

富国天兴回报混合型证券投资基金

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	富国天兴回报混合	
基金主代码	010515	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年12月16日	
报告期末基金份额总额（单位：份）	4,889,605,160.48	
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争为基金份额持有人提供长期稳定和超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	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。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，主要包括：久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断和信用风险评估等管理手段。在股票投资方面，本基金坚持个股精选策略，“自下而上”选择优质个股，寻求基金资产的长期稳健增值。本基金的大类资产配置策略、存托凭证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略等详见法律文件。	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×80%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+沪深300指数收益率×15%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金投资港股通标的股票的，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定风险。	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	富国天兴回报A	富国天兴回报C
下属分级基金的交易代码	010515	010525
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	4,590,562,811.23	299,042,349.25

## § 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	富国天兴回报 A 报告期(2021年10月01日-2021 年12月31日)	富国天兴回报 C 报告期(2021年10月01日 -2021年12月31日)
1. 本期已实现收益	14,569,349.45	618,535.69
2. 本期利润	75,487,660.81	3,991,058.17
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0208	0.0190
4. 期末基金资产净值	5,014,179,740.44	325,289,072.53
5. 期末基金份额净值	1.0923	1.0878

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) 富国天兴回报 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	1.83%	0.21%	0.41%	0.15%	1.42%	0.06%
过去六个月	4.81%	0.32%	-0.70%	0.20%	5.51%	0.12%
过去一年	8.79%	0.30%	0.24%	0.22%	8.55%	0.08%
自基金合同生效起至今	9.23%	0.30%	1.61%	0.22%	7.62%	0.08%

##### (2) 富国天兴回报 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	1.73%	0.21%	0.41%	0.15%	1.32%	0.06%
过去六个月	4.60%	0.32%	-0.70%	0.20%	5.30%	0.12%
过去一年	8.36%	0.30%	0.24%	0.22%	8.12%	0.08%
自基金合同生效起至今	8.78%	0.30%	1.61%	0.22%	7.17%	0.08%

### 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天兴回报 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12月31日。

2、本基金于2020年12月16日成立，建仓期6个月，从2020年12月16日起至2021年6月15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天兴回报 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12月31日。

2、本基金于2020年12月16日成立，建仓期6个月，从2020年12月16日起至2021年6月15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		
周宁	本基金基金经理	2020-12-16	—	13.5	硕士，曾任东兴证券股份有限公司分析师，摩根士丹利华鑫基金研究员、基金经理、投资副总监；自2016年7月加入富国基金管理有限公司，现任富

					国基金养老金投资部权益投资副总监兼高级权益投资经理，兼任富国基金养老金投资部高级权益基金经理。2020年12月起任富国天兴回报混合型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。
黄兴	本基金基金经理	2020-12-16	—	18.6	博士，曾任石家庄经济学院教师(讲师)，石家庄市商业银行资金计划部副总经理，广东证券有限公司博士后科研工作站博士后；自2003年6月加入富国基金管理有限公司，历任企业年金项目经理、固定收益投资副总监/资深固定收益投资经理、养老金投资部固定收益投资副总监；现任富国基金总经理助理，兼任富国基金养老金投资部总经理、资深固定收益基金经理、资深固定收益投资经理。2020年12月起任富国天兴回报混合型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。

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天兴回报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》、《富国天兴回报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，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

2021 年四季度“保供稳价”政策初见成效，上游工业品价格有所回落，经济“胀”的压力有所缓解，但与此同时地产销售、投资增速持续下滑，居民消费恢复持续不及预期，需求羸弱的压力进一步凸显，在此形势下，政策取向开始逐渐转为积极，12 月中央经济工作会议后，稳增长的政策信号基本明确。受通胀压力缓解、政策稳增长预期增强影响，四季度 A 股整体迎来一波震荡回升行情，核心指数全 A 指数季度上涨 4.58%、沪深 300 涨 1.52%、创业板指涨 2.4%。景气度维持高位的电力设备新能源、国防军工延续强势，科技和消费板块反弹回升，受价格回落波动影响，煤炭、钢铁、石油石化等周期板块出现大幅回调。债市层面，得益于通胀压力缓解和央行降准，债券收益率在 10 月中旬见到回升高点后一路走低，信用债收益率也跟随下行，可转债跟随股市的上涨，中证转债指数上涨 8.35%。

四季度，本基金继续秉承稳健、专业的投资理念，采取“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略。权益资产配置端，一方面继续维持相对稳健的中性仓位，另一方面，结合行业前景、企业核心优势、市场估值等因素，对组合持仓进行了优化调整，增配受益政策宽松、产业趋势向上的优势标的，减配估值偏高、景气存在下行风险的持仓个股。固定收益资产配置端，利用四季度初期通胀压力仍在高位的窗口期，增配债券持仓，同时在相对宽松的货币政策环境下，资金成本较低，通过杠杆策略，配置高等级的信用品，依然能有效增厚收益，增持的主要品种为性价比较高的银行永续债；转债维持较高的仓位，以低价转债为主，同时调整结构，对涨幅较大的品种进行减持，锁定收益。上述策略的实施总体实现了基金净值的稳健上涨。

展望下阶段，中国目前正处在实体经济周期下行+金融债务周期由下行转上

行的过渡阶段，经济下行压力持续加大，但稳增长诉求下，预计将见到更多宽货币+宽信用政策落地。股票市场方面，虽然盈利仍有下行压力，但考虑到流动性易松难紧、政策积极友好，且估值仍处在相对合理位置，预计整体仍将延续震荡分化格局，需关注经济尾部波动以及美联储临近加息周期带来的波动风险。债市方面，随着稳增长政策的不断出台和逐步见效，债券收益率下行空间或相对有限，债券要控制好久期和信用风险；转债仍可维持当前的仓位，寻找结构性机会。

本基金后续将继续贯彻稳健均衡的运作策略，审时度势做好大类资产配置研究，坚持平衡收益与风险的原则，在管控好组合净值波动水平的情况下，积极把握权益和债券市场配置机会，勤勉尽责，力争为持有人提供长期稳健的投资回报。

#### 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 A 级为 1.83%，C 级为 1.73%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 0.41%，C 级为 0.41%

#### 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	1,107,175,405.88	20.06
	其中：股票	1,107,175,405.88	20.06
2	固定收益投资	4,101,956,621.30	74.32
	其中：债券	4,093,936,621.30	74.18
	资产支持证券	8,020,000.00	0.15
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	100,000,000.00	1.81
	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	151,025,873.65	2.74
7	其他资产	58,832,590.37	1.07
8	合计	5,518,990,491.20	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 40,610,339.17 元，占资产净值比例为 0.76%。

## 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	19,599,267.00	0.37
C	制造业	670,669,032.17	12.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,207,683.00	0.23
E	建筑业	21,900,434.99	0.41
F	批发和零售业	3,558,793.02	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	16,258,228.00	0.30
H	住宿和餐饮业	2,955,173.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	130,971,834.41	2.45
J	金融业	65,275,338.76	1.22
K	房地产业	20,311,304.00	0.38
L	租赁和商务服务业	39,420,686.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	32,976,741.11	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	29,369.61	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	6,320,226.00	0.12
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	24,110,955.64	0.45
S	综合	—	—
	合计	1,066,565,066.71	19.98

### 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（%）
信息技术	13,074,748.51	0.24
能源	12,973,088.13	0.24
通信服务	7,880,421.25	0.15
日常消费品	6,682,081.28	0.13
合计	40,610,339.17	0.76

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	603444	吉比特	80,200	33,832,370.00	0.63
2	600519	贵州茅台	16,400	33,620,000.00	0.63
3	300750	宁德时代	55,700	32,751,600.00	0.61
4	002534	杭锅股份	896,200	28,400,578.00	0.53
5	601009	南京银行	2,988,481	26,776,789.76	0.50
6	601888	中国中免	116,800	25,627,088.00	0.48
7	600406	国电南瑞	602,292	24,109,748.76	0.45
8	600298	安琪酵母	386,400	23,323,104.00	0.44
9	002271	东方雨虹	429,000	22,599,720.00	0.42
10	002645	华宏科技	877,900	21,420,760.00	0.40

### 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	50,078,000.00	0.94
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,478,546,000.00	27.69
	其中：政策性金融债	631,214,000.00	11.82
4	企业债券	699,355,380.00	13.10
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	555,359,000.00	10.40
7	可转债（可交换债）	872,566,241.30	16.34
8	同业存单	438,032,000.00	8.20
9	其他	—	—
10	合计	4,093,936,621.30	76.67

### 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	2128047	21 招商银行永 续债	1,600,000	161,296,000.00	3.02
2	210210	21 国开 10	1,200,000	122,592,000.00	2.30
3	123111	东财转 3	671,831	112,988,537.58	2.12
4	112112146	21 北京银行 CD146	1,000,000	97,340,000.00	1.82
5	2128022	21 交通银行永 续债	800,000	82,496,000.00	1.55

### 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	137533	臻林 01A1	200,000	8,020,000.00	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，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，降低投资组合的整体风险。

### 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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安

全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

### **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“21 北京银行 CD146”的发行主体北京银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：（1）未能确保交易信息的真实性、完整性、可追溯性以及在支付全流程中的一致性；（2）未按规定开展条码支付业务；（3）违规开展银行卡收单业务；（4）开立、撤销银行结算账户不规范；（5）未按规定管理支付机构客户备付金的违法违规事实，中国人民银行营业管理部于 2021 年 2 月 5 日对公司做出警告，没收违法所得 50.317056 万元，并罚款 451 万元，罚没合计 501.317056 万元的行政处罚（银管罚〔2021〕4 号）；由于存在：（1）服务收费管理不力，违规收费；（2）理财和同业投资业务严重违反审慎经营规则；（3）贷款管理不到位导致贷款资金被挪用的违法违规事实，北京银保监局于 2021 年 9 月 26 日对公司做出责令改正并罚款 820 万元的行政处罚（京银保监罚决字〔2021〕26 号）；由于发生重要信息系统突发事件但未向监管部门报告，严重违反审慎经营规则，北京银保监局于 2021 年 11 月 24 日对公司做出罚款 40 万元的行政处罚（京银保监罚决字〔2021〕30 号）。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“21 北京银行 CD142”的发行主体北京银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：（1）未能确保交易信息的真实性、完整性、可追溯性以及在支付全流程中的一致性；（2）未按规定开展条码支付业务；（3）违规开展银行卡收单业务；（4）开立、撤销银行结算

账户不规范；（5）未按规定管理支付机构客户备付金的违法违规事实，中国人民银行营业管理部于 2021 年 2 月 5 日对公司做出警告，没收违法所得 50.317056 万元，并罚款 451 万元，罚没合计 501.317056 万元的行政处罚（银管罚〔2021〕4 号）；由于存在：（1）服务收费管理不力，违规收费；（2）理财和同业投资业务严重违反审慎经营规则；（3）贷款管理不到位导致贷款资金被挪用的违法违规事实，北京银保监局于 2021 年 9 月 26 日对公司做出责令改正并罚款 820 万元的行政处罚（京银保监罚决字〔2021〕26 号）；由于发生重要信息系统突发事件但未向监管部门报告，严重违反审慎经营规则，北京银保监局于 2021 年 11 月 24 日对公司做出罚款 40 万元的行政处罚（京银保监罚决字〔2021〕30 号）。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“21 交通银行永续债”的发行主体交通银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：（1）理财业务和同业业务制度不健全；（2）理财业务数据与事实不符；（3）部分理财业务发展与监管导向不符；（4）理财业务风险隔离不到位，利用本行表内自有资金为本行表外理财产品提供融资等 23 项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 7 月 13 日对公司做出罚款 4100 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕28 号）；由于违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，中国人民银行于 2021 年 8 月 13 日对公司做出罚款 62 万元的行政处罚（银罚字〔2021〕23 号）；由于存在：（1）未按规定办理内存外贷业务；（2）未按规定办理服务贸易项下海运费支出业务；（3）未经登记办理外国投资者投资资金汇出业务；（4）违规办理个人境内银行卡境外年度超额提现；（5）违规向非居民销售外汇理财产品等 8 项违法违规事实，国家外汇管理局上海市分局于 2021 年 10 月 20 日对公司做出责令改正、警告、没收违法所得并处罚款 340 万元的行政处罚（上海汇管罚字〔2021〕3111210701 号）。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“21 招商银行永续债”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）。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“21 中国银行永续债 01”的发行主体中国银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款；违规向关系人发放信用贷款；向无资金缺口企业发放流动资金贷款；存款月末冲时点；为无真实贸易背景企业签发银行承兑汇票等 36 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 日对公司做出罚没 8761.355 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕11 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 5 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	273,674.19
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	39,897,458.53
5	应收申购款	18,661,457.65
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	58,832,590.37

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123111	东财转 3	112,988,537.58	2.12
2	113044	大秦转债	54,063,360.00	1.01



3	127018	本钢转债	31,143,703.50	0.58
4	110059	浦发转债	29,053,750.00	0.54
5	123004	铁汉转债	26,983,030.54	0.51
6	113042	上银转债	22,075,701.30	0.41
7	128035	大族转债	21,492,800.00	0.40
8	110062	烽火转债	21,277,377.00	0.40
9	128136	立讯转债	18,037,635.85	0.34
10	113009	广汽转债	17,238,400.00	0.32
11	127036	三花转债	16,840,988.01	0.32
12	110052	贵广转债	16,251,065.60	0.30
13	110079	杭银转债	15,430,506.00	0.29
14	118000	嘉元转债	15,368,291.10	0.29
15	113048	晶科转债	14,872,956.00	0.28
16	113569	科达转债	14,782,078.00	0.28
17	127024	盈峰转债	14,704,800.00	0.28
18	123113	仙乐转债	14,402,462.27	0.27
19	123100	朗科转债	14,203,075.32	0.27
20	110073	国投转债	13,897,407.00	0.26
21	132021	19中电EB	12,862,000.00	0.24
22	123107	温氏转债	12,493,748.80	0.23
23	128124	科华转债	12,446,783.18	0.23
24	113011	光大转债	12,322,200.00	0.23
25	113043	财通转债	10,720,277.60	0.20
26	127030	盛虹转债	9,601,617.60	0.18
27	113034	滨化转债	9,358,986.00	0.18
28	123056	雪榕转债	8,472,882.60	0.16
29	127012	招路转债	8,444,129.58	0.16
30	110068	龙净转债	8,254,530.00	0.15
31	110064	建工转债	8,057,000.00	0.15
32	127005	长证转债	7,655,400.00	0.14
33	110076	华海转债	7,457,829.60	0.14
34	110067	华安转债	6,997,200.00	0.13

35	127025	冀东转债	6,846,033.96	0.13
36	113606	荣泰转债	6,640,605.00	0.12
37	128129	青农转债	6,593,400.00	0.12
38	123059	银信转债	6,475,893.20	0.12
39	127016	鲁泰转债	6,151,915.00	0.12
40	128107	交科转债	6,144,000.00	0.12
41	128123	国光转债	5,598,949.86	0.10
42	128078	太极转债	5,594,575.84	0.10
43	128119	龙大转债	5,083,260.00	0.10
44	113542	好客转债	5,078,700.00	0.10
45	113623	凤 21 转债	4,849,771.10	0.09
46	113050	南银转债	4,732,800.00	0.09
47	113596	城地转债	4,307,952.00	0.08
48	128131	崇达转 2	3,925,312.62	0.07
49	128125	华阳转债	3,739,996.44	0.07
50	127020	中金转债	3,722,700.00	0.07
51	113605	大参转债	3,701,186.70	0.07
52	113051	节能转债	3,469,786.60	0.06
53	110053	苏银转债	3,392,197.60	0.06
54	127015	希望转债	3,358,047.30	0.06
55	123070	鹏辉转债	3,299,763.20	0.06
56	128022	众信转债	2,911,224.96	0.05
57	113516	苏农转债	2,891,214.00	0.05
58	113045	环旭转债	2,687,688.50	0.05
59	127021	特发转 2	2,661,635.90	0.05
60	123049	维尔转债	2,160,062.40	0.04
61	128071	合兴转债	2,138,793.20	0.04
62	127006	敖东转债	1,939,680.00	0.04
63	113601	塞力转债	1,715,742.00	0.03
64	113616	韦尔转债	1,688,300.00	0.03
65	113530	大丰转债	1,681,528.80	0.03
66	113622	杭叉转债	1,567,577.60	0.03

67	128141	旺能转债	1,551,170.40	0.03
68	113579	健友转债	1,515,367.80	0.03
69	127013	创维转债	1,273,025.20	0.02
70	128066	亚泰转债	1,237,933.40	0.02
71	127032	苏行转债	1,130,800.00	0.02
72	113017	吉视转债	819,524.80	0.02
73	113604	多伦转债	806,649.80	0.02
74	128118	瀛通转债	795,509.00	0.01
75	123023	迪森转债	730,511.60	0.01
76	113588	润达转债	414,507.10	0.01
77	123117	健帆转债	192,941.80	0.00
78	128083	新北转债	33,255.33	0.00

#### 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

项目	富国天兴回报 A	富国天兴回报 C
报告期期初基金份额总额	1,639,049,080.18	134,399,327.02
报告期期间基金总申购份额	3,359,896,297.36	226,381,508.85
减：报告期期间基金总赎回份额	408,382,566.31	61,738,486.62
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	4,590,562,811.23	299,042,349.25

## § 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	94,621,306.45
报告期期间买入/申购总份额	342,302,992.09
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	436,924,298.54
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	8.94

### 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	申购	2021-10-1 4	46,693,126 .63	50,000,000 .00	—
2	申购	2021-11-0 5	92,677,479 .15	100,000,00 0.00	—
3	申购	2021-12-0 7	202,932,38 6.31	220,000,00 0.00	—
合计			342,302,99 2.09	370,000,00 0.00	

注：A类基金份额申购适用固定费用1000元

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021-10-01至2021-11-03; 2021-11-05至2021-12-31	746,575,423.08	437,281,512.00	18,929,653.47	1,164,927,281.61	23.82%

## 产品特有风险

本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20% 的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。

### 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天兴回报混合型证券投资基金的文件
- 2、富国天兴回报混合型证券投资基金基金合同
- 3、富国天兴回报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、富国天兴回报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  
2022 年 01 月 24 日