

富国双债增强债券型证券投资基金

二〇二三年第3季度报告

2023年09月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2023年10月25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 2023 年 10 月 23 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 7 月 1 日起至 2023 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	7,640,291,355.02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,主要通过通过对可转债(含可分离交易可转债)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	6,923,502,000.69份	524,020,019.20份	192,769,335.13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07月01日-2023年09月30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	27,030,181.63	1,779,523.67	409,779.38
2. 本期利润	-33,395,361.90	-1,739,800.63	-1,884,630.32
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0045	-0.0024	-0.0128
4. 期末基金资产净值	7,161,644,007.38	537,695,474.87	199,335,650.52
5. 期末基金份额净值	1.0344	1.0261	1.0341

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。本产品自2023年8月4日起增加E类份额。

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	-0.37%	0.22%	-0.55%	0.15%	0.18%	0.07%
过去六个月	-1.23%	0.21%	-0.23%	0.15%	-1.00%	0.06%
过去一年	3.44%	0.23%	0.83%	0.18%	2.61%	0.05%
自基金合同生效起至今	11.36%	0.24%	2.94%	0.20%	8.42%	0.04%

(2) 富国双债增强债券 C

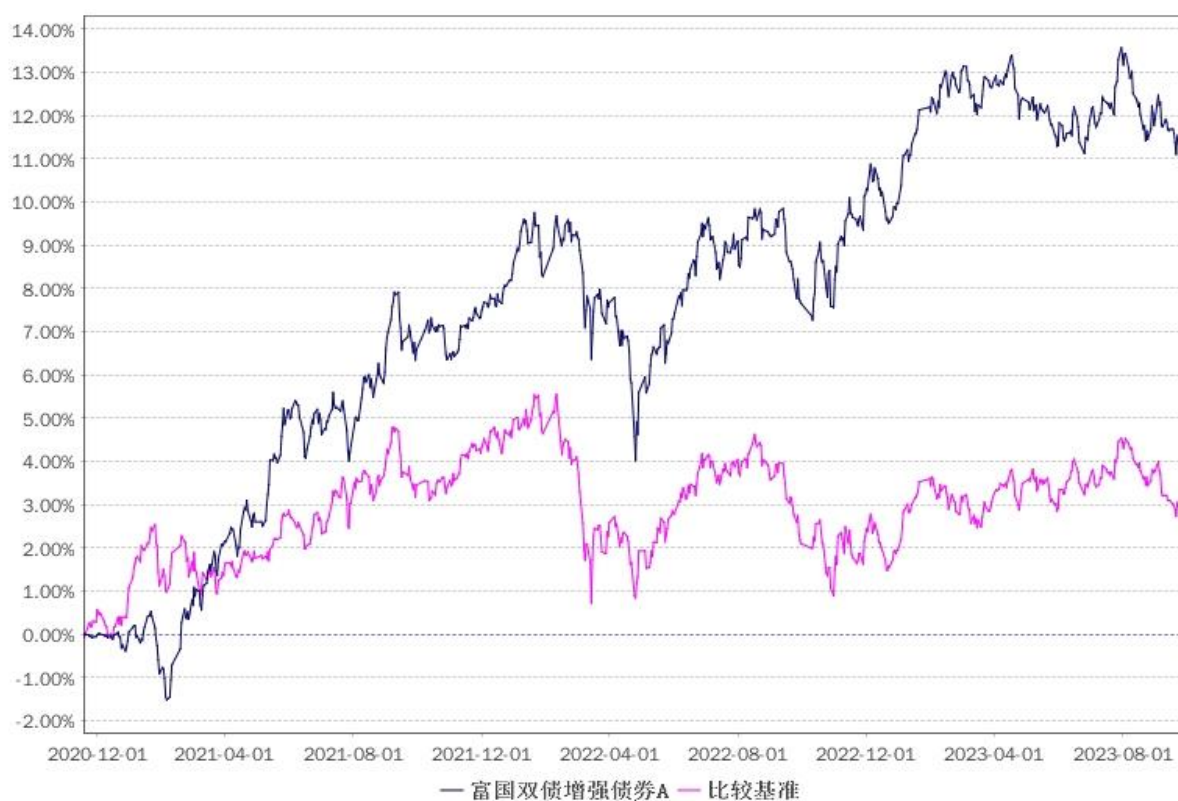
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.45%	0.22%	-0.55%	0.15%	0.10%	0.07%
过去六个月	-1.39%	0.21%	-0.23%	0.15%	-1.16%	0.06%
过去一年	3.12%	0.23%	0.83%	0.18%	2.29%	0.05%
自基金合同生效起至今	10.40%	0.24%	2.94%	0.20%	7.46%	0.04%

(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
自基金分级生效日起至今	-1.85%	0.22%	-1.52%	0.14%	-0.33%	0.08%

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

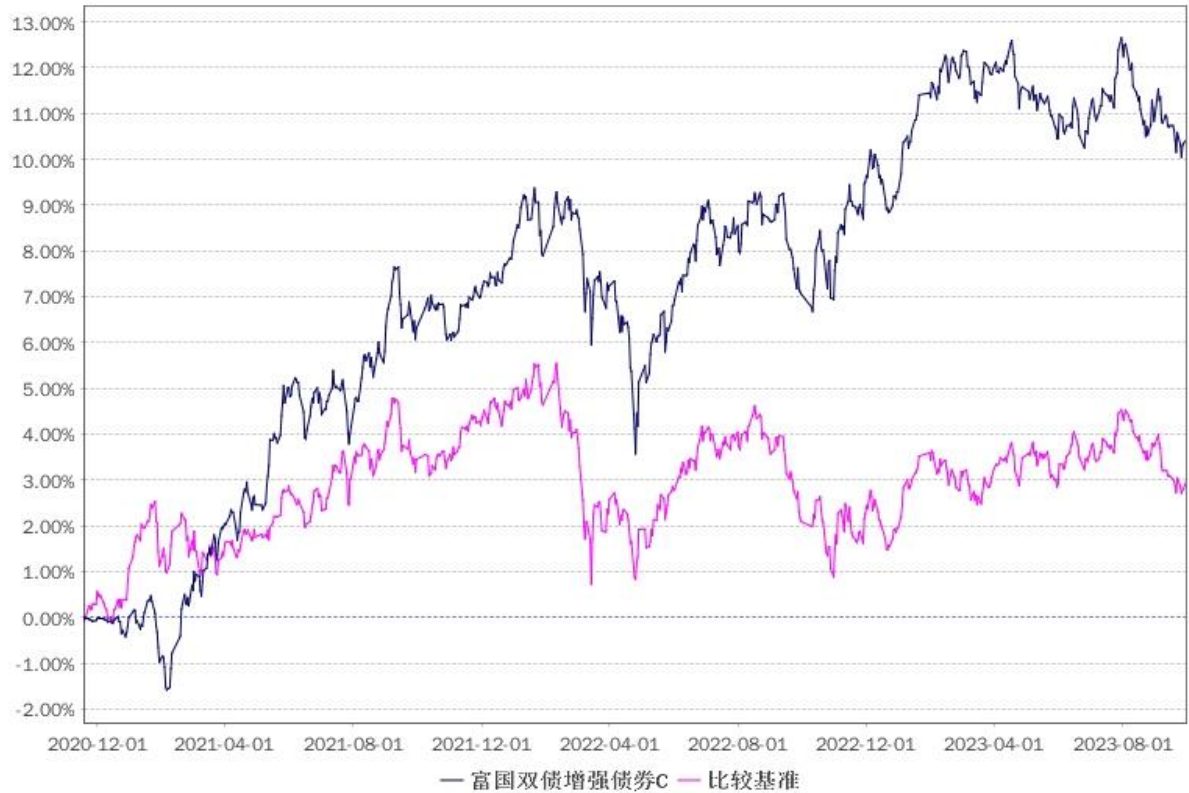
(1) 自基金合同生效以来富国双债增强债券 A 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为 2023 年 9 月 30 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。

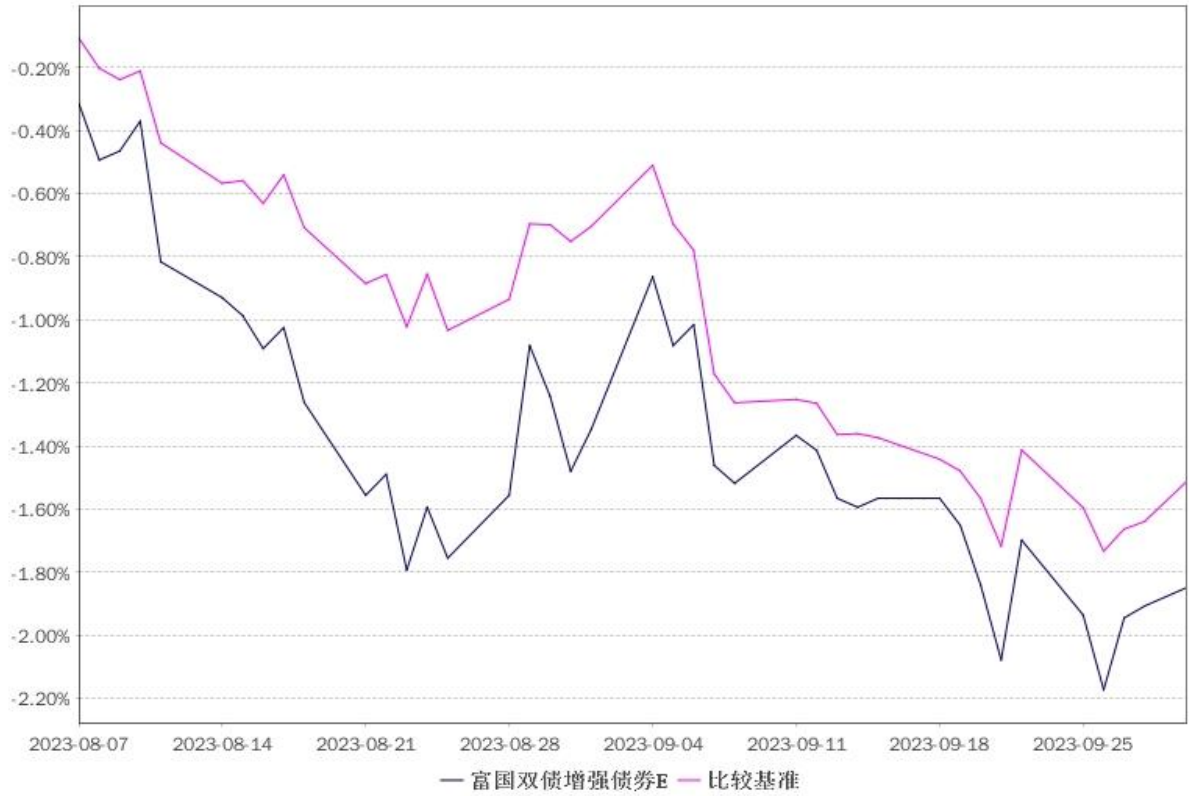
(2) 自基金合同生效以来富国双债增强债券 C 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为 2023 年 9 月 30 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 2023 年 9 月 30 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	—	16	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

经历了二季度的经济复苏趋缓后，国内宏观基本面在三季度逐步筑底企稳，部分消费及基建投资对经济形成支撑力量，地产投资及进出口则有一定拖累。另外，三季度以来高层对于将经济增速维持在合理水平的要求更为明确，包括地产、财税在内的一系列政策陆续推出，叠加部分产成品库存下行至较低水平，整体经济预期较前期有所改善。具体来看，制造业 PMI 自 5 月份触底后连续回升，并于 9 月重回荣枯线以上，其中生产分项拉动较为明显，新订单亦有所改善。工业增加值整体呈现区间波动的特征，趋势性不明显，边际上化学品制造及黑色金属冶炼等行业增速提升。居民消费方面，社消同比增速二季度在基数等因素影响下

回落较多，但7月之后也开始呈现筑底回升迹象，分项上看化妆品、通讯器材类近期表现较好。固定资产投资增速仍在下滑，基建与制造业投资有一定拉动，但地产投资依然未见好转。各地地产政策调整优化后，行业预期虽然有所改善，但实际效果可能需要较长时间方能显现。进出口方面，二季度增速下降较为明显，时至三季度边际改善，但同比仍在负值区间，部分机电产品表现较好。物价方面，CPI环比在三季度转正，同比则在零附近徘徊。PPI降幅逐步收窄，部分大宗品边际上行。基于以上经济运行情况，国内货币政策基调总体保持偏宽裕状态，银行间公开市场操作利率再次下调，同时配合地产政策下调了部分符合要求的房贷利率。海外市场方面，美国通胀及就业数据在三季度表现出较强韧性，市场开始进一步定价联储将利率维持在高位更长时间，10年期美国国债收益率继续上升。

在上述环境下，国内债券市场收益率三季度先下后上，曲线形态呈现扁平化趋势。信用债利差随收益率水平同样经历了先收缩后扩大的过程，中低评级城投债在再融资债发行的利好提振下利差整体有所下行。转债市场7月份在权益市场带动下表现较强，后逐步回落。权益市场受到政策预期提振，主要指数在季初有所反弹。但之后基本面弹性不大，叠加地产销售改善有限，市场再度承压下行。在投资策略上，本组合在三季度债券收益率下行过程中进一步降低了组合久期及杠杆。信用策略上仍主要配置高等级债券。转债投资上，保持中低仓位，关注部分结构性机会。权益仓位在市场下行过程中有所提升，综合考量公司资质、行业前景及估值等因素寻找性价比较高的投资标的，持续优化持仓结构。

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-0.37%，C 级为-0.45%，E 级为-1.85%，同期业绩比较基准收益率 A 级为-0.55%，C 级为-0.55%，E 级为-1.52%。

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	1,573,833,111.14	17.51
	其中：股票	1,573,833,111.14	17.51
2	固定收益投资	7,295,706,397.33	81.17
	其中：债券	7,295,706,397.33	81.17
	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	73,911,868.16	0.82
7	其他资产	44,565,504.14	0.50
8	合计	8,988,016,880.77	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 370,667,949.00 元，占资产净值比例为 4.69%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 201,543,015.00 元，占资产净值比例为 2.55%。

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	770,834,107.15	9.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,147,266.00	0.36
E	建筑业	83,784,386.12	1.06
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	26,873,830.00	0.34
H	住宿和餐饮业	19,830,506.67	0.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,093,700.00	0.19
J	金融业	45,223,108.00	0.57
K	房地产业	11,835,243.20	0.15
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	1,001,622,147.14	12.68

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	205,312,321.00	2.60
非日常生活消费品	88,353,118.00	1.12
日常消费品	61,731,895.00	0.78
房地产	45,122,710.00	0.57
工业	43,623,700.00	0.55
信息技术	40,437,760.00	0.51
金融	34,056,960.00	0.43
原材料	30,933,000.00	0.39
公用事业	22,639,500.00	0.29
合计	572,210,964.00	7.24

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	15,624,000	82,338,480.00	1.04
2	300450	先导智能	2,813,988	76,596,753.36	0.97
3	601615	明阳智能	4,510,400	71,174,112.00	0.90
4	600372	中航机载	4,150,802	58,775,356.32	0.74
5	300481	濮阳惠成	3,189,000	57,370,110.00	0.73
6	002353	杰瑞股份	1,778,500	56,716,365.00	0.72
7	601238	广汽集团	3,260,997	32,642,579.97	0.41
7	02238	广汽集团	6,710,000	23,820,500.00	0.30
8	601231	环旭电子	3,569,600	52,080,464.00	0.66

9	000090	天健集团	7,747,452	46,949,559.12	0.59
10	002532	天山铝业	7,031,800	46,058,290.00	0.58

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	578,407,549.01	7.32
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,778,542,164.89	22.52
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	1,935,760,709.07	24.51
5	企业短期融资券	481,864,238.68	6.10
6	中期票据	788,701,370.44	9.99
7	可转债（可交换债）	1,732,430,365.24	21.93
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	7,295,706,397.33	92.37

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	5,522,930	600,981,637.76	7.61
2	113042	上银转债	2,634,020	287,288,953.16	3.64
3	220023	22 付息国债 23	1,500,000	152,325,287.67	1.93
4	113044	大秦转债	1,087,450	128,033,979.55	1.62
5	2128008	21 中国银行二级 01	1,200,000	126,153,508.20	1.60

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，上海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、国家金融监督管理总局重庆监管局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国泰君安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上海分行的处罚。

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	869,528.44
2	应收证券清算款	10,284,017.57
3	应收股利	3,380,013.38
4	应收利息	—
5	应收申购款	30,031,944.75
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	44,565,504.14

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	600,981,637.76	7.61
2	113042	上银转债	287,288,953.16	3.64
3	113044	大秦转债	128,033,979.55	1.62
4	113056	重银转债	55,195,926.49	0.70
5	110085	通22转债	49,800,465.50	0.63
6	113065	齐鲁转债	47,255,304.70	0.60
7	127040	国泰转债	44,230,666.26	0.56
8	113641	华友转债	33,741,479.66	0.43
9	123128	首华转债	33,169,927.46	0.42
10	113052	兴业转债	28,071,789.29	0.36
11	113046	金田转债	26,700,789.93	0.34

12	110089	兴发转债	24,783,793.63	0.31
13	113054	绿动转债	23,167,488.07	0.29
14	113647	禾丰转债	23,112,738.76	0.29
15	118031	天23转债	21,068,459.43	0.27
16	110086	精工转债	19,575,835.52	0.25
17	113584	家悦转债	16,607,054.26	0.21
18	127027	能化转债	15,192,689.17	0.19
19	128035	大族转债	14,598,625.38	0.18
20	110084	贵燃转债	13,044,139.34	0.17
21	113033	利群转债	12,950,235.40	0.16
22	127030	盛虹转债	12,347,629.65	0.16
23	110063	鹰19转债	11,819,212.00	0.15
24	128048	张行转债	11,367,435.90	0.14
25	118000	嘉元转债	10,798,443.28	0.14
26	113631	皖天转债	10,629,011.01	0.13
27	127045	牧原转债	9,497,549.46	0.12
28	123113	仙乐转债	8,506,480.58	0.11
29	128141	旺能转债	7,445,634.74	0.09
30	110079	杭银转债	7,216,560.49	0.09
31	110047	山鹰转债	6,942,720.70	0.09
32	127043	川恒转债	5,501,681.51	0.07
33	123117	健帆转债	5,473,393.73	0.07
34	123161	强联转债	5,413,733.86	0.07
35	113653	永22转债	4,905,042.59	0.06
36	127061	美锦转债	4,556,420.14	0.06
37	127031	洋丰转债	4,447,457.53	0.06
38	113037	紫银转债	4,399,382.19	0.06
39	128144	利民转债	4,202,915.01	0.05
40	132026	G三峡EB2	3,547,886.85	0.04
41	127068	顺博转债	3,285,172.60	0.04
42	118008	海优转债	3,237,230.14	0.04
43	113021	中信转债	2,659,464.20	0.03

44	113549	白电转债	2,459,241.10	0.03
45	128116	瑞达转债	2,372,898.90	0.03
46	113024	核建转债	2,354,880.43	0.03
47	127070	大中转债	2,192,925.14	0.03
48	110043	无锡转债	1,635,616.46	0.02
49	118013	道通转债	1,270,109.79	0.02
50	113058	友发转债	1,249,927.40	0.02
51	113618	美诺转债	1,136,698.63	0.01
52	118026	利元转债	710,011.43	0.01
53	123146	中环转 2	518,330.43	0.01
54	128129	青农转债	347,947.24	0.00
55	123169	正海转债	1,212.97	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	7,204,434,550.04	903,785,554.44	—
报告期期间基金总申购份额	786,762,110.09	103,060,267.50	203,013,474.76
报告期期间基金总赎回份额	1,067,694,659.44	482,825,802.74	10,244,139.63
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	6,923,502,000.69	524,020,019.20	192,769,335.13

注：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。

§ 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	949.13
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

单位：份

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	申购	2023-08-07	949.13	1,000.00	0.000%
合计			949.13	1,000.00	

注：E类基金份额不收取申购费

§ 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	2023-07-01 至 2023-09-30	2,034,422,913.29	—	490,000,000.00	1,544,422,913.29	20.21%
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>							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定自 2023 年 8 月 4 日起，对本基金增加 E 类基金份额，并对本基金的基金合同及托管协议的相应条款进行修订。具体可参见基金管理人于 2023 年 8 月 1 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 E 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》及修订后的基金合同、托管协议。

二、本报告期内，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《富国双债增强债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，经与基金托管人协商一致，本基金管理人决定自 2023 年 9 月 19 日起，将基金管理费年费率由 0.70%调整为 0.65%，将基金托管费年费率由 0.16%调整为 0.12%，并相应修改基金合同和其他法律文件相关内容。具体可参见基金管理人于 2023 年 9 月 16 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国双债增强债券型证券投资基金调整费率并修改基金合同等事项的公告》及修改后的基金合同、托管协议、招募说明书、基金产品资料概要。

§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
2023 年 10 月 25 日