

富国信用债债券型证券投资基金

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： 中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	富国信用债债券		
基金主代码	000191		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年06月25日		
报告期末基金份额总额（单位：份）	21,362,231,102.73		
投资目标	本基金以信用债券为主要投资对象，合理控制信用风险，在追求本金安全的基础上谨慎投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。		
投资策略	<p>信用产品投资是本基金重要特点之一，本基金所界定的信用债券是指短期融资券、中期票据、企业债、公司债、金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、次级债、中小企业私募债、可转换债券的纯债部分、资产支持证券等除国债、央行票据及政策性金融债之外的、非国家信用的固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他信用类金融工具。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。</p> <p>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。</p>		
业绩比较基准	中债企业债总全价指数		
风险收益特征	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	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	富国信用债债券 A/B	富国信用债债券 C	富国信用债债券 D
下属分级基金的交易代码	前端 000191	后端 000582	000192 006684
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	20,731,044,909.60	614,366,530.59	16,819,662.54

### § 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	富国信用债债券 A/B (2021年07月01日-2021年09月30日)	富国信用债债券 C (2021年07月01日-2021年09月30日)	富国信用债债券 D (2021年07月01日-2021年09月30日)
1. 本期已实现收益	187,060,543.36	6,145,198.17	145,852.54
2. 本期利润	230,994,860.07	7,934,983.85	201,348.91
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0121	0.0110	0.0117
4. 期末基金资产净值	24,059,680,091.06	705,421,688.30	19,325,071.69
5. 期末基金份额净值	1.1606	1.1482	1.1490

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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国信用债债券 A/B

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	1.12%	0.03%	0.45%	0.03%	0.67%	0.00%
过去六个月	2.53%	0.02%	0.87%	0.03%	1.66%	-0.01%
过去一年	4.76%	0.03%	0.37%	0.03%	4.39%	0.00%
过去三年	15.79%	0.05%	2.04%	0.05%	13.75%	0.00%
过去五年	21.65%	0.06%	-11.77%	0.07%	33.42%	-0.01%
自基金合同生效起至今	54.04%	0.09%	-11.56%	0.08%	65.60%	0.01%

(2) 富国信用债债券 C

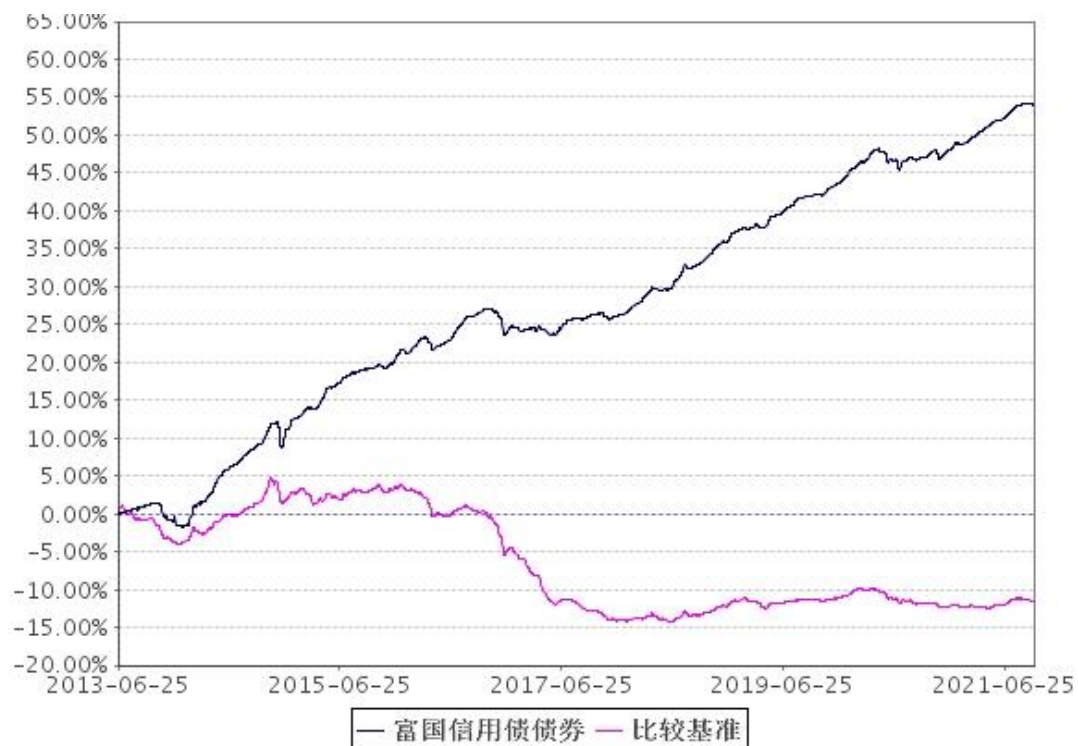
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.02%	0.03%	0.45%	0.03%	0.57%	0.00%
过去六个月	2.32%	0.02%	0.87%	0.03%	1.45%	-0.01%
过去一年	4.33%	0.03%	0.37%	0.03%	3.96%	0.00%
过去三年	14.33%	0.05%	2.04%	0.05%	12.29%	0.00%
过去五年	19.17%	0.06%	-11.77%	0.07%	30.94%	-0.01%
自基金合同生效起至今	48.85%	0.09%	-11.56%	0.08%	60.41%	0.01%

(3) 富国信用债债券 D

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	1.03%	0.03%	0.45%	0.03%	0.58%	0.00%
过去六个月	2.33%	0.02%	0.87%	0.03%	1.46%	-0.01%
过去一年	4.36%	0.03%	0.37%	0.03%	3.99%	0.00%
自基金分级生效日起至今	12.20%	0.05%	0.70%	0.05%	11.50%	0.00%

**3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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信用债债券 A/B 基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为2021年9月30日。

2、本基金于2013年6月25日成立，建仓期6个月，从2013年6月25日起至2013年12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信用债债券C基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为2021年9月30日。

2、本基金于 2013 年 6 月 25 日成立，建仓期 6 个月，从 2013 年 6 月 25 日起至 2013 年 12 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。

(3) 自基金 D 级份额生效以来富国信用债债券 D 基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为 2021 年 9 月 30 日。

2、本基金自 2018 年 12 月 5 日起增加 D 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		
黄纪亮	本基金基金经理	2014-06-21	—	13.2	硕士，曾任国泰君安证券股份有限公司研究员；自 2012 年 11 月加入富国基金管理有限公司，历任债券研究员、固定收

				<p>益基金经理、固定收益投资部固定收益投资副总监；现任富国基金总经理助理，兼任富国基金固定收益策略研究部总经理、富国基金固定收益投资部总经理、高级固定收益基金经理。2013年2月起任富国强回报定期开放债券型证券投资基金基金经理，2014年3月起任富国汇利回报两年定期开放债券型证券投资基金（原富国汇利回报分级债券型证券投资基金，于2017年12月11日更名）、富国天利增长债券投资基金基金经理，2014年6月起任富国信用债债券型证券投资基金基金经理，2016年8月起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，2016年9月起任富国产业债债券型证券投资基金基金经理，2016年9月至2020年6月任富国睿利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，2017年8月起任富国祥利一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，2017年9月至2019年8月任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，</p>
--	--	--	--	--



				<p>2018年4月至2021年9月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，2018年4月至2021年7月任富国臻利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、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，2018年8月至2020年11月任富国颐利纯债债券型证券投资基金基金经理，2018年9月至2019年11月任富国金融债债券型证券投资基金基金经理，2019年3月至2021年7月任富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2019年9月起任富国投资级信用债债券型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信用债债券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》、

《富国信用债债券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 3 季度，拉动上半年经济的主要动力减弱，经济增速面临回落压力。外需保持韧性，但内需动能不强，居民收入和疫情反复成为扰动项，受政策调控影响地产景气度明显下滑，双控限产对部分行业生产造成拖累。国内外大宗商品价格攀升，推动 PPI 继续走高，但 CPI 维持低位。货币政策保持稳健偏松，流动性边际改善，债券市场维持牛市，债市收益率明显下行。投资操作上，本基金侧重信用债配置策略，同时灵活调整组合久期，适当运用杠杆，报告期内净值有所增长。

### 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/B 级为 1.12%，C 级为 1.02%，D 级为 1.03%，同期业绩比较基准收益率 A/B 级为 0.45%，C 级为 0.45%，D 级为 0.45%

### 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	26,891,560,705.05	98.37
	其中：债券	25,490,739,405.05	93.25
	资产支持证券	1,400,821,300.00	5.12

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	65,893,351.96	0.24
7	其他资产	379,404,529.83	1.39
8	合计	27,336,858,586.84	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	335,839,863.60	1.36
2	央行票据	—	—
3	金融债券	11,186,721,606.30	45.14
	其中：政策性金融债	3,832,151,406.30	15.46
4	企业债券	6,750,739,135.15	27.24
5	企业短期融资券	831,295,000.00	3.35

6	中期票据	6,055,426,800.00	24.43
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	330,717,000.00	1.33
9	其他	—	—
10	合计	25,490,739,405.05	102.85

#### 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	2028023	20 招商银行永 续债 01	6,800,000	681,428,000.00	2.75
2	200313	20 进出 13	5,200,000	526,604,000.00	2.12
3	200407	20 农发 07	5,200,000	523,484,000.00	2.11
4	190403	19 农发 03	5,100,000	511,887,000.00	2.07
5	210201	21 国开 01	5,100,000	510,306,000.00	2.06

#### 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	136234	惠和 06A	1,000,000	100,190,000.00	0.40
2	136282	万科 26 优	1,000,000	100,060,000.00	0.40
3	136303	永熙优 39	1,000,000	100,040,000.00	0.40
4	168274	信润 02A5	1,000,000	99,350,000.00	0.40
5	189773	2 天智 02A	800,000	79,952,000.00	0.32
6	136444	荟享 055A	800,000	79,896,000.00	0.32
7	189763	21 天圆 02	600,000	59,976,000.00	0.24
8	137925	万科 19 优	500,000	50,215,000.00	0.20
9	137091	信借 06A	500,000	50,170,000.00	0.20
10	136231	链融 48A1	500,000	50,095,000.00	0.20
11	136230	瑞新 30A1	500,000	50,095,000.00	0.20

#### 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“21 国开 01”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“20 招商银行永续债 01”的发行主体招商银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在违反规定办理结汇、售汇的行为，国家外汇管理局深圳市分局于 2020 年 11 月 27 日对公司做出责令改正，处以罚款人民币 55 万元，没收违法所得 128.82 万元人民币的行政处罚（深外管检[2020]92 号）；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“20 工商银行二级 01”的发行主体中国工商银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于违规开展外汇掉期业务、外汇远期业务和外汇期权业务，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 100 万元的行政处罚（京汇罚（2020）31 号）；由于存在：未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告；关键岗位未进行实质性轮岗；法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞等 23 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 日对公司做出罚款 5470 万元的行政处罚（银保监罚决字（2020）71 号）。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“21 工商银行永续债 01”的发行主体中国工商银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于违规开展外汇掉期业务、外汇远期业务和外汇期权业务，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 100 万元的行政处罚（京汇罚（2020）31 号）；由于存在：未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告；关键岗位未进行实质性轮岗；法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞等 23 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 日对公司做出罚款 5470 万元的行政处罚（银保监罚决字（2020）71 号）。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“20 进出 13”的发行主体中国进出口银行（以下简称“公司”），由于存在：（1）违规投资企业股权；（2）个别高管人员未经核准实际履职；（3）监管数据漏报错报；（4）违规向地方政府购买服务提供融资等 24 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 7345.6 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕31 号）。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“20 农业银行永续债 01”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）。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“20 中国银行永续债 03”的发行主体中国银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于“原油宝”产品风险事件中存在的相关违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 1 日对公司做出罚款 5050 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2020〕60 号）；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）。

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“原油宝”产品风险事件



中存在的相关违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 1 日对公司做出罚款 5050 万元的行政处罚（银保监罚决字（2020）60 号）；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 2 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	47,039.67
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	370,993,209.80
5	应收申购款	8,364,280.36
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	379,404,529.83

#### 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	富国信用债债券 A/B	富国信用债债券 C	富国信用债债券 D
报告期期初基金份额总额	16,438,994,889.80	613,358,815.15	17,309,040.82
报告期期间基金总申购份额	6,037,927,624.88	356,789,209.02	1,149,511.45
减：报告期期间基金总赎回份额	1,745,877,605.08	355,781,493.58	1,638,889.73
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	20,731,044,909.60	614,366,530.59	16,819,662.54

### § 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信用债债券型证券投资基金的文件
- 2、富国信用债债券型证券投资基金基金合同
- 3、富国信用债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、富国信用债债券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 10 月 27 日