

富国宝利增强债券型发起式证券投资基金

二〇二四年第3季度报告

2024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

报告送出日期：2024年10月25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 2024 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 2024 年 7 月 1 日起至 2024 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	富国宝利增强债券	
基金主代码	005078	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年02月08日	
报告期末基金份额总额	1,623,660,395.06份	
投资目标	本基金在追求本金安全、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	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公司债券、可分离交易可转债、中小企业私募债券、可交换债券等债券品种,加以对国家债券、金融债券、中央银行票据以及质押及买断式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。当本基金管理人判断市场出现明显的趋势性投资机会时,本基金可以直接参与股票市场投资,努力获取超额收益。在股票市场投资过程中,本基金主要采取自下而上的投资策略,利用数量化投资技术与基本面研究相结合的研究方法进行投资。本基金的资产证券化产品投资策略、存托凭证投资策略、权证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*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	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	富国宝利增强债券A	富国宝利增强债券E
下属分级基金的交易代码	005078	022175
报告期末下属分级基金的份额总额	1,623,659,579.00份	816.06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（2024年07月01日-2024年09月30日）	
	富国宝利增强债券 A	富国宝利增强债券 E
1. 本期已实现收益	-31,420,179.41	0.74
2. 本期利润	74,878,073.89	50.71
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0405	0.0621
4. 期末基金资产净值	2,090,494,777.44	1,050.71
5. 期末基金份额净值	1.2875	1.2875

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。本产品自2024年9月25日起增加E类份额。

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) 富国宝利增强债券 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	4.13%	0.51%	1.81%	0.13%	2.32%	0.38%
过去六个月	4.97%	0.39%	2.58%	0.11%	2.39%	0.28%
过去一年	4.06%	0.35%	4.20%	0.10%	-0.14%	0.25%
过去三年	2.78%	0.29%	3.77%	0.11%	-0.99%	0.18%
过去五年	20.28%	0.30%	8.71%	0.12%	11.57%	0.18%
自基金合同生效起至今	32.91%	0.29%	13.52%	0.12%	19.39%	0.17%

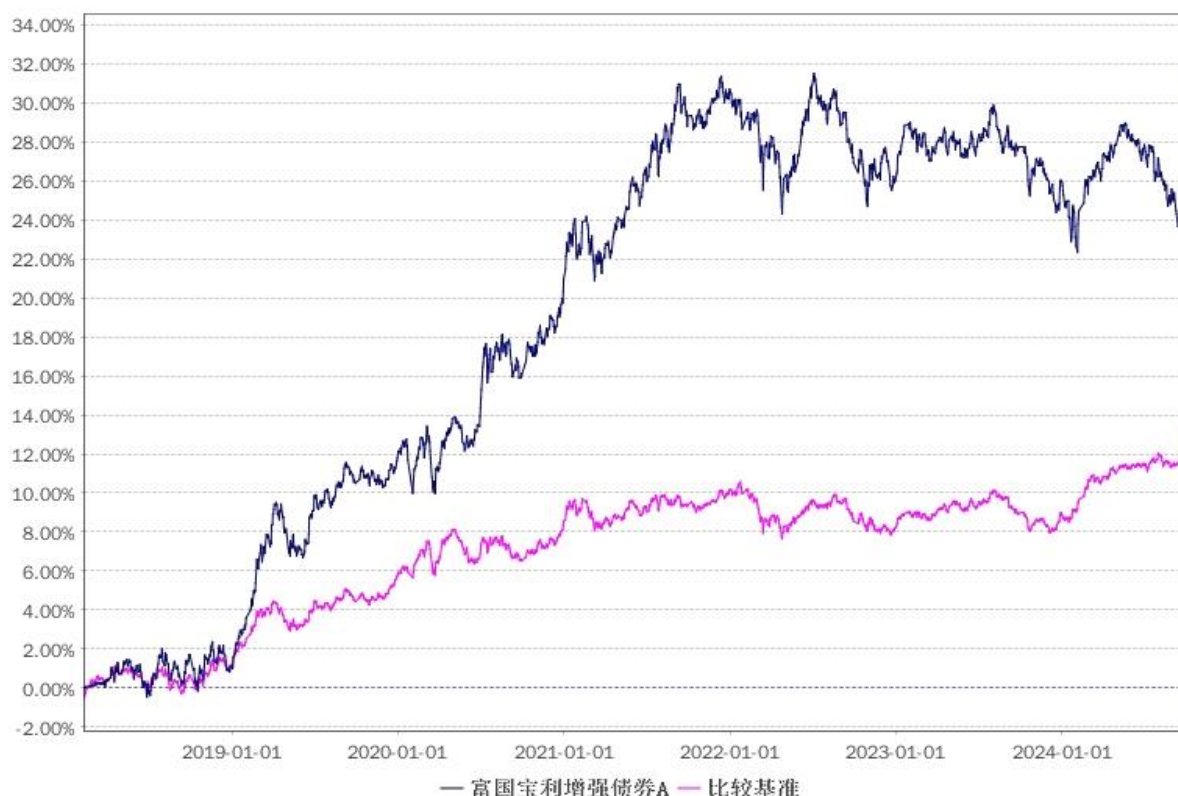
(2) 富国宝利增强债券 E

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

自基金分级 生效日起至 今	5.07%	0.83%	0.96%	0.30%	4.11%	0.53%
---------------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

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

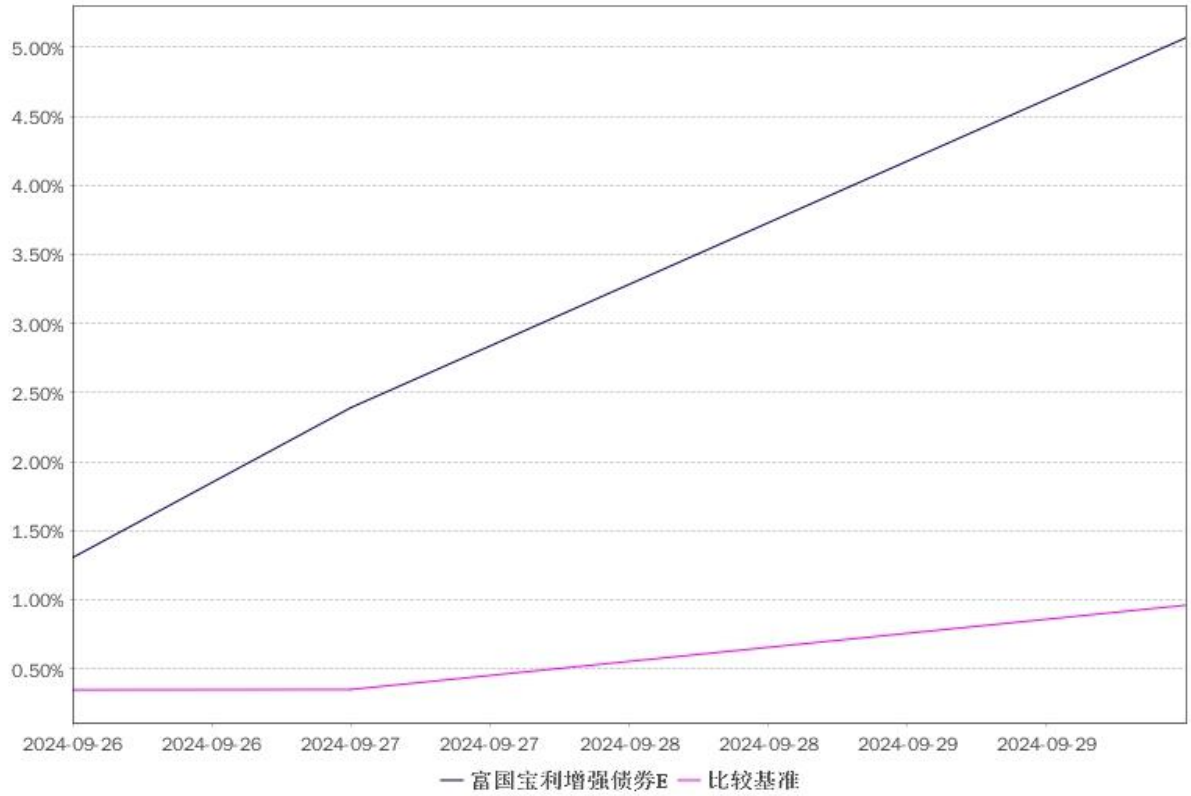
(1) 自基金合同生效以来富国宝利增强债券 A 基金累计净值增长率变动及其与
同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2024 年 9 月 30 日。

2、本基金于 2018 年 2 月 8 日成立，建仓期 6 个月，从 2018 年 2 月 8 日起至 2018 年 8 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宝利增强债券 E 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 2024 年 9 月 30 日。

2、本基金自 2024 年 9 月 25 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		
陈斯扬	本基金现任基金经理	2018-03-19	—	12	硕士，曾任交银施罗德基金管理有限公司研究员、投资经理；自2016年10月加入富国基金管理有限公司，历任定量投资经理、定量基金经理；现任富国基金量化投资部债券投资总监助理兼定量基金经理。自2018年03月起任富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理；自2018年03月起任富国丰利增强债券型发起式证券投资基金基金经理；自2018年04月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理；自2024年03月起任富国盛利增强债券型发起式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合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国宝利增强债券型发起式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》、《富国宝利增强债券型发起式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 3 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

三季度国内终于迎来了期待已久的政策转向，风险资产也迎来了数年来最为凌厉的修复。而在 9 月末一揽子以货币政策为主导的宽松政策被宣布之前，股票市场的情绪和估值都被压抑到了极低的水平，可转债市场的平均到期收益率抬升到历史最高水平，长期债券收益率也持续创下新低，都反映了极端谨慎的市场情绪。

站在当时，要从胜率的角度去准确捕捉这一次市场的转向，是非常困难的。国内经济增长数据已经历了一段时间的回落，通缩压力加剧，商品房交易加速回落，而决策层的政策定力超乎寻常，在这样的背景下，担忧长期增长前景的声音越来越多。

但如果换一个角度，市场的赔率其实提供了一个更好的视角。抛开股权风险溢价等传统指标，9 月份在我们颇为关注的可转债市场上，超过一半的可转债被打出了负纯债溢价率，对于拥有下修和强制转股条款的这类看涨期权来说，质疑债底的潜台词即是认为，在这个转债剩余的数年生命周期中，不可能再出现任何一个向上超过 30%幅度的震荡。在 A 股较高的波动特性面前，这种假设显然是过于悲观的。从这个角度来说，当时可转债市场丰厚的到期收益率回报，其实是数年来赔率最佳投资机会的信号。从事后来看，转债市场的这一赔率信号，确实也成了市场触底的标志之一。

在组合方面，三季度我们持续增加对优秀的低估可转债的配置力度，择机寻找受流动性挤压而出现估值错杀的品种，这一操作在季末的价值回归行情中为组合带来了一定回报。

组合的股票仓位继续维持指数增强的配置。但三季度末市场波动开始急剧放大，风格和行业切换加快，对选股模型构成了较大的挑战，超额收益在这一阶段也出现了一定波动。我们预计后续市场波动终将回归正常，指增超额也有望回归稳定。

纯债方面，组合久期依然保持灵活，随着季末长久期债券动量有所走弱，组合也适时缩短了久期配置。但后续依然将视市场情况进行择机配置。

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 级为 4.13%，E 级为 5.07%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 1.81%，E 级为 0.96%。

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	446,927,827.34	18.42
	其中：股票	446,927,827.34	18.42
2	固定收益投资	1,904,022,030.59	78.47
	其中：债券	1,904,022,030.59	78.47
	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	7,096,656.68	0.29
	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	57,588,575.39	2.37
7	其他资产	10,844,836.46	0.45
8	合计	2,426,479,926.46	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	3,279,948.78	0.16
B	采矿业	17,214,054.00	0.82
C	制造业	244,412,418.47	11.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,341,752.00	0.73
E	建筑业	6,856,713.22	0.33
F	批发和零售业	1,672,258.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	20,751,433.70	0.99
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,161,638.64	1.06
J	金融业	105,310,162.53	5.04
K	房地产业	2,636,952.00	0.13
L	租赁和商务服务业	5,660,226.00	0.27
M	科学研究和技术服务业	1,020,406.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	231,176.00	0.01
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	378,688.00	0.02
S	综合	—	—
	合计	446,927,827.34	21.38

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	300750	宁德时代	81,777	20,598,808.53	0.99
2	600519	贵州茅台	10,849	18,964,052.00	0.91
3	601318	中国平安	196,035	11,191,638.15	0.54
4	000333	美的集团	131,650	10,013,299.00	0.48
5	000651	格力电器	207,802	9,962,027.88	0.48
6	600276	恒瑞医药	146,600	7,667,180.00	0.37
7	600900	长江电力	243,800	7,326,190.00	0.35
8	000725	京东方A	1,445,049	6,459,369.03	0.31
9	600999	招商证券	322,670	6,272,704.80	0.30
10	601816	京沪高铁	976,100	5,895,644.00	0.28

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	209,941,611.49	10.04
2	央行票据	—	—
3	金融债券	642,955,729.07	30.76
	其中：政策性金融债	135,951,189.75	6.50
4	企业债券	377,951,614.27	18.08
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	673,173,075.76	32.20
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,904,022,030.59	91.08

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	1928036	19 中信银行永 续债	1,100,000	114,167,016.39	5.46
2	019740	24 国债 09	1,030,000	103,806,109.04	4.97
3	190311	19 进出 11	800,000	82,731,737.70	3.96
4	2028017	20 农业银行永 续债 01	600,000	61,261,854.25	2.93
5	185651	22 沪电 03	600,000	60,927,797.26	2.91

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，中国农业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、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国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、中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

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	205,158.92
2	应收证券清算款	243,107.95
3	应收股利	—
4	应收利息	—

5	应收申购款	10,396,569.59
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	10,844,836.46

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	118034	晶能转债	25,888,365.72	1.24
2	113053	隆22转债	24,769,535.71	1.18
3	123107	温氏转债	14,847,297.56	0.71
4	127049	希望转2	12,722,341.06	0.61
5	113648	巨星转债	12,203,314.25	0.58
6	113050	南银转债	12,067,589.26	0.58
7	118003	华兴转债	11,953,670.46	0.57
8	110059	浦发转债	11,781,386.20	0.56
9	127020	中金转债	11,498,777.40	0.55
10	113058	友发转债	11,340,123.84	0.54
11	132026	G三峡EB2	11,262,499.97	0.54
12	128109	楚江转债	11,139,922.75	0.53
13	127015	希望转债	11,104,272.62	0.53
14	128081	海亮转债	11,047,656.08	0.53
15	123208	孩王转债	10,883,197.64	0.52
16	113055	成银转债	10,568,473.04	0.51
17	127032	苏行转债	10,527,310.89	0.50
18	127052	西子转债	10,373,377.01	0.50
19	127083	山路转债	10,338,354.01	0.49
20	110073	国投转债	10,170,191.29	0.49
21	113056	重银转债	9,926,940.86	0.47
22	110085	通22转债	9,871,471.08	0.47
23	113673	岱美转债	9,744,128.55	0.47
24	127045	牧原转债	9,682,818.26	0.46
25	113068	金铜转债	9,644,413.12	0.46
26	123158	宙邦转债	9,537,949.24	0.46

27	123178	花园转债	9,418,994.01	0.45
28	110079	杭银转债	9,273,918.01	0.44
29	113682	益丰转债	9,006,696.51	0.43
30	127031	洋丰转债	8,320,532.93	0.40
31	113666	爱玛转债	8,257,590.40	0.40
32	113069	博23转债	8,005,965.94	0.38
33	123035	利德转债	7,952,829.36	0.38
34	123131	奥飞转债	7,920,725.42	0.38
35	127041	弘亚转债	7,576,508.10	0.36
36	123115	捷捷转债	7,506,292.13	0.36
37	127043	川恒转债	7,395,382.20	0.35
38	110074	精达转债	6,718,101.41	0.32
39	113065	齐鲁转债	6,601,583.59	0.32
40	110090	爱迪转债	6,333,966.64	0.30
41	123145	药石转债	6,072,375.70	0.29
42	123222	博俊转债	5,867,549.29	0.28
43	111017	蓝天转债	5,624,755.14	0.27
44	111010	立昂转债	5,283,391.70	0.25
45	113052	兴业转债	5,139,114.84	0.25
46	123188	水羊转债	5,116,814.88	0.24
47	123212	立中转债	5,024,857.19	0.24
48	127085	韵达转债	5,022,323.73	0.24
49	113042	上银转债	4,840,976.16	0.23
50	128128	齐翔转2	4,772,885.60	0.23
51	123184	天阳转债	4,769,508.68	0.23
52	113045	环旭转债	4,712,449.18	0.23
53	113658	密卫转债	4,687,029.44	0.22
54	123182	广联转债	4,598,241.40	0.22
55	123101	拓斯转债	4,528,509.90	0.22
56	123050	聚飞转债	4,397,338.36	0.21
57	127040	国泰转债	4,372,125.53	0.21
58	128087	孚日转债	4,218,867.10	0.20

59	127086	恒邦转债	4,122,017.57	0.20
60	111011	冠盛转债	4,117,335.73	0.20
61	110077	洪城转债	4,087,112.61	0.20
62	113579	健友转债	4,029,861.59	0.19
63	128141	旺能转债	3,984,808.66	0.19
64	128083	新北转债	3,983,152.42	0.19
65	123240	楚天转债	3,855,672.09	0.18
66	113652	伟22转债	3,655,629.76	0.17
67	123229	艾录转债	3,629,263.52	0.17
68	111007	永和转债	3,582,214.71	0.17
69	113672	福蓉转债	3,492,076.17	0.17
70	111018	华康转债	3,381,752.65	0.16
71	127072	博实转债	3,375,520.35	0.16
72	123169	正海转债	3,284,256.85	0.16
73	123224	宇邦转债	3,124,184.34	0.15
74	127100	神码转债	3,040,705.64	0.15
75	111002	特纸转债	2,930,451.17	0.14
76	127050	麒麟转债	2,878,728.46	0.14
77	113636	甬金转债	2,815,415.68	0.13
78	127095	广泰转债	2,809,954.84	0.13
79	127051	博杰转债	2,759,133.11	0.13
80	127053	豪美转债	2,701,136.01	0.13
81	127088	赫达转债	2,617,408.77	0.13
82	123133	佩蒂转债	2,563,950.23	0.12
83	127076	中宠转2	2,563,410.89	0.12
84	113651	松霖转债	2,529,477.60	0.12
85	123120	隆华转债	2,514,548.76	0.12
86	113615	金诚转债	2,502,402.74	0.12
87	123237	佳禾转债	2,470,690.73	0.12
88	118012	微芯转债	2,440,977.65	0.12
89	118025	奕瑞转债	2,332,380.30	0.11
90	123228	震裕转债	2,281,558.00	0.11

91	113659	莱克转债	2,164,896.90	0.10
92	128106	华统转债	2,154,595.40	0.10
93	113584	家悦转债	2,075,971.97	0.10
94	123223	九典转 02	2,042,263.56	0.10
95	123078	飞凯转债	1,854,404.36	0.09
96	113631	皖天转债	1,579,265.34	0.08
97	123113	仙乐转债	1,519,734.52	0.07
98	123194	百洋转债	1,505,402.58	0.07
99	123235	亿田转债	1,503,375.06	0.07
100	113675	新 23 转债	1,429,811.42	0.07
101	111000	起帆转债	1,428,964.73	0.07
102	118037	上声转债	1,285,364.88	0.06
103	123213	天源转债	1,093,042.43	0.05
104	113619	世运转债	1,086,838.52	0.05
105	113676	荣 23 转债	1,077,716.99	0.05
106	113664	大元转债	1,065,495.87	0.05
107	113662	豪能转债	961,318.24	0.05
108	118038	金宏转债	895,828.85	0.04
109	110067	华安转债	883,740.90	0.04
110	113678	中贝转债	830,683.06	0.04
111	128136	立讯转债	812,850.55	0.04
112	123211	阳谷转债	736,947.16	0.04
113	123127	耐普转债	725,051.37	0.03
114	113669	景 23 转债	608,731.12	0.03
115	123117	健帆转债	597,174.82	0.03
116	113637	华翔转债	551,163.01	0.03
117	113037	紫银转债	539,434.25	0.03
118	113632	鹤 21 转债	525,966.68	0.03
119	127082	亚科转债	521,118.26	0.02
120	123191	智尚转债	495,281.52	0.02
121	127062	垒知转债	405,198.05	0.02
122	127054	双箭转债	314,675.54	0.02

123	113623	凤 21 转债	233,225.69	0.01
124	118004	博瑞转债	113,517.46	0.01
125	110075	南航转债	112,824.62	0.01
126	123121	帝尔转债	91,122.89	0.00
127	113656	嘉诚转债	74,418.10	0.00
128	110082	宏发转债	49,909.87	0.00
129	113051	节能转债	39,370.42	0.00
130	113667	春 23 转债	30,944.25	0.00
131	113067	燃 23 转债	10,938.41	0.00
132	127030	盛虹转债	9,948.76	0.00
133	111008	沿浦转债	9,935.83	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	富国保利增强债券 A	富国保利增强债券 E
报告期期初基金份额总额	2,059,128,417.19	—
报告期期间基金总申购份额	498,688,780.10	816.06
报告期期间基金总赎回份额	934,157,618.29	—
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	1,623,659,579.00	816.06

注：本基金自 2024 年 9 月 25 日起增加 E 类份额，相关数据按实际存续期计算。

§ 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	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	816.06
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	10,000,816.06
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.62

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

单位：份

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	申购	2024-09- 26	816.06	1,000.00	0.000%
合计			816.06	1,000.00	

注：E类基金份额不收取申购费

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数 (份)	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数 (份)	发起份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	10,000,816.06	0.62	10,000,000.00	0.62	3年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,000,816.06	0.62	10,000,000.00	0.62	3年

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关约定，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定自 2024 年 9 月 25 日起对本基金增加 E 类基金份额，并对基金合同及托管协议的相应条款进行修订。具体可参见基金管理人于 2024 年 9 月 23 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国宝利增强债券型发起式证券投资基金增加 E 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》及修订后的基金合同、托管协议。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国宝利增强债券型发起式证券投资基金的文件
- 2、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金合同
- 3、富国宝利增强债券型发起式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、富国宝利增强债券型发起式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

10.2 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

10.3 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 10 月 25 日