

富国可转换债券证券投资基金

二〇二二年第三季度报告

2022年9月30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：2022年10月26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 10 月 24 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 2022 年 7 月 1 日起至 2022 年 9 月 30 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	1,550,531,235.84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	1,461,813,643.69份	88,717,592.15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（2022年7月1日-2022年9月30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	51,428,148.55	3,795,104.84
2. 本期利润	-193,070,669.32	-10,443,234.85
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1562	-0.1299
4. 期末基金资产净值	2,973,224,152.91	179,699,736.75
5. 期末基金份额净值	2.034	2.026

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 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/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	-5.92%	0.79%	-4.92%	0.41%	-1.00%	0.38%
过去六个月	0.20%	0.89%	-0.85%	0.51%	1.05%	0.38%
过去一年	-10.04%	0.86%	-4.30%	0.56%	-5.74%	0.30%
过去三年	33.12%	0.85%	17.01%	0.56%	16.11%	0.29%
过去五年	34.70%	0.81%	26.07%	0.56%	8.63%	0.25%
自基金合同生效起至今	103.40%	0.96%	39.68%	0.86%	63.72%	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	-5.94%	0.79%	-4.92%	0.41%	-1.02%	0.38%
过去六个月	0.10%	0.88%	-0.85%	0.51%	0.95%	0.37%
过去一年	-10.20%	0.86%	-4.30%	0.56%	-5.90%	0.30%

自基金分级 生效日起至 今	19.46%	0.87%	11.03%	0.56%	8.43%	0.31%
---------------------	--------	-------	--------	-------	-------	-------

### 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

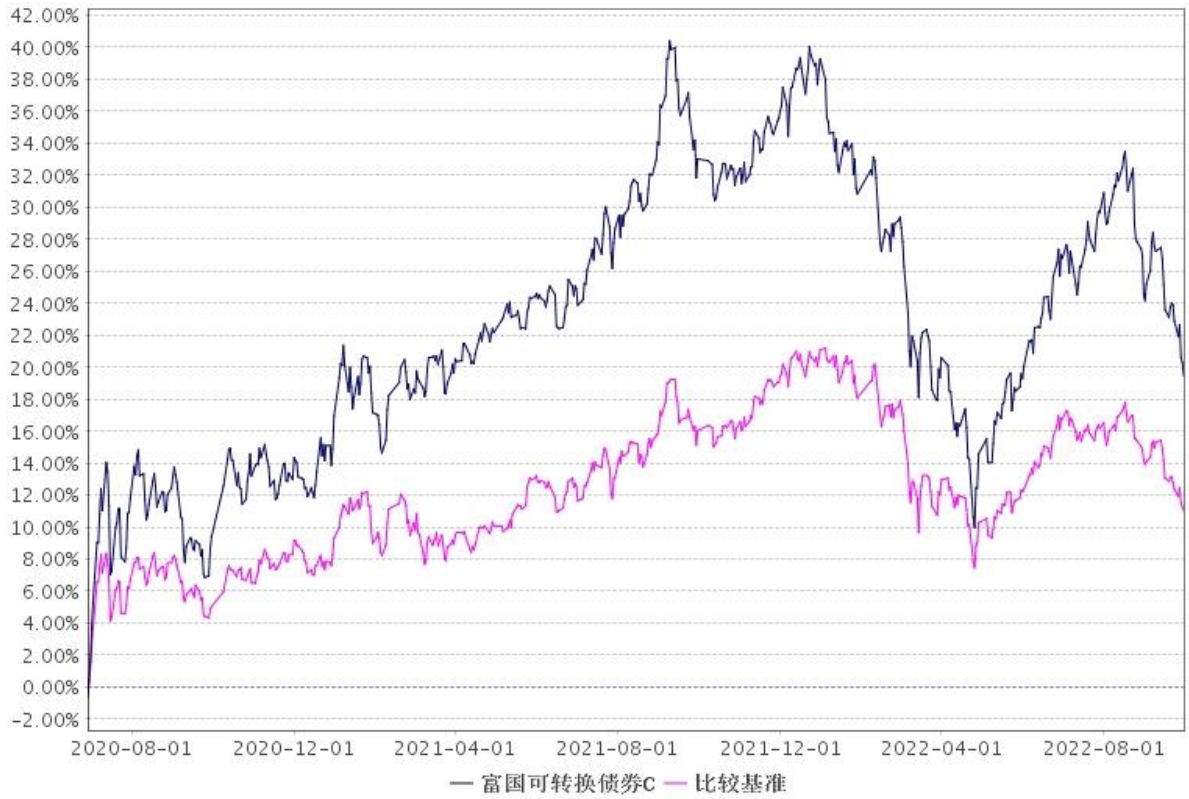
(1) 自基金合同生效以来富国可转换债券 A/B 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2022年9月30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2022年9月30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	—	9	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月起任富国久利稳健配置混合型证券投资基金基金经理；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2019年03月起任富国优化增强债券型证券投资基金基金经理；自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；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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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**

在经历了二季度强刺激政策下经济的快速复苏后，随着政策观察期中的缓释，经济基本面出现一定程度震荡。其中地产风险有所上升，特别是新房成交量有所下滑，土地出让面积下行速度较快，市场对经济基本面的未来担忧有所上升。此外，9月份之后，美联储超预期加息，美债利率和美元指数快速拉升，全球避险情绪迅速升温，此前相比较具有强势的人民币汇率在此期间也未能幸免，兑美元汇率连续冲破 7、7.1 两道关卡，资本项下流动性流出后，无论股债，流动性快速紧缩。货币市场利率从前期隔夜 1%以下水平攀升至 2%附近，权益市场成交量也从 8000 亿元稳态下滑至 5000 多亿元低位。

在多重因素影响下，权益和债券市场表现都是先扬后抑制。在其中组合考虑到权益市场整体估值水平不高，今年年内将进入上市公司盈利底部，未来有望迎接估值和盈利水平的双升，这种假设背景是基于更长维度的。但对于短期市场流动性紧缩的程度以及在部分利空干扰下所出现的市场调整幅度，是估计不足的。故在期间整体上组合并未降低自身的权益暴露，而主要以调结构为主。在调结构的方面，一是降低了前期涨幅较大的成长属性标的持仓，增加了明年业绩具有确

定增长性的建材、消费电子、家电等品种，二是在估值水平上做了少量切换，将部分业绩未来盈利可能难以持续维持上行格局，同时估值水平较高的标的进行减持，三是在转债配置上注重哑铃，平衡性品种，如绝对价格 110 至 125 之间的品种以减仓处理，增加低价和具有权益属性标的持仓。在结构调整后，目前组合标的更加注重中长期的增长确定性，当然可能短期波动也难以避免。

#### **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-5.92%，C 级为-5.94%，同期业绩比较基准收益率 A/B 级为-4.92%，C 级为-4.92%

#### **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	424,442,561.78	12.85
	其中：股票	424,442,561.78	12.85
2	固定收益投资	2,815,486,305.38	85.24
	其中：债券	2,815,486,305.38	85.24
	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	34,159,474.62	1.03
7	其他资产	28,899,399.49	0.87
8	合计	3,302,987,741.27	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	24,612,000.00	0.78
B	采矿业	—	—
C	制造业	370,862,793.51	11.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	9,153,760.00	0.29
F	批发和零售业	9,241,892.00	0.29
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	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	10,572,116.27	0.34
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	424,442,561.78	13.46

### 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	1,404,600	41,295,240.00	1.31
2	000301	东方盛虹	2,100,000	36,582,000.00	1.16
3	601865	福莱特	1,076,600	35,204,820.00	1.12
4	601636	旗滨集团	3,263,300	31,490,845.00	1.00
5	603678	火炬电子	712,378	27,483,543.24	0.87
6	300498	温氏股份	1,200,000	24,612,000.00	0.78
7	603305	旭升股份	581,598	21,030,583.68	0.67
8	603916	苏博特	1,212,473	20,042,178.69	0.64
9	300850	新强联	219,400	19,329,140.00	0.61
10	002859	洁美科技	779,400	18,775,746.00	0.60

### 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	159,579,074.03	5.06
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）	2,655,907,231.35	84.24
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,815,486,305.38	89.30

### 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	113044	大秦转债	959,210	106,413,706.21	3.38
2	113057	中银转债	854,110	99,421,586.44	3.15
3	019666	22 国债 01	910,590	92,535,652.66	2.93
4	128048	张行转债	639,728	77,024,478.08	2.44
5	127063	贵轮转债	488,103	59,790,919.17	1.90

## 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，江苏江阴农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会无锡监管分局的处罚。

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中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会青海监管局、国家外汇管理局上海市分局的处罚。

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	724,965.40
2	应收证券清算款	28,049,319.95
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	125,114.14
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	28,899,399.49

#### 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	113044	大秦转债	106,413,706.21	3.38
2	113057	中银转债	99,421,586.44	3.15
3	128048	张行转债	77,024,478.08	2.44
4	110059	浦发转债	58,335,788.71	1.85
5	113641	华友转债	53,898,048.24	1.71
6	128034	江银转债	53,823,528.48	1.71
7	127049	希望转 2	53,456,492.53	1.70
8	110085	通 22 转债	49,053,231.84	1.56
9	110053	苏银转债	48,269,714.61	1.53
10	127006	敖东转债	46,279,344.41	1.47
11	110079	杭银转债	45,700,743.33	1.45
12	128083	新北转债	42,268,531.70	1.34
13	113609	永安转债	41,619,337.84	1.32
14	128121	宏川转债	41,333,845.14	1.31
15	110067	华安转债	38,227,032.33	1.21
16	110068	龙净转债	37,185,225.12	1.18
17	127005	长证转债	36,860,443.18	1.17
18	128140	润建转债	36,603,872.55	1.16
19	127032	苏行转债	35,627,840.33	1.13
20	113598	法兰转债	35,193,393.81	1.12
21	132018	G 三峡 EB1	33,927,779.78	1.08
22	123060	苏试转债	33,399,038.73	1.06
23	110061	川投转债	32,940,632.01	1.04
24	113588	润达转债	32,653,404.02	1.04
25	123083	朗新转债	31,225,241.13	0.99
26	123127	耐普转债	30,724,401.01	0.97
27	113519	长久转债	30,186,037.28	0.96
28	111000	起帆转债	30,167,768.61	0.96
29	110084	贵燃转债	29,841,211.05	0.95
30	128109	楚江转债	29,278,265.11	0.93
31	128014	永东转债	28,600,471.77	0.91
32	123125	元力转债	28,583,813.30	0.91

33	128130	景兴转债	27,161,003.77	0.86
34	127038	国微转债	27,000,074.37	0.86
35	110083	苏租转债	26,897,835.72	0.85
36	113545	金能转债	26,862,218.12	0.85
37	123107	温氏转债	26,371,970.96	0.84
38	127040	国泰转债	26,258,018.28	0.83
39	113602	景20转债	26,054,455.94	0.83
40	113024	核建转债	25,765,351.07	0.82
41	128023	亚太转债	25,502,138.14	0.81
42	123114	三角转债	25,095,491.26	0.80
43	123087	明电转债	23,800,274.35	0.75
44	123091	长海转债	21,149,847.78	0.67
45	113629	泉峰转债	20,934,755.06	0.66
46	113534	鼎胜转债	20,080,800.08	0.64
47	127030	盛虹转债	19,966,615.63	0.63
48	127035	濮耐转债	19,606,003.96	0.62
49	123121	帝尔转债	19,472,800.79	0.62
50	123105	拓尔转债	18,888,482.52	0.60
51	128081	海亮转债	18,259,091.57	0.58
52	127028	英特转债	18,256,507.01	0.58
53	127036	三花转债	18,087,595.53	0.57
54	123046	天铁转债	17,709,977.40	0.56
55	113049	长汽转债	17,484,498.47	0.55
56	127022	恒逸转债	17,460,764.62	0.55
57	123057	美联转债	16,740,147.95	0.53
58	113054	绿动转债	15,999,396.91	0.51
59	127033	中装转2	15,957,616.44	0.51
60	123027	蓝晓转债	15,046,838.36	0.48
61	113051	节能转债	14,286,269.45	0.45
62	123132	回盛转债	14,208,568.77	0.45
63	128133	奇正转债	13,309,503.65	0.42
64	113637	华翔转债	12,963,513.47	0.41



65	127016	鲁泰转债	12,704,036.92	0.40
66	113582	火炬转债	12,573,479.85	0.40
67	110043	无锡转债	12,558,172.40	0.40
68	128135	洽洽转债	12,059,501.37	0.38
69	128119	龙大转债	11,923,615.54	0.38
70	113530	大丰转债	11,845,339.36	0.38
71	127031	洋丰转债	11,777,821.92	0.37
72	123088	威唐转债	11,704,770.90	0.37
73	110080	东湖转债	11,184,849.32	0.35
74	113628	晨丰转债	10,892,983.56	0.35
75	127050	麒麟转债	10,689,397.58	0.34
76	123103	震安转债	10,442,881.18	0.33
77	123118	惠城转债	10,347,782.12	0.33
78	127043	川恒转债	10,174,603.75	0.32
79	113050	南银转债	9,862,355.25	0.31
80	127047	帝欧转债	9,802,688.70	0.31
81	127020	中金转债	9,347,076.00	0.30
82	113048	晶科转债	8,957,830.01	0.28
83	118003	华兴转债	8,098,657.93	0.26
84	123077	汉得转债	7,390,417.58	0.23
85	113567	君禾转债	6,817,591.22	0.22
86	123078	飞凯转债	6,649,752.06	0.21
87	128095	恩捷转债	6,117,969.86	0.19
88	127007	湖广转债	6,102,239.73	0.19
89	123108	乐普转2	5,730,518.68	0.18
90	127012	招路转债	5,726,920.55	0.18
91	113046	金田转债	5,517,075.34	0.17
92	110077	洪城转债	5,470,207.92	0.17
93	128044	岭南转债	5,424,968.49	0.17
94	128116	瑞达转债	5,343,301.37	0.17
95	123048	应急转债	5,005,974.26	0.16
96	110055	伊力转债	4,750,701.47	0.15

97	113033	利群转债	4,572,172.16	0.15
98	128078	太极转债	4,451,134.45	0.14
99	132021	19中电EB	3,942,806.73	0.13
100	128087	孚日转债	3,921,997.31	0.12
101	123120	隆华转债	3,680,409.80	0.12
102	123075	贝斯转债	3,549,667.16	0.11
103	113579	健友转债	3,291,640.82	0.10
104	113549	白电转债	3,058,609.34	0.10
105	127026	超声转债	2,926,048.13	0.09
106	128071	合兴转债	2,889,607.24	0.09
107	123059	银信转债	2,823,158.49	0.09
108	113017	吉视转债	2,579,151.30	0.08
109	128108	蓝帆转债	2,519,692.73	0.08
110	123119	康泰转2	2,200,598.63	0.07
111	127056	中特转债	1,840,571.29	0.06
112	110075	南航转债	1,605,282.94	0.05
113	127037	银轮转债	1,566,844.25	0.05
114	113053	隆22转债	1,492,122.63	0.05
115	113045	环旭转债	1,162,624.93	0.04
116	113601	塞力转债	1,031,548.99	0.03
117	113542	好客转债	439,314.58	0.01
118	113505	杭电转债	113,314.55	0.00
119	113055	成银转债	98,485.09	0.00
120	123129	锦鸡转债	94,410.96	0.00
121	123080	海波转债	47,952.48	0.00
122	127042	嘉美转债	24,049.98	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	1,079,440,363.71	89,580,597.74
报告期期间基金总申购份额	1,428,125,357.37	21,494,718.79
减：报告期期间基金总赎回份额	1,045,752,077.39	22,357,724.38
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	1,461,813,643.69	88,717,592.15

## § 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	2022-07-01 至 2022-07-17	307,143,757.41	—	257,527,754.12	49,616,003.29	3.20%
	2	2022-07-19 至 2022-08-10; 2022-09-22 至 2022-09-30	71,111,518.23	775,242,474.08	488,491,712.73	357,862,279.58	23.08%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

## §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 10 月 26 日