

富国泓利纯债债券型发起式证券投资基金

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	富国泓利纯债债券型发起式	
基金主代码	004920	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年07月25日	
报告期末基金份额总额（单位：份）	6,216,432,213.55	
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。	
投资策略	本基金奉行“自上而下”和“自下而上”相结合的主动式投资管理理念，采用价值分析方法，在分析和判断财政、货币、利率、通货膨胀等宏观经济运行指标的基础上，自上而下确定和动态调整大类资产比例和债券的组合目标久期、期限结构配置及类属配置；同时，采用“自下而上”的投资理念，在研究分析信用风险、流动性风险、供求关系、收益率水平、税收水平等因素基础上，自下而上的精选个券，把握固定收益类金融工具投资机会。	
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率×90%+1年期定期存款利率（税后）×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	富国泓利纯债债券型发起式 A	富国泓利纯债债券型发起式 C
下属分级基金的交易代码	004920	007176
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	6,118,349,553.64	98,082,659.91

## § 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	富国泓利纯债债券型发起式 A 报告期(2021年07月01日-2021年09月30日)	富国泓利纯债债券型发起式 C 报告期(2021年07月01日-2021年09月30日)
--------	--	--

1. 本期已实现收益	61,642,606.69	946,564.23
2. 本期利润	63,381,284.45	982,582.02
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0116	0.0108
4. 期末基金资产净值	6,417,166,966.29	102,095,512.38
5. 期末基金份额净值	1.0488	1.0409

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) 富国泓利纯债债券型发起式 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	1.18%	0.03%	1.52%	0.05%	-0.34%	-0.02%
过去六个月	2.57%	0.02%	2.69%	0.04%	-0.12%	-0.02%
过去一年	4.46%	0.03%	4.76%	0.04%	-0.30%	-0.01%
过去三年	16.48%	0.04%	13.75%	0.06%	2.73%	-0.02%
自基金合同生效起至今	23.38%	0.04%	19.51%	0.06%	3.87%	-0.02%

#### (2) 富国泓利纯债债券型发起式 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	1.11%	0.03%	1.52%	0.05%	-0.41%	-0.02%
过去六个月	2.42%	0.02%	2.69%	0.04%	-0.27%	-0.02%
过去一年	4.14%	0.03%	4.76%	0.04%	-0.62%	-0.01%
自基金分级生效日起至今	9.86%	0.04%	9.84%	0.06%	0.02%	-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

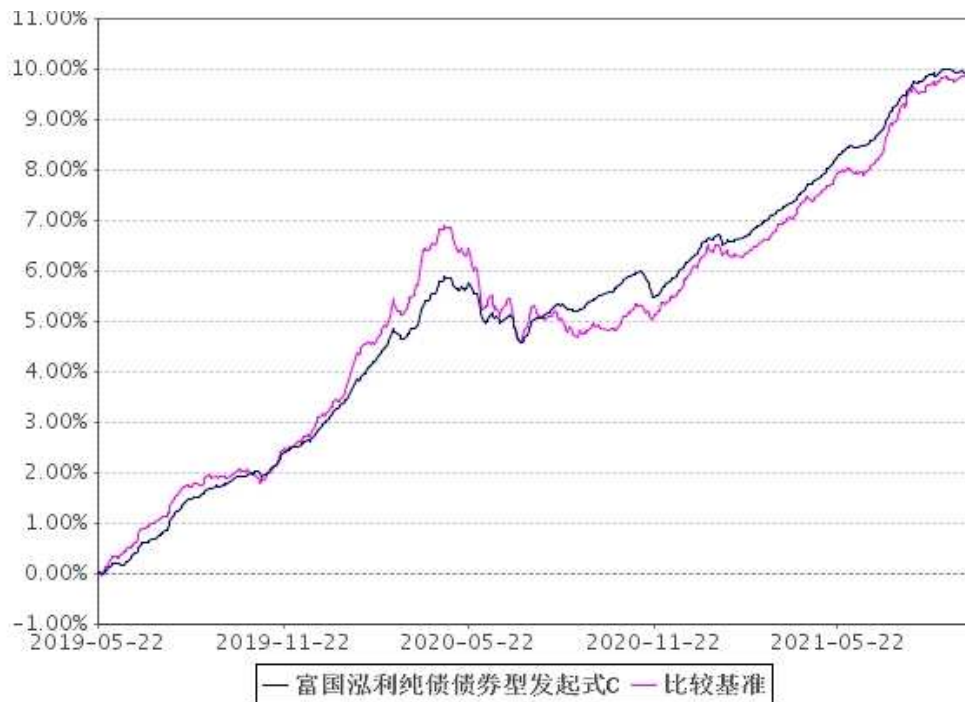
(1) 自基金合同生效以来富国泓利纯债债券型发起式 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2021年9月30日。

2、本基金于2017年7月25日成立，建仓期6个月，从2017年7月25日起至2018年1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泓利纯债债券型发起式 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9月30日。

2、本基金自2019年5月21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		
武磊	本基金基金经理	2017-07-31	—	10.2	博士，曾任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投资经理，国泰君安证券股份有限公司资本市场部董事，上海国泰君安证券资产管理有限公司投资经理；自

				<p>2016年12月加入富国基金管理有限公司，历任固定收益基金经理、固定收益投资部固定收益投资总监助理；现任富国基金固定收益投资部固定收益投资副总监兼固定收益基金经理。2017年3月起任富国产业债债券型证券投资基金基金经理，2017年3月至2019年11月任富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2017年6月起任富国鼎利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金（原富国鼎利纯债债券型发起式证券投资基金，于2019年7月9日更名）基金经理，2017年7月起任富国泓利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年4月起任富国臻利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年5月起任富国尊利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；</p> <p>2018年7月至2019年11月任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年7月起任富国新天锋债券型证券投资基金（LOF）（原富国新天锋</p>
--	--	--	--	---

					定期开放债券型证券投资基金，于2019年2月20日更名)基金经理；2018年9月起任富国中债-1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理；2019年3月至2020年10月任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理；2019年4月起任富国中债1-5年农发行债券指数证券投资基金基金经理；2020年3月起任富国泽利纯债债券型证券投资基金基金经理；2020年6月起任富国添享一年持有期债券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泓利纯债债券型发起式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》、《富国泓利纯债债券型发起式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

三季度，国内疫情出现多点散发，对消费活动产生较明显负面影响，进入9月后上游价格高涨导致电力紧张，也影响了工业生产，三季度经济有一定回落压力。7月份超预期降准后，央行继续通过续作MLF、逆回购等方式向市场提供流动性，资金面总体平稳，但资金利率仍然围绕在政策附近。债市经历降准后的下行行情后，重回震荡格局。本基金适当增配利率债和高等级信用债，灵活运用杠杆，报告期净值有所增长。

#### 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1.18%，C级为1.11%，同期业绩比较基准收益率A级为1.52%，C级为1.52%

#### 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	—	—
	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	8,288,076,100.00	97.32
	其中：债券	8,084,616,500.00	94.93
	资产支持证券	203,459,600.00	2.39
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	66,284,003.36	0.78
7	其他资产	162,045,560.30	1.90
8	合计	8,516,405,663.66	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

注：本基金本报告期末未持有境内股票资产。

## 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

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

### 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	110,770,000.00	1.70
2	央行票据	—	—
3	金融债券	2,002,717,000.00	30.72
	其中：政策性金融债	771,304,000.00	11.83
4	企业债券	2,866,110,500.00	43.96
5	企业短期融资券	442,149,000.00	6.78
6	中期票据	2,355,850,500.00	36.14
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	307,019,500.00	4.71
9	其他	—	—
10	合计	8,084,616,500.00	124.01

## 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	102101769	21 国电 MTN004	2,000,000	199,560,000.00	3.06
2	112103106	21 农业银行 CD106	1,500,000	146,025,000.00	2.24
3	210205	21 国开 05	1,400,000	144,116,000.00	2.21
4	190207	19 国开 07	1,200,000	120,576,000.00	1.85
5	210405	21 农发 05	1,100,000	111,936,000.00	1.72

#### 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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	137917	2 金易 1A	300,000	30,129,000.00	0.46
2	136334	荟柒 1A	240,000	24,002,400.00	0.37
3	136256	21 元顺 2A	200,000	20,026,000.00	0.31
4	136006	永熙优 36	190,000	19,060,800.00	0.29
5	2189127	21 工元至 诚 3 优先 _bc	300,000	16,596,000.00	0.25
6	189073	金诚 06A	150,000	15,015,000.00	0.23
7	137923	东裕 03A	100,000	10,042,000.00	0.15
8	189348	安慧 14A2	100,000	10,040,000.00	0.15
9	2189309	21 信瑞 1 优先	100,000	10,019,000.00	0.15
10	189968	明远 02A1	100,000	10,000,000.00	0.15

#### 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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

## **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的约定，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。**

本报告编制日前一年内，本基金持有的“19 国开 07”的发行主体国家开发银行（以下简称“公司”），由于存在违反银行交易记录管理规定的行为，国家外汇管理局北京外汇管理部于 2020 年 10 月 26 日对公司做出罚款 60 万元的行政处罚（京汇罚〔2020〕32 号）；由于存在为违规的政府购买服务项目提供融资；项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况；违规变相发放土地储备贷款等 24 项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 25 日对公司作出罚款 4880 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2020〕67 号）。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“21 国开 05”的发行主体国家开发银行（以下简称“公司”），由于存在违反银行交易记录管理规定的行为，国家外汇管理局北京外汇管理部于 2020 年 10 月 26 日对公司做出罚款 60 万元的行政处罚（京汇罚〔2020〕32 号）；由于存在为违规的政府购买服务项目提供融资；项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况；违规变相发放土地储备贷款等 24 项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年

12月25日对公司作出罚款4880万元的行政处罚(银保监罚决字(2020)67号)。

本报告编制日前一年内,本基金持有的“21国开10”的发行主体国家开发银行(以下简称“公司”),由于存在违反银行交易记录管理规定的行为,国家外汇管理局北京外汇管理部于2020年10月26日对公司做出罚款60万元的行政处罚(京汇罚(2020)32号);由于存在为违规的政府购买服务项目提供融资;项目资本金管理不到位,棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况;违规变相发放土地储备贷款等24项违法违规事实,中国银行保险监督管理委员会于2020年12月25日对公司作出罚款4880万元的行政处罚(银保监罚决字(2020)67号)。

本报告编制日前一年内,本基金持有的“21上海银行”的发行主体上海银行股份有限公司(以下简称“公司”),由于公司2014年至2018年间绩效考评管理严重违反审慎经营规则;2018年未按规定延期支付2017年度绩效薪酬等违法违规事实,中国银行保险监督管理委员会上海监管局于2020年11月18日对公司做出责令改正,并处罚款共计80万元的行政处罚(沪银保监银罚决字(2020)25号);由于未按照规定进行信息披露的违法违规事实,中国银行保险监督管理委员会上海监管局于2021年4月25日对公司做出责令改正,并处罚款30万元的行政处罚(沪银保监罚决字(2021)31号);由于存在严重违反审慎经营规则等违法行为,中国银行保险监督管理委员会上海监管局于2021年7月2日对公司做出责令改正,并处罚款共计460万元的行政处罚(沪银保监罚决字(2021)72号)。

本报告编制日前一年内,本基金持有的“21光大银行CD129”的发行主体中国光大银行股份有限公司(以下简称“公司”),由于存在违反银行交易记录管理规定的行为,国家外汇管理局北京外汇管理部于2020年10月20日对公司做出罚款60万元人民币的行政处罚(京汇罚(2020)29号);由于存在违规开展外汇交易的行为,国家外汇管理局北京外汇管理部于2020年10月20日对公司做出罚款60万元人民币的行政处罚(京汇罚(2020)30号)。

本报告编制日前一年内,本基金持有的“21农业银行CD106”的发行主体中

国农业银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费）的违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 7 日对公司做出没收违法所得 49.59 万元，罚款 148.77 万元，罚没合计 198.36 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2020〕66 号）；由于存在：（1）发生重要信息系统突发事件未报告；（2）制卡数据违规明文留存；（3）生产网络、分行无线互联网络保护不当；（4）数据安全较粗放，存在数据泄露风险；（5）网络信息系统存在较多漏洞；（6）互联网门户网站泄露敏感信息的违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 1 月 19 日对公司做出罚款 420 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕1 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 4 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。

股票不属于本基金的投资范围，故本项不适用。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	163,626.23
2	应收证券清算款	50,368,816.73
3	应收股利	—
4	应收利息	110,226,857.49
5	应收申购款	1,286,259.85
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	162,045,560.30

#### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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

项目	富国泓利纯债债券型发起式 A	富国泓利纯债债券型发起 式 C
报告期期初基金份额总额	5,020,734,276.67	77,984,128.58
报告期期间基金总申购份额	1,326,926,089.01	39,244,599.75
减：报告期期间基金总赎回份额	229,310,812.04	19,146,068.42
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	6,118,349,553.64	98,082,659.91

## § 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	10,000,958.77
报告期期间买入/申购总份额	—
报告期期间卖出/赎回总份额	958.77
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.16

注：买入/申购含红利再投资、转换入份额；卖出/赎回含转换出份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位：份



序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	赎回	2021-09-08	958.77	-999.23	0.00%
合计			958.77	-999.23	

### § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数 (份)	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数 (份)	发起份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.16	10,000,000.00	0.16	3年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,000,000.00	0.16	10,000,000.00	0.16	3年

### § 9 影响投资者决策的其他重要信息

#### 9.1 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。

### § 10 备查文件目录

#### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国泓利纯债债券型发起式证券投资基金的文件
- 2、富国泓利纯债债券型发起式证券投资基金基金合同
- 3、富国泓利纯债债券型发起式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、富国泓利纯债债券型发起式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

## **10.2 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

## **10.3 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