

富国沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金

二〇二一年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国农业银行股份有限公司

送出日期： 2022 年 01 月 24 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 20 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 10 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富国沪深 300ESG 基准 ETF
场内简称	300ESGETF
基金主代码	516830
交易代码	516830
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 06 月 24 日
报告期末基金份额总额（单位：份）	374,676,885.00
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	本基金主要采用完全复制法，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。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本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、股指期货投资策略、国债期货投资策略、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	本基金的业绩比较基准为沪深 300ESG 基准指数收益率。
风险收益特征	本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。本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。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

## § 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 10 月 01 日-2021 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-7,970,947.31
2. 本期利润	8,932,681.13
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0215
4. 期末基金资产净值	357,633,821.25

5. 期末基金份额净值	0.9545
-------------	--------

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。

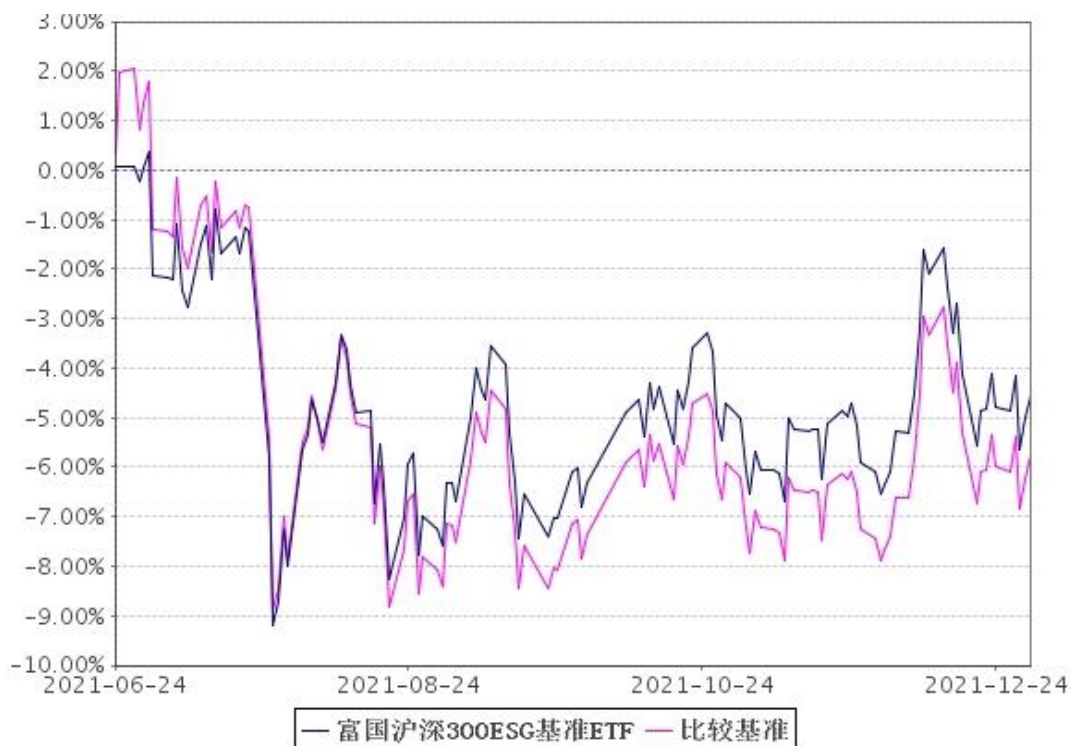
本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 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	1.89%	0.81%	1.73%	0.82%	0.16%	-0.01%
过去六个月	-4.57%	1.03%	-6.99%	1.05%	2.42%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-4.55%	1.02%	-5.76%	1.05%	1.21%	-0.03%

#### 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12月31日。

2、本基金于2021年6月24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6月24日起至2021年12月23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		
蔡卡尔	本基金基金经理	2021-06-24	—	8.4	硕士，自2013年8月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、定量研究员、量化投资部量化投资总监助理；

				<p>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。</p> <p>自 2017 年 1 月起任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2017 年 5 月起任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2018 年 5 月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金基金经理，2021 年 1 月起任富国中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 4 月起任富国中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至 2021 年 12 月任富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月起任富国沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 9 月起任富国中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金、富国中证新华社民族品牌工程交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 11 月起任富国中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经</p>
--	--	--	--	--

					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沪深 300ESG 基准交易型开放式指数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》、《富国沪深 300ESG 基准交易型开放式指数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1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**

由于国庆节期间中美关系缓和预期升温，新冠特效药或促进疫情改善，多部委强调全力做好能源保供，央行提出地产“两维护”，政策可能边际松动，节后A股迎来反弹。进入10月中旬，随着保供措施进一步加强，煤炭等能源价格上涨预期减弱，市场宽松预期提升，以新能源车、光伏为代表的新能源板块带动科技股快速反弹。随着经济数据下行压力增大，地产政策放松预期加强，以银行为代表的金融板块也迎来反弹。11月初，受到房地产信用风险事件发酵的影响，A股整体再次迎来调整。11月中旬，随着公布的金融数据显示新增居民中长贷走强，表明房贷放款边际放松，同时部分银行加强房地产开发贷投放，提振投资者对经济的信心，地产、金融板块迎来大幅反弹。12月初，海外市场迎来一定幅度的调整，一方面是受新冠变种奥密克戎病毒的影响，部分地区再次封锁，经济前景受到担忧；另一方面是受美联储鹰派表态的影响，鲍威尔称高通胀已非“暂时性”，下次会议上讨论加快缩债是合适的。A股在外围扰动之下保持了较强定力，11月PMI重回扩张区间，稳增长政策发力预期升温成为重要支撑。12月中旬，央行决定下调金融机构存款准备金率0.5个百分点，随后召开的中央经济工作会



议进一步释放“稳字当头、稳中求进”的稳增长信号。随着稳增长信号落地，市场迎来休整，各板块轮换加速。总体来看，2021年4季度上证综指上涨2.01%，沪深300上涨1.52%，创业板指上涨2.4%，中证500指数上涨3.6%，中证1000指数上涨8.17%。

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为1.89%，同期业绩比较基准收益率为1.73%

#### 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	356,232,473.71	99.49
	其中：股票	356,232,473.71	99.49
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	1,695,712.84	0.47
7	其他资产	146,546.67	0.04
8	合计	358,074,733.22	100.00

注：本基金通过转融通证券出借业务出借证券的公允价值为2,345,690.00元，占资产净值比例为0.66%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末积极投资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	1,263,921.83	0.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	32,925.21	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
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	256,687.30	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	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	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,584,207.85	0.44

### 5.2.2 报告期末指数投资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	4,969,071.60	1.39
B	采矿业	9,441,489.00	2.64
C	制造业	204,190,810.43	57.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,607,780.00	2.69
E	建筑业	6,057,794.00	1.69
F	批发和零售业	1,753,116.00	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	8,915,780.50	2.49
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务	11,172,830.00	3.12

	业		
J	金融业	76,134,921.33	21.29
K	房地产业	7,979,482.00	2.23
L	租赁和商务服务业	1,773,675.00	0.50
M	科学研究和技术服务业	8,783,569.00	2.46
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	87,246.00	0.02
Q	卫生和社会工作	3,128,393.00	0.87
R	文化、体育和娱乐业	652,308.00	0.18
S	综合	—	—
	合计	354,648,265.86	99.17

### 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 指数投资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	300750	宁德时代	30,000	17,640,000.00	4.93
2	600036	招商银行	361,783	17,622,449.93	4.93
3	000858	五粮液	56,608	12,604,337.28	3.52
4	600519	贵州茅台	5,600	11,480,000.00	3.21
5	000333	美的集团	113,000	8,340,530.00	2.33
6	601012	隆基股份	87,280	7,523,536.00	2.10
7	601166	兴业银行	393,700	7,496,048.00	2.10
8	002475	立讯精密	140,000	6,888,000.00	1.93
9	002415	海康威视	128,500	6,723,120.00	1.88
10	600900	长江电力	278,100	6,312,870.00	1.77

#### 5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	688187	时代电气	7,732	592,657.80	0.17

2	688766	普冉股份	704	241,281.92	0.07
3	688248	南网科技	11,763	222,320.70	0.06
4	688697	纽威数控	5,837	93,567.11	0.03
5	688071	华依科技	1,101	68,603.31	0.02

#### 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。

#### 5.10 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

本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，在风险可控的基础上，以套期保值为目的，参与国债期货的投资，以降低跟踪误差。

## 5.10.2 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“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：违规办理内保外贷业务；未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料；违反外汇市场交易管理规定；未按规定保存交易通讯记录；违规办理银行卡业务的违法违规事实，国家外汇管理局福建省分局于 2021 年 7 月 21 日对公司做出责令改正、警告、没收违法所得和罚款合计 300.10537 万元人民币的行政处罚（闽汇罚〔2021〕5 号）。“兴业银行”为本基金跟踪标的指数的成份股。

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）。“招商银行”为本基金跟踪标的指数的成份股。

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	145,890.82
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	655.85
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	146,546.67

#### 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

##### 5.11.5.1 期末指数投资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	601012	隆基股份	862,000.00	0.24	转融通流通受限

##### 5.11.5.2 期末积极投资前五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	688187	时代电气	592,657.80	0.17	新股限售
2	688766	普冉股份	241,281.92	0.07	新股限售

3	688248	南网科技	222,320.70	0.06	新股限售
4	688697	纽威数控	93,567.11	0.03	新股限售
5	688071	华依科技	68,603.31	0.02	新股限售

#### 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	464,676,885.00
报告期期间基金总申购份额	2,500,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	92,500,000.00
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	374,676,885.00

### § 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，根据有关法律法规规定和基金合同的约定，本基金可在符合基金合同约定的投资目标、投资策略、投资范围、资产配置比例和风险收益特征的前提下参与北交所上市股票的投资，但本基金并非必然投资于北交所上市股票。具体可参见基金管理人于 2021 年 11 月 26 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所上市股票及相关风险提示的公告》及基金合同和招募说明书。

## § 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沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金的文件
- 2、富国沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、富国沪深 300ESG 基准交易型开放式指数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、富国沪深 300ESG 基准交易型开放式指数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  
2022 年 01 月 24 日