

富国新天锋债券型证券投资基金（LOF）

二〇二一年第2季度报告

2021年06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

报告送出日期：2021年07月21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 7 月 19 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 4 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	富国新天锋债券（LOF）
场内简称	富国天锋
基金主代码	161019
交易代码	前端交易代码：161019 后端交易代码：161020
基金运作方式	契约型开放式。
基金合同生效日	2012年05月07日
报告期末基金份额总额（单位：份）	1,020,331,685.29
投资目标	本基金在保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，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	<p>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	中债综合指数收益率
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

§ 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04月01日-2021年06月30日）
1. 本期已实现收益	7,486,986.61
2. 本期利润	14,607,892.04
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0199

4. 期末基金资产净值	1, 087, 231, 655. 13
5. 期末基金份额净值	1. 0656

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	2.00%	0.05%	1.23%	0.03%	0.77%	0.02%
过去六个月	3.10%	0.09%	2.14%	0.04%	0.96%	0.05%
过去一年	5.24%	0.14%	2.77%	0.06%	2.47%	0.08%
过去三年	21.25%	0.13%	14.62%	0.07%	6.63%	0.06%
过去五年	24.59%	0.13%	19.67%	0.07%	4.92%	0.06%
自基金合同生效起至今	75.49%	0.13%	47.91%	0.08%	27.58%	0.05%

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 6 月 30 日。

2、本基金于 2012 年 5 月 7 日成立，建仓期 6 个月，从 2012 年 5 月 7 日起至 2012 年 11 月 6 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		
武磊	本基金基金经理	2018-07-11	—	10.0	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 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、

					<p>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；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</p>
--	--	--	--	--	--

					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新天锋定期开放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》、《富国新天锋定期开放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 年二季度，经济基本面依然呈现内外分化，出口增速保持高位，国内消费仍未恢复到疫情前水平，国内宏观经济政策总体保持平稳，流动性维持相对宽松，债券市场受益于较宽松的资金面，收益率有所下行。转债市场同时受益于利率下行和权益市场反弹，表现较好。本基金积极把握债市交易机会，加大利率债和高等级信用债配置力度，优化转债持仓，把握转债市场行情增厚收益，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为 2.00%，同期业绩比较基准收益率为 1.23%

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	1,384,284.33	0.11
	其中：股票	1,384,284.33	0.11
2	固定收益投资	1,212,565,381.20	96.18
	其中：债券	1,202,565,381.20	95.39
	资产支持证券	10,000,000.00	0.79
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	9,494,647.14	0.75
7	其他资产	37,225,313.89	2.95
8	合计	1,260,669,626.56	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	1,384,284.33	0.13
C	制造业	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—

N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
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	1,384,284.33	0.13

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	601899	紫金矿业	142,857	1,384,284.33	0.13

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	21,143,700.00	1.94
2	央行票据	—	—
3	金融债券	281,087,000.00	25.85
	其中：政策性金融债	160,839,000.00	14.79
4	企业债券	444,556,614.00	40.89
5	企业短期融资券	25,116,000.00	2.31
6	中期票据	274,891,000.00	25.28
7	可转债（可交换债）	116,781,067.20	10.74
8	同业存单	38,990,000.00	3.59
9	其他	—	—
10	合计	1,202,565,381.20	110.61

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	200203	20 国开 03	400,000	40,132,000.00	3.69
2	190208	19 国开 08	300,000	30,339,000.00	2.79
3	200212	20 国开 12	300,000	30,150,000.00	2.77
4	188246	国电投 05	300,000	30,039,000.00	2.76
5	163871	21 兵装 S1	300,000	30,006,000.00	2.76

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	100,000	10,000,000.00	0.92

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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“19 国开 08”的发行主体国家开发银行（以下简称“公司”），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 国开 03”的发行主体国家开发银行（以下简称“公司”），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 国开 12”的发行主体国家开发银行（以下简称“公司”），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 北京银行小微债 02”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）同业投资对资产转让业务承担回购义务；（2）同业投资资产风险分类调整不及时、延缓风险暴露；（3）收费管理政策执行不严、违规收取相关费用；（4）个人贷款自主支付管理薄弱、贷款资金违规流入股市、房市等违法违规事实，北京银保监局于

2020年7月11日对公司做出责令改正,并给予合计150万元罚款的行政处罚(京银保监罚决字(2020)23号);由于存在:尽职调查工作未遵循勤勉尽责原则;对债务融资工具募集资金使用情况监测和督导不到位等违法违规事实,中国银行间市场交易商协会于2020年7月17日对公司做出警告,暂停债务融资工具主承销相关业务6个月的自律处分(2019年第12、14次、2020年第8次自律处分会议审议决定);由于存在:(1)北京银行下辖西单支行违规出具与事实不符的询证函回函;(2)北京银行下辖西单支行违规出具与事实不符的存款证明;(3)北京银行下辖西单支行内部控制存在缺陷等违法违规事实,北京银保监局于2020年12月23日对公司做出责令改正,并罚款合计350万元的行政处罚(京银保监罚决字(2020)41号);由于存在:对外销售虚假金融产品;出具与事实不符的单位定期存款开户证实书;关键业务环节管理失控等11项违法违规事实,北京银保监局于2020年12月30日对公司做出责令改正,并罚款合计3940万元的行政处罚(京银保监罚决字(2020)45号);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)。

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6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	24,450.82
2	应收证券清算款	1,369,771.76
3	应收股利	—
4	应收利息	15,626,424.47
5	应收申购款	20,204,666.84
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	37,225,313.89

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	127018	本钢转债	13,089,863.52	1.20
2	113044	大秦转债	12,665,133.70	1.16
3	110052	贵广转债	8,133,235.60	0.75
4	113034	滨化转债	7,776,900.00	0.72
5	128107	交科转债	4,993,760.00	0.46
6	113011	光大转债	4,623,200.00	0.43
7	128134	鸿路转债	4,050,900.00	0.37
8	113508	新风转债	3,894,300.00	0.36
9	127020	中金转债	3,570,076.80	0.33
10	128141	旺能转债	3,529,312.92	0.32
11	132008	17山高EB	3,300,761.00	0.30
12	128129	青农转债	3,201,953.04	0.29
13	123073	同和转债	2,669,856.00	0.25
14	113542	好客转债	2,492,537.60	0.23
15	113033	利群转债	2,272,536.00	0.21
16	128130	景兴转债	2,261,800.00	0.21
17	113604	多伦转债	2,216,565.00	0.20
18	127026	超声转债	2,153,000.00	0.20
19	113017	吉视转债	1,952,400.00	0.18
20	127023	华菱转2	1,325,600.00	0.12
21	123085	万顺转2	1,148,200.00	0.11
22	132017	19新钢EB	1,109,000.00	0.10
23	113610	灵康转债	820,890.70	0.08
24	128137	洁美转债	111,177.30	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	509,342,815.42
报告期期间基金总申购份额	526,573,057.84
减：报告期期间基金总赎回份额	15,584,187.97
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	1,020,331,685.29

§ 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

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	2021-04-01 至 2021-06-23	196,269,872.42	-	-	196,269,872.42	19.24%
	2	2021-04-07 至 2021-06-30	95,440,751.34	197,513,123.21	-	292,953,874.55	28.71%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》、《证券投资基金侧袋机制操作细则（试行）》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与各基金托管人协商一致，基金管理人决定自 2021 年 5 月 22 日起，对本基金增加侧袋机制并相应修改基金合同和托管协议。具体可参见基金管理人于 2021 年 5 月 20 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同及托管协议的公告》。

§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新天锋债券型证券投资基金（LOF）的文件
- 2、富国新天锋债券型证券投资基金（LOF）基金合同
- 3、富国新天锋债券型证券投资基金（LOF）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、富国新天锋债券型证券投资基金（LOF）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 07 月 21 日