

富国可转换债券证券投资基金

二〇二三年第4季度报告

2023年12月31日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2024年01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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 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 2023 年 10 月 1 日起至 2023 年 12 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	1,995,146,761.56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	富国可转换债券 E
下属分级基金的交易代码	前端	后端	009758
	100051	100052	
报告期末下属分级基金的份额总额	1,795,507,064.44份	123,971,650.93份	75,668,046.19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10月01日-2023年12月31日）		
	富国可转换债券 A/B	富国可转换债券 C	富国可转换债券 E
1. 本期已实现收益	-56,612,483.11	-3,694,556.73	-92,778.10
2. 本期利润	-100,744,048.97	-5,466,436.59	1,389,428.13
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0513	-0.0446	0.4879
4. 期末基金资产净值	3,510,930,525.21	240,801,349.52	147,840,822.78
5. 期末基金份额净值	1.955	1.942	1.954

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	-2.10%	0.62%	-2.88%	0.40%	0.78%	0.22%
过去六个月	-4.03%	0.57%	-3.74%	0.37%	-0.29%	0.20%
过去一年	-0.36%	0.59%	-1.21%	0.38%	0.85%	0.21%
过去三年	-1.46%	0.74%	-0.78%	0.49%	-0.68%	0.25%
过去五年	47.88%	0.77%	30.50%	0.54%	17.38%	0.23%
自基金合同生效起至今	95.50%	0.94%	36.44%	0.83%	59.06%	0.11%

(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	-2.17%	0.62%	-2.88%	0.40%	0.71%	0.22%
过去六个月	-4.15%	0.57%	-3.74%	0.37%	-0.41%	0.20%
过去一年	-0.56%	0.59%	-1.21%	0.38%	0.65%	0.21%

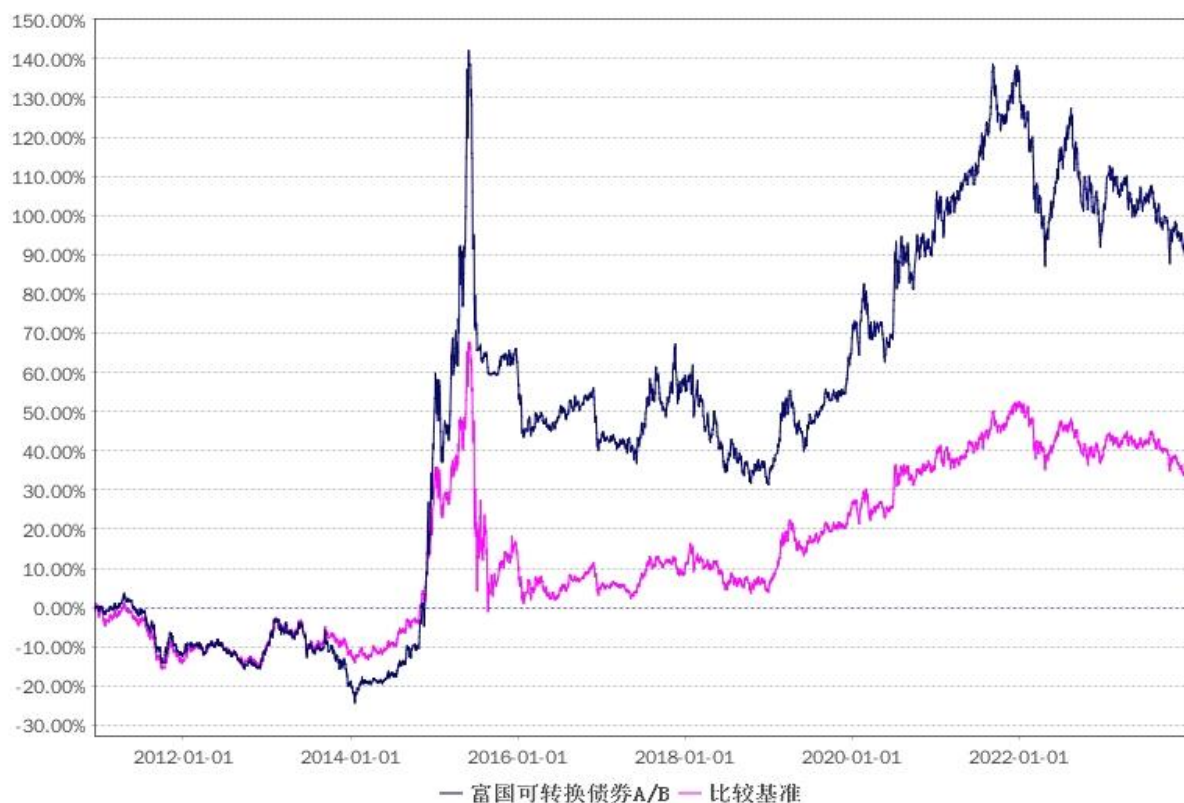
过去三年	-2.07%	0.74%	-0.78%	0.49%	-1.29%	0.25%
自基金分级 生效日起至 今	14.50%	0.80%	8.46%	0.52%	6.04%	0.28%

(3) 富国可转换债券 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	-2.15%	0.62%	-2.88%	0.40%	0.73%	0.22%
自基金分级 生效日起至 今	-1.16%	0.59%	-2.70%	0.39%	1.54%	0.20%

### 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

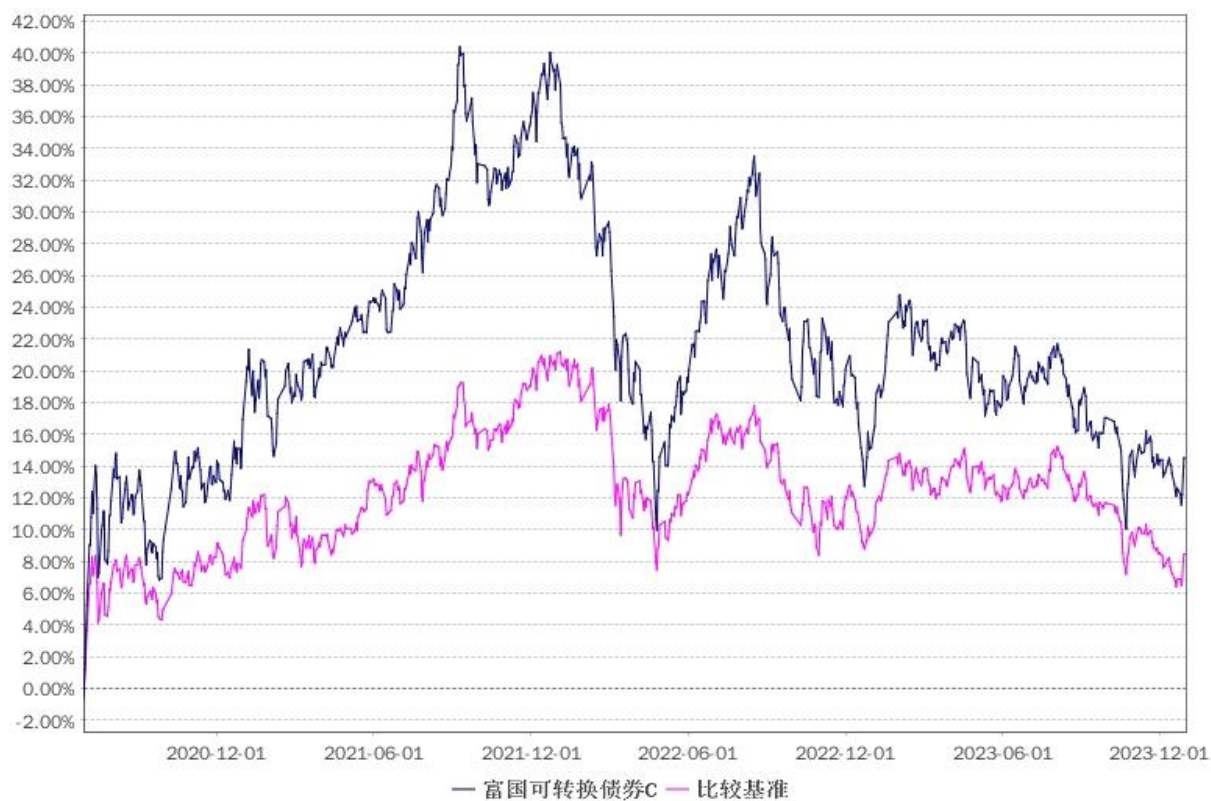
(1) 自基金合同生效以来富国可转换债券 A/B 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为 2023 年 12 月 31 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12月31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。

(3) 自基金E级份额生效以来富国可转换债券 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 12 月 31 日。

2、本基金自 2023 年 9 月 19 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		
张明凯	本基金现任基金经理	2019-03-19	—	11	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。
祝祯哲	本基金现任基金经理	2023-04-03	—	9	硕士，自2015年7月加入富国基金管理有限公司，历任组合管理助理、助理债券研究员、债券研究员、固定收益基



					金经理助理；现任富国基金固定收益策略研究部固定收益基金经理。自 2023 年 04 月起任富国可转换债券证券投资基金基金经理；自 2023 年 06 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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、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1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**

三季度经济在快速下行后小幅改善，但进入四季度后，经济增长动能再度边际转弱，增发国债对经济的拉动效果暂时有限。总体来看，在政策托底的情况下，2023年完成GDP增速目标压力不大。展望2024年，财政政策预计将继续发力，“三大工程”将会是稳增长的主要抓手，未来核心关注内需的修复弹性。同时需要关注的是当前实际利率偏高，货币政策未来也仍有发力的空间和必要性。

报告期内，股票和转债仓位调整增加了灵活度，组合波动率有效降低。行业

配置上，目前经济向上的弹性尚不清晰，逻辑上更偏好符合当前政策方向、基本面处于景气周期底部、行业具有需求弹性和估值弹性的优质个股投资机会，关注行业包括医药、电子、计算机、有色、汽车、消费等。转债配置结构上，增大了中低价优质转债的配置力度，着力提升组合非对称性。展望明年，转债整体转股溢价率和正股波动率有向上弹性，低价转债的转股溢价率将会继续分化，着力挖掘风险收益比更优秀的均衡型转债的投资机会。

#### **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-2.10%，C 级为-2.17%，E 级为-2.15%，同期业绩比较基准收益率 A/B 级为-2.88%，C 级为-2.88%，E 级为-2.88%。

#### **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	648,408,879.10	13.68
	其中：股票	648,408,879.10	13.68
2	固定收益投资	3,658,593,543.23	77.17
	其中：债券	3,658,593,543.23	77.17
	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	342,411,203.80	7.22
7	其他资产	91,369,603.18	1.93
8	合计	4,740,783,229.31	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	46,506,790.96	1.19
C	制造业	493,879,725.24	12.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
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	16,644,218.46	0.43
J	金融业	65,893,024.44	1.69
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	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	25,485,120.00	0.65
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	648,408,879.10	16.63

### 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	1,091,600	37,605,620.00	0.96
2	601899	紫金矿业	2,862,692	35,669,142.32	0.91
3	688311	盟升电子	688,010	35,095,390.10	0.90
4	601878	浙商证券	3,277,800	34,187,454.00	0.88
5	300088	长信科技	4,836,700	32,357,523.00	0.83
6	300790	宇瞳光学	1,669,000	27,154,630.00	0.70
7	601881	中国银河	2,196,700	26,470,235.00	0.68
8	002050	三花智控	884,600	26,007,240.00	0.67
9	003032	传智教育	1,769,800	25,485,120.00	0.65
10	300707	威唐工业	1,324,000	24,613,160.00	0.63

### 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	218,757,621.91	5.61
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）	3,439,835,921.32	88.21
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	3,658,593,543.23	93.82

### 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	1,354,810	157,606,420.67	4.04
2	113021	中信转债	883,680	99,197,631.55	2.54
3	110061	川投转债	474,940	85,798,483.53	2.20
4	127058	科伦转债	436,140	78,986,423.73	2.03
5	128083	新北转债	614,827	78,266,803.32	2.01

## 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，中信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	683,248.87
2	应收证券清算款	29,657,396.21
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	61,028,958.10
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	91,369,603.18

#### 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	157,606,420.67	4.04
2	113021	中信转债	99,197,631.55	2.54
3	110061	川投转债	85,798,483.53	2.20
4	127058	科伦转债	78,986,423.73	2.03
5	128083	新北转债	78,266,803.32	2.01
6	127086	恒邦转债	72,284,518.68	1.85

7	113615	金诚转债	70,760,928.84	1.81
8	110090	爱迪转债	66,353,116.33	1.70
9	128133	奇正转债	64,311,777.86	1.65
10	110077	洪城转债	61,775,048.68	1.58
11	127032	苏行转债	60,263,471.42	1.55
12	118028	会通转债	57,642,149.85	1.48
13	113058	友发转债	56,276,067.38	1.44
14	110092	三房转债	51,217,599.11	1.31
15	110079	杭银转债	50,683,973.90	1.30
16	113609	永安转债	47,821,440.40	1.23
17	123127	耐普转债	47,533,857.23	1.22
18	113648	巨星转债	47,417,404.60	1.22
19	127078	优彩转债	45,805,557.18	1.17
20	127027	能化转债	44,085,089.69	1.13
21	123150	九强转债	43,045,011.22	1.10
22	127043	川恒转债	43,033,184.17	1.10
23	123190	道氏转 02	41,938,531.94	1.08
24	110059	浦发转债	41,012,090.97	1.05
25	113060	浙 22 转债	40,619,487.24	1.04
26	123160	泰福转债	39,546,406.42	1.01
27	127049	希望转 2	39,159,452.06	1.00
28	127063	贵轮转债	38,839,781.99	1.00
29	111012	福新转债	38,792,646.66	0.99
30	113062	常银转债	38,253,551.13	0.98
31	128087	孚日转债	37,731,519.87	0.97
32	132018	G 三峡 EB1	37,244,950.38	0.96
33	123107	温氏转债	36,696,609.23	0.94
34	118016	京源转债	36,579,367.32	0.94
35	110067	华安转债	36,377,014.39	0.93
36	123198	金埔转债	35,623,034.35	0.91
37	113549	白电转债	35,384,843.35	0.91
38	123130	设研转债	33,209,962.52	0.85



39	113588	润达转债	31,889,061.97	0.82
40	111005	富春转债	31,661,488.84	0.81
41	128121	宏川转债	30,966,598.93	0.79
42	127012	招路转债	29,098,363.60	0.75
43	110093	神马转债	29,072,107.70	0.75
44	132026	G 三峡 EB2	28,748,186.38	0.74
45	123184	天阳转债	28,737,810.77	0.74
46	113664	大元转债	28,126,061.65	0.72
47	127070	大中转债	26,987,134.59	0.69
48	123156	博汇转债	26,673,743.76	0.68
49	128130	景兴转债	26,537,420.04	0.68
50	123169	正海转债	26,195,554.60	0.67
51	123063	大禹转债	25,107,231.96	0.64
52	128048	张行转债	24,315,384.89	0.62
53	110083	苏租转债	24,167,691.93	0.62
54	113066	平煤转债	24,095,904.71	0.62
55	113065	齐鲁转债	23,077,954.25	0.59
56	110085	通 22 转债	23,019,214.42	0.59
57	127016	鲁泰转债	22,633,674.65	0.58
58	123162	东杰转债	21,846,372.04	0.56
59	127018	本钢转债	21,008,957.63	0.54
60	110084	贵燃转债	20,444,038.09	0.52
61	113600	新星转债	20,352,503.14	0.52
62	128081	海亮转债	19,531,659.79	0.50
63	127087	星帅转 2	19,490,189.41	0.50
64	118030	睿创转债	19,121,702.83	0.49
65	123050	聚飞转债	18,710,825.31	0.48
66	123158	宙邦转债	18,519,525.05	0.47
67	110073	国投转债	18,379,961.28	0.47
68	127006	敖东转债	18,093,854.50	0.46
69	127022	恒逸转债	17,487,419.43	0.45
70	110045	海澜转债	17,464,427.42	0.45

71	113640	苏利转债	16,786,640.33	0.43
72	110074	精达转债	16,742,524.45	0.43
73	113669	景23转债	16,477,041.21	0.42
74	110068	龙净转债	16,218,307.75	0.42
75	113649	丰山转债	15,431,454.23	0.40
76	127020	中金转债	15,088,616.41	0.39
77	113524	奇精转债	14,660,807.82	0.38
78	127054	双箭转债	13,686,755.38	0.35
79	127050	麒麟转债	13,113,884.00	0.34
80	123147	中辰转债	12,653,485.47	0.32
81	127040	国泰转债	12,357,865.02	0.32
82	123146	中环转2	11,654,839.37	0.30
83	113056	重银转债	10,947,014.52	0.28
84	127053	豪美转债	10,528,169.59	0.27
85	123175	百畅转债	10,296,942.90	0.26
86	113647	禾丰转债	10,076,384.91	0.26
87	128042	凯中转债	9,952,880.96	0.26
88	128119	龙大转债	9,880,266.66	0.25
89	127039	北港转债	9,738,794.14	0.25
90	110075	南航转债	9,691,746.51	0.25
91	123167	商络转债	9,560,525.49	0.25
92	127035	濮耐转债	9,403,033.23	0.24
93	128144	利民转债	9,359,553.14	0.24
94	118034	晶能转债	9,248,197.85	0.24
95	128134	鸿路转债	8,655,931.08	0.22
96	113637	华翔转债	8,301,839.18	0.21
97	123168	惠云转债	8,227,355.40	0.21
98	110060	天路转债	8,085,874.39	0.21
99	113628	晨丰转债	7,756,325.02	0.20
100	127059	永东转2	7,193,546.30	0.18
101	113631	皖天转债	7,069,215.86	0.18
102	123193	海能转债	7,051,731.72	0.18

103	123096	思创转债	6,723,753.57	0.17
104	123059	银信转债	6,220,726.38	0.16
105	113051	节能转债	6,004,358.30	0.15
106	123153	英力转债	5,956,760.03	0.15
107	113024	核建转债	5,357,559.49	0.14
108	118003	华兴转债	5,303,700.82	0.14
109	113666	爱玛转债	5,301,257.53	0.14
110	118022	锂科转债	5,102,716.93	0.13
111	110063	鹰19转债	4,953,891.23	0.13
112	111011	冠盛转债	4,623,887.86	0.12
113	128066	亚泰转债	4,069,087.87	0.10
114	113033	利群转债	3,998,896.32	0.10
115	118029	富淼转债	3,796,876.83	0.10
116	110088	淮22转债	3,554,915.60	0.09
117	123149	通裕转债	3,444,110.96	0.09
118	127082	亚科转债	3,186,323.30	0.08
119	118027	宏图转债	3,151,090.25	0.08
120	123049	维尔转债	3,020,337.41	0.08
121	127060	湘佳转债	3,000,063.26	0.08
122	113602	景20转债	2,986,042.14	0.08
123	123151	康医转债	2,880,080.25	0.07
124	123179	立高转债	2,702,750.79	0.07
125	113665	汇通转债	2,349,719.07	0.06
126	123194	百洋转债	2,214,306.22	0.06
127	127075	百川转2	2,106,021.92	0.05
128	123173	恒锋转债	1,659,065.68	0.04
129	128141	旺能转债	1,564,331.25	0.04
130	113668	鹿山转债	1,561,810.13	0.04
131	113054	绿动转债	1,548,278.41	0.04
132	123085	万顺转2	1,396,316.98	0.04
133	111002	特纸转债	1,347,447.22	0.03
134	123174	精锻转债	1,098,881.88	0.03

135	111010	立昂转债	1,064,760.20	0.03
136	127068	顺博转债	1,033,567.40	0.03
137	123129	锦鸡转债	763,129.04	0.02
138	127042	嘉美转债	600,897.85	0.02
139	113663	新化转债	308,446.83	0.01
140	123191	智尚转债	249,711.59	0.01
141	127056	中特转债	185,943.21	0.00
142	111007	永和转债	102,415.89	0.00
143	113532	海环转债	61,948.11	0.00
144	123022	长信转债	20,021.42	0.00
145	113667	春23转债	13,263.07	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	富国可转换债券 E
报告期期初基金份额总额	2,147,786,094.8 8	126,267,696.82	1,008,574.44
报告期期间基金总申购份额	604,565,398.42	10,521,888.27	76,849,785.72
报告期期间基金总赎回份额	956,844,428.86	12,817,934.16	2,190,313.97
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	1,795,507,064.4 4	123,971,650.93	75,668,046.19

## § 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	505.82
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	505.82
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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，经基金管理人董事会七届一次会议审议通过并按规定备案，李强先生自 2023 年 11 月 22 日起担任首席信息官，同日起林志松先生不再兼任首席信息官。具体可参见基金管理人于 2023 年 11 月 23 日发布的《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

## §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  
2024 年 01 月 22 日