

富国兴利增强债券型发起式证券投资基金

二〇二四年第1季度报告

2024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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2024年04月22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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 月 18 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 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	富国兴利增强债券
基金主代码	005121
交易代码	005121
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年09月20日
报告期末基金份额总额	1,241,684,992.96份
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金按照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。本基金在债券投资过程中突出主动性的投资管理,在对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势进行客观判断的基础上,通过合理配置收益率相对较高的企业债、公司债、资产支持证券,以及风险收益特征优异的可转换公司债券、可分离交易可转债、中小企业私募债券、可交换债券等债券品种,加以对国家债券、金融债券、中央银行票据以及质押及买断式回购等高流动性品种的投资,灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略,在保证基金流动性的前提下,积极把握固定收益证券市场中投资机会,获取各类债券的超额投资收益。当本基金管理人判断市场出现明显的趋势性投资机会时,本基金可以直接参与股票市场投资,努力获取超额收益。在股票市场投资过程中,本基金主要采取自下而上的投资策略,利用数量化投资技术与基本面研究相结合的研究方法进行投资。此外,本基金的存托凭证投资策略、权证投资策略等详见基金合同。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%。
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	中国工商银行股份有限公司

### § 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（2024年01月01日- 2024年03月31日）
1. 本期已实现收益	-85,779,225.21
2. 本期利润	-54,754,342.92
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0310
4. 期末基金资产净值	1,718,644,969.53
5. 期末基金份额净值	1.3841

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。

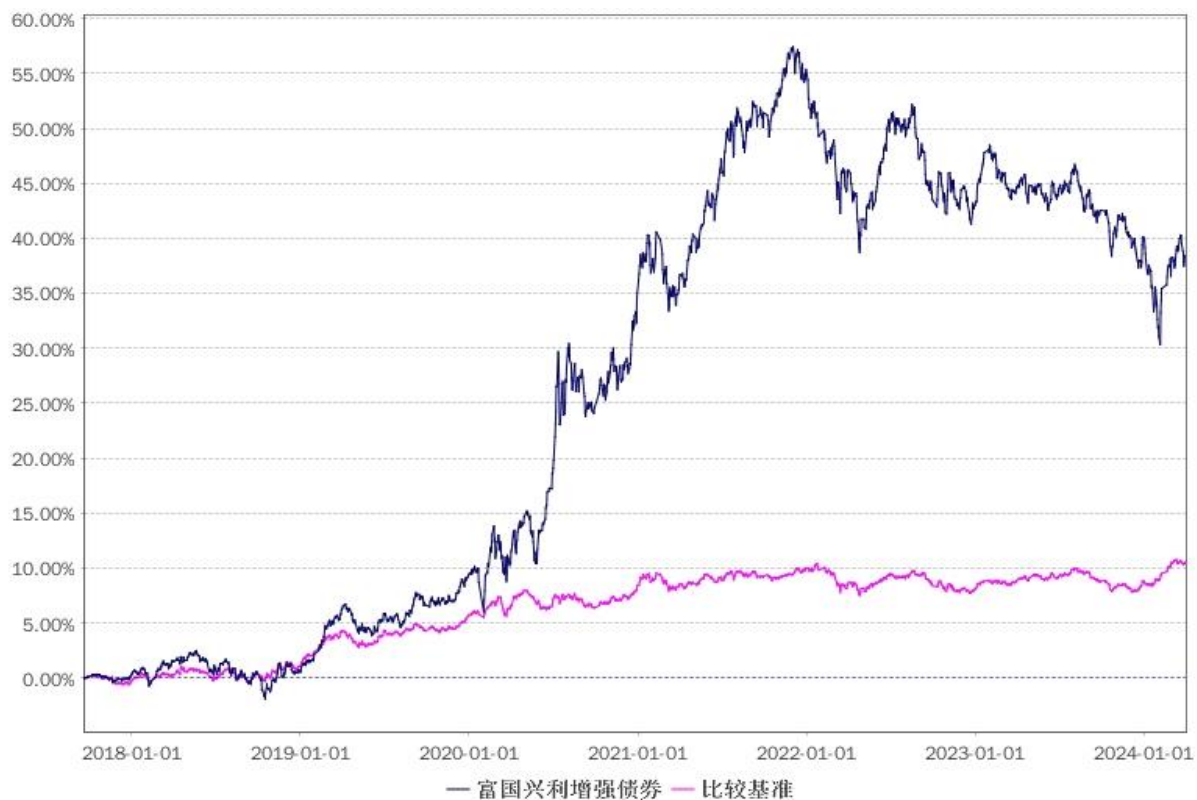
本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 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

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	-1.21%	0.63%	1.55%	0.11%	-2.76%	0.52%
过去六个月	-2.90%	0.51%	1.58%	0.10%	-4.48%	0.41%
过去一年	-4.31%	0.42%	1.54%	0.09%	-5.85%	0.33%
过去三年	2.32%	0.45%	2.03%	0.11%	0.29%	0.34%
过去五年	30.82%	0.51%	6.12%	0.12%	24.70%	0.39%
自基金合同生效起至今	38.41%	0.46%	10.53%	0.12%	27.88%	0.34%

##### 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



注：1、截止日期为 2024 年 3 月 31 日。

2、本基金于 2017 年 9 月 20 日成立，建仓期 6 个月，从 2017 年 9 月 20 日起至 2018 年 3 月 19 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		
陈斯扬	本基金现任基金经理	2018-04-02	—	11	硕士，曾任交银施罗德基金管理有限公司研究员、投资经理；自 2016 年 10 月加入富国基金管理有限公司，历任定量投资经理；现任富国基金量化投资部定量基金经理。自 2018 年 03 月起任富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2018 年 03 月起任富国丰利增强债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2018 年 04 月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2024 年 03 月起任富国盛利增强债券型发起式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兴利增强债券型发起式证券投资

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》、《富国兴利增强债券型发起式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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现 4 次同日反向交易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

国内权益市场在一季度充满了波折，站在情绪修复的当前，很难想象两个月前的市场曾经有多么悲观。当时出于对经济增长的忧虑，及对雪球敲入、股票融资杠杆平仓等一系列因素的担忧，权益市场出现了深度回调，尤其是小微盘股出现了近年来最为剧烈的调整，并引发了各种策略的止损和踩踏。考虑到这轮调整是在市场本身的点位和估值已经处在历经数年调整后的历史较低水平之上，其对投资者信心的冲击更大。为了阻断负反馈并稳定市场，汇金在年后开始加大力度买入指数 ETF，终于推动市场企稳，股市走出一波强劲反弹，期间风格则继续分化，小微盘股波动仍剧烈，大盘股则稳步修复。在这一显著的波动背后，年内组合指增仓位的超额收益维持稳健，在良好的风格暴露控制之下，均跑赢了跟踪的基准指数。

债券市场一季度走出一波牛市行情，在交易情绪和配置需求的双重推动下，30 年期国债利率持续下行并击穿一年期 MLF 的政策利率，呈现出收益率曲线极度平坦化的状态，期间哪怕超长期特别国债将持续发行的政策表态都未能对长端构成太大的扰动，不过长端利率进一步下行的动能似乎有暂时衰弱的迹象。后续政策力度与经济增长的修复程度将决定关键方向。

可转债市场一季度整体表现弱于主要的宽基指数，一方面受发行主体风格偏向小微盘的影响，这类正股风格在一季度的表现整体最弱；另一方面配置需求走弱也导致转债估值有所压缩。在正股经历数年的回调洗礼之后，转债的平价和 delta 均偏低，使得当前处于比较微妙的平衡下，下跌有防御性，但上涨进攻性欠缺。考虑到转债本身还有下修的可能性，因此作为一类资产仍处在比较好的左侧配置窗口上。组合转债仓位相较市场平均水平也录得了正的超额。后续还是会积极寻找期权估值扩张的机会，以提供进一步的超额回报。



#### **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-1.21%，同期业绩比较基准收益率为1.55%。

#### **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	340,962,005.02	15.94
	其中：股票	340,962,005.02	15.94
2	固定收益投资	1,726,633,004.92	80.71
	其中：债券	1,726,633,004.92	80.71
	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	46,927,514.87	2.19
7	其他资产	24,909,081.01	1.16
8	合计	2,139,431,605.82	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	16,731,165.00	0.97
B	采矿业	2,594,056.00	0.15
C	制造业	250,959,727.68	14.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	337,560.00	0.02
F	批发和零售业	981,120.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	301,782.00	0.02
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,525,500.58	1.54
J	金融业	26,324,564.41	1.53
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	344,148.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	4,499,341.35	0.26
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	9,755,264.00	0.57
R	文化、体育和娱乐业	1,607,776.00	0.09
S	综合	—	—
	合计	340,962,005.02	19.84

### 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	300750	宁德时代	303,826	57,775,552.16	3.36
2	300059	东方财富	1,702,869	21,949,981.41	1.28
3	300760	迈瑞医疗	76,602	21,560,398.92	1.25
4	300124	汇川技术	290,257	17,769,533.54	1.03
5	300498	温氏股份	874,575	16,616,925.00	0.97
6	300308	中际旭创	66,600	10,426,896.00	0.61
7	300274	阳光电源	97,136	10,082,716.80	0.59
8	300015	爱尔眼科	762,130	9,755,264.00	0.57
9	300122	智飞生物	201,900	9,073,386.00	0.53
10	300433	蓝思科技	505,800	6,899,112.00	0.40

#### 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	101,335,616.44	5.90
2	央行票据	—	—
3	金融债券	602,779,757.00	35.07
	其中：政策性金融债	40,997,442.62	2.39
4	企业债券	275,656,540.28	16.04
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	746,861,091.20	43.46
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,726,633,004.92	100.46

#### 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	019727	23 国债 24	1,000,000	101,335,616.44	5.90
2	2028006	20 邮储银行永 续债	800,000	81,090,581.92	4.72
3	188139	21 国电 01	700,000	71,701,594.52	4.17
4	188639	国电投 10	700,000	71,228,854.80	4.14
5	2128022	21 交通银行永 续债	500,000	53,278,398.91	3.10

## 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，深圳市地铁集团有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市南山区招商街道办事处、深圳市光明区凤凰街道办事处的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

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	271,325.89

2	应收证券清算款	24,636,536.10
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,219.02
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	24,909,081.01

#### 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	118031	天 23 转债	17,818,549.31	1.04
2	127049	希望转 2	16,875,570.81	0.98
3	132026	G 三峡 EB2	15,752,843.72	0.92
4	127067	恒逸转 2	13,590,694.13	0.79
5	127045	牧原转债	12,775,567.99	0.74
6	127022	恒逸转债	12,533,788.25	0.73
7	128081	海亮转债	12,500,359.47	0.73
8	127056	中特转债	12,291,315.09	0.72
9	113050	南银转债	11,486,525.45	0.67
10	127083	山路转债	11,356,598.76	0.66
11	113052	兴业转债	11,018,930.24	0.64
12	128109	楚江转债	10,974,540.31	0.64
13	123119	康泰转 2	10,851,881.70	0.63
14	113632	鹤 21 转债	10,814,422.99	0.63
15	113048	晶科转债	10,762,682.53	0.63
16	118019	金盘转债	10,696,920.36	0.62
17	113024	核建转债	10,452,364.12	0.61
18	113641	华友转债	10,291,014.98	0.60
19	113666	爱玛转债	10,274,284.18	0.60
20	113623	凤 21 转债	9,679,206.95	0.56
21	123208	孩王转债	9,582,388.81	0.56
22	113065	齐鲁转债	9,517,813.51	0.55
23	113669	景 23 转债	9,496,882.33	0.55
24	123149	通裕转债	9,442,355.13	0.55

25	123169	正海转债	9,439,078.80	0.55
26	113602	景20转债	9,430,843.44	0.55
27	110079	杭银转债	9,282,120.43	0.54
28	110093	神马转债	9,178,095.02	0.53
29	113054	绿动转债	8,891,516.26	0.52
30	127070	大中转债	8,872,020.61	0.52
31	128128	齐翔转2	8,617,635.81	0.50
32	113047	旗滨转债	8,474,671.30	0.49
33	113068	金铜转债	8,464,701.27	0.49
34	128119	龙大转债	8,263,285.05	0.48
35	127015	希望转债	7,867,745.84	0.46
36	113045	环旭转债	7,692,795.71	0.45
37	128141	旺能转债	7,631,226.37	0.44
38	110059	浦发转债	7,629,798.63	0.44
39	110091	合力转债	7,427,665.76	0.43
40	113652	伟22转债	7,394,528.56	0.43
41	113648	巨星转债	7,350,921.92	0.43
42	113056	重银转债	7,276,646.55	0.42
43	110073	国投转债	7,244,852.38	0.42
44	113049	长汽转债	7,172,495.72	0.42
45	110089	兴发转债	7,123,825.97	0.41
46	127086	恒邦转债	7,095,529.72	0.41
47	127085	韵达转债	7,077,229.83	0.41
48	113627	太平转债	6,965,279.05	0.41
49	127063	贵轮转债	6,883,488.75	0.40
50	123191	智尚转债	6,743,440.53	0.39
51	113619	世运转债	6,353,566.38	0.37
52	113647	禾丰转债	6,350,319.25	0.37
53	113659	莱克转债	6,243,210.05	0.36
54	127024	盈峰转债	6,199,648.42	0.36
55	123184	天阳转债	6,194,364.25	0.36
56	123113	仙乐转债	6,044,117.57	0.35

57	123194	百洋转债	6,031,010.90	0.35
58	128087	孚日转债	5,904,161.10	0.34
59	111009	盛泰转债	5,827,722.94	0.34
60	113661	福22转债	5,784,624.57	0.34
61	123035	利德转债	5,759,979.15	0.34
62	118034	晶能转债	5,628,153.73	0.33
63	123172	漱玉转债	5,312,208.88	0.31
64	113058	友发转债	5,218,797.49	0.30
65	127091	科数转债	5,107,038.02	0.30
66	110095	双良转债	4,784,257.11	0.28
67	127041	弘亚转债	4,724,840.94	0.27
68	110087	天业转债	4,700,249.28	0.27
69	127052	西子转债	4,497,664.95	0.26
70	118026	利元转债	4,448,667.83	0.26
71	113046	金田转债	4,200,710.15	0.24
72	113037	紫银转债	4,012,851.53	0.23
73	127082	亚科转债	3,998,153.86	0.23
74	127073	天赐转债	3,969,118.58	0.23
75	127027	能化转债	3,892,916.01	0.23
76	110067	华安转债	3,879,306.78	0.23
77	127030	盛虹转债	3,864,708.95	0.22
78	123085	万顺转2	3,250,081.83	0.19
79	113644	艾迪转债	3,242,641.45	0.19
80	123117	健帆转债	3,233,395.76	0.19
81	127035	濮耐转债	3,109,297.74	0.18
82	111014	李子转债	3,001,864.58	0.17
83	113051	节能转债	2,994,565.12	0.17
84	110062	烽火转债	2,928,248.47	0.17
85	123078	飞凯转债	2,892,312.55	0.17
86	127088	赫达转债	2,826,564.22	0.16
87	113021	中信转债	2,817,357.70	0.16
88	127040	国泰转债	2,779,320.07	0.16



89	113530	大丰转债	2,722,307.60	0.16
90	127068	顺博转债	2,596,782.57	0.15
91	113638	台21转债	2,578,688.45	0.15
92	123204	金丹转债	2,542,423.78	0.15
93	123221	力诺转债	2,527,279.83	0.15
94	123213	天源转债	2,500,719.22	0.15
95	118043	福立转债	2,472,919.90	0.14
96	110063	鹰19转债	2,326,369.97	0.14
97	128071	合兴转债	2,185,102.77	0.13
98	113043	财通转债	2,180,709.59	0.13
99	113639	华正转债	2,176,221.76	0.13
100	111002	特纸转债	2,031,929.65	0.12
101	113030	东风转债	1,965,711.39	0.11
102	128048	张行转债	1,944,051.39	0.11
103	123211	阳谷转债	1,919,488.15	0.11
104	111017	蓝天转债	1,912,128.05	0.11
105	113039	嘉泽转债	1,874,592.85	0.11
106	118028	会通转债	1,792,306.55	0.10
107	123158	宙邦转债	1,725,073.97	0.10
108	127076	中宠转2	1,693,047.12	0.10
109	127051	博杰转债	1,678,382.71	0.10
110	123050	聚飞转债	1,593,942.21	0.09
111	113534	鼎胜转债	1,374,263.21	0.08
112	113616	韦尔转债	1,316,755.92	0.08
113	118044	赛特转债	1,293,892.34	0.08
114	127054	双箭转债	1,203,569.68	0.07
115	128121	宏川转债	1,116,140.87	0.06
116	113573	纵横转债	970,444.39	0.06
117	113671	武进转债	954,774.30	0.06
118	123165	回天转债	951,585.73	0.06
119	111011	冠盛转债	947,811.20	0.06
120	113676	荣23转债	907,282.87	0.05

121	110090	爱迪转债	897,911.95	0.05
122	113569	科达转债	883,050.25	0.05
123	127043	川恒转债	876,986.36	0.05
124	127031	洋丰转债	873,309.58	0.05
125	127077	华宏转债	869,755.45	0.05
126	123120	隆华转债	846,422.33	0.05
127	113636	甬金转债	796,504.35	0.05
128	113545	金能转债	636,808.64	0.04
129	113053	隆 22 转债	610,528.00	0.04
130	113637	华翔转债	591,645.89	0.03
131	118032	建龙转债	508,362.74	0.03
132	118029	富淼转债	493,787.99	0.03
133	128123	国光转债	434,062.16	0.03
134	123182	广联转债	354,002.88	0.02
135	123166	蒙泰转债	336,973.88	0.02
136	123076	强力转债	333,081.78	0.02
137	123177	测绘转债	281,788.93	0.02
138	118030	睿创转债	238,160.45	0.01
139	110081	闻泰转债	28,843.48	0.00
140	113664	大元转债	16,929.34	0.00
141	110083	苏租转债	11,445.23	0.00
142	123107	温氏转债	9,871.19	0.00
143	123144	裕兴转债	9,444.99	0.00
144	123156	博汇转债	8,871.99	0.00
145	123159	崧盛转债	8,487.51	0.00
146	123175	百畅转债	7,588.13	0.00
147	111008	沿浦转债	7,560.44	0.00
148	110086	精工转债	7,498.16	0.00
149	128142	新乳转债	7,425.03	0.00
150	127020	中金转债	7,338.53	0.00
151	118023	广大转债	6,972.50	0.00
152	113673	岱美转债	5,918.95	0.00

153	128097	奥佳转债	5,382.90	0.00
154	127050	麒麟转债	5,060.36	0.00
155	113674	华设转债	4,980.68	0.00
156	127032	苏行转债	4,898.24	0.00
157	110094	众和转债	3,810.08	0.00
158	113651	松霖转债	3,800.38	0.00
159	118021	新致转债	3,585.91	0.00
160	111005	富春转债	3,314.97	0.00
161	127060	湘佳转债	2,895.43	0.00
162	111007	永和转债	2,628.37	0.00
163	123127	耐普转债	1,441.01	0.00
164	123161	强联转债	1,370.83	0.00
165	110068	龙净转债	1,337.62	0.00
166	113662	豪能转债	1,134.01	0.00
167	123090	三诺转债	996.32	0.00
168	123185	能辉转债	617.65	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

报告期期初基金份额总额	2,201,205,172.28
报告期期间基金总申购份额	414,763,011.72
报告期期间基金总赎回份额	1,374,283,191.04
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	1,241,684,992.96

## § 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	10,002,250.23
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	10,002,250.23
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.81

注：买入/申购含红利再投资、转换入份额；卖出/赎回含转换出份额。

### 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数 (份)	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数 (份)	发起份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	10,002,250.23	0.81	10,002,250.23	0.81	3年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	2,983,271.20	0.24	—	—	—
合计	12,985,521.43	1.05	10,002,250.23	0.81	3年

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国兴利增强债券型发起式证券投资基金的文件
- 2、富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金合同
- 3、富国兴利增强债券型发起式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、富国兴利增强债券型发起式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

### 10.2 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

### 10.3 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  
2024 年 04 月 22 日