富国双利增强债券型证券投资基金

二 0 二六年第 3 季度报告

2026 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： 兴业银行股份有限公司

报告送出日期： 2026 年 10 月 27 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 7 月 1 日起至 2026 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	富国双利增强债券		
基金主代码	012746		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021 年 10 月 14 日		
报告期末基金份额总额	9,585,535,912.35 份		
投资目标	本基金在保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。		
投资策略	本基金采取稳健灵活的投资策略，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。在资产配置方面，本基金采取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。在债券投资方面，本基金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。在股票投资方面，本基金将精选基本面良好、有长期投资价值的优质企业。本基金的动态收益增强策略、存托凭证投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略详见法律文件。		
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×85%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+沪深 300 指数收益率×10%		
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	兴业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	富国双利增强债券 A	富国双利增强债券 C	富国双利增强债券 E
下属分级基金的交易代码	012746	012747	024731
报告期末下属分级基金的份额总额	1,760,121,977.08 份	2,747,542,754.33 份	5,077,871,180.94 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（2026 年 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日）		
	富国双利增强债券 A	富国双利增强债券 C	富国双利增强债券 E
1.本期已实现收益	-14,384,701.76	-25,043,130.66	-45,103,064.07
2.本期利润	-65,520,145.64	-120,253,841.61	-199,883,934.45
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0388	-0.0425	-0.0396
4.期末基金资产净值	1,997,070,893.95	3,099,820,150.60	5,762,723,876.85
5.期末基金份额净值	1.1346	1.1282	1.1349

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）富国双利增强债券 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	-3.47%	0.44%	-0.52%	0.15%	-2.95%	0.29%
过去六个月	3.22%	0.43%	0.71%	0.16%	2.51%	0.27%
过去一年	6.61%	0.42%	0.08%	0.15%	6.53%	0.27%
过去三年	19.41%	0.35%	8.74%	0.16%	10.67%	0.19%
自基金合同生效起至今	13.46%	0.33%	7.19%	0.17%	6.27%	0.16%

（2）富国双利增强债券 C

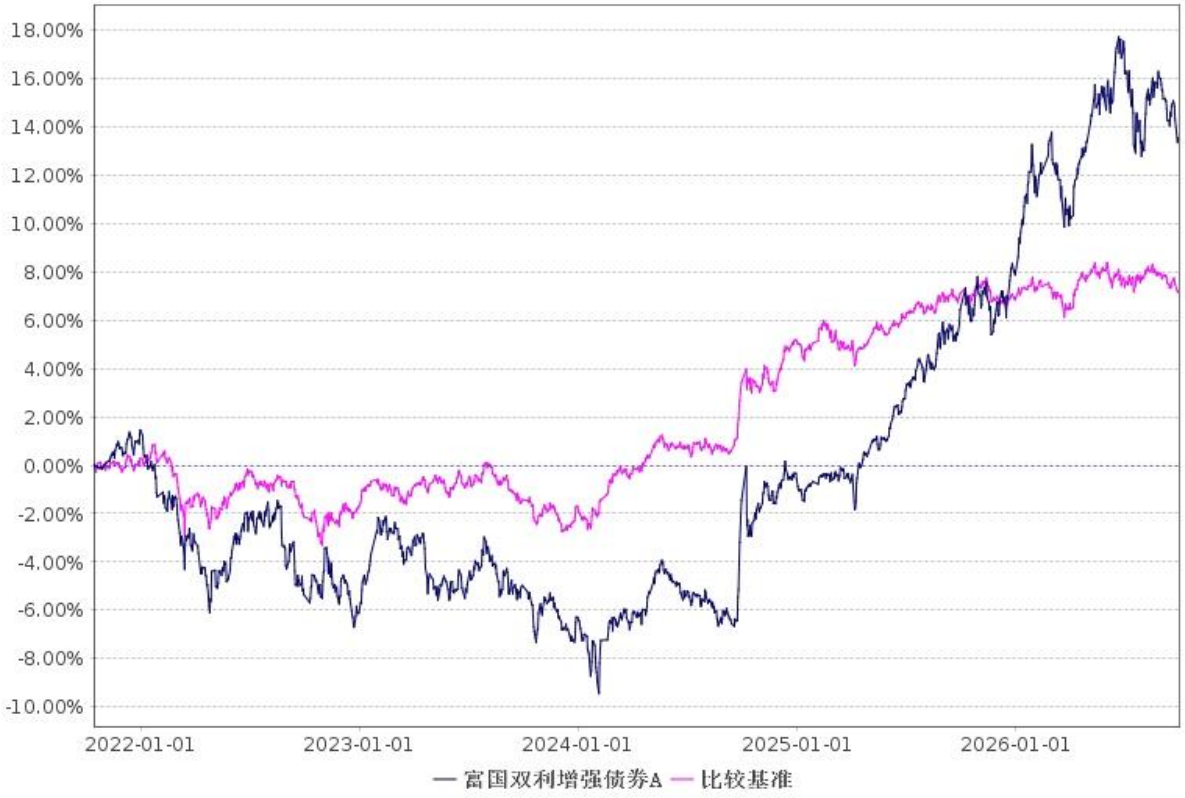
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.47%	0.44%	-0.52%	0.15%	-2.95%	0.29%
过去六个月	3.22%	0.43%	0.71%	0.16%	2.51%	0.27%
过去一年	6.59%	0.42%	0.08%	0.15%	6.51%	0.27%
过去三年	19.37%	0.35%	8.74%	0.16%	10.63%	0.19%
自基金合同生效起至今	12.82%	0.33%	7.19%	0.17%	5.63%	0.16%

（3）富国双利增强债券 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	-3.47%	0.44%	-0.52%	0.15%	-2.95%	0.29%
过去六个月	3.22%	0.43%	0.71%	0.16%	2.51%	0.27%
过去一年	6.57%	0.42%	0.08%	0.15%	6.49%	0.27%
自基金分级生效日起至今	9.94%	0.39%	0.88%	0.15%	9.06%	0.24%

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） 富国双利增强债券 A



注：1、截止日期为 2026 年 9 月 30 日。

（2） 富国双利增强债券 C



注：1、截止日期为 2026 年 9 月 30 日。

（3） 富国双利增强债券 E



注：1、截止日期为 2026 年 9 月 30 日。

2、本基金自 2025 年 7 月 2 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		
张育浩	本基金现任基金经理	2025-02-26	—	9	硕士，曾任 IHS Markit 宏观经济学家，Goldenwise Capital 首席经济学家，西部证券股份有限公司宏观首席分析师；自 2021 年 7 月加入富国基金管理有限公司，自 2021 年 12 月起历任固定收益基金经理、高级固定收益基金经理；现任富国基金固定收益投资部研究总监兼高级固定收益基金经理。自 2021 年 12 月起任富国悦享回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 月起任富国稳健双盈债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2025 年 02 月起任富国双利增强债券型证券投资基金基金经理；自 2025 年 11 月起任富国稳健添利债券型证券投资基金基金经理；自 2025 年 11 月起任富国兴享回报 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；自 2025 年 11 月起任富国优化增强债券型证券投资基金基金经理；自 2026 年 09 月起任富国嘉裕债券型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
朱晨杰	本基金前任基	2023-09-08	2026-09-03	13	硕士，曾任法国兴业银行（巴黎）交

	金经理				易助理，海通证券股份有限公司债券销售、交易岗，平安证券股份有限公司自营交易员，中欧基金管理有限公司基金经理、投资经理，工银瑞信基金管理有限公司基金经理、投资经理；自 2022 年 2 月加入富国基金管理有限公司，自 2022 年 6 月起历任固定收益投资经理；现任富国基金固定收益投资部固定收益基金经理。自 2023 年 06 月起任富国腾享回报 6 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2024 年 08 月起任富国稳健双鑫债券型证券投资基金基金经理；自 2024 年 12 月起任富国可转换债券证券投资基金基金经理；自 2025 年 10 月起任富国稳健添荣债券型证券投资基金基金经理；自 2025 年 10 月起任富国稳进回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；自 2025 年 12 月起任富国稳健双景债券型证券投资基金基金经理；自 2026 年 01 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 2026 年 05 月起任富国稳健添颐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利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》、《富国双利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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和相关法规要求，制定了《证券投资公平交易管理办法》，保证公司旗下不同投资组合在系统控制、日常操作层面享有公平的交易机会，并保持各投资组合的独立投资决策权。

本报告期内公司旗下基金严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，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。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间，出现 11 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，为投资组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平对待投资组合或利益输送等情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年第三季度，国内经济运行总体保持平稳，政策托底与新动能扩张继续对经济增长形成支撑，但供强需弱、结构分化的特征仍较突出。从供给端看，高技术制造、人工智能相关产业链、先进装备及出口导向型行业延续较高景气度，制造业景气在季末有所修复；从需求端看，出口仍具韧性，消费呈低位企稳态势，房地产投资及部分传统行业资本开支仍然偏弱，内生需求修复基础有待进一步巩固。价格层面，能源及部分工业品价格上涨带动生产端价格回升，但向居民消费端的传导相对有限，反映出本轮价格修复更多具有输入性和结构性特征。

政策层面，财政政策继续通过政府债券发行、重点项目建设和产业支持措施稳定需求；货

币政策维持适度宽松，更加突出逆周期调节、总量与结构性工具协同以及政策传导效率。9 月底，中国人民银行下调抵押补充贷款（PSL）利率，扩大 PSL 支持范围，增加科技创新和技术改造再贷款、支农支小再贷款额度；财政部会同中国人民银行、金融监管总局公布居民购房贷款贴息政策。

海外方面，能源价格波动、地缘冲突及经贸摩擦使全球供应链和通胀路径面临较大不确定性，部分经济体的通胀黏性仍然较强。9 月，美联储将联邦基金利率目标区间上调 25 个基点，全球利率中枢维持偏高水平，无风险利率上行压力持续影响资产估值、企业融资成本及跨境资本流动。总体而言，海外经济增长、通胀与货币政策之间的平衡难度上升，外部环境对国内金融市场的扰动较二季度进一步增强。

本组合三季度立足宏观流动性、产业景气周期与海内外地缘风险三个维度，动态调整股债大类资产配置比例。权益端均衡把握高景气成长主线与低位价值修复机会，固收端持续优化久期结构。展望后续运作，本组合将继续强化自上而下的宏观周期研判与自下而上的个股基本面研究相结合的投研框架，灵活调整大类资产配置比例。权益端将围绕产业景气度、盈利兑现能力和估值匹配度进行均衡配置，同时结合市场风格再平衡，积极挖掘低位板块的修复机会。固收端将以获取稳健票息收益和控制净值波动为主要目标，在资金面总体合理充裕的背景下，短端资产仍具备较好的流动性管理价值；长端利率受到经济弱修复、政府债券供给、输入性通胀及市场预期反复等因素影响，本组合将控制长久期资产的波动风险，并积极把握阶段性交易机会。总体而言，本组合力争长期为持有人创造稳健、可持续的投资回报。

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情况：富国双利增强债券 A 为-3.47%，富国双利增强债券 C 为-3.47%，富国双利增强债券 E 为-3.47%；同期业绩比较基准收益率情况：富国双利增强债券 A 为-0.52%，富国双利增强债券 C 为-0.52%，富国双利增强债券 E 为-0.52%。

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	2,099,193,511.25	16.43
	其中：股票	2,099,193,511.25	16.43
2	固定收益投资	10,092,451,505.31	78.98
	其中：债券	10,092,451,505.31	78.98
	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	574,893,190.05	4.50
7	其他资产	11,920,766.03	0.09
8	合计	12,778,458,972.64	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 417,065,441.00 元，占资产净值比例为 3.84%。

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	197,367,829.33	1.82
C	制造业	1,083,320,301.87	9.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	38,841,308.00	0.36
F	批发和零售业	22,986,000.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	34,035,000.00	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	51,180,360.00	0.47
J	金融业	205,458,260.00	1.89
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	26,592,000.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	22,347,011.05	0.21

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	1,682,128,070.25	15.49

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（%）
金融	113,628,560.00	1.05
能源	94,235,000.00	0.87
原材料	86,705,080.00	0.80
医疗保健	54,304,000.00	0.50
非日常生活消费品	32,028,500.00	0.29
通信服务	22,198,800.00	0.20
信息技术	13,965,501.00	0.13
合计	417,065,441.00	3.84

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	688825	长鑫科技	1,000,000	54,790,000.00	0.50
2	00005	汇丰控股	352,000	47,741,760.00	0.44
3	02888	渣打集团	220,000	46,156,000.00	0.43
4	002241	歌尔股份	2,000,000	45,580,000.00	0.42
5	688041	海光信息	200,000	45,360,000.00	0.42
6	002837	英维克	800,000	43,160,000.00	0.40
7	300395	菲利华	450,000	42,714,000.00	0.39
8	688147	微导纳米	400,343	40,598,783.63	0.37
9	688126	沪硅产业	1,701,003	39,769,450.14	0.37
10	300476	胜宏科技	181,787	38,229,806.10	0.35

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	1,140,370,808.23	10.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,984,985,303.71	64.32
	其中：政策性金融债	3,120,400,653.01	28.73
4	企业债券	870,880,145.88	8.02
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,096,215,247.49	10.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,092,451,505.31	92.94

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	240203	24 国开 03	4,600,000	475,927,972.60	4.38
2	250208	25 国开 08	4,600,000	463,284,904.11	4.27
3	2600002	26 超长特别国债 02	3,200,000	327,666,360.66	3.02
4	250215	25 国开 15	2,900,000	289,839,506.85	2.67
5	200215	20 国开 15	2,000,000	224,234,794.52	2.06

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 声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人民银行的处罚。

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 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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	3,436,304.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,717,264.78
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,767,196.75
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	11,920,766.03

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	113056	重银转债	60,892,578.82	0.56
2	113042	上银转债	47,910,193.91	0.44
3	113062	常银转债	46,914,367.94	0.43
4	132026	G 三峡 EB2	39,732,548.99	0.37
5	110093	神马转债	34,417,733.98	0.32
6	127111	金威转债	33,783,799.75	0.31
7	127089	晶澳转债	33,063,334.46	0.30
8	127049	希望转 2	32,498,334.25	0.30
9	118024	冠宇转债	31,292,655.29	0.29
10	127038	国微转债	23,246,958.01	0.21
11	118034	晶能转债	23,137,835.62	0.21
12	110100	龙建转债	22,910,754.05	0.21
13	110085	通 22 转债	22,556,800.00	0.21
14	127061	美锦转债	21,046,773.04	0.19

15	113666	爱玛转债	20,535,099.00	0.19
16	123252	银邦转债	19,828,192.24	0.18
17	111017	蓝天转债	19,070,178.08	0.18
18	127045	牧原转债	17,694,246.58	0.16
19	113659	莱克转债	17,357,826.84	0.16
20	113700	海天转债	16,910,528.21	0.16
21	113070	渝水转债	15,331,346.88	0.14
22	123250	嘉益转债	14,552,864.21	0.13
23	123214	东宝转债	14,125,143.83	0.13
24	127098	欧晶转债	13,494,114.80	0.12
25	113691	和邦转债	13,406,589.84	0.12
26	127108	太能转债	13,387,987.51	0.12
27	110098	南药转债	13,123,547.95	0.12
28	111002	特纸转债	13,077,117.85	0.12
29	113692	保隆转债	12,979,396.71	0.12
30	118031	天 23 转债	12,813,833.27	0.12
31	123264	双乐转债	12,124,463.49	0.11
32	113671	武进转债	11,783,182.04	0.11
33	118067	上 26 转债	10,731,186.57	0.10
34	123144	裕兴转债	10,368,734.20	0.10
35	110086	精工转债	10,271,000.18	0.09
36	113698	凯众转债	9,275,271.84	0.09
37	127050	麒麟转债	8,136,560.13	0.07
38	111020	合顺转债	7,886,353.09	0.07
39	123165	回天转债	7,826,356.10	0.07
40	123229	艾录转债	6,341,804.94	0.06
41	113680	丽岛转债	6,030,235.55	0.06
42	113647	禾丰转债	5,795,956.16	0.05
43	123261	普联转债	5,726,379.76	0.05
44	123090	三诺转债	5,580,246.58	0.05
45	118042	奥维转债	5,363,388.24	0.05
46	123223	九典转 02	5,171,982.29	0.05

47	127083	山路转债	5,012,530.57	0.05
48	113661	福 22 转债	4,583,294.30	0.04
49	123215	铭利转债	4,475,666.99	0.04
50	113054	绿动转债	4,341,149.14	0.04
51	123150	九强转债	3,953,964.66	0.04
52	123142	申昊转债	3,741,488.22	0.03
53	113694	清源转债	3,673,017.92	0.03
54	127068	顺博转债	3,483,275.34	0.03
55	127095	广泰转债	3,038,098.25	0.03
56	123253	永贵转债	2,718,833.81	0.03
57	113648	巨星转债	2,676,903.51	0.02
58	111015	东亚转债	2,659,920.55	0.02
59	123237	佳禾转债	2,476,015.04	0.02
60	113634	珀莱转债	2,373,234.52	0.02
61	113059	福莱转债	2,324,573.15	0.02
62	113066	平煤转债	1,999,299.40	0.02
63	123263	鼎捷转债	1,810,324.10	0.02
64	110099	福能转债	1,787,190.98	0.02
65	123257	安克转债	1,756,167.77	0.02
66	123171	共同转债	1,752,115.43	0.02
67	113688	国检转债	1,643,120.96	0.02
68	113681	镇洋转债	1,364,839.45	0.01
69	111004	明新转债	1,320,236.99	0.01
70	127105	龙星转债	1,313,478.09	0.01
71	113696	伯 25 转债	1,139,610.89	0.01
72	113058	友发转债	919,371.51	0.01
73	123220	易瑞转债	824,863.53	0.01
74	118015	芯海转债	720,781.28	0.01

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	富国双利增强债券 A	富国双利增强债券 C	富国双利增强债券 E
报告期期初基金份额总额	1,547,803,450.96	2,861,244,228.78	4,780,622,111.90
报告期期间基金总申购份额	339,283,370.53	909,773,585.89	1,295,516,512.85
减：报告期期间基金总赎回份额	126,964,844.41	1,023,475,060.34	998,267,443.81
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	1,760,121,977.08	2,747,542,754.33	5,077,871,180.94

§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	116,354,133.57
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	116,354,133.57
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.21

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十五次会议审议通过，李强先生自 2026 年 8 月 7 日起离任基金管理人首席信息官。具体可参见基金管理人于 2026 年 8 月 8 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双利增强债券型证券投资基金的文件

2、富国双利增强债券型证券投资基金基金合同

3、富国双利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、富国双利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

2026 年 10 月 27 日