

富国积极成长一年定期开放混合型证券投资基金

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 1 日起至 2021 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富国积极成长一年定期开放混合
基金主代码	009693
交易代码	009693
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020年06月15日
报告期末基金份额总额（单位：份）	1,341,668,837.30
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要投资于积极成长主题相关股票，指顺应未来产业趋势、以技术创新为主要增长驱动力的公司，尤其是管理层锐意进取，能够在经济结构转型中把握市场机遇的优秀公司。本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、公司价值评估以及组合风险管理全过程中。新三板精选层股票投资策略方面，本基金结合定量分析和定性分析，着重遴选盈利模式清晰，业务快速发展，已初步具有盈利能力的成长型公司，或者面向市场高度认可、研发创新能力强的创新型企业。本基金以定期开放方式运作，在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。本基金的大类资产配置策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、金融衍生工具投资策略、资产支持证券投资策略、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 500 指数收益率*55%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*5%+中国战略新兴产业成份指数收益率*20%+中债综合全价指数收益率*20%
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高于债券型基金与货币市场基金，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。
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

### § 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	102,496,626.68
2. 本期利润	58,267,479.79
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0442
4. 期末基金资产净值	2,077,000,396.04
5. 期末基金份额净值	1.5481

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	2.95%	1.65%	0.20%	0.88%	2.75%	0.77%
过去六个月	19.41%	1.47%	9.05%	0.78%	10.36%	0.69%
过去一年	33.73%	1.62%	13.14%	0.91%	20.59%	0.71%
自基金合同生效起至今	54.81%	1.63%	23.15%	1.00%	31.66%	0.63%

##### 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2020年6月15日成立，建仓期6个月，从2020年6月15日起至2020年12月14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		
杨栋	本基金基金经理	2020-06-15	—	10.4	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

				<p>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。</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积极成长一年定期开放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》、《富国积极成长一年定期开放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**

本基金在 2021 年第三季度上涨 2.95%，跑赢基准。主要原因有以下几个方面：

- 1、本基金自下而上选择的个股，在第三季度表现较好。
- 2、超配高景气、有成长性的化工公司。今年上半年，在国内外需求共振、油价上涨的背景下，大多数化工品价格上涨，盈利能力很强。在此基础上，符合未来产业趋势的化工工艺，可以进行新的项目拓展，成长性凸显。
- 3、本基金超配军工板块，但军工板块在第三季度波动较大，表现欠佳。
- 4、新三板精选层转板的预期逐步明确，本基金持有的新三板精选层股票上涨幅度较大。

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，本基金将继续坚持以绝对收益为导向，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。

#### **4.5 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 2.95%，同期业绩比较基准收益率为 0.20%

#### **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	2,034,201,416.54	97.65
	其中：股票	2,034,201,416.54	97.65
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	33,487,638.66	1.61
7	其他资产	15,409,126.37	0.74
8	合计	2,083,098,181.57	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 33,020,378.26 元，占资产净值比例为 1.59%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 55,303,858.54 元，占资产净值比例为 2.66%。

### 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	8,529.06	0.00
B	采矿业	111,563,648.26	5.37
C	制造业	1,558,523,473.63	75.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,715,960.86	1.05
E	建筑业	33,814,516.41	1.63
F	批发和零售业	61,220.26	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	37,784.62	0.00
H	住宿和餐饮业	40,233.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	92,767,341.17	4.47
J	金融业	732.61	0.00
K	房地产业	—	—

L	租赁和商务服务业	24,317,769.00	1.17
M	科学研究和技术服务业	57,054,301.14	2.75
N	水利、环境和公共设施管理业	174,450.58	0.01
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	11,716.70	0.00
S	综合	45,785,502.00	2.20
	合计	1,945,877,179.74	93.69

## 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（%）
原材料	65,729,891.85	3.16
工业	9,029,474.86	0.43
房地产	7,359,718.55	0.35
医疗保健	6,205,151.54	0.30
合计	88,324,236.80	4.25

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。

## 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	002810	山东赫达	2,226,945	94,110,695.70	4.53
2	835368	连城数控	721,903	85,177,334.97	4.10
3	301050	雷电微力	340,307	76,333,331.59	3.68
4	430047	诺思兰德	6,234,861	75,628,863.93	3.64
5	603678	火炬电子	984,289	69,441,588.95	3.34
6	002025	航天电器	1,020,619	63,007,321.29	3.03
7	002402	和而泰	2,857,747	59,441,137.60	2.86
8	300573	兴齐眼药	459,362	58,660,527.40	2.82
9	002179	中航光电	712,300	58,437,092.00	2.81
10	835185	贝特瑞	349,254	56,834,103.42	2.74

### 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

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	835368	连城数控	721,903.00	85,177,334.97	4.10
2	430047	诺思兰德	6,234,861.00	75,628,863.93	3.64
3	835185	贝特瑞	349,254.00	56,834,103.42	2.74
4	830799	艾融软件	1,619,017.00	27,928,043.25	1.34
5	833819	颖泰生物	3,641,803.00	25,383,366.91	1.22
6	839729	永顺生物	746,599.00	12,109,835.78	0.58
7	430198	微创光电	1,004,198.00	10,453,701.18	0.50
8	832317	观典防务	242,290.00	5,994,254.60	0.29
9	833874	泰祥股份	200,000.00	3,848,000.00	0.19
合计	—	—	14,759,925.00	303,357,504.04	14.61

### 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；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

## **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；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。

### **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	374,150.52
2	应收证券清算款	15,028,242.02
3	应收股利	—
4	应收利息	6,733.83
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	15,409,126.37

#### 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

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	002025	航天电器	850,240.89	0.04	非公开发行限售

2	301050	雷电微力	37,729.69	0.00	新股限售
---	--------	------	-----------	------	------

注：本基金本报告期末持有航天电器（股票代码 002025）公允价值为 63,007,321.29 元，其中非公开发行限售股票部分公允价值为 850,240.89 元，剩余部分为正常流通股票；雷电微力（股票代码 301050）公允价值为 76,333,331.59 元，其中新股限售股票部分公允价值为 37,729.69 元，剩余部分为正常流通股票。

#### 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	1,091,877,066.34
报告期期间基金总申购份额	249,791,770.96
减：报告期期间基金总赎回份额	—
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	1,341,668,837.30

### § 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 基金管理人运用自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自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积极成长一年定期开放混合型证券投资基金的文件

2、富国积极成长一年定期开放混合型证券投资基金基金合同

3、富国积极成长一年定期开放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、富国积极成长一年定期开放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 10 月 27 日