

富国可转换债券证券投资基金

二〇二三年第1季度报告

2023年03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

报告送出日期：2023年04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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

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	1,790,763,667.00份		
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比。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/B	富国可转换债券 C	
下属分级基金的交易代码	前端 100051	后端 100052	009758
报告期末下属分级基金的份额总额	1,687,884,593.53份		102,879,073.47份

§ 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（2023年01月01日-2023年03月31日）	
	富国可转换债券 A/B	富国可转换债券 C
1. 本期已实现收益	11,805,032.49	508,824.65
2. 本期利润	162,664,619.83	9,309,310.78
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1018	0.0904
4. 期末基金资产净值	3,505,021,146.17	212,558,869.20
5. 期末基金份额净值	2.077	2.066

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 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/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	5.86%	0.61%	3.24%	0.38%	2.62%	0.23%
过去六个月	2.11%	0.73%	2.08%	0.47%	0.03%	0.26%
过去一年	2.32%	0.81%	1.21%	0.49%	1.11%	0.32%
过去三年	23.34%	0.83%	14.97%	0.54%	8.37%	0.29%
过去五年	43.14%	0.78%	28.93%	0.55%	14.21%	0.23%
自基金合同生效起至今	107.70%	0.95%	42.59%	0.85%	65.11%	0.10%

(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	5.79%	0.61%	3.24%	0.38%	2.55%	0.23%
过去六个月	1.97%	0.72%	2.08%	0.47%	-0.11%	0.25%
过去一年	2.08%	0.81%	1.21%	0.49%	0.87%	0.32%

自基金分级 生效日起至 今	21.82%	0.84%	13.35%	0.55%	8.47%	0.29%
---------------------	--------	-------	--------	-------	-------	-------

3.2.2 自基金合同生效以来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

(1) 自基金合同生效以来富国可转换债券 A/B 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 2023 年 3 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2023年3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	本基金现任基金经理	2019-03-19	—	10	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，自2018年5月起历任固定收益基金经理；现任富国基金固定收益投资部固定收益投资总监助理兼固定收益基金经理。自2019年03月起任富国可转换债券证券投资基金基金经理；自2019年03月起任富国收益增强债券型证券投资基金基金经理；自2019年03月起任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理；自2022年04月起任富国利享回报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。

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中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

摆脱了疫情的压制，消费、出行、生产等均出现了显著的复苏。为防止这种复苏是一次性的，相对短期的，政策端的呵护也是到位的。整体来看，目前是流动性宽松，企业盈利预期向上的阶段，也是对权益市场最好的时期。对于债券而言，虽然中长期包括通胀与经济增长超预期都可能构成利率上行风险，但短期政策利率较低的现实仍然是有利于市场走势的。在这种对于股债而言均较好的环境中，组合保持相对积极的态度，首先是权益仓位保持相对较高水平，且布局以成长类标的为主，其次转债仓位也保持较高位置，期待额外增加组合弹性，最后在债券方面紧抓票息策略，通过适度杠杆获取套息收益，同时少量参与中长端债券交易机会，力争做到少量净值增厚。

不过在有利环境下，挑战也同时存在。市场虽然整体向上，但结构上却差异极大。年初以来可以看到 TMT 等科技类标的表现抢眼，中特估在政策支持下也出现较大涨幅，但新能源、医药、食品饮料等传统白马则表现疲弱。从相应板块的业绩表现来看，市场在预期层面表现的较为极端，特别对于当下业绩超预期、高增长的标的并不热衷，反而去追逐当下业绩可能疲弱甚至亏损，但未来存在潜在增长的标的，景气度投资阶段性让位于预期投资，或者热点炒作。造成这种局面有对当下经济增长前景仍存担忧的现实，也有流动性结构中机构趋于恶化，大众奔波涌入的客观因素。面对此种局面，作为组合管理人，在时间序列平衡概率和相应的盈利可能，并将这种可能进行折现自身相对能够把握的，企业长期盈利水平仍然是决定公司估值的核心因素。故组合在一季度中采取相对均衡的操作方式，既考虑当下业绩确定性，也考虑未来潜在可能性，并通过转债风险收益不对称特征，获取相对平稳组合收益。从结果来看，部分成功了，部分也存在一些遗

憾，不断改进组合的构建水平，提升组合的风险抗性是永远不能停歇的脚步。

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 5.86%，C 级为 5.79%，同期业绩比较基准收益率 A/B 级为 3.24%，C 级为 3.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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	454,637,739.69	11.30
	其中：股票	454,637,739.69	11.30
2	固定收益投资	3,470,785,456.75	86.27
	其中：债券	3,470,785,456.75	86.27
	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	69,452,749.62	1.73
7	其他资产	28,090,924.62	0.70
8	合计	4,022,966,870.68	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	446,056,989.69	12.00
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	8,580,750.00	0.23
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	454,637,739.69	12.23

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	002859	洁美科技	1,604,200	45,960,330.00	1.24
2	603966	法兰泰克	3,210,156	45,263,199.60	1.22
3	603225	新凤鸣	3,403,563	36,928,658.55	0.99
4	603501	韦尔股份	373,200	33,998,520.00	0.91
5	688680	海优新材	196,198	32,449,187.22	0.87
6	603989	艾华集团	953,200	24,859,456.00	0.67
7	601058	赛轮轮胎	2,195,286	23,687,135.94	0.64
8	002738	中矿资源	300,000	21,090,000.00	0.57
9	601865	福莱特	588,970	20,207,560.70	0.54
10	600761	安徽合力	1,000,000	17,960,000.00	0.48

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	201,516,178.41	5.42
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）	3,269,269,278.34	87.94
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	3,470,785,456.75	93.36

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	110059	浦发转债	1,362,570	144,668,723.24	3.89
2	113044	大秦转债	1,200,320	135,536,188.14	3.65

3	019688	22 国债 23	920,000	92,435,071.78	2.49
4	127006	敖东转债	684,621	82,108,847.34	2.21
5	113615	金诚转债	276,960	76,991,275.73	2.07

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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局、中国银行保险监督管理委员会青海监管局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。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	651,436.04
2	应收证券清算款	24,326,789.64
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	3,112,698.94
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	28,090,924.62

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	110059	浦发转债	144,668,723.24	3.89
2	113044	大秦转债	135,536,188.14	3.65
3	127006	敖东转债	82,108,847.34	2.21
4	113615	金诚转债	76,991,275.73	2.07
5	132018	G 三峡 EB1	68,670,747.32	1.85
6	128083	新北转债	66,299,401.89	1.78

7	127043	川恒转债	60,817,679.22	1.64
8	127049	希望转2	59,398,478.41	1.60
9	127063	贵轮转债	59,251,229.70	1.59
10	128133	奇正转债	58,034,277.78	1.56
11	123107	温氏转债	51,379,701.04	1.38
12	123148	上能转债	48,377,134.39	1.30
13	127032	苏行转债	45,505,143.37	1.22
14	128048	张行转债	44,765,065.67	1.20
15	110061	川投转债	42,941,645.81	1.16
16	123150	九强转债	42,355,191.55	1.14
17	113057	中银转债	42,320,954.80	1.14
18	127020	中金转债	42,218,056.17	1.14
19	128034	江银转债	40,995,645.66	1.10
20	118012	微芯转债	39,104,839.84	1.05
21	127058	科伦转债	38,724,558.37	1.04
22	128121	宏川转债	38,554,643.84	1.04
23	123119	康泰转2	37,908,603.68	1.02
24	113654	永02转债	36,609,192.90	0.98
25	110079	杭银转债	36,385,914.60	0.98
26	110085	通22转债	35,021,163.37	0.94
27	110068	龙净转债	34,940,761.30	0.94
28	110053	苏银转债	34,477,207.16	0.93
29	128130	景兴转债	34,023,604.79	0.92
30	113609	永安转债	33,339,665.51	0.90
31	128037	岩土转债	32,985,920.43	0.89
32	110084	贵燃转债	32,859,371.10	0.88
33	113534	鼎胜转债	32,245,066.53	0.87
34	123114	三角转债	30,436,209.18	0.82
35	113519	长久转债	28,377,238.30	0.76
36	127033	中装转2	26,982,119.18	0.73
37	128109	楚江转债	24,455,706.23	0.66
38	113050	南银转债	24,396,203.34	0.66

39	127016	鲁泰转债	24,229,283.21	0.65
40	127022	恒逸转债	22,699,570.44	0.61
41	127040	国泰转债	22,223,739.12	0.60
42	113588	润达转债	22,115,687.54	0.59
43	110077	洪城转债	21,992,018.13	0.59
44	128014	永东转债	21,871,316.79	0.59
45	113626	伯特转债	21,533,035.56	0.58
46	123063	大禹转债	21,388,316.73	0.58
47	127036	三花转债	20,864,478.08	0.56
48	127018	本钢转债	20,464,808.86	0.55
49	110080	东湖转债	19,833,140.93	0.53
50	127005	长证转债	19,781,210.53	0.53
51	110083	苏租转债	19,750,728.03	0.53
52	113634	珀莱转债	19,469,609.32	0.52
53	113594	淳中转债	19,098,212.05	0.51
54	113648	巨星转债	18,969,230.58	0.51
55	113629	泉峰转债	18,138,407.13	0.49
56	123147	中辰转债	17,635,643.17	0.47
57	128119	龙大转债	17,358,220.13	0.47
58	113647	禾丰转债	17,226,817.31	0.46
59	123085	万顺转 2	17,144,439.31	0.46
60	113504	艾华转债	17,046,817.62	0.46
61	113640	苏利转债	16,786,765.33	0.45
62	123087	明电转债	16,576,630.88	0.45
63	113545	金能转债	15,861,400.62	0.43
64	113058	友发转债	15,776,395.89	0.42
65	113051	节能转债	14,906,035.29	0.40
66	128081	海亮转债	14,635,588.66	0.39
67	128144	利民转债	14,492,922.74	0.39
68	113048	晶科转债	14,480,657.79	0.39
69	123145	药石转债	14,105,025.75	0.38
70	113017	吉视转债	13,925,308.46	0.37

71	113054	绿动转债	13,815,532.09	0.37
72	110074	精达转债	13,562,475.11	0.36
73	127035	濮耐转债	13,557,038.50	0.36
74	123044	红相转债	13,120,497.55	0.35
75	123121	帝尔转债	12,971,616.71	0.35
76	110075	南航转债	12,565,455.31	0.34
77	128087	孚日转债	12,554,567.97	0.34
78	123133	佩蒂转债	12,495,664.43	0.34
79	113637	华翔转债	11,752,267.27	0.32
80	113024	核建转债	11,744,698.63	0.32
81	123077	汉得转债	11,734,698.79	0.32
82	123080	海波转债	11,652,037.76	0.31
83	128075	远东转债	11,003,088.64	0.30
84	127050	麒麟转债	10,980,553.81	0.30
85	123127	耐普转债	10,790,069.54	0.29
86	123049	维尔转债	10,458,276.57	0.28
87	127064	杭氧转债	10,448,127.12	0.28
88	128049	华源转债	10,093,878.56	0.27
89	110047	山鹰转债	10,004,525.58	0.27
90	113585	寿仙转债	9,508,068.22	0.26
91	127012	招路转债	9,462,630.14	0.25
92	127070	大中转债	9,049,283.63	0.24
93	123025	精测转债	8,892,690.64	0.24
94	128106	华统转债	8,380,585.48	0.23
95	127069	小熊转债	8,269,435.27	0.22
96	127028	英特转债	8,265,386.18	0.22
97	113059	福莱转债	8,264,044.66	0.22
98	123098	一品转债	8,175,155.02	0.22
99	113649	丰山转债	7,914,167.67	0.21
100	127060	湘佳转债	7,802,644.88	0.21
101	110063	鹰19转债	7,738,713.54	0.21
102	123151	康医转债	7,675,584.78	0.21

103	123091	长海转债	7,559,819.18	0.20
104	118000	嘉元转债	7,264,021.78	0.20
105	118003	华兴转债	7,190,739.73	0.19
106	111000	起帆转债	6,989,505.36	0.19
107	128023	亚太转债	6,793,912.38	0.18
108	111004	明新转债	6,077,340.30	0.16
109	127027	靖远转债	5,948,054.19	0.16
110	113651	松霖转债	5,910,244.81	0.16
111	128108	蓝帆转债	5,575,618.81	0.15
112	123158	宙邦转债	5,566,433.92	0.15
113	123076	强力转债	5,461,378.59	0.15
114	127037	银轮转债	5,349,263.92	0.14
115	113046	金田转债	5,329,376.71	0.14
116	127029	中钢转债	5,132,607.63	0.14
117	128066	亚泰转债	4,226,417.53	0.11
118	113643	风语转债	4,125,230.14	0.11
119	111002	特纸转债	4,084,087.28	0.11
120	111005	富春转债	3,918,162.74	0.11
121	118013	道通转债	3,815,866.85	0.10
122	127066	科利转债	3,629,866.85	0.10
123	123067	斯莱转债	3,481,806.67	0.09
124	127031	洋丰转债	3,333,460.27	0.09
125	113569	科达转债	3,317,268.49	0.09
126	123096	思创转债	3,278,173.97	0.09
127	113549	白电转债	3,239,862.20	0.09
128	128134	鸿路转债	3,137,299.11	0.08
129	113618	美诺转债	3,117,719.18	0.08
130	113056	重银转债	2,919,836.71	0.08
131	113591	胜达转债	2,659,198.04	0.07
132	123120	隆华转债	2,582,517.81	0.07
133	123090	三诺转债	2,482,427.40	0.07
134	113584	家悦转债	2,451,358.48	0.07

135	111006	嵘泰转债	2,337,443.52	0.06
136	127061	美锦转债	2,205,880.50	0.06
137	123156	博汇转债	2,183,998.25	0.06
138	127026	超声转债	1,603,827.58	0.04
139	128124	科华转债	661,279.88	0.02
140	128140	润建转债	192,601.85	0.01
141	127065	瑞鹤转债	179,548.02	0.00
142	123071	天能转债	146,574.02	0.00
143	113505	杭电转债	112,813.97	0.00
144	123022	长信转债	88,527.14	0.00
145	113033	利群转债	27,799.20	0.00
146	127042	嘉美转债	25,167.46	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/B	富国可转换债券 C
报告期期初基金份额总额	1,396,084,704.18	77,356,142.69
报告期期间基金总申购份额	1,119,571,068.41	59,262,721.80
报告期期间基金总赎回份额	827,771,179.06	33,739,791.02
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	1,687,884,593.53	102,879,073.47

§ 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

注：本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

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。

§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
2023 年 04 月 21 日