

富国精诚回报 12 个月持有期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： 上海银行股份有限公司

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。

基金托管人上海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 | 富国精诚回报 12 个月持有期混合 | |
| 基金主代码 | 011769 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式，本基金每个工作日开放申购，但对每份基金份额设置 12 个月的最短持有期限。 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 04 月 30 日 | |
| 报告期末基金份额总额（单位：份） | 5,827,510,457.12 | |
| 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 | 本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。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，在严格控制整体资产风险的基础上，根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合整体框架。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。本基金的存托凭证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略和资产支持证券投资策略详见法律文件。 | |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富（总值）指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+恒生指数收益率（使用汇率估值折算）*5% | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。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有风险。 | |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 上海银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 富国精诚回报 12 个月持有期混合 A | 富国精诚回报 12 个月持有期混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 011769 | 011770 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份） | 5,466,307,913.38 | 361,202,543.74 |

§ 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 | 富国精诚回报 12 个月持有期混合 A 报告期(2021 年 10 月 01 日-2021 年 12 月 31 日) | 富国精诚回报 12 个月持有期混合 C 报告期(2021 年 10 月 01 日-2021 年 12 月 31 日) |
|-----------------|---|---|
| 1. 本期已实现收益 | 78,824,747.61 | 4,633,235.24 |
| 2. 本期利润 | 154,010,654.77 | 9,584,977.80 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0282 | 0.0265 |
| 4. 期末基金资产净值 | 5,710,024,361.27 | 375,790,575.73 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0446 | 1.0404 |

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) 富国精诚回报 12 个月持有期混合 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 | 2.77% | 0.28% | 0.90% | 0.15% | 1.87% | 0.13% |
| 过去六个月 | 3.65% | 0.32% | 0.44% | 0.20% | 3.21% | 0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.46% | 0.29% | 1.19% | 0.19% | 3.27% | 0.10% |

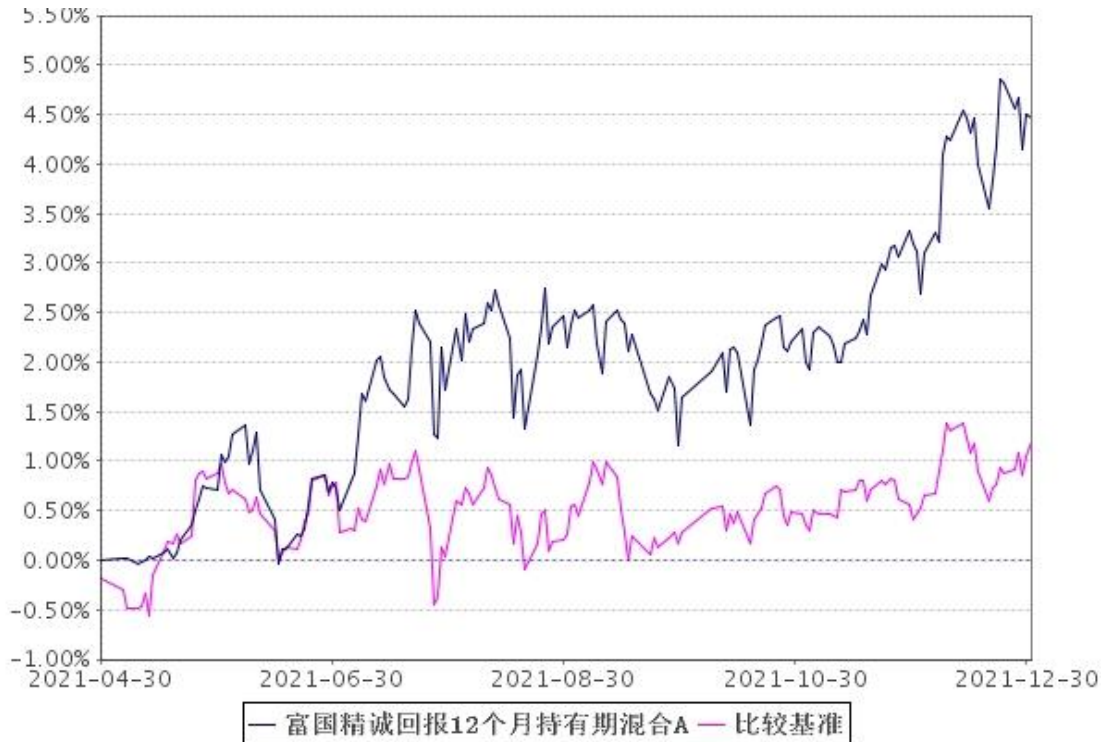
(2) 富国精诚回报 12 个月持有期混合 C

| 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 | 2.61% | 0.28% | 0.90% | 0.15% | 1.71% | 0.13% |
| 过去六个月 | 3.34% | 0.32% | 0.44% | 0.20% | 2.90% | 0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.04% | 0.29% | 1.19% | 0.19% | 2.85% | 0.10% |

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

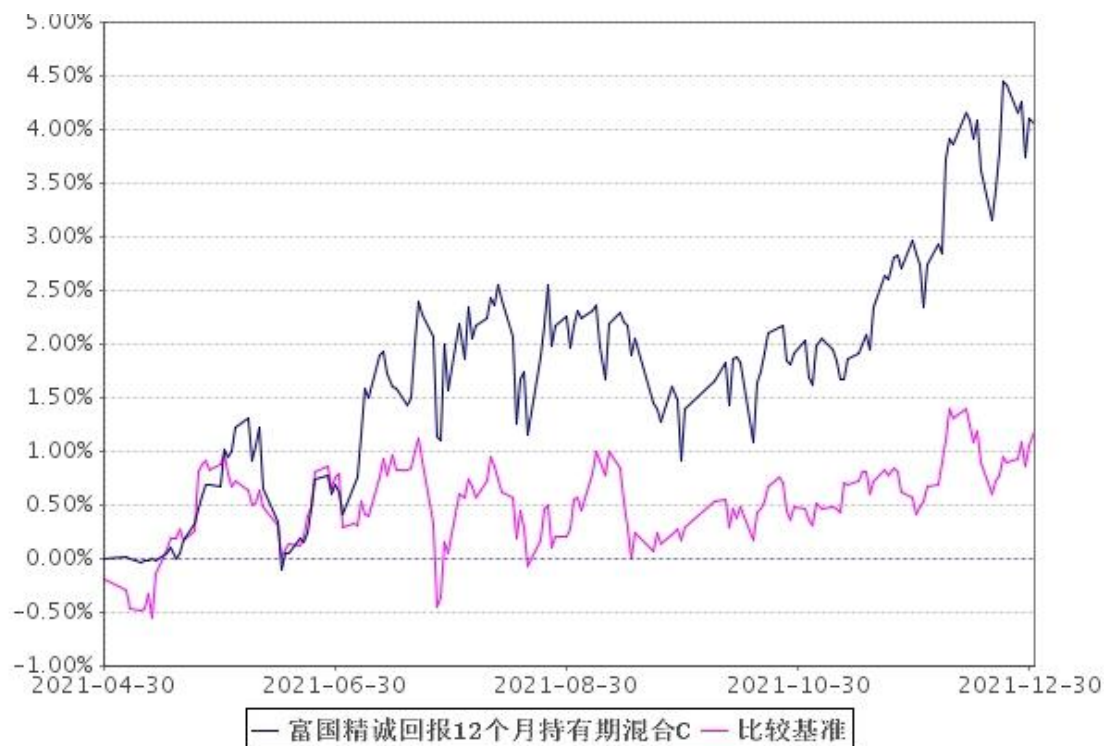
(1) 自基金合同生效以来富国精诚回报 12 个月持有期混合 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2021 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2021 年 4 月 30 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期 6 个月，从 2021 年 4 月 30 日起至 2021 年 10 月 30 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精诚回报 12 个月持有期混合 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2021年4月30日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月，从2021年4月30日起至2021年10月30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 | | |
| 徐斌 | 本基金基金经理 | 2021-04-30 | — | 14.7 | 硕士，曾任国家上海新药安全评价研究中心研究员，长江证券股份有限公司化工研究员，银华基金管理有限公司化工研 |

| | | | | | |
|-----|---------|------------|---|------|--|
| | | | | | <p>究员，嘉实基金管理有限公司研究部化工研究员、机构投资部投资经理，海富通基金管理有限公司投资经理、年金权益投资部副总监；自2019年7月加入富国基金管理有限公司，现任富国基金权益投资部高级权益基金经理。2019年8月起任富国改革动力混合型证券投资基金基金经理；2020年6月至2021年11月任富国新材料新能源混合型证券投资基金基金经理，2021年4月起任富国精诚回报12个月持有期混合型证券投资基金基金经理，2021年7月起任富国浦诚回报12个月持有期混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。</p> |
| 张士扬 | 本基金基金经理 | 2021-04-30 | — | 10.9 | <p>博士，曾任深圳市戴毅成信息管理咨询有限公司顾问、项目经理，中诚信国际信用评级有限责任公司分析师、项目经理，交银施罗德基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理，中金基金管理有限公司研究部副总经理兼基金经理助理；自2016年5月加入富国基金管理有限公司，历任固定收益投资经理、固定收益信用研究部副</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>总经理；现任富国基金固定收益信用研究部总经理，兼任富国基金固定收益投资部固定收益基金经理。2020年9月起任富国稳进回报12个月持有期混合型证券投资基金基金经理，2021年4月起任富国精诚回报12个月持有期混合型证券投资基金基金经理，2021年8月起任富国诚益回报12个月持有期混合型证券投资基金基金经理，2021年10月起任富国信享回报12个月持有期混合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精诚回报12个月持有期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》、《富国精诚回报12个月持有期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 年四季度以来，市场波动较大，宏观大环境，全球疫情有所反复，库存回补和经济复苏逐步进入中后期，三季度左右大概率是本轮经济复苏的顶点，市场整体以结构性机会为主，我们在四季度仓位上没有做太大波动，仓位中性偏谨慎，逢低布局了汽车零部件、电网投资等投资方向。行业配置上，主要在自己看好的化工、食品饮料、电子、汽车零部件上有一定的集中，风格风向上，成长和价值比较均衡，但显然回头看，过去几年在一些中小市值标的的积累上，显然非常不够，需要更勤奋的翻石头。

在这样一个波动比较大的市场，保持不贪婪、不计较、不折腾的平静心态是长周期维度能把投资做好很重要的一个因素。我们依然还是会坚持自下而上为主，围绕着公司中长期的价值判断，把研究做深做细。在扩大研究的广度和深度，提升研究的效率的同时，也加强对基本盘的研究，核心是对买点和卖点做好价值判断，不被市场情绪左右。我也一直认为对于伟大公司价值空间的判断，远胜于对买入时点的判断，也始终相信，持续稳定的收益回报，一定来自于稳定的投资框架，不漂移，不跟风短期市场的风格变化。

展望 2022 年一季度，社融下行的斜率可能趋缓，周期标的在未来 1-2 个季度或面临表观增速的压力，大众消费对于购买力的修复还需要时间，一季度可能更倾向于高端消费和成长股，看好白酒、电子、电网、汽车零部件、地产以及军工等行业。

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 2.77%，C 级为 2.61%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 0.90%，C 级为 0.90%

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 | 1,508,278,270.62 | 23.97 |
| | 其中：股票 | 1,508,278,270.62 | 23.97 |
| 2 | 固定收益投资 | 3,853,302,156.40 | 61.25 |
| | 其中：债券 | 3,853,302,156.40 | 61.25 |
| | 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 | 881,780,416.51 | 14.02 |
| 7 | 其他资产 | 47,872,354.84 | 0.76 |
| 8 | 合计 | 6,291,233,198.37 | 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 48,331,140.00 元，占资产净值比例为 0.79%。

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 | 1,349,511,333.10 | 22.17 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | — | — |
| E | 建筑业 | 11,519.99 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 63,663.02 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 20,648,432.00 | 0.34 |
| H | 住宿和餐饮业 | 4,608.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | — | — |
| J | 金融业 | — | — |
| K | 房地产业 | 57,721,590.00 | 0.95 |
| L | 租赁和商务服务业 | — | — |

| | | | |
|---|---------------|------------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业 | 40,756.62 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 11,992.19 | 0.00 |
| 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 | 31,933,235.70 | 0.52 |
| S | 综合 | — | — |
| | 合计 | 1,459,947,130.62 | 23.99 |

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（%） |
|------|---------------|--------------|
| 公用事业 | 48,331,140.00 | 0.79 |
| 合计 | 48,331,140.00 | 0.79 |

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 | 002475 | 立讯精密 | 2,270,076 | 111,687,739.20 | 1.84 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 47,200 | 96,760,000.00 | 1.59 |
| 3 | 002028 | 思源电气 | 1,760,736 | 86,645,818.56 | 1.42 |
| 4 | 002304 | 洋河股份 | 517,100 | 85,181,883.00 | 1.40 |
| 5 | 600426 | 华鲁恒升 | 2,313,340 | 72,407,542.00 | 1.19 |
| 6 | 002138 | 顺络电子 | 1,636,500 | 62,481,570.00 | 1.03 |
| 7 | 600048 | 保利发展 | 3,693,000 | 57,721,590.00 | 0.95 |
| 8 | 002484 | 江海股份 | 2,065,800 | 56,437,656.00 | 0.93 |
| 9 | 000568 | 泸州老窖 | 210,300 | 53,388,861.00 | 0.88 |
| 10 | 002540 | 亚太科技 | 6,599,900 | 50,819,230.00 | 0.84 |

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 | 189,994,656.40 | 3.12 |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | 1,410,516,000.00 | 23.18 |
| | 其中：政策性金融债 | 545,392,000.00 | 8.96 |
| 4 | 企业债券 | 1,238,263,000.00 | 20.35 |
| 5 | 企业短期融资券 | 40,120,000.00 | 0.66 |
| 6 | 中期票据 | 280,155,000.00 | 4.60 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 414,000.00 | 0.01 |
| 8 | 同业存单 | — | — |
| 9 | 其他 | 693,839,500.00 | 11.40 |
| 10 | 合计 | 3,853,302,156.40 | 63.32 |

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 | 1680380 | 16 铁道 01 | 3,000,000 | 301,170,000.00 | 4.95 |
| 2 | 1680448 | 16 铁道 09 | 3,000,000 | 300,120,000.00 | 4.93 |
| 3 | 1928021 | 19 农业银行永续债 01 | 2,800,000 | 289,996,000.00 | 4.77 |
| 4 | 210206 | 21 国开 06 | 2,700,000 | 270,189,000.00 | 4.44 |
| 5 | 1928018 | 19 工商银行永续债 | 2,200,000 | 228,206,000.00 | 3.75 |

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“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：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 进出 16”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“19 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：（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）；由于存在：（1）农业银行制定文件要求企业对公账户必须开通属于该行收费项目的动账短信通知服务，侵害客户自主选择权；（2）农业银行河南分行和新疆分行转发并执行总行强制企业对公账户开通动账短信通知服务要求，违法行为情节较为严重的事实，中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 12 月 8 日对公司做出罚款 150 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕38 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 7 名证券的发行主体本期末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 | 2,184,957.23 |
| 2 | 应收证券清算款 | — |

| | | |
|---|-------|---------------|
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 45,429,461.11 |
| 5 | 应收申购款 | 257,936.50 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 其他 | — |
| 8 | 合计 | 47,872,354.84 |

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 | 富国精诚回报 12 个月持有期混合 A | 富国精诚回报 12 个月持有期混合 C |
|-------------------------------|---------------------|---------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 5,464,893,990.87 | 361,200,599.35 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,413,922.51 | 1,944.39 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | — | — |
| 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 | 5,466,307,913.38 | 361,202,543.74 |

§ 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。

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精诚回报 12 个月持有期混合型证券投资基金的文件

2、富国精诚回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金合同

3、富国精诚回报 12 个月持有期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、富国精诚回报 12 个月持有期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