

富国优化增强债券型证券投资基金  
二〇二一年第3季度报告

2021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： 中国建设银行股份有限公司  
送出日期： 2021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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富国优化增强债券		
基金主代码	100035		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2009年06月10日		
报告期末基金份额总额（单位：份）	2,344,190,060.27		
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>本基金按照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。本基金在债券投资过程中突出主动性的投资管理，在对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势进行客观判断的基础上，通过合理配置收益率相对较高的企业债、公司债、资产支持证券，以及风险收益特征优异的可转换债、可分离债券、可交换债券等债券品种，加以对国家债券、金融债券、中央银行票据以及回购等高流动性品种的投资，灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略，在保证基金流动性的前提下，积极把握固定收益证券市场中投资机会，获取各类债券的超额投资收益。</p> <p>本基金的股票投资策略、存托凭证投资策略、权证投资策略详见法律文件。</p>		
业绩比较基准	中债综合指数收益率*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	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	富国优化增强债券 A/B	富国优化增强债券 C	
下属分级基金的交易代码	前端	后端	100037
	100035	100036	
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	2,069,134,925.79		275,055,134.48

## § 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	富国优化增强债券 A/B 报告期（2021 年 07 月 01 日- 2021 年 09 月 30 日）	富国优化增强债券 C 报告期（2021 年 07 月 01 日- 2021 年 09 月 30 日）
1. 本期已实现收益	23,691,604.08	2,454,758.56
2. 本期利润	-28,767,109.52	-4,024,578.29
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0163	-0.0171
4. 期末基金资产净值	3,743,454,401.21	470,983,616.02
5. 期末基金份额净值	1.809	1.712

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）富国优化增强债券 A/B

阶段	净值增长率①	净值增长率 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	-0.39%	0.28%	0.81%	0.13%	-1.20%	0.15%
过去六个月	1.74%	0.23%	2.30%	0.12%	-0.56%	0.11%
过去一年	6.85%	0.28%	5.39%	0.13%	1.46%	0.15%
过去三年	23.44%	0.34%	17.97%	0.13%	5.47%	0.21%
过去五年	26.54%	0.33%	23.23%	0.13%	3.31%	0.20%
自基金合同 生效起至今	109.05%	0.39%	68.51%	0.16%	40.54%	0.23%

##### （2）富国优化增强债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率 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	-0.52%	0.28%	0.81%	0.13%	-1.33%	0.15%
过去六个月	1.54%	0.23%	2.30%	0.12%	-0.76%	0.11%
过去一年	6.47%	0.28%	5.39%	0.13%	1.08%	0.15%
过去三年	21.89%	0.34%	17.97%	0.13%	3.92%	0.21%

过去五年	23.91%	0.33%	23.23%	0.13%	0.68%	0.20%
自基金合同生效起至今	98.73%	0.39%	68.51%	0.16%	30.22%	0.23%

### 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

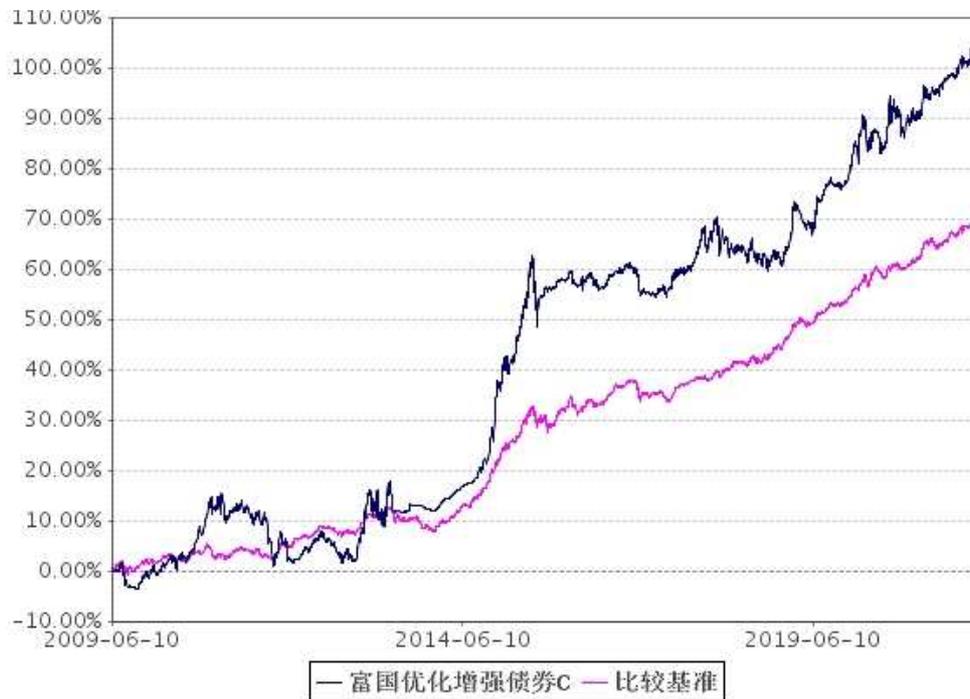
(1) 自基金合同生效以来富国优化增强债券 A/B 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2021 年 9 月 30 日。

2、本基金于 2009 年 6 月 10 日成立，建仓期 6 个月，从 2009 年 6 月 10 日起至 2009 年 12 月 9 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优化增强债券 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2021年9月30日。

2、本基金于2009年6月10日成立，建仓期6个月，从2009年6月10日起至2009年12月9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		
张明凯	本基金基金经理	2019-03-19	—	8.3	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，现任富国基金固定收益投

					<p>资部固定收益投资总监助理兼固定收益基金经理。自 2019 年 3 月起任富国天丰强化收益债券型证券投资基金、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、富国收益增强债券型证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国久利稳健配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 3 月至 2021 年 4 月任富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 4 月至 2020 年 10 月任富国中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理，2019 年 4 月至 2021 年 8 月任富国颐利纯债债券型证券投资基金、富国金融债债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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合规守信情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国优化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》、

《富国优化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的增长为目标，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

三季度以来，商品价格大幅度上涨，其中能源品上涨幅度达到历史级别水平。与此同时国内正经历疫情复苏后经济增速逐渐斜率向下的过程，与全球正处于疫情复苏后的高增长阶段，国内比较优势有所弱化。从消费数据以及对应的工业增加值数据来看，总体并不乐观，主要依靠海外出口，而新出口订单逐渐走低则预示出口项对经济增长的支持可能会逐渐弱化。综合来看，一方面价格与需求的背离可能持续，另一方面产业利润正在经历从下游向上游的转移阶段。根据时间推演，临近季末，供需缺口的矛盾愈演愈烈，特别是能源匮乏已经成为全球性难题，中上游高能耗企业被动进入到限电模式。根据基本面的变化，我们在组合上调整到倾向于中上游板块，特别是在大幅度增加权益风险暴露的情况下，向中上游倾斜。但对于与权益相关联的转债标的，由于溢价率水平较高，同时安全边际不足，相对性价比已经较为劣势，总体上是采取降低仓位的做法。对于纯债资产，由于未来不确定性加大，降低纯债久期成为主要投资方向。

总体而言，市场前期演进与我们较早研判相符，但后续市场迅速出现反转，商品价格与对应标的走出反向行情，市场更担忧未来的长期需求，我们认为这种短期波动是存在的，同时市场可能低估了上游企业未来将获得的长期政策支持，这种政策支持是在碳中和限制产能的背景之下的。

#### 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-0.39%，C 级为-0.52%，同期业绩比较基准收益率 A/B 级为 0.81%，C 级为 0.81%

#### 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	495,290,155.74	11.11
	其中：股票	495,290,155.74	11.11
2	固定收益投资	3,839,494,977.91	86.10
	其中：债券	3,839,494,977.91	86.10
	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	14,136,710.34	0.32
7	其他资产	110,529,096.75	2.48
8	合计	4,459,450,940.74	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	83,257,278.00	1.98
C	制造业	375,164,937.90	8.90
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	6,809,331.84	0.16
J	金融业	10,705,988.00	0.25

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	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	19,352,620.00	0.46
	合计	495,290,155.74	11.75

### 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	000983	山西焦煤	3,659,900	43,406,414.00	1.03
2	300502	新易盛	1,200,000	40,404,000.00	0.96
3	000960	锡业股份	2,000,000	37,620,000.00	0.89
4	601225	陕西煤业	2,000,000	29,600,000.00	0.70
5	002340	格林美	2,500,000	27,950,000.00	0.66
6	300073	当升科技	300,000	24,630,000.00	0.58
7	601600	中国铝业	3,000,000	23,250,000.00	0.55
8	002493	荣盛石化	1,200,000	22,560,000.00	0.54
9	600409	三友化工	2,000,000	22,280,000.00	0.53
10	000400	许继电气	1,029,400	22,080,630.00	0.52

#### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

### 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	700,983,589.20	16.63
2	央行票据	—	—
3	金融债券	2,033,028,966.00	48.24
	其中：政策性金融债	1,519,465,766.00	36.05
4	企业债券	348,880,637.10	8.28
5	企业短期融资券	350,725,000.00	8.32
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	259,866,785.61	6.17
8	同业存单	146,010,000.00	3.46
9	其他	—	—
10	合计	3,839,494,977.91	91.10

#### 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	019654	21 国债 06	2,900,000	290,261,000.00	6.89
2	2120071	21 上海银行	2,000,000	200,060,000.00	4.75
3	210005	21 付息国债 05	1,600,000	168,960,000.00	4.01
4	210201	21 国开 01	1,500,000	150,090,000.00	3.56
5	200407	20 农发 07	1,400,000	140,938,000.00	3.34

#### 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。**

本报告编制日前一年内，本基金持有的“19 国开 14”的发行主体国家开发银行（以下简称“公司”），由于存在违反银行交易记录管理规定的行为，国家外汇管理局北京外汇管理部于 2020 年 10 月 26 日对公司做出罚款 60 万元的行政处罚（京汇罚（2020）32 号）；由于存在为违规的政府购买服务项目提供融资；项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况；违规变相发放土地储备贷款等 24 项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 25 日对公司作出罚款 4880 万元的行政处罚（银保监罚决字（2020）67 号）。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“20 国开 02”的发行主体国家开发银行（以下简称“公司”），由于存在违反银行交易记录管理规定的行为，国家外汇管理局北京外汇管理部于 2020 年 10 月 26 日对公司做出罚款 60 万元的行政处罚（京汇罚（2020）32 号）；由于存在为违规的政府购买服务项目提供融资；项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况；违规变相发放土地储备贷款等 24 项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年

12月25日对公司作出罚款4880万元的行政处罚(银保监罚决字(2020)67号)。

本报告编制日前一年内,本基金持有的“20国开07”的发行主体国家开发银行(以下简称“公司”),由于存在违反银行交易记录管理规定的行为,国家外汇管理局北京外汇管理部于2020年10月26日对公司做出罚款60万元的行政处罚(京汇罚(2020)32号);由于存在为违规的政府购买服务项目提供融资;项目资本金管理不到位,棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况;违规变相发放土地储备贷款等24项违法违规事实,中国银行保险监督管理委员会于2020年12月25日对公司作出罚款4880万元的行政处罚(银保监罚决字(2020)67号)。

本报告编制日前一年内,本基金持有的“21国开01”的发行主体国家开发银行(以下简称“公司”),由于存在违反银行交易记录管理规定的行为,国家外汇管理局北京外汇管理部于2020年10月26日对公司做出罚款60万元的行政处罚(京汇罚(2020)32号);由于存在为违规的政府购买服务项目提供融资;项目资本金管理不到位,棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况;违规变相发放土地储备贷款等24项违法违规事实,中国银行保险监督管理委员会于2020年12月25日对公司作出罚款4880万元的行政处罚(银保监罚决字(2020)67号)。

本报告编制日前一年内,本基金持有的“21上海银行”的发行主体上海银行股份有限公司(以下简称“公司”),由于公司2014年至2018年间绩效考核管理严重违反审慎经营规则;2018年未按规定延期支付2017年度绩效薪酬等违法违规事实,中国银行保险监督管理委员会上海监管局于2020年11月18日对公司做出责令改正,并处罚款共计80万元的行政处罚(沪银保监银罚决字(2020)25号);由于未按照规定进行信息披露的违法违规事实,中国银行保险监督管理委员会上海监管局于2021年4月25日对公司做出责令改正,并处罚款30万元的行政处罚(沪银保监罚决字(2021)31号);由于存在严重违反审慎经营规则等违法行为,中国银行保险监督管理委员会上海监管局于2021年7月2日对公司做出责令改正,并处罚款共计460万元的行政处罚(沪银保监罚决字(2021)72号)。

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 5 名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	342,350.06
2	应收证券清算款	61,751,022.71
3	应收股利	—
4	应收利息	48,416,711.26
5	应收申购款	19,012.72
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	110,529,096.75

#### 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	107,517,493.60	2.55
2	132004	15 国盛 EB	50,064,294.00	1.19
3	132007	16 凤凰 EB	27,261,000.00	0.65
4	127027	靖远转债	12,446,129.22	0.30
5	128129	青农转债	10,809,000.00	0.26
6	113037	紫银转债	9,889,662.20	0.23
7	128048	张行转债	8,244,600.00	0.20
8	132011	17 浙报 EB	5,075,000.00	0.12
9	128034	江银转债	4,975,971.90	0.12
10	128119	龙大转债	643,223.30	0.02
11	128140	润建转债	503,501.35	0.01
12	128134	鸿路转债	31,745.00	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	富国优化增强债券 A/B	富国优化增强债券 C
报告期期初基金份额总额	1,208,255,389.32	232,598,325.10
报告期期间基金总申购份额	1,065,690,795.27	89,244,644.06
减：报告期期间基金总赎回份额	204,811,258.80	46,787,834.68
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	2,069,134,925.79	275,055,134.48

## § 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	2021-07-01 至 2021-08-03	412, 185, 219.90	-	-	412, 185, 219.90	17.58%
产品特有风险							
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。							

## § 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优化增强债券型证券投资基金的文件
- 2、富国优化增强债券型证券投资基金基金合同
- 3、富国优化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、富国优化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  
2021年10月27日