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	116,647,298.59	9.57
7	其他资产	110,714,882.57	9.08
8	合计	1,218,816,791.86	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

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	13,320,230.18	1.10
B	采矿业	5,484,020.60	0.45
C	制造业	546,110,544.19	44.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,274,340.39	0.93

E	建筑业	18,894,106.44	1.56
F	批发和零售业	2,971,480.12	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	22,590,431.00	1.86
H	住宿和餐饮业	951,065.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,456,237.10	2.43
J	金融业	200,288,050.59	16.50
K	房地产业	29,971,680.00	2.47
L	租赁和商务服务业	26,815,146.00	2.21
M	科学研究和技术服务业	22,707,285.67	1.87
N	水利、环境和公共设施管理业	37,101.40	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	1,236,688.00	0.10
Q	卫生和社会工作	10,555,149.54	0.87
R	文化、体育和娱乐业	2,824,946.00	0.23
S	综合	—	—
	合计	945,488,502.22	77.89

### 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	600519	贵州茅台	18,199	37,429,883.30	3.08
2	600036	招商银行	581,800	31,527,742.00	2.60
3	601318	中国平安	390,471	25,099,475.88	2.07
4	601888	中国中免	74,500	22,357,450.00	1.84
5	603259	药明康德	138,428	21,676,440.52	1.79
6	601919	中远海控	590,500	18,033,870.00	1.49
7	300059	东方财富	508,972	16,689,191.88	1.37
8	300122	智飞生物	87,800	16,394,894.00	1.35
9	601166	兴业银行	788,900	16,211,895.00	1.34
10	600809	山西汾酒	35,900	16,083,200.00	1.32

#### 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	44,509,300.00	3.67
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	1,456,808.48	0.12
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	45,966,108.48	3.79

#### 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	019640	20 国债 10	415,000	41,500,000.00	3.42
2	019645	20 国债 15	30,000	3,009,300.00	0.25
3	113050	南银转债	12,690	1,269,000.00	0.10
4	123117	健帆转债	1,417	141,700.00	0.01
5	127036	三花转债	352	46,108.48	0.00

#### 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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF2109	IF2109	-543.00	-841,606,560.00	-20,230,891.60	—

IF2107	IF2107	-42.00	-65,409,120.00	-341,594.96	—
IF2112	IF2112	-3.00	-4,626,180.00	-221,640.00	—
公允价值变动总额合计(元)					-20,794,126.56
股指期货投资本期收益(元)					-19,600,307.25
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-31,489,692.75

## 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

### 1、对冲策略

现阶段本基金将根据对证券市场走势的判断，适时利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险。

原则上本基金绝大多数时间在股票投资策略的基础上，通过构建和股票多头相匹配的股指期货空头头寸，从而对冲本基金的系统性风险，以获取精选股票的绝对收益。

### 2、套利策略

本基金主要采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉绝对收益机会。同时，本基金根据市场情况的变化，灵活运用其他对冲套利策略提高资本的利用率，从而提高绝对收益，达到投资策略的多元化以进一步降低本基金收益的波动。

#### (1) 股指期货套利策略

股指期货套利策略是指积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式：

##### ①期现套利

期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

##### ②跨期套利

跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约价差进行获利。

#### (2) 其他套利策略

基金经理会实时关注市场的发展，前瞻性地运用其他套利策略。

### 3、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、国债期货等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

## 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

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、国债期货等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

### 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 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 945,488,502.22 元，占基金资产净值的比例为 77.89%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 911,641,860.00 元，占基金资产净值的比例为 75.10%，空头合约市值占股票资产的比例为 96.42%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-2,751,130.28 元，公允价值变动损益为 16,261,860.44 元。

## 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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“兴业银行”的发行主体兴业银行股

份有限公司（以下简称“公司”），由于存在同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保的违法违规事实，中国银保监会福建监管局于2020年8月31日对公司做出没收违法所得6,361,807.97元，并合计处以罚款15,961,807.97元的行政处罚（闽银保监罚决字〔2020〕24号）；由于存在为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；违反银行卡收单外包管理规定等5项违法违规事实，中国人民银行福州中心支行于2020年9月4日对公司做出警告，没收违法所得10,875,088.15元，并处13,824,431.23元罚款的行政处罚（福银罚字〔2020〕35号）。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“招商银行”的发行主体招商银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；理财产品之间风险隔离不到位；理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准等27项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于2021年5月17日对公司做出罚款7170万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕16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。

#### 5.12.2 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。

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。

#### 5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
----	----	-------

1	存出保证金	109,625,063.60
2	应收证券清算款	128,952.65
3	应收股利	—
4	应收利息	933,825.41
5	应收申购款	27,040.91
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	110,714,882.57

#### 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：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

#### 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	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C
报告期期初基金份额总额	736,623,529.76	93,744,495.65
报告期期间基金总申购份额	243,616,041.01	153,126,269.95
减：报告期期间基金总赎回份额	45,563,621.47	16,313,438.44
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	934,675,949.30	230,557,327.16



## § 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	2021-04-01 至 2021-05-30	200, 02 5, 000. 00	—	—	200, 025, 00 0. 00	17. 17%
	2	2021-04-01 至 2021-06-30	257, 43 3, 465. 00	—	—	257, 433, 46 5. 00	22. 09%
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>							

## § 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量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金的文件

2、富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金合同

3、富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置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、富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置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 07 月 21 日