

富国可转换债券证券投资基金

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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	富国可转换债券		
基金主代码	100051		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2010年12月08日		
报告期末基金份额总额（单位：份）	2,283,506,057.61		
投资目标	本基金主要利用可转债品种兼具债券和股票的特性，通过将“自上而下”宏观分析与“自下而上”个券选配有效结合，力争在锁定投资组合下方风险的基础上实现基金资产的长期稳定增值。		
投资策略	本基金主要投资于可转债品种，一方面通过利用可转债的债券特性，强调收益的安全性与稳定性，另一方面利用可转债的股票特性（内含股票期权），分享股市上涨所产生的较高收益。采用自上而下的整体资产和类属资产配置策略，以及自下而上的明细资产配置策略，动态调整各类资产配置。对于可转债，本基金将积极参与发行条款较好、申购收益较高、公司基本面优秀的可转债的一级市场申购，上市后根据个券的具体情况做出持有或卖出的决策；同时，本基金将综合运用多种可转债投资策略进行二级市场投资操作，在承担较小风险的前提下获取较高的投资回报。采取策略包括个券精选、买入并持有、条款博弈、低风险套利和分阶段投资等传统投资策略以及分离交易可转债投资策略。同时本基金也会采取相关策略投资普通债权、股票二级市场、新股申购和权证。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。		
业绩比较基准	天相转债指数收益率×60%+沪深300指数收益率×20%+中债综合指数收益率×20%		
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	中国农业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	富国可转换债券 A	富国可转换债券 C	
下属分级基金的交易代码	前端	后端	009758
	100051	100052	
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	2,204,944,805.97		78,561,251.64

### § 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	富国可转换债券 A 报告期(2021年10月01日-2021 年12月31日)	富国可转换债券 C 报告期(2021年10月01日 -2021年12月31日)
1. 本期已实现收益	-6,049,660.60	-480,696.01
2. 本期利润	272,527,889.12	7,195,240.01
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1040	0.0920
4. 期末基金资产净值	5,221,068,605.52	185,531,786.06
5. 期末基金份额净值	2.368	2.362

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) 富国可转换债券 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	4.73%	0.62%	4.36%	0.40%	0.37%	0.22%
过去六个月	11.49%	0.70%	7.41%	0.48%	4.08%	0.22%
过去一年	19.35%	0.68%	10.76%	0.48%	8.59%	0.20%
过去三年	79.12%	0.78%	45.68%	0.56%	33.44%	0.22%
过去五年	65.83%	0.77%	44.84%	0.52%	20.99%	0.25%
自基金合同生效起至今	136.80%	0.96%	52.32%	0.87%	84.48%	0.09%

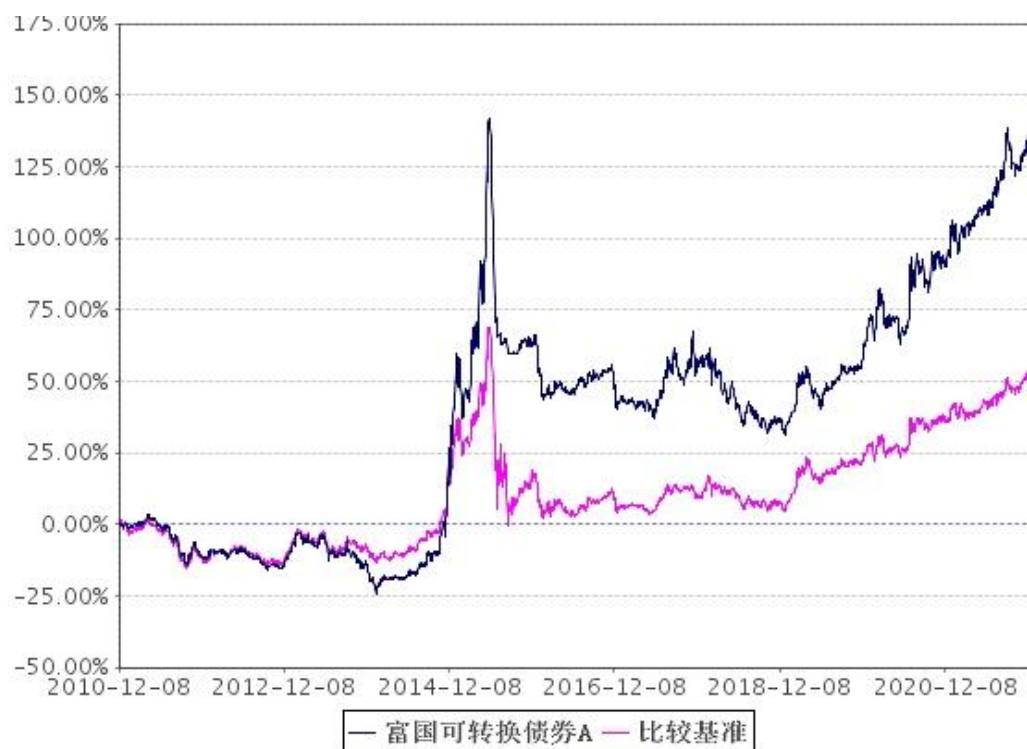
###### (2) 富国可转换债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	--------	----------	-----------	--------------	-----	-----

		②	率③	准差④		
过去三个月	4.70%	0.62%	4.36%	0.40%	0.34%	0.22%
过去六个月	11.36%	0.70%	7.41%	0.48%	3.95%	0.22%
过去一年	19.11%	0.68%	10.76%	0.48%	8.35%	0.20%
自基金分级 生效日起至 今	39.27%	0.83%	21.08%	0.54%	18.19%	0.29%

### 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可转换债券 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 2021 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2010 年 12 月 8 日成立，建仓期 6 个月，从 2010 年 12 月 8 日起至 2011 年 6 月 7 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可转换债券 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2021年12月31日。

2、本基金自2020年6月24日起增加C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		
张明凯	本基金基金经理	2019-03-19	—	8.5	硕士，曾任南京银行信用研究员，鑫元基金管理有限公司研究员、基金经理；自2018年2月加入富国基金管理有限公司，现任富国基金固定收益投资部固定收益投资总监助理兼

				<p>固定收益基金经理。自 2019 年 3 月起任富国天丰强化收益债券型证券投资基金、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、富国久利稳健配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 3 月至 2021 年 4 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 4 月至 2020 年 10 月任富国中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理，2019 年 4 月至 2021 年 8 月任富国颐利纯债债券型证券投资基金、富国金融债债券型证券投资基金基金经理，2021 年 10 月起任富国双利增强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可转换债券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》、

《富国可转换债券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，以为投资者减少和分散风险、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

四季度市场在通胀和衰退中进行摇摆，从产业利润角度来看，中上游价格上涨，导致大部分利润留存，中游行业在下游需求不振的情况下被双方面挤压，导致经营出现一定困难。造成这一结果，一部分源于全球为抗击疫情导致的经济压力，采取的大规模货币投放的政策举措；另一方面则在于长期以来，发展新能源、做到碳中和达标，部分地方采取了较为激进的手段，在新能源对于全社会能源需求还未能够完成承接的情况下，大面积关停老能源，使得在来水不佳的情况下阶段性出现能源短缺。造成此情景，组合在年初就进行深入研究布局，将资源倾斜向中上游领域。但中间市场表现却与产业利润流向存在较大偏差。反思来看，主要是以下几个方面原因导致：一是政策端打压超预期，监管对于大宗商品快速上涨采取较为鹰派的举措，特别是煤炭价格采取严格限制，导致预期利润无法实现；二是市场对于周期品本身不存在长期预期，在未来盈利的必然下降与短期利润可能的爆发式增长面前，市场更偏向后者；三是周期品短期出现过热，市场资金快速涌入导致交易过于拥挤。

在这一过程中，虽然组合进行了阶段性止损的，但相关标的的跌幅仍超出预期，最终仍然令净值出现较大回撤。进入到季度中段后，痛定思痛，组合进行了一些调整。首先是降低了周期品的持仓，其次是增加了消费类、科技类的持仓，保持权益仓位对冲性，最后是考虑到经济仍存在下行可能，增加了长久期债券的配置力度。通过调整，净值出现一定好转，但距离高点仍有不小的距离。

经过此轮，在后续投资中，首先还是要降低相关因子的集中度，小概率事件虽少见，但仍然时有发生。其次需要在关键时点上增加模型分析因子，特别是市场交易拥挤度的分析，在缺乏趋势性行情的背景，此举可能更为关键。最后还是要怀着一颗敬畏之心，市场变化总是有超预期的情况出现，在出现时要加强应对的力度和及时性。

#### 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 4.73%，C 级为 4.70%，同期业绩比较基准收益率 A/B 级为 4.36%，C 级为 4.36%

#### 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	689,868,646.54	11.47
	其中：股票	689,868,646.54	11.47
2	固定收益投资	5,169,954,171.55	85.96
	其中：债券	5,169,954,171.55	85.96
	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	123,802,168.18	2.06
7	其他资产	30,485,644.65	0.51
8	合计	6,014,110,630.92	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	—	—
C	制造业	473,677,504.00	8.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,649,129.94	0.79
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	13,289,899.60	0.25
J	金融业	160,252,113.00	2.96
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	689,868,646.54	12.76

### 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	300059	东方财富	4,318,300	160,252,113.00	2.96
2	002008	大族激光	2,897,808	156,481,632.00	2.89
3	600745	闻泰科技	779,000	100,724,700.00	1.86
4	603501	韦尔股份	200,000	62,154,000.00	1.15
5	002859	洁美科技	1,614,100	60,044,520.00	1.11
6	601778	晶科科技	4,999,898	42,649,129.94	0.79
7	601636	旗滨集团	2,033,800	34,777,980.00	0.64
8	603920	世运电路	1,108,640	24,722,672.00	0.46
9	002049	紫光国微	100,000	22,500,000.00	0.42
10	300031	宝通科技	482,392	13,289,899.60	0.25

#### 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	269,023,000.00	4.98

2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
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）	4,900,931,171.55	90.65
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	5,169,954,171.55	95.62

### 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	123111	东财转3	4,937,839	830,445,763.02	15.36
2	113044	大秦转债	5,010,420	548,340,364.80	10.14
3	110081	闻泰转债	2,134,680	336,596,342.40	6.23
4	132015	18中油EB	3,157,800	328,190,154.00	6.07
5	132009	17中油EB	2,663,680	278,301,286.40	5.15

### 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

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“青农转债”的发行主体青岛农村商业银行股份有限公司，由于房地产贷款管理严重不审慎，青岛银保监局于 2021 年 10 月 18 日对公司做出罚款 200 万元的行政处罚（青银保监罚决字（2021）53 号）。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“浦发转债”的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于 2016 年 5 月至 2019 年 1 月期间，未按规定开展代销业务的违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会上海监管局于 2021 年 4 月 23 日对公司做出责令改正，并处罚款共计 760 万元的行政处罚（沪银保监罚决字（2021）29 号）；由于存在：（1）监管发现的问题屡查屡犯；（2）配合现场检查不力；（3）内部控制制度修订不及时；（4）信息系统管控有效性不足等 31 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 6920 万元的行政处罚（银保监罚决字（2021）27 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 8 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	1,272,013.32
2	应收证券清算款	13,943,492.27
3	应收股利	—
4	应收利息	13,578,176.05
5	应收申购款	1,691,963.01
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	30,485,644.65

### 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	830,445,763.02	15.36
2	113044	大秦转债	548,340,364.80	10.14
3	132015	18中油EB	328,190,154.00	6.07
4	132009	17中油EB	278,301,286.40	5.15
5	123107	温氏转债	258,219,439.60	4.78
6	110059	浦发转债	226,344,560.00	4.19
7	128129	青农转债	201,669,029.10	3.73
8	128048	张行转债	156,120,242.70	2.89
9	113051	节能转债	133,404,448.80	2.47
10	123083	朗新转债	110,379,429.69	2.04
11	113026	核能转债	101,728,717.90	1.88
12	128078	太极转债	82,957,602.40	1.53
13	132008	17山高EB	80,942,425.60	1.50
14	113619	世运转债	79,793,794.80	1.48
15	128035	大族转债	78,181,671.96	1.45
16	128081	海亮转债	77,919,550.80	1.44

17	110067	华安转债	77,041,504.40	1.42
18	118000	嘉元转债	66,517,398.90	1.23
19	111000	起帆转债	62,781,326.00	1.16
20	132017	19 新钢 EB	61,831,840.00	1.14
21	128034	江银转债	56,386,617.30	1.04
22	113021	中信转债	52,137,600.00	0.96
23	123087	明电转债	41,029,125.39	0.76
24	113609	永安转债	38,590,778.50	0.71
25	113033	利群转债	32,533,692.00	0.60
26	127005	长证转债	31,900,944.93	0.59
27	113504	艾华转债	27,849,234.80	0.52
28	123114	三角转债	24,603,800.00	0.46
29	110064	建工转债	24,372,425.00	0.45
30	123057	美联转债	22,197,848.20	0.41
31	110079	杭银转债	20,796,934.60	0.38
32	128134	鸿路转债	14,464,815.90	0.27
33	128066	亚泰转债	14,171,726.98	0.26
34	123077	汉得转债	13,374,892.90	0.25
35	132018	G 三峡 EB1	11,192,000.00	0.21
36	128119	龙大转债	10,993,352.37	0.20
37	110074	精达转债	10,926,105.00	0.20
38	128111	中矿转债	10,437,240.00	0.19
39	123100	朗科转债	10,209,639.51	0.19
40	128137	洁美转债	9,546,000.00	0.18
41	128023	亚太转债	8,735,502.40	0.16
42	110060	天路转债	8,108,320.00	0.15
43	127035	濮耐转债	7,893,833.74	0.15
44	123085	万顺转 2	7,851,500.00	0.15
45	113602	景 20 转债	7,167,500.00	0.13
46	128145	日丰转债	7,145,500.00	0.13
47	128116	瑞达转债	7,122,196.80	0.13
48	123078	飞凯转债	6,778,167.50	0.13

49	113025	明泰转债	6,718,050.00	0.12
50	113009	广汽转债	5,387,000.00	0.10
51	128075	远东转债	5,248,768.00	0.10
52	123076	强力转债	4,978,438.40	0.09
53	123084	高澜转债	4,782,404.52	0.09
54	132021	19中电EB	3,990,490.00	0.07
55	128096	奥瑞转债	3,286,087.00	0.06
56	123075	贝斯转债	3,246,908.80	0.06
57	128071	合兴转债	3,070,010.00	0.06
58	128108	蓝帆转债	2,910,847.00	0.05
59	123063	大禹转债	2,713,679.39	0.05
60	113532	海环转债	2,228,738.10	0.04
61	128121	宏川转债	2,037,201.69	0.04
62	128130	景兴转债	1,748,688.00	0.03
63	123060	苏试转债	506,448.00	0.01
64	113039	嘉泽转债	322,360.80	0.01
65	113505	杭电转债	124,460.00	0.00
66	123109	昌红转债	75,772.56	0.00
67	123061	航新转债	51,811.70	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	富国可转换债券 A	富国可转换债券 C
报告期期初基金份额总额	2,847,218,184.84	127,313,389.43
报告期期间基金总申购份额	579,648,461.11	28,675,979.25
减：报告期期间基金总赎回份额	1,221,921,839.98	77,428,117.04
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	2,204,944,805.97	78,561,251.64

## § 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	2021-10-13 至 2021-10-18;20 21-10-21 至 2021-11-25	582,44 8,332. 40	69,546 ,475.2 7	474,00 0,000. 00	177,994,80 7.67	7.79%

## 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可转换债券证券投资基金的文件
- 2、富国可转换债券证券投资基金基金合同
- 3、富国可转换债券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、富国可转换债券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