# 富国天盈债券型证券投资基金（LOF）
# 二 0 二 0 年第 4 季度报告

2020 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

报告送出日期：　2021 年 01 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。 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021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2020年10月1日起至2020年12月31日止。

## §2　基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 富国天盈债券（LOF） | |
| 场内简称 | 富国天盈 | |
| 基金主代码 | 161015 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2011 年 05 月 23 日 | |
| 报告期末基金份额总额（单位：份） | 1,439,344,757.81 | |
| 投资目标 | 本基金在追求基金资产长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。 | |
| 投资策略 | 本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例；在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整，并把信用产品投资和回购交易结合起来，将回购套利策略作为本基金重要的操作策略之一。同时本基金也会采取相关策略投资附权债券、资产证券化产品、新股申购、存托凭证。 | |
| 业绩比较基准 | 中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数。 | |
| 风险收益特征 | 从基金资产整体运作来看，本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 富国天盈债券 A | 富国天盈债券 C |
| 下属分级基金场内简称 | — | 富国天盈 |
| 下属分级基金的交易代码 | 007762 | 161015 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份） | 149,654,498.66 | 1,289,690,259.15 |

注：1.根据《富国天盈分级债券型证券投资基金基金合同》约定，富国天盈分级债券型证券投资基金在基金合同生效 3 年期届满后转换为上市开放式基金

（LOF），无需召开基金份额持有人大会。《富国天盈分级债券型证券投资基金基金合同》于 2011 年 5 月 23 日正式生效，该基金已于 2014 年 5 月 23 日正式转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“富国天盈债券型证券投资基金（LOF）”。

2.根据《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》等法律法规的规定和《富国天盈债券型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关约定,2019 年 8 月 26 日起对富国天盈债券型证券投资基金（LOF）增加收取申购费但不收取销售服务费的 A 类基金份额,同时原富国天盈债券型证券投资基金（LOF）的基金份额转换为 C 类基金份额。

## §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 | 富国天盈债券 A<br>报告期（2020 年 10 月 01 日-2020 年 12 月 31 日） | 富国天盈债券 C<br>报告期（2020 年 10 月 01 日-2020 年 12 月 31 日） |
|---|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 1,936,481.14 | 13,405,085.91 |
| 2.本期利润 | 1,400,826.66 | 8,579,033.71 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0083 | 0.0063 |
| 4.期末基金资产净值 | 167,232,338.40 | 1,434,481,036.25 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1175 | 1.1123 |

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）富国天盈债券 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 | 0.72% | 0.09% | 1.26% | 0.05% | -0.54% | 0.04% |
| 过去六个月 | 2.34% | 0.12% | 0.62% | 0.07% | 1.72% | 0.05% |
| 过去一年 | 5.04% | 0.13% | 2.98% | 0.09% | 2.06% | 0.04% |
| 自基金分级 | 7.49% | 0.12% | 4.47% | 0.08% | 3.02% | 0.04% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 生效日起至今 | | | | | | |

（2）富国天盈债券 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 | 0.62% | 0.09% | 1.26% | 0.05% | -0.64% | 0.04% |
| 过去六个月 | 2.15% | 0.12% | 0.62% | 0.07% | 1.53% | 0.05% |
| 过去一年 | 4.67% | 0.13% | 2.98% | 0.09% | 1.69% | 0.04% |
| 过去三年 | 19.60% | 0.10% | 16.56% | 0.07% | 3.04% | 0.03% |
| 过去五年 | 25.54% | 0.09% | 19.00% | 0.08% | 6.54% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 100.48% | 0.21% | 52.14% | 0.08% | 48.34% | 0.13% |

### 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盈债券 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 2020 年 12 月 31 日。

2、本基金自 2019 年 8 月 26 日起增加 A 类份额，相关数据按实际存续期计算。

（2）自基金合同生效以来富国天盈债券 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 2020 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2011 年 5 月 23 日成立，建仓期 6 个月，从 2011 年 5 月 23 日起至 2011 年 11 月 22 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 | | |
| 俞晓斌 | 本基金基金经理 | 2019-03-13 | — | 13.5 | 硕士，自 2007 年 7 月至 2012 年 10 月任上海国际货币经纪有限公司经纪人；2012 年 10 月加入富国基金管理有限公司，历任高级交易员、资深交易员兼研究助理，2016 年 12 月起任富国泰利定期开放 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 债券型发起式证券投资基金基金经理，2017 年 11 月至2020年4月任富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 8 月至 2019 年 10 月任富国优化增强债券型证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、富国颐利纯债债券型证券投资基金基金经理，2018 年 8 月至2020年4月任富国臻选成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年12月至2020年4月任富国金融债债券型证券投资基金基金经理，2018 年 12 月起任富国两年期理财债券型证券投资基金基金经理，2019 年 3 月至 2020 年 3 月任富国新优享灵活配置混合型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019年3月至2020年 4 月任富国收益增强债券型证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 3 月至 2020 年 6 月任富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金基金经理，2019 年 3 月起任富国天盈债券型证券投资基金（LOF）、富国稳健增强债券型证券投资基金基金经理，2019 年 5 月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 5 月至 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 2020 年 6 月任富国新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 6 月至 2019 年 9 月任富国新优选灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金经理，2019 年 6 月至 2020 年 7 月任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 6 月起任富国科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020 年 11 月起任富国双债增强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盈债券型证券投资基金（LOF）的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天盈债券型证券投资基金（LOF）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

2020 年四季度，国内经济继续恢复，增长动能有所变化。结构上看，政策逆周期调节下上行较快的基建及地产投资边际趋弱，以制造业投资及消费为代表的内生性动能加强，出口表现依然强劲。数据方面，中采 PMI 维持扩张区间，

生产与新订单表现良好。工业增加值稳定在较高水平，高新技术制造业同比扩张较为明显。固定资产投资各项均持续改善，基础设施投资小幅正增长，制造业投资降幅收窄，房地产投资平稳。社会消费品零售同比继续改善，但升幅较前期稍有收窄，其中汽车消费连续数月保持两位数增长。进出口方面，外需改善叠加国内供给对海外的替代效应，表现仍较好。物价方面，CPI 同比逐月下降至较低水平，PPI 环比增速有所趋弱。金融数据方面，社融增速边际有所回落。货币政策上，四季度整体平稳，进入 12 月份央行 MLF 及公开市场操作规模均有所加大，市场流动性预期改善。海外市场，部分主要经济体疫情在四季度重新爆发，但总需求较为稳定。美国大选后，新政府的财政刺激方案可能对经济有进一步正向拉动作用。

在上述背景下，国内债券市场 4 季度收益率整体先上后下，11 月信用事件爆发加剧了市场波动，中低评级债利率显著拉宽。进入 12 月央行增加流动性投放，叠加中央经济工作会议对于政策定调较为温和，收益率曲线经历陡峭化下行。转债市场，10 月初上涨之后陷入震荡行情，12 月出现回调。权益市场，在部分大盘价值及高景气行业带动下，指数逐级向上，结构性行情延续。在投资操作上，本组合在 4 季度前期纯债维持中性略低的杠杆及久期水平，债市回调过程中将仓位及久期调整至中性水平。转债前期维持偏低仓位，后期随着市场回调适当增加仓位。

### 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 0.72%，C 级为 0.62%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 1.26%，C 级为 1.26%

### 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 | 1,757,178,859.55 | 97.90 |
| | 其中：债券 | 1,757,178,859.55 | 97.90 |
| | 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 | 1,000,000.00 | 0.06 |
| | 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 | 5,796,836.54 | 0.32 |
| 7 | 其他资产 | 30,941,579.13 | 1.72 |
| 8 | 合计 | 1,794,917,275.22 | 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 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。

## 5.4 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 | 82,622,600.00 | 5.16 |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | 196,135,082.80 | 12.25 |
| | 其中：政策性金融债 | 90,681,082.80 | 5.66 |
| 4 | 企业债券 | 587,390,094.50 | 36.67 |
| 5 | 企业短期融资券 | 70,095,000.00 | 4.38 |
| 6 | 中期票据 | 544,365,000.00 | 33.99 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 276,571,082.25 | 17.27 |
| 8 | 同业存单 | — | — |
| 9 | 其他 | — | — |
| 10 | 合计 | 1,757,178,859.55 | 109.71 |

## 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 | 190406 | 19 农发 06 | 400,000 | 40,252,000.00 | 2.51 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 2 | 019627 | 20 国债 01 | 395,000 | 39,496,050.00 | 2.47 |
| 3 | 019640 | 20 国债 10 | 305,000 | 30,460,350.00 | 1.90 |
| 4 | 143598 | 18 陕煤 01 | 300,000 | 30,147,000.00 | 1.88 |
| 5 | 112969 | 19 中电科 | 300,000 | 30,069,000.00 | 1.88 |

### 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

| | |
|---|---|
| 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。

本基金本报告期末未持有前十名股票超出基金合同规定的备选股票库

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 25,241.27 |
| 2 | 应收证券清算款 | 6,002,104.11 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 24,097,743.26 |
| 5 | 应收申购款 | 816,490.49 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 30,941,579.13 |

### 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 | 127016 | 鲁泰转债 | 11,174,466.78 | 0.70 |
| 2 | 128107 | 交科转债 | 10,880,604.70 | 0.68 |
| 3 | 113569 | 科达转债 | 8,750,450.00 | 0.55 |
| 4 | 113557 | 森特转债 | 8,179,862.50 | 0.51 |
| 5 | 128105 | 长集转债 | 7,616,787.00 | 0.48 |
| 6 | 113033 | 利群转债 | 6,617,137.60 | 0.41 |
| 7 | 113570 | 百达转债 | 6,418,425.20 | 0.40 |
| 8 | 127013 | 创维转债 | 6,175,132.92 | 0.39 |
| 9 | 110070 | 凌钢转债 | 6,122,304.60 | 0.38 |
| 10 | 113567 | 君禾转债 | 5,972,384.70 | 0.37 |
| 11 | 113542 | 好客转债 | 5,655,500.00 | 0.35 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 12 | 128064 | 司尔转债 | 5,053,229.36 | 0.32 |
| 13 | 123010 | 博世转债 | 4,835,776.16 | 0.30 |
| 14 | 128035 | 大族转债 | 4,384,800.00 | 0.27 |
| 15 | 113534 | 鼎胜转债 | 4,210,315.20 | 0.26 |
| 16 | 110057 | 现代转债 | 4,194,060.00 | 0.26 |
| 17 | 113530 | 大丰转债 | 3,996,953.10 | 0.25 |
| 18 | 110063 | 鹰 19 转债 | 3,752,803.50 | 0.23 |
| 19 | 128083 | 新北转债 | 3,691,994.80 | 0.23 |
| 20 | 113577 | 春秋转债 | 3,586,354.00 | 0.22 |
| 21 | 110068 | 龙净转债 | 3,532,214.00 | 0.22 |
| 22 | 113572 | 三祥转债 | 3,437,400.00 | 0.21 |
| 23 | 127007 | 湖广转债 | 3,251,787.26 | 0.20 |
| 24 | 113549 | 白电转债 | 3,176,100.00 | 0.20 |
| 25 | 128072 | 翔鹭转债 | 3,084,149.80 | 0.19 |
| 26 | 128108 | 蓝帆转债 | 3,022,750.00 | 0.19 |
| 27 | 128025 | 特一转债 | 2,546,163.20 | 0.16 |
| 28 | 113532 | 海环转债 | 2,472,000.00 | 0.15 |
| 29 | 128057 | 博彦转债 | 2,141,519.40 | 0.13 |
| 30 | 113030 | 东风转债 | 2,023,436.00 | 0.13 |
| 31 | 128066 | 亚泰转债 | 2,011,159.20 | 0.13 |
| 32 | 113528 | 长城转债 | 1,988,400.00 | 0.12 |
| 33 | 123050 | 聚飞转债 | 1,808,550.00 | 0.11 |
| 34 | 123053 | 宝通转债 | 1,673,550.00 | 0.10 |
| 35 | 113505 | 杭电转债 | 1,624,928.00 | 0.10 |
| 36 | 113546 | 迪贝转债 | 1,527,600.00 | 0.10 |
| 37 | 113568 | 新春转债 | 1,496,850.00 | 0.09 |
| 38 | 113525 | 台华转债 | 1,443,753.60 | 0.09 |
| 39 | 113584 | 家悦转债 | 1,383,818.00 | 0.09 |
| 40 | 113026 | 核能转债 | 1,248,158.70 | 0.08 |
| 41 | 128051 | 光华转债 | 1,187,773.00 | 0.07 |
| 42 | 113017 | 吉视转债 | 966,900.00 | 0.06 |
| 43 | 128044 | 岭南转债 | 909,700.00 | 0.06 |
| 44 | 128101 | 联创转债 | 901,611.93 | 0.06 |
| 45 | 113508 | 新凤转债 | 518,685.00 | 0.03 |
| 46 | 127014 | 北方转债 | 296,732.28 | 0.02 |
| 47 | 128094 | 星帅转债 | 166,500.00 | 0.01 |
| 48 | 127012 | 招路转债 | 120,071.50 | 0.01 |

### 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 | 富国天盈债券 A | 富国天盈债券 C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 183,445,402.15 | 1,254,770,234.96 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 19,879,571.41 | 430,842,282.07 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 53,670,474.90 | 395,922,257.88 |
| 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 | 149,654,498.66 | 1,289,690,259.15 |

## §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 | 954.27 |
| 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 | 954.27 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.00 |

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 2020 年 12 月 28 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 2020 年 12 月 26 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下由中国工商银行股份有限公司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》及修改后的基金合同、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天盈分级债券型证券投资基金的文件

2、富国天盈分级债券型证券投资基金基金合同

3、富国天盈分级债券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、富国天盈分级债券型证券投资基金财务报表及报表附注

6、富国天盈债券型证券投资基金（LOF）财务报表及报表附注

7、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 01 月 22 日