

富国双债增强债券型证券投资基金（E 类份额）基金产品资料概要更新

2024 年 06 月 07 日（信息截至：2024 年 06 月 06 日）

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

| | | | |
|---------|------------------|--------|------------------|
| 基金简称 | 富国双债增强债券 | 基金代码 | 010435 |
| 份额简称 | 富国双债增强债券 E | 份额代码 | 018958 |
| 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 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 11 月 18 日 | 基金类型 | 债券型 |
| 运作方式 | 普通开放式 | 开放频率 | 每个开放日 |
| 交易币种 | 人民币 | | |
| 基金经理 | 俞晓斌 | 任职日期 | 2020 年 11 月 18 日 |
| | | 证券从业日期 | 2007 年 07 月 02 日 |

二、基金投资与净值表现

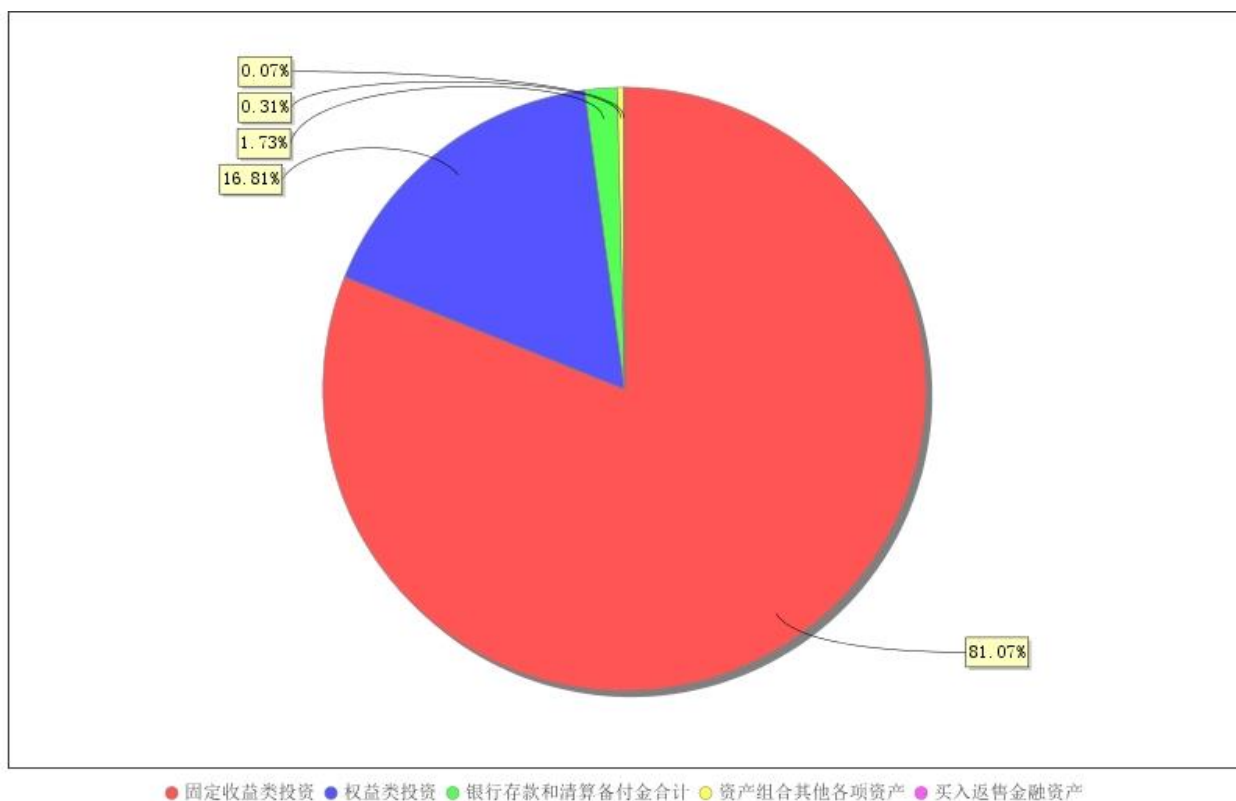
（一）投资目标与投资策略

| | |
|------|---|
| 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。 |
| 投资范围 | <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、政府支持债券、政府支持机构债券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、现金等货币市场工具、国债期货等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金在投资信用债时遵守以下约定：本基金主动投资于信用债的信用评级不低于 AA，上述信用评级为债项评级，若无债项评级的或债项评级为 A-1 的，依照其主体评级。本基金持有信用债期间，如果其信用评级下降不再符合前述标准，应逐步卖出。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，投资于可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券和信用债的比例合计不低于非现金基金资产的 80%，投资于可转换债券（含可分离交易可转债）和可交换债券的比例合计不低于非现金基金资产的 20%，投资于信用债的比例不低于非现金基金资产的 20%；其中信用债是指金融债（不含政策性金融债）、企业债、公司债、次级债、短期融资券（超短期融资券）、中期票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债、可分离交易可转换债券的纯债部分等非国家信用的金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他信用类金融工具。本基金对股票及存托凭证资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低</p> |

| | |
|--------|--|
| | 于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。 |
| 主要投资策略 | 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。 |

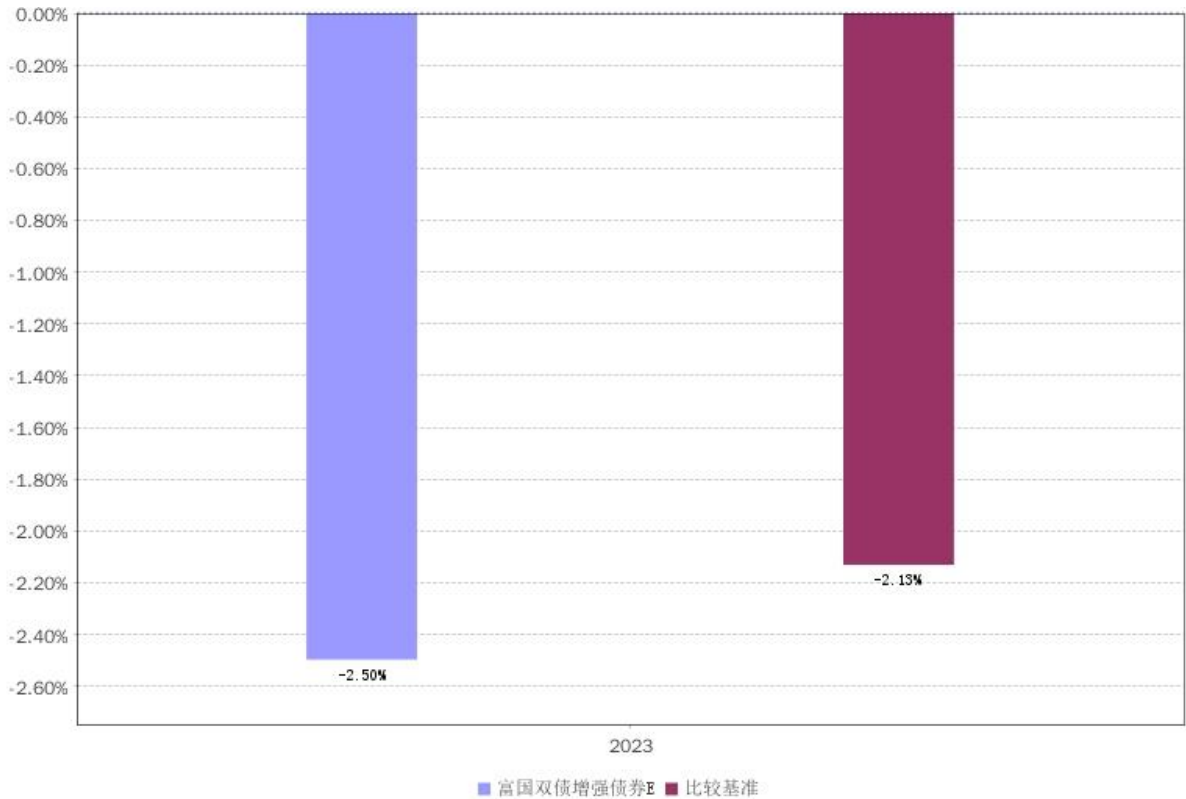
注：详情请阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节的相关内容。

（二）投资组合资产配置图表



注：截止日期 2024 年 03 月 31 日。

（三）自基金合同生效以来基金（E 份额）每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：本基金合同生效日 2020 年 11 月 18 日。该份额生效日 2023 年 08 月 07 日。业绩表现截止日期 2023 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

| 费用类型 | 金额 (M) / 持有期限 (N) | 费率 (普通客户) | 费率 (特定客户) |
|------|-------------------|-----------|-----------|
| 赎回费 | N < 7 天 | 1.5% | |
| | N ≥ 7 天 | 0 | |

注：本基金 E 类份额不收取申购费，赎回费在赎回基金过程中收取，特定客户的具体含义请见《招募说明书》相关内容。

(二) 基金运作相关费用

| 费用类别 | 年费率/收费方式 | 收取方 |
|-------|----------------|------------|
| 管理费 | 0.65% | 基金管理人、销售机构 |
| 托管费 | 0.12% | 基金托管人 |
| 销售服务费 | 0.15% | 销售机构 |
| 审计费用 | 65,000.00 元/年 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00 元/年 | 规定披露报刊 |

注：以上费用将从基金资产中扣除；本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。审计费用、信息披露费为基金整体承担的年费用金额，非单个份额类别费用。年费用金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。除上述费用外的其他运作费用，详见《招募说明书》中的“基金费用与税收”章节。

(三) 基金运作综合费用测算

| |
|--------------|
| 基金运作综合费率（年化） |
|--------------|

注：若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如上表所示。基金管理费率、托管费率、销售服务费率为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、 风险揭示与重要提示

（一） 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金投资中的风险包括：因经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而形成的市场风险；基金在交易过程发生交收违约或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息导致的信用风险；债券收益率曲线变动风险；再投资风险；管理风险；操作或技术风险；合规性风险；流动性风险；本基金的特有风险；基金财产投资运营过程中的增值税等税负风险；本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险等。

本基金的特有风险包括：1、本基金为债券型基金，对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，投资于可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券和信用债的比例合计不低于非现金基金资产的80%。因此，本基金需要承担由于市场利率波动造成的利率风险以及如企业债、公司债、中期票据等信用品种的发债主体信用恶化造成的信用风险；如果债券市场出现整体下跌，将无法完全避免债券市场系统性风险。

2、 资产支持证券投资风险

本基金的投资范围包括资产支持证券。资产支持证券存在信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

3、 巨额赎回的风险

若本基金发生了巨额赎回，基金管理人有可能根据基金当时的资产组合状况采取全额赎回、部分延期赎回或延缓支付赎回款项的措施以应对巨额赎回，因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人存在不能及时赎回份额或获得赎回款的风险。

4、 可转换债券和可交换债投资风险

本基金投资于可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券和信用债的比例合计不低于非现金基金资产的80%。可转换债券投资方面，本基金可能承担由可转换债券对应股票价格波动带来的可转换债券价格波动风险，以及在转股期内由于可转换债券对应股票价格低于转股价而导致不能获得转股收益的风险等。信用债投资方面，本基金无法完全规避发债主体特别是公司债、企业债的发债主体的信用质量变化造成的信用风险；另外，如果持有的信用债出现信用违约风险，将给基金净值带来较大的负面影响和波动。

5、 基金投资存托凭证的风险

本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。

除以上风险外，本基金还可能存在国债期货的投资风险、港股通标的股票投资风险、基金合同可能终止的不确定性风险。

（二） 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册/核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

与本基金或基金合同相关的一切争议将提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁，仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告、定期公告等披露文件。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站(www.fullgoal.com.cn)，客户服务热线：95105686，4008880688（全国统一，免长途话费）

1. 基金合同、托管协议、招募说明书
2. 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
3. 基金份额净值
4. 基金销售机构及联系方式
5. 其他重要资料