

富国国家安全主题混合型证券投资基金
二〇二一年第1季度报告

2021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： 中国建设银行股份有限公司
报告送出日期： 2021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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------------|--|
| 基金简称 | 富国国家安全主题混合 |
| 基金主代码 | 001268 |
| 交易代码 | 前端交易代码：001268 后端交易代码：001269 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年05月14日 |
| 报告期末基金份额总额（单位：份） | 681,911,245.34 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于国家安全主题相关股票，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 | 本基金主要投资于国家安全主题股票，指有助于健全公共安全体系、完善国家安全体制和实现国家安全战略的有关上市公司所发行的股票。本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素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；在行业配置的基础上，本基金将采用自下而上的研究方法，采取定性和定量分析相结合的方法对上市公司基本面进行深入分析，运用不同的估值方法对上市公司的估值水平进行分析，精选符合国家安全主题的优质股票构建投资组合；本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。在债券投资方面，本基金将采用久期控制下的主动性投资策略。本基金中小企业私募债券投资策略、金融衍生工具投资策略详见法律文件。 |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率×80%+中债综合财富指数收益率×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。 |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

§ 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01月01日-2021 |
|--------|----------------------|

| | 年 03 月 31 日) |
|-----------------|----------------|
| 1. 本期已实现收益 | 79,637,864.01 |
| 2. 本期利润 | -49,620,184.65 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0678 |
| 4. 期末基金资产净值 | 803,654,337.97 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.179 |

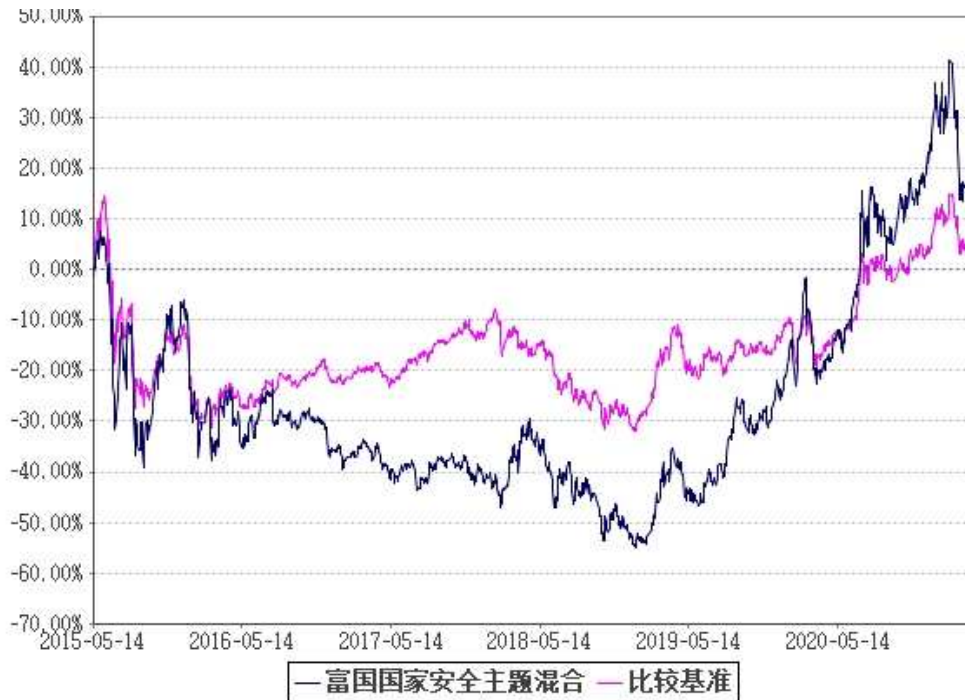
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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 | -6.72% | 2.23% | -1.99% | 1.19% | -4.73% | 1.04% |
| 过去六个月 | 10.50% | 1.85% | 6.86% | 1.01% | 3.64% | 0.84% |
| 过去一年 | 50.38% | 1.82% | 27.00% | 1.03% | 23.38% | 0.79% |
| 过去三年 | 72.62% | 1.92% | 22.34% | 1.10% | 50.28% | 0.82% |
| 过去五年 | 60.19% | 1.73% | 37.52% | 0.95% | 22.67% | 0.78% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.90% | 2.04% | 4.54% | 1.23% | 13.36% | 0.81% |

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3月31日。

2、本基金于2015年5月14日成立，建仓期6个月，从2015年5月14日起至2015年11月13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 | | |
| 章旭峰 | 本基金基金经理 | 2020-07-30 | — | 25.86 | 学士，曾任职于华龙证券上海证券部、大鹏证券上海经纪业务总部、上海证券报信息披露中心、北京世华国际金融有限公司基金债券部；自2007年9月至2015年4月在天治基金管理有限公司工作，历任行业研究员、基金经理助理、基金经理；自2015年 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | 4 月加入富国基金管理有限公司，2015 年 8 月至 2017 年 10 月任富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金基金经理，2017 年 6 月任富国产业升级混合型证券投资基金基金经理，2018 年 3 月起任富国军工主题混合型证券投资基金基金经理，2020 年 7 月起任富国国家安全主题混合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国家安全主题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》、《富国国家安全主题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

2021 年一季度，随着海外疫苗接种速度不断加快，全球经济复苏置信度提高。3 月制造业 PMI 数据延续修复，其中 PMI 新出口订单续升 2.4 个百分点，与 PMI 新订单的差值进一步放大，显示外需仍强。中国 A 股市场在经济复苏与政策收紧之间的预期再平衡，二季度全球经济复苏或将显著超预期。尤其是支撑本轮中国经济修复的两大动能，出口与制造业二季度环比依然有望维持强势。

报告期内，流动性收敛，风险偏好下降导致上证指数下跌 0.9%，沪深 300 下跌 3.13%，创业板指、中小板指更是大幅下挫 7%、4.19%。涨幅前列的行业分别是钢铁、消费者服务、银行、电力及公用事业、建材等低估值行业，跌幅靠前的行业分别是国防军工、非银金融、通信、计算机、汽车等。

报告期内，本基金继续保持受益于全球经济复苏的银行、机械、有色、化工、

油气设备、消费者服务等低估值传统行业的配置，同时保留了未来三年景气度超高的国防军工行业，前瞻性增配了受益于全球智能汽车电子化渗透率提升的细分领域龙头企业，进一步降低组合的整体估值，把握好风险与收益的再平衡。

我们中长期看好中国经济结构转型方向，本基金将长期坚持“国防安全+科技安全+大消费安全”的投资策略方向，选择最优的成长性行业赛道，通过组合优化进一步减少净值回撤，力争给广大投资者持续稳定的回报。

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-6.72%，同期业绩比较基准收益率为-1.99%

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 | 721,195,528.93 | 89.41 |
| | 其中：股票 | 721,195,528.93 | 89.41 |
| 2 | 固定收益投资 | 30,022,000.00 | 3.72 |
| | 其中：债券 | 30,022,000.00 | 3.72 |
| | 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 | 54,098,932.32 | 6.71 |
| 7 | 其他资产 | 1,324,222.88 | 0.16 |
| 8 | 合计 | 806,640,684.13 | 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

| 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 | 21,038,930.38 | 2.62 |
| C | 制造业 | 518,439,946.36 | 64.51 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 24,036.12 | 0.00 |
| E | 建筑业 | — | — |
| F | 批发和零售业 | 12,580.00 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | — | — |
| H | 住宿和餐饮业 | 65,889,100.50 | 8.20 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 373,738.02 | 0.05 |
| J | 金融业 | 39,421,905.93 | 4.91 |
| K | 房地产业 | — | — |
| L | 租赁和商务服务业 | 49,095,232.00 | 6.11 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 26,755,365.00 | 3.33 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 144,694.62 | 0.02 |
| 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 | 721,195,528.93 | 89.74 |

5.3 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 | 002402 | 和而泰 | 3,412,566 | 70,094,105.64 | 8.72 |
| 2 | 600754 | 锦江酒店 | 1,187,191 | 65,889,100.50 | 8.20 |
| 3 | 600760 | 中航沈飞 | 807,600 | 52,421,316.00 | 6.52 |
| 4 | 601888 | 中国中免 | 160,400 | 49,095,232.00 | 6.11 |
| 5 | 000661 | 长春高新 | 107,100 | 48,487,383.00 | 6.03 |
| 6 | 000513 | 丽珠集团 | 1,134,300 | 47,368,368.00 | 5.89 |
| 7 | 603236 | 移远通信 | 223,140 | 46,716,590.40 | 5.81 |
| 8 | 002747 | 埃斯顿 | 1,784,300 | 46,195,527.00 | 5.75 |
| 9 | 002430 | 杭氧股份 | 1,428,239 | 42,661,498.93 | 5.31 |
| 10 | 688002 | 睿创微纳 | 438,761 | 38,918,100.70 | 4.84 |

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 | 30,022,000.00 | 3.74 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,022,000.00 | 3.74 |
| 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） | — | — |
| 8 | 同业存单 | — | — |
| 9 | 其他 | — | — |
| 10 | 合计 | 30,022,000.00 | 3.74 |

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 | 180208 | 18 国开 08 | 200,000 | 20,032,000.00 | 2.49 |
| 2 | 200211 | 20 国开 11 | 100,000 | 9,990,000.00 | 1.24 |

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

| | |
|-------------------|---|
| 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。

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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

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

| | |
|-------------------|---|
| 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。

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 | 231,455.14 |
| 2 | 应收证券清算款 | — |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 875,974.45 |
| 5 | 应收申购款 | 216,793.29 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 1,324,222.88 |

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：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

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 | 840,971,898.93 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 61,544,376.94 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 220,605,030.53 |
| 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 | 681,911,245.34 |

§ 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（%） | — |

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

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，根据《中华人民共和国证券法》、《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》和《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定自 2021 年 3 月 9 日起，在本基金投资范围中增加存托凭证，并对基金合同及托管协议的相应条款进行修订。具体可参见基金管理人于 2021 年 3 月 6 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下由中国银行股份有限公司等基金托管人托管的部分基金投资范围增加存托凭证、增加 C 类基金份额并相应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。

§ 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国家安全主题混合型证券投资基金的文件
- 2、富国国家安全主题混合型证券投资基金基金合同
- 3、富国国家安全主题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、富国国家安全主题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04月22日