

富国双债增强债券型证券投资基金

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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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	富国双债增强债券		
基金主代码	010435		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020年11月18日		
报告期末基金份额总额	3,451,357,607.73份		
投资目标	本基金在严格控制组合下行风险的前提下，通过主动管理充分捕捉可转债（含可交换债）和信用债市场投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。		
投资策略	本基金采取稳健灵活的投资策略，主要通过可分离交易可转债及可交换债、信用债等固定收益类金融工具的主动管理，力求在有效控制风险的基础上，获得基金资产的稳定增值；同时根据对权益类市场的趋势研判适度参与股票资产投资，力求提高基金总体收益率。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	中证可转债及可交换债券指数收益率*20%+中债新综合全价（总值）指数收益率*70%+沪深300指数收益率*5%+经汇率调整的恒生指数收益率*5%		
风险收益特征	本基金为债券型基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。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	中国邮政储蓄银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	富国双债增强债券A	富国双债增强债券C	富国双债增强债券E
下属分级基金的交易代码	010435	010436	018958
报告期末下属分级基金的份额总额	3,195,063,644.08份	126,026,232.88份	130,267,730.77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（2024年01月01日-2024年03月31日）		
	富国双债增强债券 A	富国双债增强债券 C	富国双债增强债券 E
1. 本期已实现收益	-114,956,642.92	-4,357,104.64	-3,885,713.23
2. 本期利润	-77,298,324.88	-5,041,774.94	-2,134,529.33
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0183	-0.0285	-0.0162
4. 期末基金资产净值	3,241,353,723.94	126,638,336.77	132,104,155.06
5. 期末基金份额净值	1.0145	1.0049	1.0141

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) 富国双债增强债券 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	-1.28%	0.41%	0.89%	0.19%	-2.17%	0.22%
过去六个月	-1.92%	0.34%	0.27%	0.18%	-2.19%	0.16%
过去一年	-3.13%	0.28%	0.03%	0.16%	-3.16%	0.12%
过去三年	6.98%	0.27%	1.83%	0.20%	5.15%	0.07%
自基金合同生效起至今	9.22%	0.26%	3.21%	0.20%	6.01%	0.06%

(2) 富国双债增强债券 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	-1.35%	0.41%	0.89%	0.19%	-2.24%	0.22%
过去六个月	-2.07%	0.35%	0.27%	0.18%	-2.34%	0.17%
过去一年	-3.42%	0.28%	0.03%	0.16%	-3.45%	0.12%
过去三年	6.02%	0.27%	1.83%	0.20%	4.19%	0.07%

自基金合同生效起至今	8.12%	0.26%	3.21%	0.20%	4.91%	0.06%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

(3) 富国双债增强债券 E

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	-1.28%	0.41%	0.89%	0.19%	-2.17%	0.22%
过去六个月	-1.93%	0.35%	0.27%	0.18%	-2.20%	0.17%
自基金分级生效日起至今	-3.75%	0.32%	-1.25%	0.17%	-2.50%	0.15%

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双债增强债券 A 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

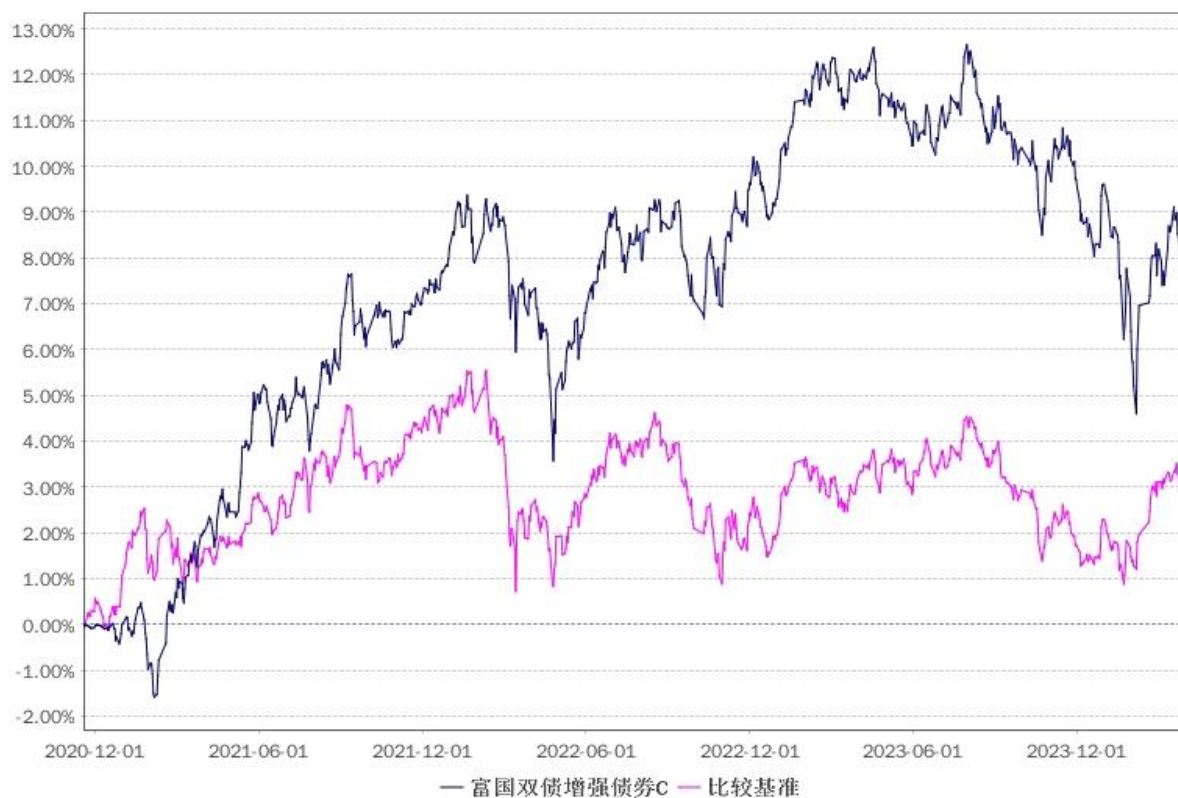


注：1、截止日期为 2024 年 3 月 31 日。

2、本基金于 2020 年 11 月 18 日成立，建仓期 6 个月，从 2020 年 11 月 18 日起至 2021 年 5 月 17 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双债增强债券 C 基金累计净值增长率与业绩比较

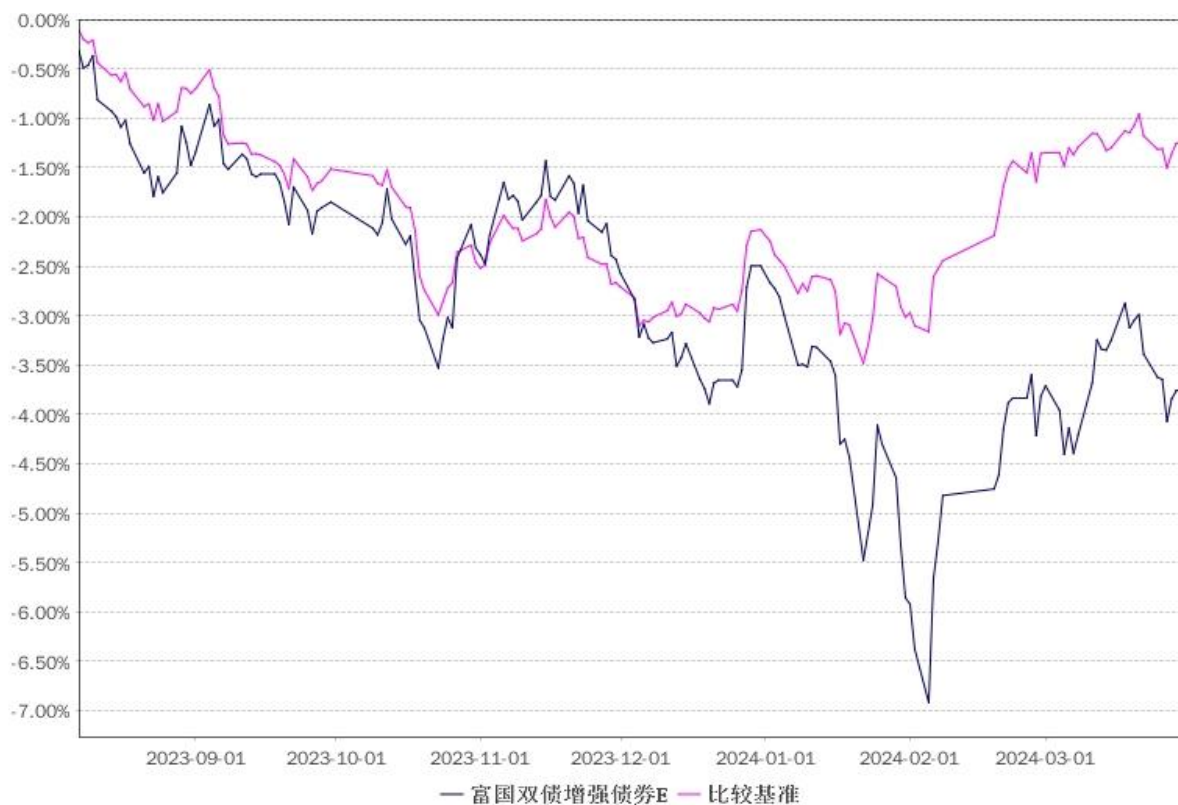
基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为2024年3月31日。

2、本基金于2020年11月18日成立，建仓期6个月，从2020年11月18日起至2021年5月17日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(3) 自基金E级份额生效以来富国双债增强债券E基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为2024年3月31日。

2、本基金自2023年8月4日起增加E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		
俞晓斌	本基金现任基金经理	2020-11-18	—	17	硕士，曾任上海国际货币经纪有限责任公司经纪人；自 2012 年 10 月加入富国基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、资深交易员、固定收益基金经理、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。自 2016 年 12 月起任富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2018 年 12 月起任富国两年期理财债券型证券投资基金基金经理；自 2019 年 03 月起任富国天盈债券型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2019 年 03 月起任富国稳健增强债券型证券投资基金（原富国信用增强债券型证券投资基金）基金经理；自 2020 年 11 月起任富国双债增强债券型证券投资基金基金经理；自 2021 年 06 月

					起任富国泰享回报 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 月起任富国恒享回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；自 2023 年 04 月起任富国稳健添盈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遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国双债增强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》、《富国双债增强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

2024 年第一季度，国内宏观数据出现较为明显的回升，超过此前市场预期，经济企稳向好的积极因素逐步聚集。但另一方面，微观主体信心和商品价格恢复仍有待验证，国际环境依然存在较多变数。具体来看，3 月制造业 PMI 回升至荣枯线以上，结束了去年 4 季度以来偏弱的局面。社会消费品零售增速在高基数影响下 1-2 月回落，但各分项较去年 12 月有所改善，其中服务和汽车消费较为突出。规模以上企业工业增加值增长较快，或受出口与补库行为带动。固定资产投资回升，制造业和高技术产业投资保持较快增长。进出口平稳向好，机电、劳动密集型产品等均呈现一定拉动效应。物价方面，CPI 整体平稳，文娱类价格支撑

较为明显。PPI 同比仍在负值区间，但跌幅有趋势性收窄迹象。海外经济方面，美国经济及通胀仍显示出韧性，联储降息时点可能延后。欧洲经济承压较为明显，或率先进入宽松周期。

国内债券市场在存款利率下行以及配置需求持续释放情况下，1-2 月收益率下行较快，后转入震荡，信用及期限利差压缩仍在持续。转债及权益市场一季度前半段出现较为明显的下跌，后在监管层呵护及经济数据企稳等利好推动下，出现明显反弹。结构上，红利板块表现突出，市场对于经营质量及稳定性基于更多溢价。投资操作方面，本组合在收益率下行过程中，逐步降低了久期和杠杆暴露。信用策略上，主要配置高等级债券。转债投资上，在下跌过程中适当加仓，后以优化结构为主。权益仓位较前期略有降低，综合考虑公司质地、估值保护、行业前景等因素择优配置。

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-1.28%，C 级为-1.35%，E 级为-1.28%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 0.89%，C 级为 0.89%，E 级为 0.89%。

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	656,085,191.30	16.81
	其中：股票	656,085,191.30	16.81
2	固定收益投资	3,163,370,833.63	81.07
	其中：债券	3,163,370,833.63	81.07
	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	2,600,000.00	0.07
	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	67,549,114.84	1.73
7	其他资产	12,183,614.51	0.31
8	合计	3,901,788,754.28	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 200,012,964.00 元，占资产净值比例为 5.71%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 71,595,422.00 元，占资产净值比例为 2.05%。

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	3,398,850.00	0.10
C	制造业	266,035,580.54	7.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,073,665.00	0.52
E	建筑业	44,707,432.08	1.28
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	27,798,372.00	0.79
H	住宿和餐饮业	23,088,765.28	0.66
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	1,374,140.40	0.04
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	384,476,805.30	10.98

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（%）
医疗保健	88,367,979.00	2.52
工业	39,651,720.00	1.13
非日常生活消费品	32,626,020.00	0.93
房地产	32,108,140.00	0.92
金融	27,177,720.00	0.78
日常消费品	22,204,725.00	0.63
公用事业	18,233,982.00	0.52
信息技术	8,484,000.00	0.24
通信服务	2,754,100.00	0.08
合计	271,608,386.00	7.76

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深港通投资的股票。

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	01093	石药集团	10,124,000	56,491,920.00	1.61
2	300450	先导智能	1,980,088	47,858,726.96	1.37
3	000090	天健集团	9,847,452	44,707,432.08	1.28
4	02128	中国联塑	11,127,000	37,386,720.00	1.07
5	002532	天山铝业	4,269,100	28,133,369.00	0.80
6	03900	绿城中国	4,946,000	27,994,360.00	0.80
7	600258	首旅酒店	1,619,128	23,088,765.28	0.66
8	01044	恒安国际	993,500	22,204,725.00	0.63
9	002353	杰瑞股份	635,800	19,252,024.00	0.55

10	600372	中航机载	1,610,402	18,825,599.38	0.54
----	--------	------	-----------	---------------	------

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	205,996,138.19	5.89
2	央行票据	—	—
3	金融债券	777,471,302.78	22.21
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	734,294,758.36	20.98
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	571,771,455.91	16.34
7	可转债（可交换债）	873,837,178.39	24.97
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	3,163,370,833.63	90.38

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	3,055,240	333,012,370.96	9.51
2	188215	21 国君 G5	1,100,000	112,646,389.04	3.22
3	188134	21 华泰 G5	900,000	92,144,682.74	2.63
4	188127	21 国君 G3	800,000	81,940,208.22	2.34
5	175326	20 中金 14	800,000	81,388,164.38	2.33

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

根据基金合同的约定，本基金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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，华泰证券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江苏省分行的处罚。

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	413,392.25
2	应收证券清算款	11,412,371.69
3	应收股利	303,396.72
4	应收利息	—
5	应收申购款	54,453.85
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	12,183,614.51

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	333,012,370.96	9.51
2	127040	国泰转债	42,917,605.30	1.23
3	113065	齐鲁转债	36,426,317.24	1.04
4	113056	重银转债	31,450,516.06	0.90
5	113052	兴业转债	28,339,600.96	0.81
6	113046	金田转债	25,884,405.93	0.74
7	110089	兴发转债	23,500,144.96	0.67
8	113054	绿动转债	22,298,695.78	0.64
9	113647	禾丰转债	22,076,425.27	0.63
10	118031	天23转债	19,232,334.36	0.55
11	113641	华友转债	16,493,381.95	0.47
12	127083	山路转债	15,590,768.20	0.45
13	110086	精工转债	14,616,723.51	0.42
14	110085	通22转债	14,452,669.56	0.41
15	127027	能化转债	13,735,206.34	0.39
16	113584	家悦转债	11,873,093.31	0.34

17	127045	牧原转债	11,546,434.38	0.33
18	128048	张行转债	10,522,137.54	0.30
19	123128	首华转债	10,184,969.96	0.29
20	127085	韵达转债	9,437,005.48	0.27
21	113669	景23转债	8,938,242.19	0.26
22	123113	仙乐转债	8,522,207.93	0.24
23	110063	鹰19转债	7,966,237.15	0.23
24	118034	晶能转债	6,928,817.22	0.20
25	110079	杭银转债	6,922,789.21	0.20
26	127031	洋丰转债	6,765,256.97	0.19
27	111004	明新转债	5,496,090.90	0.16
28	113047	旗滨转债	5,476,341.70	0.16
29	113516	苏农转债	5,463,541.10	0.16
30	123117	健帆转债	5,383,453.85	0.15
31	127030	盛虹转债	5,265,439.56	0.15
32	127049	希望转2	5,174,650.69	0.15
33	123190	道氏转02	4,720,302.74	0.13
34	113059	福莱转债	4,473,036.37	0.13
35	113037	紫银转债	4,460,393.41	0.13
36	127017	万青转债	4,433,715.07	0.13
37	118000	嘉元转债	4,398,093.63	0.13
38	127061	美锦转债	4,168,950.41	0.12
39	110095	双良转债	3,954,903.35	0.11
40	123216	科顺转债	3,585,681.23	0.10
41	113033	利群转债	3,566,423.40	0.10
42	127070	大中转债	3,305,758.41	0.09
43	118010	洁特转债	3,203,590.18	0.09
44	118008	海优转债	3,193,361.88	0.09
45	113655	欧22转债	3,147,057.53	0.09
46	111009	盛泰转债	3,057,567.12	0.09
47	113653	永22转债	3,027,786.51	0.09
48	127068	顺博转债	2,854,652.88	0.08

49	128116	瑞达转债	2,336,782.74	0.07
50	128144	利民转债	2,244,266.88	0.06
51	113631	皖天转债	1,810,056.23	0.05
52	127089	晶澳转债	1,762,435.18	0.05
53	123180	浙矿转债	1,558,608.94	0.04
54	127043	川恒转债	1,528,260.41	0.04
55	113048	晶科转债	1,431,174.27	0.04
56	123161	强联转债	1,420,918.45	0.04
57	113058	友发转债	1,130,343.84	0.03
58	113024	核建转债	1,126,313.90	0.03
59	118013	道通转债	1,091,036.68	0.03
60	113636	甬金转债	1,072,011.23	0.03
61	128124	科华转债	987,196.44	0.03
62	127071	天箭转债	881,034.27	0.03
63	110047	山鹰转债	542,794.19	0.02
64	123211	阳谷转债	403,327.00	0.01
65	118026	利元转债	391,269.52	0.01
66	128129	青农转债	355,342.46	0.01
67	118033	华特转债	175,537.13	0.01
68	123091	长海转债	75,144.78	0.00
69	113606	荣泰转债	54,926.51	0.00
70	118032	建龙转债	12,225.16	0.00
71	123146	中环转 2	1,022.54	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	富国双债增强债券 A	富国双债增强债券 C	富国双债增强债券 E
报告期期初基金份额总额	5,170,966,079.63	263,441,469.85	144,092,653.93
报告期期间基金总申购份额	39,520,679.99	9,782,644.71	14,890,594.89
报告期期间基金总赎回份额	2,015,423,115.54	147,197,881.68	28,715,518.05
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	3,195,063,644.08	126,026,232.88	130,267,730.77

§ 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	949.13
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	949.13
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.00

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 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双债增强债券型证券投资基金的文件
- 2、富国双债增强债券型证券投资基金基金合同
- 3、富国双债增强债券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、富国双债增强债券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
2024 年 04 月 22 日