

富国稳健增强债券型证券投资基金

二〇二二年第1季度报告

2022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

送出日期：2022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 2022 年 4 月 20 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 1 月 1 日起至 2022 年 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | | |
|-----------------------|--|------------|------------------|
| 基金简称 | 富国稳健增强债券 | | |
| 基金主代码 | 000107 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2013年05月21日 | | |
| 报告期末基金份额总额（单位：份） | 14,219,844,551.38 | | |
| 投资目标 | 本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，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 | <p>本基金将采用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。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例；在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整，并把信用产品投资和回购交易结合起来，将回购套利策略作为本基金重要的操作策略之一。另外，本基金对股票的选择将运用“价值为本，成长为重”的合理价格成长投资策略来确定具体选股标准；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。</p> | | |
| 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 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 富国稳健增强债券 A/B | 富国稳健增强债券 C | |
| 下属分级基金的交易代码 | 前端 | 后端 | 000109 |
| | 000107 | 000108 | |
| 报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份） | 12,419,153,430.35 | | 1,800,691,121.03 |

§ 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 | 富国稳健增强债券 A/B 报告期(2022年01月01日-2022 年03月31日) | 富国稳健增强债券 C 报告期(2022年01月01日 -2022年03月31日) |
|-----------------|--|--|
| 1. 本期已实现收益 | 71,721,726.38 | 10,059,103.63 |
| 2. 本期利润 | -119,865,013.15 | -22,454,313.60 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0120 | -0.0140 |
| 4. 期末基金资产净值 | 15,483,010,838.19 | 2,193,543,540.93 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.247 | 1.218 |

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) 富国稳健增强债券 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 | -0.40% | 0.20% | -1.42% | 0.16% | 1.02% | 0.04% |
| 过去六个月 | 1.36% | 0.17% | -0.72% | 0.13% | 2.08% | 0.04% |
| 过去一年 | 5.02% | 0.17% | 0.13% | 0.12% | 4.89% | 0.05% |
| 过去三年 | 17.94% | 0.17% | 4.14% | 0.13% | 13.80% | 0.04% |
| 过去五年 | 31.12% | 0.15% | 8.51% | 0.13% | 22.61% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 75.93% | 0.17% | 23.62% | 0.12% | 52.31% | 0.05% |

(2) 富国稳健增强债券 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益 | 业绩比较基准收益率标 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|----------|----------|------------|-----|-----|
|----|--------|----------|----------|------------|-----|-----|

| | | ② | 率③ | 准差④ | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.49% | 0.22% | -1.42% | 0.16% | 0.93% | 0.06% |
| 过去六个月 | 1.14% | 0.17% | -0.72% | 0.13% | 1.86% | 0.04% |
| 过去一年 | 4.62% | 0.18% | 0.13% | 0.12% | 4.49% | 0.06% |
| 过去三年 | 16.48% | 0.17% | 4.14% | 0.13% | 12.34% | 0.04% |
| 过去五年 | 28.37% | 0.16% | 8.51% | 0.13% | 19.86% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 69.42% | 0.17% | 23.62% | 0.12% | 45.80% | 0.05% |

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稳健增强债券 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 3 月 31 日。

2、本基金于 2013 年 5 月 21 日成立，建仓期 6 个月，从 2013 年 5 月 21 日起至 2013 年 11 月 20 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稳健增强债券 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3月31日。

2、本基金于2013年5月21日成立，建仓期6个月，从2013年5月21日起至2013年11月20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 | | |
| 俞晓斌 | 本基金基金经理 | 2019-03-13 | — | 14.8 | 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，历任高级交易员、资深交易员兼研究助理；现任富国 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>基金固定收益投资部固定收益基金经理。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，2017年11月至2020年4月任富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金（原富国天源平衡混合型证券投资基金，于2015年10月27日更名）、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年8月至2019年10月任富国优化增强债券型证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、富国颐利纯债债券型证券投资基金基金经理，2018年8月至2020年4月任富国臻选成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年12月至2020年4月任富国金融债债券型证券投资基金基金经理，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，2019年3月至2020年3月任富国新优享灵活配置混合型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019年3月至2020年4月任富国收益增强债券型证券投资基金、富</p> |
|--|--|--|--|--|

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2019年3月至2020年6月任富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金基金经理，2019年3月起任富国天盈债券型证券投资基金（LOF）、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，于2016年1月19日更名）基金经理，2019年5月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2019年5月至2020年6月任富国新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年6月至2020年7月任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2019年5月至2021年8月任富国新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年6月至2022年1月任富国科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年6月至2019年9月任富国新优选灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 经理,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,2021年6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。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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国稳健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》、《富国稳健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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现2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

2022年一季度，国内宏观经济较去年四季度有些许改善迹象，但“需求收缩、供给冲击、预期转弱”的三重压力尚未根本扭转，且出现了部分新的风险因素，基本面筑底回升的过程可能会更为曲折复杂。从经济各分项看，出口维持高增，消费相对疲软。投资中，基建增速在积极财政政策定调下开始上行，制造业投资相对景气，房地产投资继续下行。数据方面，中采PMI在1-2月运行于荣枯线上方，但3月受到国内局部疫情影响有所回落。工业增加值较去年4季度明显改善，或主要受益于上游供给约束边际缓解。地产投资方面，1-2月销售增速仍旧下滑，土地购置同比也依然在负值区间，整体回升尚需时日。基建投资增速较去年明显加快，水利、信息传输及道路运输投资等均有所改善。制造业投资维持

较快增长，其中装备及消费品制造投资更为突出。消费方面，1-2月社会消费品零售同比增速6.7%，整体情况平稳。但3月以来，多地疫情反弹力度较大，后续收入预期及消费信心或在一定时期内受到影响。外贸方面，进出口增速在一季度稍有回落，但绝对水平仍较高。金融数据方面，1月份社融及信贷规模表现亮眼，2月稍显疲弱。人民银行于1月下调OMO利率，1年和5年LPR利率也有所下行。在更加积极有为货币政策定调下，后续宽信用过程大概率延续。物价方面，1-2月CPI环比涨幅略有扩大，同比涨幅总体平稳。PPI同比涨幅有所回落，但受制于产能投放及地缘政治因素，原油、有色金属等国际大宗商品价格仍维持高位。海外市场方面，一季度欧美发达经济体通胀预期上行，消费者信心边际转弱。在高企通胀压力下，主要央行均释放偏鹰信号，紧缩节奏加快。美债收益率快速上行，且曲线形态进一步平坦。突发地缘政治风险进一步加剧了上游资源品价格上涨的预期，影响全球供应链和经贸环境稳定，市场开始下调今年全球经济增长预期。

在上述环境下，国内债券市场一季度收益率先下后上，而后进入区间震荡。总体上，利率债表现相较信用债更为稳定，曲线短端表现优于中长端。市场对于短期货币政策偏宽松及中期宽信用将见效的预期较为一致。权益市场，一季度总体表现不佳。上游资源品及稳增长相关行业板块表现较好，而静态估值较高或者与消费相关性较大的板块跌幅较大。市场在全球流动性趋紧环境及短期业绩确定性上寻找最优解。转债市场，在股票市场下跌及本身估值偏高的双重压制下，一季度表现同样疲弱。债性品种受益于更好的抗跌性，有相对收益。

在投资操作上，本组合在1季度前期纯债维持中高久期，中后期降至中性久期，保持中低杠杆水平。信用策略上，主要配置高等级债券。转债投资上，维持低仓位，等待转债估值回归合理水平。股票前期维持中性偏低仓位，后随着市场调整适当增加部分性价比较为突出的标的，行业上也更为均衡，坚持价值投资取向。

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-0.40%，C级为-0.49%，同期业绩比较基准收益率A/B级为-1.42%，C级为-1.42%

4.6 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 | 2,158,986,684.39 | 11.88 |
| | 其中：股票 | 2,158,986,684.39 | 11.88 |
| 2 | 固定收益投资 | 15,664,453,584.01 | 86.21 |
| | 其中：债券 | 15,664,453,584.01 | 86.21 |
| | 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 | 246,765,903.26 | 1.36 |
| 7 | 其他资产 | 100,553,441.90 | 0.55 |
| 8 | 合计 | 18,170,759,613.56 | 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 | 97,329,600.00 | 0.55 |
| C | 制造业 | 1,668,763,778.12 | 9.44 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,875,345.02 | 0.02 |
| E | 建筑业 | — | — |
| F | 批发和零售业 | — | — |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 24,773,430.00 | 0.14 |
| H | 住宿和餐饮业 | — | — |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 20,800,000.00 | 0.12 |
| J | 金融业 | 285,728,563.25 | 1.62 |

| | | | |
|---|---------------|------------------|-------|
| K | 房地产业 | 37,195,968.00 | 0.21 |
| L | 租赁和商务服务业 | — | — |
| M | 科学研究和技术服务业 | 21,520,000.00 | 0.12 |
| 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 | 2,158,986,684.39 | 12.21 |

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 | 600582 | 天地科技 | 29,140,409 | 143,079,408.19 | 0.81 |
| 2 | 300463 | 迈克生物 | 4,985,626 | 122,596,543.34 | 0.69 |
| 3 | 300003 | 乐普医疗 | 5,782,208 | 116,627,135.36 | 0.66 |
| 4 | 600028 | 中国石化 | 22,530,000 | 97,329,600.00 | 0.55 |
| 5 | 002595 | 豪迈科技 | 4,697,000 | 90,793,010.00 | 0.51 |
| 6 | 601601 | 中国太保 | 3,567,215 | 81,760,567.80 | 0.46 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 1,564,000 | 75,775,800.00 | 0.43 |
| 8 | 600352 | 浙江龙盛 | 6,885,800 | 75,055,220.00 | 0.42 |
| 9 | 002013 | 中航机电 | 5,800,000 | 62,756,000.00 | 0.36 |
| 10 | 000513 | 丽珠集团 | 1,477,522 | 56,884,597.00 | 0.32 |

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 | 2,776,187,634.25 | 15.71 |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | 3,396,405,251.37 | 19.21 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,596,948,815.07 | 9.03 |
| 4 | 企业债券 | 3,359,229,579.53 | 19.00 |
| 5 | 企业短期融资券 | 3,735,892,589.00 | 21.13 |
| 6 | 中期票据 | 1,727,634,898.62 | 9.77 |

| | | | |
|----|-----------|-------------------|-------|
| 7 | 可转债（可交换债） | 551,026,393.57 | 3.12 |
| 8 | 同业存单 | 118,077,237.67 | 0.67 |
| 9 | 其他 | — | — |
| 10 | 合计 | 15,664,453,584.01 | 88.62 |

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 | 210017 | 21 付息国债 17 | 11,200,000 | 1,138,925,524.86 | 6.44 |
| 2 | 210205 | 21 国开 05 | 6,400,000 | 666,757,435.62 | 3.77 |
| 3 | 210210 | 21 国开 10 | 4,700,000 | 492,673,057.53 | 2.79 |
| 4 | 019641 | 20 国债 11 | 4,034,900 | 410,917,421.81 | 2.32 |
| 5 | 1928037 | 19 交通银行 02 | 4,000,000 | 406,281,315.07 | 2.30 |

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，国家开发银行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的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通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、中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业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福建省分局、中国银行保险监督管理委员会的处罚。

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 | 764,544.90 |
| 2 | 应收证券清算款 | 74,925,280.90 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | — |
| 5 | 应收申购款 | 24,863,616.10 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 其他 | — |
| 8 | 合计 | 100,553,441.90 |

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 | 132015 | 18 中油 EB | 57,688,822.38 | 0.33 |
| 2 | 113011 | 光大转债 | 36,250,366.54 | 0.21 |
| 3 | 127021 | 特发转 2 | 10,300,726.55 | 0.06 |
| 4 | 128123 | 国光转债 | 8,920,567.91 | 0.05 |
| 5 | 113563 | 柳药转债 | 8,023,513.05 | 0.05 |
| 6 | 113043 | 财通转债 | 7,733,829.30 | 0.04 |
| 7 | 113623 | 凤 21 转债 | 7,164,907.55 | 0.04 |
| 8 | 110063 | 鹰 19 转债 | 6,766,342.57 | 0.04 |
| 9 | 123113 | 仙乐转债 | 6,435,853.15 | 0.04 |
| 10 | 123076 | 强力转债 | 6,360,255.75 | 0.04 |
| 11 | 123101 | 拓斯转债 | 6,269,004.56 | 0.04 |
| 12 | 127017 | 万青转债 | 6,113,857.53 | 0.03 |
| 13 | 128116 | 瑞达转债 | 5,462,395.29 | 0.03 |
| 14 | 113033 | 利群转债 | 5,447,500.00 | 0.03 |
| 15 | 113042 | 上银转债 | 5,237,286.30 | 0.03 |
| 16 | 127022 | 恒逸转债 | 4,197,181.29 | 0.02 |
| 17 | 110068 | 龙净转债 | 4,167,725.19 | 0.02 |
| 18 | 113044 | 大秦转债 | 3,312,211.50 | 0.02 |
| 19 | 123117 | 健帆转债 | 2,772,516.88 | 0.02 |
| 20 | 113604 | 多伦转债 | 2,688,520.87 | 0.02 |
| 21 | 113606 | 荣泰转债 | 2,293,872.69 | 0.01 |
| 22 | 127016 | 鲁泰转债 | 1,792,911.75 | 0.01 |
| 23 | 128131 | 崇达转 2 | 1,731,731.46 | 0.01 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 24 | 113542 | 好客转债 | 1,725,477.73 | 0.01 |
| 25 | 110057 | 现代转债 | 1,351,200.20 | 0.01 |
| 26 | 127012 | 招路转债 | 897,314.14 | 0.01 |
| 27 | 110060 | 天路转债 | 776,474.92 | 0.00 |
| 28 | 128105 | 长集转债 | 582,748.52 | 0.00 |
| 29 | 123049 | 维尔转债 | 545,994.79 | 0.00 |
| 30 | 128133 | 奇正转债 | 366,213.69 | 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 | 富国稳健增强债券 A/B | 富国稳健增强债券 C |
|-------------------------------|-------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 4,393,210,333.28 | 702,314,186.82 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 9,190,302,418.68 | 1,982,925,254.37 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1,164,359,321.61 | 884,548,320.16 |
| 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 | 12,419,153,430.35 | 1,800,691,121.03 |

§ 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

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稳健增强债券型证券投资基金的文件
- 2、富国稳健增强债券型证券投资基金基金合同
- 3、富国稳健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、富国稳健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
 2022 年 04 月 22 日