

富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金

二〇二一年中期报告

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： 招商银行股份有限公司

送出日期： 2021 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	8
§4	管理人报告.....	10
4.1	基金管理人及基金经理.....	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8	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.....	13
§5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6	中期财务报表(未经审计).....	14
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4	报表附注.....	17
§7	投资组合报告.....	39
7.1	期末基金资产组合情况.....	39
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
7.6	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.....	44
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
7.8	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.....	44
7.9	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.....	44

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12	投资组合报告附注	45
§8	基金份额持有人信息	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	47
§9	开放式基金份额变动	48
§10	重大事件揭示	48
10.1	基金份额持有人大会决议	48
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4	基金投资策略的改变	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8	其他重大事件	52
§11	影响投资者决策的其他重要信息	52
11.1	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	52
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	52
§12	备查文件目录	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	富国清洁能源产业灵活配置混合	
基金主代码	005368	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 03 月 06 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（单位：份）	812,177,177.21	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国清洁能源产业灵活配置混合 A	富国清洁能源产业灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	005368	011127
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	807,078,269.03	5,098,908.18

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于清洁能源产业相关股票，通过精选个股和风险控制，力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要投资清洁能源产业相关的股票，指直接从事清洁能源产业相关的行业及对能源进行清洁、高效利用的行业。本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例；本基金投资股票及存托凭证时，根据市场整体估值水平评估系统性风险，根据指数估值水平（中证 500 指数的市净率 P/B）决定股票及存托凭证资产的投资比例，还将运用“自上而下”的行业配置方法、定量筛选和基本面分析相结合的“自下而上”的选股策略，挑选出优质的上市公司股票进行投资；本基金将采用“自上而下”的投资策略，对债券类资产进行合理有效的配置，并在此框架下进行具有针对性的债券选择。本基金的港股通标的股票投资策略、新三板精选层股票投资策略、存托凭证投资策略、资产支持证券投资策略和金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证新能源指数收益率×80%+恒生中国企业指数收益率（经汇率调整后）×10%+中债综合全价指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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和债券型基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，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。本基金投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票，会面临参与挂牌公司股票交易产生的公司风险、流动性风险、信息风险等特有风险。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	张燕
	联系电话	021-20361818	0755-83199084
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95555
传真		021-20361616	0755-83195201
注册地址		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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		裴长江	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	富国基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国清洁能源产业灵活配置混合 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年01月01日至2021年06月30日)
本期已实现收益	151,532,389.13
本期利润	267,396,248.91
加权平均基金份额本期利润	0.3349
本期加权平均净值利润率	18.66%
本期基金份额净值增长率	17.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年06月30日)
期末可供分配利润	439,094,268.57
期末可供分配基金份额利润	0.5441
期末基金资产净值	1,731,596,678.62
期末基金份额净值	2.1455
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	114.55%

(2) 富国清洁能源产业灵活配置混合C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年01月01日至2021年06月30日)
本期已实现收益	363,961.90
本期利润	1,458,620.53
加权平均基金份额本期利润	0.5851
本期加权平均净值利润率	32.74%
本期基金份额净值增长率	15.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年06月30日)
期末可供分配利润	2,749,875.22
期末可供分配基金份额利润	0.5393
期末基金资产净值	10,911,867.55
期末基金份额净值	2.1400
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	15.69%

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。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

本基金自 2021 年 1 月 15 日起增加 C 类份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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) 富国清洁能源产业灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	11.30%	2.03%	9.80%	1.80%	1.50%	0.23%
过去三个月	32.67%	1.78%	26.91%	1.63%	5.76%	0.15%
过去六个月	17.73%	2.24%	19.84%	2.03%	-2.11%	0.21%
过去一年	86.44%	2.19%	83.50%	1.92%	2.94%	0.27%
自基金合同生效起至今	114.55%	1.95%	88.25%	1.87%	26.30%	0.08%

(2) 富国清洁能源产业灵活配置混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	11.24%	2.03%	9.80%	1.80%	1.44%	0.23%
过去三个月	32.47%	1.78%	26.91%	1.63%	5.56%	0.15%
自基金分级生效日起至今	15.69%	2.13%	15.33%	1.96%	0.36%	0.17%

注：本基金的业绩比较基准为：中证新能源指数收益率×80%+恒生中国企业指数收益率（经汇率调整后）×10%+中债综合全价指数收益率×10%

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1 日收益率（benchmarkt）按下列公式计算：

$$\text{benchmarkt} = 80\% * [\text{中证新能源指数 t} / (\text{中证新能源指数 t-1}) - 1] + 10\% * [\text{恒生中国企业指数 t} / (\text{恒生中国企业指数 t-1}) - 1] + 10\% * [\text{中债综合全价指数 t} / (\text{中债综合全价指数 t-1}) - 1];$$

其中，t=1, 2, 3, ..., T，T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

$$\text{benchmarkT} = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})] - 1$$

其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})$ 表示 t 日至 T 日的 (1+benchmarkt) 数学连乘。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

(1) 自基金合同生效以来富国清洁能源产业灵活配置混合 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3月6日成立，建仓期6个月，从2020年3月6日起至2020年9月5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清洁能源产业灵活配置混合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、本基金自 2021 年 1 月 15 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月，加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省国际信托股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金等 212 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 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		
杨栋	本基金基金经理	2020-03-06	—	10.1	硕士，自 2011 年 5 月加入富国基金管理有限公司，历任助理行业研究员、行业研究员、权益基金经理；现任富国基金权益投资部权益投资总监助理兼高级权益基金经理。自 2015 年 8 月至 2020 年 4 月任富国天合稳健优选混合型证券投资基金（原富国天合稳健优选股票型证券投资基金，于 2015 年 7 月 30 日更名）基金经理；自 2015 年 12 月起任富国低碳新

					经济混合型证券投资基金基金经理；自 2020 年 3 月起任富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2020 年 6 月起任富国积极成长一年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月起任富国均衡优选混合型证券投资基金、富国成长领航混合型证券投资基金基金经理，2021 年 2 月起任富国融泰三个月定期开放混合型发起式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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国清洁能源产业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》、《富国清洁能源产业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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在 2021 年上半年上涨 17.73%，跑输基准。第一季度表现较差，有较大的回撤。主要原因有以下几个方面：

1、光伏行业跌幅较大。春节后，由于以多晶硅料、硅片为主的产业链上游环节持续涨价，叠加春节期间需求淡季，光伏组件开工率有所下降。资本市场对这一边际变化反应剧烈，导致行业龙头公司在不到 1 个月的时间下跌近 40%。随着行业开工旺季的到来，以及产业链利润率的再平衡，行业开工率有望上升。

2、对于低估值公用事业类板块配置比例较低。以有色金属、化工为代表的周期类板块，在全球经济疫后恢复的预期下表现较好。水电、火电、环保等板块在市场风格转向低估值时，超额收益明显。

3、对于收益“碳中和”的节能环保设备配置比例不足。

本基金在 2021 年第二季度上涨 32.67%，跑赢基准。主要原因有以下几个方面：

1、在电动车板块配置较多，充分受益板块上涨。主要配置电芯、关键添加剂、上游资源等等。

2、光伏行业基本面在第二季度或已见底，以硅片和硅料价格的松动为标志。分布式光伏受到政策鼓励，市场预期分布式光伏将有快速发展。本基金配置了光伏产业龙头，以及光伏玻璃的技术领先企业，在季度末有较大上涨。

“碳中和”的行业背景下，国内的能源从生产到消费都会有比较大的变化。在生产端，风电、光伏、核电等等清洁能源比例会大幅提高。在消费端除了控制高耗能产业新增产能外，存量消费的节能环保受益明显。本基金将继续坚持自下而上、精选个股，在清洁能源领域寻找投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值 A 级为 2.1455 元，C 级为 2.1400 元；份额累计净值 A 级为 2.1455 元，C 级为 2.1400 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为 17.73%，C 级为 15.69%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 19.84%，C 级为 15.33%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国外过于宽松的货币政策可能会有所调整，由此可能引发新兴

市场的资金流出，对股市有一定负面影响。在 A 股结构性行情高涨的背景下，应该适当保持谨慎。

资本市场对美债长端收益率上行、国内货币政策边际变化、以及对国际关系的担忧将长期存在。市场未来有望更关注到基本面变化的长期因素，本基金将继续坚持自下而上、精选个股，在新能源、科技、医药、军工等领域寻找投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2021 年 06 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
资 产：		
银行存款	111,242,161.40	74,703,483.13
结算备付金	1,270,207.40	1,408,414.53
存出保证金	262,025.32	448,363.03
交易性金融资产	1,636,153,965.98	1,452,249,310.53
其中：股票投资	1,636,153,965.98	1,416,226,082.63
基金投资	—	—
债券投资	—	36,023,227.90
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	34,767,472.28	22,017,607.24
应收利息	12,297.42	837,928.64
应收股利	—	—
应收申购款	12,833,118.87	5,732,645.90
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	1,796,541,248.67	1,557,397,753.00
负债和所有者权益	本期末 (2021 年 06 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	3.76	10,969,302.44
应付赎回款	50,874,069.49	20,363,323.65
应付管理人报酬	2,000,449.80	1,740,838.17
应付托管费	333,408.29	290,139.68
应付销售服务费	4,819.45	—
应付交易费用	539,833.13	814,962.19
应交税费	—	—
应付利息	—	—

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	280,118.58	225,368.67
负债合计	54,032,702.50	34,403,934.80
所有者权益：		
实收基金	812,177,177.21	835,724,592.00
未分配利润	930,331,368.96	687,269,226.20
所有者权益合计	1,742,508,546.17	1,522,993,818.20
负债和所有者权益总计	1,796,541,248.67	1,557,397,753.00

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.1455 元，基金份额总额 812,177,177.21 份。其中：富国清洁能源产业灵活配置混合 A 份额净值 2.1455 元，份额总额 807,078,269.03 份；富国清洁能源产业灵活配置混合 C 份额净值 2.1400 元，份额总额 5,098,908.18 份。

6.2 利润表

会计主体：富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2020 年 3 月 6 日(基 金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日)
一、收入	283,558,417.94	251,055,685.85
1. 利息收入	487,268.77	1,587,703.00
其中：存款利息收入	181,258.35	1,587,703.00
债券利息收入	306,010.42	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	163,052,114.90	-32,316,861.05
其中：股票投资收益	158,752,439.52	-36,410,241.16
基金投资收益	—	—
债券投资收益	-335,909.10	—
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	4,635,584.48	4,093,380.11
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	116,958,518.41	280,883,940.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	3,060,515.86	900,903.08
减：二、费用	14,703,548.50	11,874,893.23
1. 管理人报酬	10,718,423.13	8,116,699.14
2. 托管费	1,786,403.79	1,352,783.15
3. 销售服务费	11,831.35	—
4. 交易费用	2,068,779.18	2,330,535.96
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 税金及附加	—	—
7. 其他费用	118,111.05	74,874.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	268,854,869.44	239,180,792.62
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	268,854,869.44	239,180,792.62

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	835,724,592.00	687,269,226.20	1,522,993,818.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	268,854,869.44	268,854,869.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-23,547,414.79	-25,792,726.68	-49,340,141.47
其中：1. 基金申购款	559,408,421.83	473,155,775.47	1,032,564,197.30
2. 基金赎回款	-582,955,836.62	-498,948,502.15	-1,081,904,338.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	812,177,177.21	930,331,368.96	1,742,508,546.17
项目	上年度可比期间(2020 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,750,660,779.01	—	1,750,660,779.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	239,180,792.62	239,180,792.62

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-299,976,342.73	-20,370,258.42	-320,346,601.15
其中：1. 基金申购款	17,853,526.28	1,003,373.49	18,856,899.77
2. 基金赎回款	-317,829,869.01	-21,373,631.91	-339,203,500.92
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	1,450,684,436.28	218,810,534.20	1,669,494,970.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈 戈	林志松	徐慧
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2018〕723号《关于准予富国广利定期开放混合型证券投资基金变更注册的批复》及机构部函〔2020〕315号《关于富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司自2020年2月26日至2020年2月28日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2020）验字第60467606_B10号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2020年3月6日正式生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币1,750,509,719.12元，折合基金份额1,750,509,719.12份。募集资金在募集期间产生的利息为人民币151,059.89元，折合基金份额151,059.89份。以上收到的实收基金（本息）共计人民币1,750,660,779.01元，折合基金份额1,750,660,779.01份。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人于2021年1月13日发布的《关于富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金修订基金合同及托管协议的公告》，自2021年1月15日起，本基金增加C类份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用且从不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额。在投资者申购时不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票

（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、新三板精选层股票、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金所投资新三板精选层挂牌公司被调出精选层的，自调出之日起，基金管理人不得新增投资该股票，并应当逐步将该股票调出投资组合；基金所投资精选层挂牌公司因转板上市被调出精选层的除外。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票（含新三板精选层股票）及存托凭证投资占基金资产的比例 0-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%），其中投资于本基金定义的清洁能源产业相关的股票（含新三板精选层股票）及存托凭证不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为中证新能源指数收益率 $\times$ 80%+恒生中国企业指数收益率（经汇率调整后） $\times$ 10%+中债综合全价指数收益率 $\times$ 10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和中期报告》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续

免征企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）
活期存款	111,242,161.40
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—

其他存款	—
合计	111,242,161.40

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末（2021年06月30日）		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		946,859,130.55	1,636,153,965.98	689,294,835.43
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		946,859,130.55	1,636,153,965.98	689,294,835.43

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）
应收活期存款利息	11,288.56
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	872.23
应收债券利息	—
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	136.63
合计	12,297.42

6.4.7.6其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）
交易所市场应付交易费用	539,833.13
银行间市场应付交易费用	—
合计	539,833.13

6.4.7.8其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2021年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	115,406.40
应付证券出借违约金	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	104,712.18
合计	280,118.58

6.4.7.9实收基金

富国清洁能源产业灵活配置混合 A：

金额单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	835,724,592.00	835,724,592.00
本期申购	548,604,037.44	548,604,037.44
本期赎回（以“-”号填列）	-577,250,360.41	-577,250,360.41
本期末	807,078,269.03	807,078,269.03

富国清洁能源产业灵活配置混合 C：

金额单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	—	—
本期申购	10,804,384.39	10,804,384.39
本期赎回（以“-”号填列）	-5,705,476.21	-5,705,476.21
本期末	5,098,908.18	5,098,908.18

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

富国清洁能源产业灵活配置混合 A:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	298,307,738.06	388,961,488.14	687,269,226.20
本期利润	151,532,389.13	115,863,859.78	267,396,248.91
本期基金份额交易产生的变动数	-10,745,858.62	-19,401,206.90	-30,147,065.52
其中：基金申购款	239,580,538.56	224,776,386.46	464,356,925.02
基金赎回款	-250,326,397.18	-244,177,593.36	-494,503,990.54
本期已分配利润	—	—	—
本期末	439,094,268.57	485,424,141.02	924,518,409.59

富国清洁能源产业灵活配置混合 C:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	363,961.90	1,094,658.63	1,458,620.53
本期基金份额交易产生的变动数	2,385,913.32	1,968,425.52	4,354,338.84
其中：基金申购款	5,117,706.29	3,681,144.16	8,798,850.45
基金赎回款	-2,731,792.97	-1,712,718.64	-4,444,511.61
本期已分配利润	—	—	—
本期末	2,749,875.22	3,063,084.15	5,812,959.37

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
活期存款利息收入	156,653.96
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	12,626.11
其他	11,978.28
合计	181,258.35

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
卖出股票成交总额	731,433,193.38
减：卖出股票成本总额	572,680,753.86
买卖股票差价收入	158,752,439.52

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	37,067,229.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	36,266,909.10
减：应收利息总额	1,136,229.50
买卖债券差价收入	-335,909.10

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
股票投资产生的股利收益	4,635,584.48
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	4,635,584.48

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
1. 交易性金融资产	116,958,518.41
股票投资	116,714,837.21
债券投资	243,681.20

资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	116,958,518.41

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
基金赎回费收入	2,626,051.36
转换费收入	434,464.50
合计	3,060,515.86

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
交易所市场交易费用	2,068,779.18
银行间市场交易费用	—
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	2,068,779.18

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）
审计费用	34,712.18
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	14,398.87
债券账户维护费	9,000.00
合计	118,111.05

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

关联方名称	金额单位：人民币元			
	本期(2021年01月01日至2021年06月30日)		上年度可比期间(2020年3月6日(基金合同生效日)至2020年6月30日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
申万宏源	395,981,895.38	29.59	617,724,204.32	31.24

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	353,694.98	29.53	212,599.49	39.38
关联方名称	上年度可比期间(2020年3月6日(基金合同生效日)至2020年6月30日)			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	563,359.01	31.31	180,000.30	15.15

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2021年01月01日至2021年06月30日）	上年度可比期间(2020年3月6日(基金合同生效日)至2020年6月30日)
当期发生的基金应支付的管理费	10,718,423.13	8,116,699.14
其中：支付销售机构的客户维护费	4,584,071.26	4,392,732.89

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2021年01月01日至2021年06月30日)	上年度可比期间(2020年3月6日(基金合同生效日)至2020年6月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	1,786,403.79	1,352,783.15

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A 级	C 级	合计
富国基金管理有限公司	—	8,833.81	8,833.81
海通证券股份有限公司	—	42.58	42.58
合计	—	8,876.39	8,876.39

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，自 2021 年 01 月 15 日起，本基金增加 C 类份额，C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.60% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性按照指定路径支付。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日）
----	--	---

	富国清洁能源产业灵活配置混合 A	富国清洁能源产业灵活配置混合 C	富国清洁能源产业灵活配置混合 A	富国清洁能源产业灵活配置混合 C
基金合同生效日(2020 年 03 月 06 日)持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	—	—	—	—
期间申购/买入总份额	—	540.60	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减:期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	—	540.60	—	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	0.01%	—	—

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）		上年度可比期间(2020 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	111,242,161.40	156,653.96	114,526,078.91	1,570,173.49

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

海通证券股份有限公司	300981	中红医疗	IPO 网下 申购	6,003	291,685.77
海通证券股份有限公司	688626	翔宇医疗	IPO 网下 申购	3,652	105,776.89
海通证券股份有限公司	688329	艾隆科技	IPO 网下 申购	1,846	31,186.42

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002623	亚玛顿	2021-06-29	2021-12-30	非公开发行限售	25.60	39.00	703,125	18,000,000.00	27,421,875.00	—
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	—
300724	捷佳伟创	2021-04-26	2021-10-27	非公开发行限售	94.41	106.34	243,619	23,000,069.79	25,906,444.46	—
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	—
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	—
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	—
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	—
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股限售	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	—
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股限售	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	—
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	—
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股限售	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	—
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	—
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	—
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	—

300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	—
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	—
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	—
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股限售	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	—
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	—
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	—
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	—
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股限售	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	—
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	—
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	—
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股限售	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	—
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	—
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	—
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股认购	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	—
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股认购	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	—
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	—
603319	湘油泵	2021-01-18	2021-07-14	非公开发行限售	35.96	25.84	695,216	24,999,967.36	17,964,381.44	—
603319	湘油泵	2021-06-08	2021-07-14	非公开发行限售_转增	—	25.84	278,086	—	7,185,742.24	—
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股认购	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	—
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股认购	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	—
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股认购	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	—

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不在下表进行列示。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2021 年 06 月 30 日）	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	111,242,161.40	—	—	—	—	—	111,242,161.40
结算备付金	1,270,207.40	—	—	—	—	—	1,270,207.40
存出保证金	262,025.32	—	—	—	—	—	262,025.32
交易性金融资产	—	—	—	—	—	1,636,153,965.98	1,636,153,965.98
应收证券清算款	—	—	—	—	—	34,767,472.28	34,767,472.28
应收利息	—	—	—	—	—	12,297.42	12,297.42
应收申购款	—	—	—	—	—	12,833,118.87	12,833,118.87
资产总计	112,774,394.12	—	—	—	—	1,683,766,854.55	1,796,541,248.67
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	3.76	3.76
应付赎回款	—	—	—	—	—	50,874,069.49	50,874,069.49
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,000,449.80	2,000,449.80
应付托管费	—	—	—	—	—	333,408.29	333,408.29
应付销售服务费	—	—	—	—	—	4,819.45	4,819.45
应付交易费用	—	—	—	—	—	539,833.13	539,833.13
其他负债	—	—	—	—	—	280,118.58	280,118.58
负债总计	—	—	—	—	—	54,032,702.50	54,032,702.50
利率敏感度缺口	112,774,394.12	—	—	—	—	1,629,734,152.05	1,742,508,546.17
上年度末（2020 年 12 月 31 日）	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	74,703,483.13	—	—	—	—	—	74,703,483.13
结算备付金	1,408,414.53	—	—	—	—	—	1,408,414.53
存出保证金	448,363.03	—	—	—	—	—	448,363.03
交易性金融资产	2,000,799.90	13,924,428.00	20,098,000.00	—	—	1,416,226,082.63	1,452,249,310.53
应收证券清算款	—	—	—	—	—	22,017,607.24	22,017,607.24
应收利息	—	—	—	—	—	837,928.64	837,928.64
应收申购款	—	—	—	—	—	5,732,645.90	5,732,645.90
资产总计	78,561,060.59	13,924,428.00	20,098,000.00	—	—	1,444,814,264.41	1,557,397,753.00
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	10,969,302.44	10,969,302.44
应付赎回款	—	—	—	—	—	20,363,323.65	20,363,323.65
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,740,838.17	1,740,838.17
应付托管费	—	—	—	—	—	290,139.68	290,139.68
应付交易费用	—	—	—	—	—	814,962.19	814,962.19
其他负债	—	—	—	—	—	225,368.67	225,368.67
负债总计	—	—	—	—	—	34,403,934.80	34,403,934.80
利率敏感度缺口	78,561,060.59	13,924,428.00	20,098,000.00	—	—	1,410,410,329.61	1,522,993,818.20

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。本基金本期末未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动； 2. 利率变动范围合理。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2021 年 06 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 基准点利率增加 0.1%	0.00	-8,808.79
	2. 基准点利率减少 0.1%	0.00	8,808.79

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末（2021 年 06 月 30 日）				
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产					
交易性金融资产	—	17,104,242.00	—	—	17,104,242.00
资产合计	—	17,104,242.00	—	—	17,104,242.00
以外币计价的负债					
负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	—	17,104,242.00	—	—	17,104,242.00
项目	上年度末（2020 年 12 月 31 日）				
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产					
交易性金融资产	—	34,360,850.00	—	—	34,360,850.00
资产合计	—	34,360,850.00	—	—	34,360,850.00
以外币计价的负债					

负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	—	34,360,850.00	—	—	34,360,850.00

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化 1%，其他变量不变；(2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末(2021 年 06 月 30 日)	上年度末(2020 年 12 月 31 日)
	港币相对人民币贬值 1%	-171,042.42	-343,608.50
	港币相对人民币升值 1%	171,042.42	343,608.50

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、新三板精选层股票、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金所投资新三板精选层挂牌公司被调出精选层的，自调出之日起，基金管理人不得新增投资该股票，并应当逐步将该股票调出投资组合；基金所投资精选层挂牌公司因转板上市被调出精选层的除外。

基金的投资组合比例为：股票（含新三板精选层股票）及存托凭证投资占基金资产的比例 0-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%），其中投资于本基金定义的清洁能源产业相关的股票（含新三板精选层股票）及存托

凭证不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2021 年 06 月 30 日）		上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,636,153,965.98	93.90	1,416,226,082.63	92.99
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	36,023,227.90	2.37
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,636,153,965.98	93.90	1,452,249,310.53	95.35

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2021 年 06 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	18,429,374.33	12,984,590.15
	2. 业绩比较基准减少 1%	-18,429,374.33	-12,984,590.15

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负

债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币1,557,166,507.05元，属于第二层次的余额为人民币139,188.00元，属于第三层次余额为人民币78,848,270.93元。

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期变动情况如下：

上年度末余额人民币105,562,714.67元，本期变动人民币-26,714,443.74元，本期末人民币78,848,270.93元。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,636,153,965.98	91.07
	其中：股票	1,636,153,965.98	91.07
2	基金投资	—	—
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	112,512,368.80	6.26
8	其他各项资产	47,874,913.89	2.66
9	合计	1,796,541,248.67	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 10,189,092.00 元，占资产净值比例为 0.58%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 6,915,150.00 元，占资产净值比例为 0.40%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	8,696.30	0.00
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,479,800,906.01	84.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,905.59	0.00
E	建筑业	43,944,239.44	2.52
F	批发和零售业	55,583.76	0.00
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	18,247.24	0.00
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	2,130.30	0.00
M	科学研究和技术服务业	54,763,824.50	3.14
N	水利、环境和公共设施管理业	22,948,140.20	1.32
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	17,464,329.54	1.00
	合计	1,619,049,723.98	92.91

7.2.2 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（%）
信息技术	6,915,150.00	0.40
工业	10,189,092.00	0.58
合计	17,104,242.00	0.98

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深港通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	298,800	159,798,240.00	9.17
2	601012	隆基股份	1,787,520	158,803,276.80	9.11
3	688116	天奈科技	1,238,405	146,131,790.00	8.39
4	002623	亚玛顿	3,404,235	141,651,816.90	8.13
5	600438	通威股份	3,038,863	131,491,602.01	7.55
6	603319	湘油泵	3,735,391	97,931,168.83	5.62
7	002460	赣锋锂业	696,500	84,339,185.00	4.84
8	002438	江苏神通	7,465,525	82,494,051.25	4.73
9	300724	捷佳伟创	612,792	68,734,204.19	3.94
10	300124	汇川技术	855,800	63,551,708.00	3.65
11	002240	盛新锂能	2,153,700	61,488,135.00	3.53
12	002145	中核钛白	4,739,200	61,372,640.00	3.52
13	603799	华友钴业	483,681	55,236,370.20	3.17
14	300384	三联虹普	2,844,874	54,763,824.50	3.14
15	300487	蓝晓科技	533,700	45,151,020.00	2.59
16	002738	中矿资源	719,800	31,959,120.00	1.83
17	600970	中材国际	3,270,500	29,990,485.00	1.72
18	300316	晶盛机电	544,500	27,497,250.00	1.58
19	601615	明阳智能	1,465,167	23,721,053.73	1.36
20	603359	东珠生态	1,374,470	22,926,159.60	1.32
21	688006	杭可科技	209,729	17,826,965.00	1.02
22	000009	中国宝安	955,902	17,464,329.54	1.00
23	300982	苏文电能	249,200	13,942,740.00	0.80
24	03898	中车时代电 气	266,800	10,189,092.00	0.58
25	603185	上机数控	48,600	8,696,970.00	0.50
26	03800	保利协鑫能 源	4,191,000	6,915,150.00	0.40
27	300274	阳光电源	37,000	4,257,220.00	0.24
28	002895	川恒股份	226,057	3,406,678.99	0.20
29	603906	龙蟠科技	95,400	3,339,000.00	0.19
30	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.02
31	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.01
32	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
33	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
34	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00

35	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
36	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
37	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
38	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.00
39	605068	明新旭腾	641	23,056.77	0.00
40	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
41	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
42	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
43	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
44	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
45	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
46	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
47	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
48	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
49	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
50	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
51	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
52	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
53	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
54	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
55	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
56	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
57	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
58	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
59	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
60	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
61	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
62	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
63	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
64	301007	德迈仕	322	4,766.15	0.00
65	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
66	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
67	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
68	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
69	605296	神农集团	69	3,256.80	0.00
70	601156	东航物流	90	2,130.30	0.00
71	605016	百龙创园	45	1,438.20	0.00
72	001206	依依股份	21	1,333.92	0.00
73	605319	无锡振华	64	1,148.16	0.00
74	605196	华通线缆	72	987.84	0.00
75	300257	开山股份	45	646.65	0.00

76	600032	浙江新能	45	547.20	0.00
----	--------	------	----	--------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002623	亚玛顿	54,101,213.00	3.55
2	300384	三联虹普	51,211,673.82	3.36
3	002145	中核钛白	39,219,979.10	2.58
4	300082	奥克股份	35,536,155.80	2.33
5	002738	中矿资源	31,486,680.00	2.07
6	600970	中材国际	31,268,817.90	2.05
7	603799	华友钴业	30,916,559.25	2.03
8	603319	湘油泵	29,258,259.36	1.92
9	003022	联泓新科	24,460,936.95	1.61
10	300390	天华超净	24,150,048.00	1.59
11	688006	杭可科技	24,064,409.08	1.58
12	603359	东珠生态	23,447,479.30	1.54
13	300724	捷佳伟创	23,000,069.79	1.51
14	300316	晶盛机电	22,586,384.00	1.48
15	002240	盛新锂能	19,345,678.03	1.27
16	000009	中国宝安	16,250,214.06	1.07
17	300432	富临精工	13,006,210.00	0.85
18	300982	苏文电能	12,155,929.00	0.80
19	002497	雅化集团	12,058,065.60	0.79
20	002459	晶澳科技	11,176,010.00	0.73

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	55,217,412.43	3.63
2	002623	亚玛顿	41,004,049.00	2.69
3	002438	江苏神通	37,012,262.00	2.43
4	600732	爱旭股份	32,246,075.86	2.12
5	002747	埃斯顿	31,679,763.00	2.08
6	300724	捷佳伟创	30,241,982.00	1.99
7	300082	奥克股份	29,991,286.80	1.97
8	600438	通威股份	29,818,224.00	1.96
9	003022	联泓新科	28,756,849.40	1.89
10	603063	禾望电气	25,538,085.97	1.68

11	601877	正泰电器	25,000,635.00	1.64
12	300390	天华超净	22,941,620.38	1.51
13	002074	国轩高科	20,448,788.24	1.34
14	300769	德方纳米	18,170,641.00	1.19
15	601012	隆基股份	14,926,588.74	0.98
16	688063	派能科技	14,557,044.68	0.96
17	06865	福莱特	13,724,136.21	0.90
18	300573	兴齐眼药	12,634,751.00	0.83
19	03690	美团-W	12,449,765.76	0.82
20	002158	汉钟精机	12,178,948.00	0.80

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	675,893,800.00
卖出股票收入（成交）总额	731,433,193.38

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	—
股指期货投资本期收益(元)	—
股指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股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货、国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货、国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货、国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货、国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行股指期货、国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货、国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货、国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货、国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	262,025.32
2	应收证券清算款	34,767,472.28
3	应收股利	—
4	应收利息	12,297.42
5	应收申购款	12,833,118.87
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	47,874,913.89

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002623	亚玛顿	27,421,875.00	1.57	非公开发行限售
2	300724	捷佳伟创	25,906,444.46	1.49	非公开发行限售
3	603319	湘油泵	25,150,123.68	1.44	非公开发行限售

注：本基金本报告期末持有亚玛顿（股票代码 002623）公允价值为 141,651,816.90 元，其中非公开发行限售股票部分公允价值为 27,421,875.00 元，剩余部分为正常流通股票；捷佳伟创（股票代码 300724）公允价值为 68,734,204.19 元，其中非公开发行限售股票部分公允价值为 25,906,444.46 元，剩余部分为正常流通股票；湘油泵（股票代码 603319）公允价值为 97,931,168.83 元，其中非公开发行限售股票部分公允价值为 25,150,123.68 元，剩余部分为正常流通股票。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国清洁能源产业灵活配置混合 A	36,298	22,234.79	120,900,065.01	14.98	686,178,204.02	85.02
富国清洁能源产业灵活配置混合 C	129	39,526.42	2,764,040.30	54.21	2,334,867.88	45.79
合计	36,427	22,296.02	123,664,105.31	15.23	688,513,071.90	84.77

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	富国清洁能源产业灵活配置混合 A	915,678.65	0.1135
	富国清洁能源产业灵活配置混合 C	51,454.09	1.0091
	合计	967,132.74	0.1191

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	富国清洁能源产业灵活配置混合 A	0~10
	富国清洁能源产业灵活配置混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	富国清洁能源产业	0

金	灵活配置混合 A	
	富国清洁能源产业 灵活配置混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国清洁能源产业灵活 配置混合 A	富国清洁能源产业灵活 配置混合 C
基金合同生效日(2020 年 03 月 06 日)基金 份额总额	1,750,660,779.01	—
报告期期初基金份额总额	835,724,592.00	—
本报告期基金总申购份额	548,604,037.44	10,804,384.39
减：本报告期基金总赎回份额	577,250,360.41	5,705,476.21
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	807,078,269.03	5,098,908.18

注：本基金自 2021 年 1 月 15 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
东方证券	2	153,012,724.04	11.43	—	—	—	—	—	—	139,439.67	11.64	—
国金证券	2	7,883,411.67	0.59	—	—	—	—	—	—	7,184.14	0.60	—
国泰君安	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
恒泰证券	2	33,487,838.62	2.50	—	—	—	—	—	—	30,517.09	2.55	—
华泰证券	2	149,811,514.12	11.19	—	—	—	—	—	—	136,522.88	11.40	—
申万宏源	1	395,981,895.38	29.59	—	—	—	—	—	—	353,694.98	29.53	—
信达证券	2	20,150,390.72	1.51	—	—	—	—	—	—	18,360.78	1.53	—
野村证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	2	212,398,531.39	15.87	—	—	—	—	—	—	193,558.25	16.16	—
浙商证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中金财富	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中金公司	1	47,250,867.51	3.53	—	—	—	—	—	—	43,060.43	3.59	—
中信建投	1	57,807,806.84	4.32	—	—	—	—	—	—	52,681.37	4.40	—

中信山东	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	2	260,665,731.13	19.48	—	—	—	—	—	—	222,917.97	18.61	—
中银证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金新增券商交易单元：浙商证券（012031），德邦证券（50403、012563）。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金 2021 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	规定披露媒介	2021 年 01 月 06 日
2	关于富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金修订基金合同及托管协议的公告	规定披露媒介	2021 年 01 月 13 日
3	富国基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	规定披露媒介	2021 年 01 月 20 日
4	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金最低定投金额的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 05 日
5	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 17 日
6	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021 年 03 月 24 日
7	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2021 年 04 月 20 日
8	富国基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	规定披露媒介	2021 年 04 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票指引》、《存托凭证发行与

交易管理办法（试行）》和《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等法律法规的规定及基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定自 2021 年 1 月 15 日起在投资范围中新增新三板精选层股票及存托凭证，并增加收取销售服务费的 C 类份额及增加侧袋机制的相关约定，同时对基金合同及托管协议的相应条款进行修改。具体可参加基金管理人于 2021 年 1 月 13 日发布的《关于富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金修订基金合同及托管协议的公告》及修订后的基金合同、托管协议。

§ 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金的文件	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	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 。
2、富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同		
3、富国清洁能源产业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、富国清洁能源产业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		