

工银瑞信双债增强债券型证券投资基金  
(LOF)  
2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 日

### § 1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 17 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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

本报告中财务资料未经审计。  
本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

### § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                       |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 工银双债 LOF                                                                                                                                                                              |
| 场内简称       | 工银双债 LOF                                                                                                                                                                              |
| 基金主代码      | 164814                                                                                                                                                                                |
| 基金运作方式     | 上市开放式基金（LOF）                                                                                                                                                                          |
| 基金合同生效日    | 2013 年 9 月 25 日                                                                                                                                                                       |
| 报告期末基金份额总额 | 65,638,531.33 份                                                                                                                                                                       |
| 投资目标       | 在锁定投资组合下方风险的基础上，通过积极主动的可转债、信用债投资管理，追求基金资产的长期稳定增值。                                                                                                                                     |
| 投资策略       | 本基金将在资产配置策略的基础上，通过构建债券组合以获取相对稳定的基础收益，同时，通过重点投资可转债和信用债以及灵活把握权益类资产的投资机会来提高基金资产的收益水平。                                                                                                    |
| 业绩比较基准     | 80%×中证智选可转换债券流动性策略指数收益率+20%×中债综合财富(1 年以下)指数收益率。                                                                                                                                       |
| 风险收益特征     | 本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。另外，由于本基金可转债（含分离交易的可转换债券）和信用债合计投资比例不低于固定收益类资产的 80%，可转债（含分离交易的可转换债券）的投资比例不低于固定收益类资产的 30%。而可转债和信用债的预期收益和风险水平通常高于普通债券，所以本基金的预期收益和风险水平高于普通债券型基金。 |
| 基金管理人      | 工银瑞信基金管理有限公司                                                                                                                                                                          |
| 基金托管人      | 中国银行股份有限公司                                                                                                                                                                            |

### § 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 4 月 1 日 – 2026 年 6 月 30 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 1,688,621.15                          |
| 2. 本期利润         | 8,867,740.76                          |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1515                                |
| 4. 期末基金资产净值     | 83,187,489.37                         |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.267                                 |

注：1、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益是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、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

### 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

| 阶段          | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|-------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月       | 13.43%     | 1.12%         | 7.20%          | 0.82%                 | 6.23%  | 0.30% |
| 过去六个月       | 11.48%     | 1.14%         | 6.26%          | 0.95%                 | 5.22%  | 0.19% |
| 过去一年        | 27.06%     | 0.94%         | 21.19%         | 0.79%                 | 5.87%  | 0.15% |
| 过去三年        | 32.32%     | 0.71%         | 30.32%         | 0.52%                 | 2.00%  | 0.19% |
| 过去五年        | 39.53%     | 0.69%         | 34.94%         | 0.43%                 | 4.59%  | 0.26% |
| 过去七年        | 68.86%     | 0.71%         | 45.26%         | 0.38%                 | 23.60% | 0.33% |
| 自基金转型<br>以来 | 75.34%     | 0.67%         | 37.71%         | 0.35%                 | 37.63% | 0.32% |

#### 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



注：1、本基金于 2016 年 9 月 26 日由“工银瑞信双债增强债券型证券投资基金”转型而来。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至本报告期末，本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定。

3.3 其他指标

无。

§ 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 焦文龙 | 指数及量化投资部总经理、本基金的基金经理 | 2024 年 11 月 8 日 | —    | 17 年   | 硕士研究生。曾任鹏华基金执行总经理，基金经理；2021 年加入工银瑞信，现任指数及量化投资部总经理、基金经理。2022 年 11 月 25 日至今，担任工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2022 年 11 月 25 日至今，担任工银瑞信新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2023 年 9 月 22 日至今，担任工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金经理；2024 年 11 月 8 日至今，担任工银瑞信双债增强债券型证券投资基金（LOF）基金经理；2024 年 11 月 19 日至今，担任工银瑞信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2024 年 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 11 月 26 日至 2026 年 2 月 5 日，担任工银瑞信中证 A500 指数证券投资基金（自 2024 年 12 月 10 日起，变更为工银瑞信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金）基金经理；2025 年 4 月 10 日至今，担任工银瑞信国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2025 年 6 月 20 日至今，担任工银瑞信中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2026 年 2 月 5 日至今，担任工银瑞信国证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2026 年 2 月 5 日至今，担任工银瑞信中证港股通高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期；离职日期为本基金管理人对外披露的离职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《基金从业人员管理规则》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，制定了《公平交易管理办法》、《异常交易监控管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情

况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价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的 5%的情况有 4 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

海外方面，随着二季度中后段地缘扰动边际缓和，前期由冲突引发的原油风险溢价基本出清，叠加供给修复预期升温，国际油价在经历前期高位震荡后明显回落。美国六月非农就业数据低于预期，推动市场加息预期降温，但制造业景气与企业资本开支仍具支撑，显示美国经济韧性尚未明显削弱，市场对流动性收紧及再通胀的交易也边际缓和。国内方面，当前增长动能仍主要来自外需韧性延续与出口表现偏强，内需修复相对偏慢；国内 PPI 同比持续改善，带动工业企业营收与利润同步修复，企业盈利环境边际改善。

在二季度风险偏好回升的背景下，全球主要权益市场整体显著修复，AI 资本开支扩张与盈利预期上修驱动科技主线领涨。A 股方面，随着外部地缘扰动缓和，市场情绪明显修复，创业板指与科创 50 持续走强并阶段性创出新高。整体来看，二季度成长风格显著占优，申万一级行业中电子、通信、建材等板块涨幅居前。

在基金操作上，本基金采用定量分析和定性分析相结合的方式，当前主要配置可转债。2026 年二季度可转债市场整体呈现震荡走势，在组合配置上，基金更加偏向于成长型的转债，优选正股具备上行潜力、转债估值合理的个券。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 13.43%，业绩比较基准收益率为 7.20%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内没有触及 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

## § 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              | 11,843,981.53 | 14.02  |
|   | 其中：股票             | 11,843,981.53 | 14.02  |
| 2 | 基金投资              | —             | —      |
| 3 | 固定收益投资            | 70,924,574.20 | 83.96  |
|   | 其中：债券             | 70,924,574.20 | 83.96  |
|   | 资产支持证券            | —             | —      |
| 4 | 贵金属投资             | —             | —      |
| 5 | 金融衍生品投资           | —             | —      |
| 6 | 买入返售金融资产          | —             | —      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —             | —      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 1,644,207.23  | 1.95   |
| 8 | 其他资产              | 59,407.18     | 0.07   |
| 9 | 合计                | 84,472,170.14 | 100.00 |

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 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              | —             | —            |
| C  | 制造业              | 11,552,686.53 | 13.89        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 291,295.00    | 0.35         |
| 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  | —             | —            |
| J  | 金融业              | —             | —            |
| 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               | —             | —            |
|    | 合计               | 11,843,981.53 | 14.24        |

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 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  | 605358 | 立昂微  | 32,747 | 2,541,167.20 | 3.05         |
| 2  | 002850 | 科达利  | 10,080 | 1,908,144.00 | 2.29         |
| 3  | 603638 | 艾迪精密 | 74,070 | 1,736,941.50 | 2.09         |
| 4  | 688301 | 奕瑞科技 | 13,741 | 1,703,884.00 | 2.05         |
| 5  | 002371 | 北方华创 | 1,000  | 884,560.00   | 1.06         |
| 6  | 688981 | 中芯国际 | 5,448  | 865,251.36   | 1.04         |
| 7  | 002937 | 兴瑞科技 | 16,679 | 732,708.47   | 0.88         |
| 8  | 300750 | 宁德时代 | 1,700  | 668,117.00   | 0.80         |
| 9  | 000338 | 潍柴动力 | 12,500 | 340,625.00   | 0.41         |
| 10 | 003816 | 中国广核 | 74,500 | 291,295.00   | 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      | 4,241,603.27  | 5.10         |
| 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） | 66,682,970.93 | 80.16        |
| 8  | 同业存单      | —             | —            |
| 9  | 其他        | —             | —            |
| 10 | 合计        | 70,924,574.20 | 85.26        |

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 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  | 123255 | 鼎龙转债     | 5,769  | 3,221,057.14 | 3.87         |
| 2  | 127037 | 银轮转债     | 4,460  | 2,840,374.22 | 3.41         |
| 3  | 019792 | 25 国债 19 | 24,000 | 2,425,181.59 | 2.92         |
| 4  | 113697 | 应流转债     | 9,140  | 2,421,665.54 | 2.91         |
| 5  | 113658 | 密卫转债     | 16,380 | 2,305,269.59 | 2.77         |



## 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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 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

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国债期货交易情况说明

### 5.9.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 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，密尔克卫智能供应链服务集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方证监局、上海证券交易所的处罚，安徽应流机电股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方证监局的处罚。

上述情形对上市公司的财务和经营状况无重大影响，投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

### 5.10.2 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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称    | 金额（元）    |
|----|-------|----------|
| 1  | 存出保证金 | 3,141.31 |

|   |         |           |
|---|---------|-----------|
| 2 | 应收证券清算款 | —         |
| 3 | 应收股利    | —         |
| 4 | 应收利息    | —         |
| 5 | 应收申购款   | 56,265.87 |
| 6 | 其他应收款   | —         |
| 7 | 其他      | —         |
| 8 | 合计      | 59,407.18 |

#### 5.10.4 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  | 123255 | 鼎龙转债    | 3,221,057.14 | 3.87         |
| 2  | 127037 | 银轮转债    | 2,840,374.22 | 3.41         |
| 3  | 113697 | 应流转债    | 2,421,665.54 | 2.91         |
| 4  | 113658 | 密卫转债    | 2,305,269.59 | 2.77         |
| 5  | 118030 | 睿创转债    | 2,272,466.53 | 2.73         |
| 6  | 123158 | 宙邦转债    | 2,247,470.54 | 2.70         |
| 7  | 127084 | 柳工转 2   | 2,081,835.03 | 2.50         |
| 8  | 123178 | 花园转债    | 2,021,090.35 | 2.43         |
| 9  | 118051 | 皓元转债    | 1,980,891.80 | 2.38         |
| 10 | 127064 | 杭氧转债    | 1,892,960.27 | 2.28         |
| 11 | 118024 | 冠宇转债    | 1,883,722.81 | 2.26         |
| 12 | 127045 | 牧原转债    | 1,678,699.80 | 2.02         |
| 13 | 127038 | 国微转债    | 1,647,033.04 | 1.98         |
| 14 | 118059 | 顾中转债    | 1,616,108.79 | 1.94         |
| 15 | 113633 | 科沃转债    | 1,578,926.41 | 1.90         |
| 16 | 123176 | 精测转 2   | 1,450,650.08 | 1.74         |
| 17 | 113696 | 伯 25 转债 | 1,417,000.00 | 1.70         |
| 18 | 113677 | 华懋转债    | 1,400,808.58 | 1.68         |
| 19 | 111018 | 华康转债    | 1,275,600.22 | 1.53         |
| 20 | 123257 | 安克转债    | 1,263,367.10 | 1.52         |
| 21 | 113640 | 苏利转债    | 1,101,435.49 | 1.32         |
| 22 | 127111 | 金威转债    | 1,028,682.14 | 1.24         |
| 23 | 123258 | 胜蓝转 02  | 1,016,724.27 | 1.22         |
| 24 | 127031 | 洋丰转债    | 1,013,981.42 | 1.22         |
| 25 | 127088 | 赫达转债    | 1,009,978.08 | 1.21         |
| 26 | 127105 | 龙星转债    | 984,083.21   | 1.18         |
| 27 | 113699 | 金 25 转债 | 984,005.59   | 1.18         |
| 28 | 123193 | 海能转债    | 983,231.84   | 1.18         |
| 29 | 123150 | 九强转债    | 951,563.70   | 1.14         |
| 30 | 111002 | 特纸转债    | 895,215.86   | 1.08         |
| 31 | 118056 | 路维转债    | 880,236.58   | 1.06         |
| 32 | 123165 | 回天转债    | 829,796.14   | 1.00         |

|    |        |          |            |      |
|----|--------|----------|------------|------|
| 33 | 118060 | 瑞可转债     | 806,816.02 | 0.97 |
| 34 | 132026 | G 三峡 EB2 | 772,599.45 | 0.93 |
| 35 | 123091 | 长海转债     | 769,710.30 | 0.93 |
| 36 | 123252 | 银邦转债     | 763,848.49 | 0.92 |
| 37 | 111021 | 奥锐转债     | 752,845.07 | 0.90 |
| 38 | 113673 | 岱美转债     | 728,811.10 | 0.88 |
| 39 | 123259 | 锦浪转 02   | 723,700.28 | 0.87 |
| 40 | 118013 | 道通转债     | 711,078.04 | 0.85 |
| 41 | 113661 | 福 22 转债  | 681,247.62 | 0.82 |
| 42 | 113632 | 鹤 21 转债  | 664,506.34 | 0.80 |
| 43 | 123262 | 神宇转债     | 645,419.32 | 0.78 |
| 44 | 118058 | 微导转债     | 638,310.14 | 0.77 |
| 45 | 123192 | 科思转债     | 633,995.68 | 0.76 |
| 46 | 127050 | 麒麟转债     | 632,176.44 | 0.76 |
| 47 | 111003 | 聚合转债     | 624,511.35 | 0.75 |
| 48 | 110087 | 天业转债     | 602,068.89 | 0.72 |
| 49 | 123251 | 华医转债     | 422,395.89 | 0.51 |
| 50 | 118062 | 天准转债     | 421,224.45 | 0.51 |
| 51 | 113691 | 和邦转债     | 388,667.87 | 0.47 |
| 52 | 113062 | 常银转债     | 380,410.27 | 0.46 |
| 53 | 110090 | 爱迪转债     | 322,941.58 | 0.39 |
| 54 | 113646 | 永吉转债     | 317,737.95 | 0.38 |
| 55 | 118032 | 建龙转债     | 316,354.65 | 0.38 |
| 56 | 123195 | 蓝晓转 02   | 315,423.45 | 0.38 |
| 57 | 113066 | 平煤转债     | 315,191.38 | 0.38 |
| 58 | 113659 | 莱克转债     | 312,357.99 | 0.38 |
| 59 | 113692 | 保隆转债     | 310,743.46 | 0.37 |
| 60 | 113067 | 燃 23 转债  | 302,709.40 | 0.36 |
| 61 | 110077 | 洪城转债     | 289,693.05 | 0.35 |
| 62 | 127110 | 广核转债     | 288,415.32 | 0.35 |
| 63 | 127092 | 运机转债     | 153,600.16 | 0.18 |
| 64 | 127053 | 豪美转债     | 129,756.03 | 0.16 |

注：上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 56,450,810.11 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 14,567,014.53 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 5,379,293.31  |
| 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               | 65,638,531.33 |

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

## § 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         | 9,000,000.00 |
| 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         | 9,000,000.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 13.71        |

注：1、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

2、期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额：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

无。

## § 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

无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

## 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准工银瑞信双债增强债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《工银瑞信双债增强债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信双债增强债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信双债增强债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

## 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

## 9.3 查阅方式

投资者可于营业时间免费查阅，或登录基金管理人网站查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：[www.icbcubs.com.cn](http://www.icbcubs.com.cn)

工银瑞信基金管理有限公司

2026 年 7 月 21 日