

富国中证 800 银行交易型开放式指数证券投资基金

二〇二二年第 1 季度报告

2022 年 03 月 31 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： 2022 年 04 月 22 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 4 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富国中证 800 银行 ETF
场内简称	银行 ETF
基金主代码	159887
交易代码	159887
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 05 月 12 日
报告期末基金份额总额（单位：份）	294,615,950.00
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。在正常市场情况下，本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%。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、参与融资及转融通证券出借业务策略、股票期权投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为中证 800 银行指数收益率。
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，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	招商银行股份有限公司

## § 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（2022 年 01 月 01 日-2022 年 03 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-808,569.71
2. 本期利润	10,377,345.93
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0359
4. 期末基金资产净值	277,602,845.45
5. 期末基金份额净值	0.9423

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	2.19%	1.45%	2.40%	1.46%	-0.21%	-0.01%
过去六个月	1.80%	1.19%	1.98%	1.20%	-0.18%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-5.77%	1.22%	-10.75%	1.24%	4.98%	-0.02%

#### 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2022年3月31日。

2、本基金于 2021 年 5 月 12 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 5 月 12 日起至 2021 年 11 月 11 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		
王乐乐	本基金基金经理	2021-05-12	—	11.8	博士，曾任上海证券有限责任公司研究员，华泰联合证券有限责任公司研究员，华泰证券股份有限公司研究员、创新规划团队负责人；自 2015 年 5 月加入富国基金管理有限公司，历任定量基金经理、量化投资部量化投资总监助理；现任富国基金量化投资部 ETF 投资总监兼高级定量基金经理。2015 年 8 月至 2020 年 1 月任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 7 月任富国全球债券证券投资基金基金经理，2017 年 10 月至 2020 年 1 月任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金

				<p>基金经理,2017年11月至2020年1月任富国中证工业4.0指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理,2018年11月至2020年5月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2018年12月至2020年5月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2019年3月至2020年8月任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年6月至2020年8月任富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年7月起任富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理,</p> <p>2019年9月起任富国中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年10月起任富国中证消费50交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年11月至2020年12月任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年11月起任富国中证科技50策略交易型</p>
--	--	--	--	--

				<p>开放式指数证券投资基金、富国中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2019年12月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2020年1月起任富国中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2020年2月起任富国中证科技50策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理;2020年3月起任富国中证医药50交易型开放式指数证券投资基金、富国中证消费50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2020年5月起任富国中证800交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2020年7月起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,2021年5月起任富国中证800银行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。</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合规守信情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证 800 银行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》、《富国中证 800 银行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**

新年伊始，随着美国加息预期升温，同时伴随着市场风格切换，前期表现强势的成长赛道如新能源、锂电池、军工等板块均迎来大幅调整，稳增长板块表现较强。1月下旬，尽管央行决定下调MLF、逆回购利率各10BP，进一步释放宽松信号，但受美债收益率大幅上行、俄乌边境冲突加剧影响，节前避险情绪升温，A股迎来大幅调整。春节假期结束后，随着各地基建落地加速，稳增长力度加大，稳增长板块如建筑、银行等板块节后继续反弹，另外受原油价格大幅上涨的带动，煤炭、有色等上游周期板块也迎来上涨行情。随着1月信贷及社融数据公布，相关数据超出市场预期，宽信用正在逐步见效。同时成长板块经过大幅调整后，性价比再次凸显，新能源车、光伏等成长板块逐步迎来反弹。2月下旬，受俄乌冲突加剧，全球石油天然气供给缺口加大，布伦特原油价格持续走高。受此影响，投资者对全球经济滞胀担忧加大，全球股市均出现较大幅度的调整。3月中旬，SEC将5家中国公司列入《外国公司问责法》的暂定清单，资本对中概股从纳斯达克退市的担忧加剧，中概股和港股互联网公司均迎来一轮大幅回调，A股也出现外资大幅流出的情况。与此同时，由于央行未如期降息，投资者对房地产信用风险担忧加剧，A股再次大幅回调。随着国务院金融稳定发展委员会召开专题会议研究当前经济形势和资本市场问题，对市场关切的问题如宏观经济运行、房地产、中概股、平台经济等均做出积极务实的回应，投资者信心获得提振，A股应声上涨。3月下旬，市场恐慌情绪逐步消除，各板块相继企稳，其中与稳增长相关的房地产产业链表现较为突出。

总体来看，2022年1季度上证综指下跌10.65%，沪深300下跌14.53%，创业板指下跌19.96%，中证500指数下跌14.06%。

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2.19%，同期业绩比较基准收益率为2.40%

#### 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	275,993,707.90	94.80
	其中：股票	275,993,707.90	94.80
2	固定收益投资	540,068.65	0.19
	其中：债券	540,068.65	0.19
	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	9,618,214.14	3.30
7	其他资产	4,987,386.67	1.71
8	合计	291,139,377.36	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	303,658.86	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
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	64,436.60	0.02
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	—	—
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	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	368,095.46	0.13

### 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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
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	—	—
J	金融业	275,625,612.44	99.29
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	—	—
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	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	275,625,612.44	99.29

### 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	600036	招商银行	800,700	37,472,760.00	13.50
2	601166	兴业银行	1,756,400	36,304,788.00	13.08
3	601398	工商银行	4,230,600	20,179,962.00	7.27
4	000001	平安银行	1,152,943	17,732,263.34	6.39
5	002142	宁波银行	467,540	17,481,320.60	6.30
6	601328	交通银行	3,317,500	16,952,425.00	6.11
7	601288	农业银行	4,111,600	12,663,728.00	4.56
8	600000	浦发银行	1,420,700	11,365,600.00	4.09
9	600016	民生银行	2,917,800	11,145,996.00	4.02
10	600919	江苏银行	1,429,000	10,074,450.00	3.63

#### 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	688295	N 神鹰	4,100	120,253.00	0.04
2	688193	仁度生物	1,635	103,364.70	0.04
3	688150	莱特光电	3,898	65,252.52	0.02
4	688173	希荻微	2,945	64,436.60	0.02
5	603051	鹿山新材	272	14,788.64	0.01

#### 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	—	—
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）	540,068.65	0.19
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	540,068.65	0.19

#### 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	113055	成银转债	5,400	540,068.65	0.19

#### 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

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、股票期权等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。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**

本基金根据基金合同约定，不允许投资国债期货。

### **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。**

本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局、中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局宁波市分局、中国人民银行宁波市中心支行、中国银行保险监督管理委员会宁波监管局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局、中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会云南监管局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海浦东发展银行股份有限公司在

报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局福建省分局、中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。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	44,309.80
2	应收证券清算款	4,830,063.27
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	113,013.60
8	其他	—
9	合计	4,987,386.67

#### 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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

##### 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	688295	N 神鹰	120,253.00	0.04	新股认购
2	688150	莱特光电	65,252.52	0.02	新股限售
3	688173	希荻微	64,436.60	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	342,315,950.00
报告期期间基金总申购份额	135,900,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	183,600,000.00
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	294,615,950.00

## § 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。

## § 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 800 银行交易型开放式指数证券投资基金的文件

2、富国中证 800 银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同

3、富国中证 800 银行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、富国中证 800 银行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 04 月 22 日