

富国裕利债券型证券投资基金

二〇二四年第 2 季度报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国银行股份有限公司

报告送出日期： 2024 年 07 月 19 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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。

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 4 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	富国裕利债券		
基金主代码	014671		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2022年02月23日		
报告期末基金份额总额	4,383,713,999.47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。在基金投资方面,本基金投资于全市场的股票型ETF及基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金。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	中国银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	富国裕利债券A	富国裕利债券C	富国裕利债券E
下属分级基金的交易代码	014671	014672	018187
报告期末下属分级基金的份额总额	2,271,399,300.46份	113,313,969.56份	1,999,000,729.45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04月01日-2024年06月30日）		
	富国裕利债券 A	富国裕利债券 C	富国裕利债券 E
1. 本期已实现收益	2,352,039.97	-31,247.35	2,230,503.86
2. 本期利润	19,938,904.42	1,608,657.93	3,138,468.50
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0092	0.0129	0.0020
4. 期末基金资产净值	2,396,880,529.47	118,457,439.85	2,108,930,012.21
5. 期末基金份额净值	1.0552	1.0454	1.0550

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) 富国裕利债券 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	1.07%	0.17%	1.10%	0.11%	-0.03%	0.06%
过去六个月	1.40%	0.23%	2.48%	0.14%	-1.08%	0.09%
过去一年	1.28%	0.20%	1.52%	0.14%	-0.24%	0.06%
自基金合同生效起至今	5.52%	0.19%	0.98%	0.17%	4.54%	0.02%

(2) 富国裕利债券 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	0.99%	0.17%	1.10%	0.11%	-0.11%	0.06%
过去六个月	1.21%	0.23%	2.48%	0.14%	-1.27%	0.09%
过去一年	0.89%	0.20%	1.52%	0.14%	-0.63%	0.06%
自基金合同生效起至今	4.54%	0.19%	0.98%	0.17%	3.56%	0.02%

(3) 富国裕利债券 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	1.07%	0.17%	1.10%	0.11%	-0.03%	0.06%
过去六个月	1.40%	0.23%	2.48%	0.14%	-1.08%	0.09%
过去一年	1.28%	0.20%	1.52%	0.14%	-0.24%	0.06%
自基金分级生效日起至今	1.19%	0.20%	1.60%	0.14%	-0.41%	0.06%

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

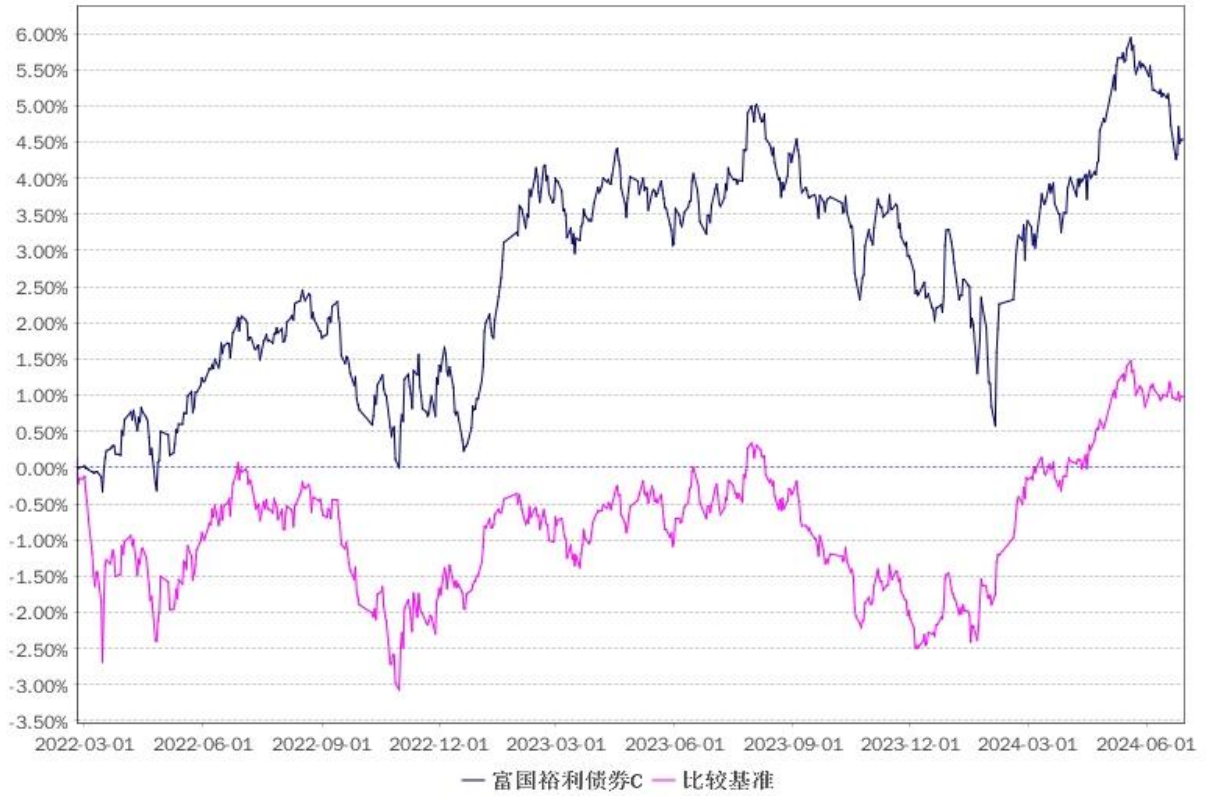
(1) 自基金合同生效以来富国裕利债券 A 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为 2024 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2022 年 2 月 23 日成立，建仓期 6 个月，从 2022 年 2 月 23 日起至 2022 年 8 月 22 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裕利债券 C 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为 2024 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2022 年 2 月 23 日成立，建仓期 6 个月，从 2022 年 2 月 23 日起至 2022 年 8 月 22 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(3) 自基金 E 级份额生效以来富国裕利债券 E 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为 2024 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2023 年 4 月 3 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		
刘兴旺	本基金现任基金经理	2022-07-28	—	19	硕士，曾任申银万国证券股份有限公司固定收益研究员，华宝兴业基金管理有限公司基金经理助理兼债券研究员，泰信基金管理有限公司基金经理，国投瑞银基金管理有限公司基金经理，国联证券股份有限公司资产管理部副总经理，长安基金管理有限公司固定收益总监；自 2021 年 11 月加入富国基金管理有限公司，自 2022 年 5 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 2022 年 07 月起任富国裕利债券型证券投资基金基金经理；自 2022 年 09 月起任富国双利增强债券型证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 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 2022 年 12 月起任富国久利稳健配置混合型证券投资

					资基金基金经理；自 2022 年 12 月起任富国优化增强债券型证券投资基金基金经理；自 2023 年 05 月起任富国稳健添利债券型证券投资基金基金经理；自 2023 年 07 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；具有基金从业资格。
黄纪亮	本基金现任基金经理	2022-02-23	—	16	硕士，曾任国泰君安证券股份有限公司助理研究员；自 2012 年 11 月加入富国基金管理有限公司，历任债券研究员、固定收益基金经理、固定收益投资部固定收益投资副总监、固定收益策略研究部总经理、高级固定收益基金经理；现任富国基金总经理助理，兼任富国基金固定收益投资部总经理、固定收益策略研究部总经理、高级固定收益基金经理。自 2013 年 02 月起任富国强回报定期开放债券型证券投资基金基金经理；自 2014 年 03 月起任富国汇利回报两年定期开放债券型证券投资基金(原富国汇利回报分级债券型证券投资基金)基金经理；自 2014 年 03 月起任富国天利增长债券投资

				基金基金经理；自 2014 年 06 月起任富国信用债债券型证券投资基金基金经理；自 2016 年 08 月起任富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理；自 2016 年 09 月起任富国产业债债券型证券投资基金基金经理；自 2017 年 08 月起任富国祥利一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理；自 2021 年 11 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 02 月起任富国裕利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裕利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》、《富国裕利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 12 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

2024 年二季度，国内经济继续平稳修复，但同时也面临有效需求不足、外部环境复杂严峻性等挑战。制造业 PMI 指数在 3-4 月短暂反弹后，5-6 月再度回落到 50 以下。CPI 和 PPI 同比略有企稳，但仍处低位。积极的财政政策逐步落地，二季度超长期特别国债开始发行。货币政策保持稳健，流动性维持合理充裕。4 月市场利率定价自律机制规范手工补息行为，5 月央行取消个人住房贷款利率政策下限，引导社会融资成本继续下降。海外方面，欧央行 6 月开启降息，美联储维持政策利率不变，降息预期推迟，美债利率先升后降，美元指数震荡偏强。二季度国内股票市场先涨后跌，风险偏好有所反复，债券市场表现偏强，4 月底利率短暂调整，5-6 月利率重新下行。投资操作上，本基金注重大类资产配置，积极把握债市机会，灵活调整组合久期和杠杆，优化权益持仓，报告期内净值有所增长。

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 1.07%，C 级为 0.99%，E 级为 1.07%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 1.10%，C 级为 1.10%，E 级为 1.10%。

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	354,919,107.11	7.49
	其中：股票	354,919,107.11	7.49
2	基金投资	189,646,077.42	4.00
3	固定收益投资	3,990,883,530.29	84.19
	其中：债券	3,960,663,879.22	83.56
	资产支持证券	30,219,651.07	0.64
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	96,509,826.71	2.04
	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	47,657,467.39	1.01
8	其他资产	60,455,449.45	1.28
9	合计	4,740,071,458.37	100.00

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 77,236,941.50 元，占资产净值比例为 1.67%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 840,850.00 元，占资产净值比例为 0.02%。

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	466,460.00	0.01
B	采矿业	15,755,190.62	0.34
C	制造业	174,772,445.92	3.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,270,958.00	0.46
E	建筑业	3,382,561.00	0.07
F	批发和零售业	2,099,913.78	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	6,938,974.00	0.15
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,935,528.09	0.15
J	金融业	30,244,423.60	0.65
K	房地产业	5,832,625.80	0.13

L	租赁和商务服务业	1,558,060.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	4,162,910.30	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	1,690,358.50	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	487,188.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	798,086.00	0.02
S	综合	445,632.00	0.01
	合计	276,841,315.61	5.99

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	17,001,692.00	0.37
医疗保健	13,702,239.50	0.30
通信服务	13,595,200.00	0.29
原材料	12,872,470.00	0.28
非日常生活消费品	12,150,300.00	0.26
能源	6,552,840.00	0.14
工业	2,203,050.00	0.05
合计	78,077,791.50	1.69

注：1、以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

2、以上行业分类的统计中已包含沪港通深港通投资的股票。

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	00700	腾讯控股	40,000	13,595,200.00	0.29
2	01378	中国宏桥	1,193,000	12,872,470.00	0.28
3	00175	吉利汽车	1,355,000	10,867,100.00	0.24
4	600079	人福医药	614,000	10,542,380.00	0.23
5	03958	东方证券	3,774,800	10,531,692.00	0.23
6	600587	新华医疗	603,980	9,506,645.20	0.21
7	002532	天山铝业	1,165,700	9,453,827.00	0.20
8	600388	龙净环保	736,565	8,551,519.65	0.18
9	03968	招商银行	200,000	6,470,000.00	0.14
9	600036	招商银行	47,000	1,606,930.00	0.03

10	000589	贵州轮胎	1,531,818	7,766,317.26	0.17
----	--------	------	-----------	--------------	------

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	57,943,172.50	1.25
2	央行票据	—	—
3	金融债券	2,813,845,920.05	60.85
	其中：政策性金融债	435,377,114.42	9.42
4	企业债券	206,009,549.58	4.45
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	373,019,797.15	8.07
7	可转债（可交换债）	509,845,439.94	11.03
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	3,960,663,879.22	85.65

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	210316	21 进出 16	1,600,000	170,120,393.44	3.68
2	092280080	22 光大银行二级资本债 01A	1,500,000	158,190,327.87	3.42
3	242480004	24 华夏银行永续债 01	1,500,000	151,136,753.42	3.27
4	312400001	24 工行 TLAC 非资本债 01A	1,300,000	130,847,493.15	2.83
5	242400007	24 中信银行永续债 01	1,100,000	111,133,078.36	2.40

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	180297	燕山湖 A	200,000	20,157,377.44	0.44
2	135099	22 金泰优	100,000	10,062,273.63	0.22

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，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。

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，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局、国家金融监督管理总局深圳监管局、国家金融监督管理总局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国光大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	279,099.65
2	应收证券清算款	1,152,000.00
3	应收股利	1,073,555.06
4	应收利息	—
5	应收申购款	57,898,996.28
6	其他应收款	51,798.46
7	其他	—
8	合计	60,455,449.45

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	110059	浦发转债	89,448,763.51	1.93
2	127089	晶澳转债	50,597,324.93	1.09
3	118031	天23转债	29,649,255.68	0.64
4	118022	锂科转债	23,274,248.22	0.50
5	123172	漱玉转债	22,375,073.90	0.48
6	127076	中宠转2	21,073,937.25	0.46
7	110087	天业转债	19,629,020.99	0.42
8	123169	正海转债	19,459,382.63	0.42
9	113641	华友转债	15,625,920.11	0.34
10	110093	神马转债	13,702,472.22	0.30
11	118040	宏微转债	11,846,843.84	0.26
12	128083	新北转债	11,242,670.42	0.24
13	123212	立中转债	10,105,249.75	0.22
14	128129	青农转债	9,623,085.89	0.21
15	123214	东宝转债	9,459,970.56	0.20
16	123190	道氏转02	9,230,315.07	0.20
17	127027	能化转债	9,008,368.55	0.19
18	118005	天奈转债	7,826,360.03	0.17
19	127061	美锦转债	7,743,699.73	0.17
20	113654	永02转债	7,548,573.80	0.16
21	118023	广大转债	7,090,602.74	0.15
22	113640	苏利转债	6,474,403.20	0.14
23	110086	精工转债	5,348,005.48	0.12
24	110085	通22转债	4,706,632.11	0.10
25	128130	景兴转债	3,699,971.60	0.08
26	110079	杭银转债	3,635,093.71	0.08
27	113653	永22转债	3,402,529.16	0.07
28	113052	兴业转债	3,246,530.14	0.07
29	123147	中辰转债	3,200,162.80	0.07
30	110052	贵广转债	3,009,770.27	0.07
31	127073	天赐转债	2,243,968.24	0.05
32	123215	铭利转债	2,214,624.33	0.05

33	123087	明电转债	2,126,018.36	0.05
34	123170	南电转债	2,030,111.72	0.04
35	123115	捷捷转债	2,026,461.78	0.04
36	123217	富仕转债	2,011,185.23	0.04
37	123076	强力转债	1,726,883.73	0.04
38	123121	帝尔转债	1,717,304.74	0.04
39	123071	天能转债	1,667,958.49	0.04
40	127025	冀东转债	1,655,775.56	0.04
41	123078	飞凯转债	1,508,354.82	0.03
42	123177	测绘转债	1,415,949.34	0.03
43	127087	星帅转 2	1,391,242.19	0.03
44	127060	湘佳转债	1,353,759.77	0.03
45	118011	银微转债	1,295,452.35	0.03
46	113652	伟 22 转债	1,284,947.65	0.03
47	123198	金埔转债	1,273,353.70	0.03
48	118033	华特转债	1,211,606.10	0.03
49	111010	立昂转债	1,206,313.45	0.03
50	113628	晨丰转债	1,200,195.90	0.03
51	118032	建龙转债	1,191,878.91	0.03
52	113669	景 23 转债	1,151,240.01	0.02
53	113633	科沃转债	1,069,603.43	0.02
54	128136	立讯转债	1,024,479.60	0.02
55	127055	精装转债	990,293.42	0.02
56	123184	天阳转债	946,942.30	0.02
57	128109	楚江转债	886,612.16	0.02
58	128131	崇达转 2	884,394.98	0.02
59	113058	友发转债	825,103.77	0.02
60	110092	三房转债	822,493.56	0.02
61	123224	宇邦转债	822,074.70	0.02
62	113602	景 20 转债	787,241.05	0.02
63	123130	设研转债	782,460.21	0.02
64	123063	大禹转债	773,652.01	0.02

65	127074	麦米转 2	767,398.58	0.02
66	123124	晶瑞转 2	760,458.06	0.02
67	123178	花园转债	668,510.38	0.01
68	123101	拓斯转债	639,088.68	0.01
69	128117	道恩转债	623,857.72	0.01
70	123090	三诺转债	619,152.53	0.01
71	118034	晶能转债	615,025.68	0.01
72	110082	宏发转债	592,111.64	0.01
73	123143	胜蓝转债	575,107.00	0.01
74	127032	苏行转债	526,695.63	0.01
75	113062	常银转债	526,119.49	0.01
76	113024	核建转债	481,161.84	0.01
77	128132	交建转债	465,760.55	0.01
78	123225	翔丰转债	459,614.36	0.01
79	123127	耐普转债	453,032.27	0.01
80	123145	药石转债	452,791.23	0.01
81	127040	国泰转债	435,280.59	0.01
82	123122	富瀚转债	422,491.27	0.01
83	113050	南银转债	401,318.66	0.01
84	113655	欧 22 转债	383,441.34	0.01
85	113658	密卫转债	377,659.41	0.01
86	123153	英力转债	368,994.36	0.01
87	123109	昌红转债	313,233.70	0.01
88	110063	鹰 19 转债	308,281.51	0.01
89	123165	回天转债	249,503.66	0.01
90	123160	泰福转债	248,407.94	0.01
91	128128	齐翔转 2	234,185.67	0.01
92	113573	纵横转债	229,155.36	0.00
93	111015	东亚转债	228,413.84	0.00
94	113593	沪工转债	221,113.42	0.00
95	128049	华源转债	198,417.09	0.00
96	128133	奇正转债	191,787.40	0.00

97	113656	嘉诚转债	177,437.07	0.00
98	123222	博俊转债	170,169.68	0.00
99	128066	亚泰转债	164,119.73	0.00
100	128120	联诚转债	161,709.63	0.00
101	127066	科利转债	160,365.72	0.00
102	128116	瑞达转债	159,166.58	0.00
103	123155	中陆转债	158,214.89	0.00
104	113632	鹤21转债	153,406.95	0.00
105	123163	金沃转债	138,198.63	0.00
106	113532	海环转债	131,433.73	0.00
107	118035	国力转债	116,413.90	0.00
108	113068	金铜转债	110,688.16	0.00
109	118041	星球转债	101,454.16	0.00
110	113042	上银转债	90,938.81	0.00
111	113673	岱美转债	86,589.18	0.00
112	123193	海能转债	84,373.26	0.00
113	128087	孚日转债	46,577.30	0.00
114	127075	百川转2	40,799.78	0.00
115	111003	聚合转债	36,130.27	0.00
116	111002	特纸转债	35,618.79	0.00
117	110076	华海转债	21,720.47	0.00
118	113033	利群转债	20,331.80	0.00
119	123114	三角转债	13,108.16	0.00
120	113055	成银转债	12,594.41	0.00
121	113662	豪能转债	12,535.11	0.00
122	113060	浙22转债	12,510.24	0.00
123	123204	金丹转债	11,650.47	0.00
124	127078	优彩转债	11,161.17	0.00
125	113606	荣泰转债	11,142.22	0.00
126	123126	瑞丰转债	11,019.99	0.00
127	123154	火星转债	10,621.16	0.00
128	128105	长集转债	10,270.75	0.00

129	123133	佩蒂转债	10,169.88	0.00
130	123039	开润转债	6,904.36	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 基金中基金

6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金 资产净 值比例 (%)	是否属于 基金管理 人及管理 人关联方 所管理的 基金
1	001508	富国新动力 灵活配置混 合 A	契约型开放 式	8,819,416. 34	23,106,870 .81	0.50	是
2	011830	富国天恒混 合 A	契约型开放 式	19,077,369 .68	20,235,366 .02	0.44	是
3	013332	富国中证 500 指数增 强(LOF)C	契约型开放 式	9,433,689. 62	19,197,558 .38	0.42	是
4	159949	华安创业板 50ETF	交易型开放 式	24,102,234 .00	17,425,915 .18	0.38	否
5	013291	富国沪深 300 指数增 强 C	契约型开放 式	12,006,986 .85	17,025,907 .35	0.37	是
6	512880	国泰中证全 指证券公司 ETF	交易型开放 式	21,000,000 .00	16,443,000 .00	0.36	否
7	510310	易方达沪深 300 发起式 ETF	交易型开放 式	7,804,600. 00	13,306,843 .00	0.29	否
8	000880	富国研究精 选灵活配置 混合 A	契约型开放 式	3,978,894. 05	10,022,834 .11	0.22	是
9	515790	光伏 ETF	交易型开放 式	13,000,000 .00	8,840,000. 00	0.19	否
10	513090	易方达中证 香港证券投 资主题 ETF	交易型开放 式	8,571,000. 00	7,851,036. 00	0.17	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 (2024年04月01日至2024年06月30日)	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费(元)	—	—
当期交易基金产生的赎回费(元)	—	—
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	18,998.93	18,998.93
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	325,698.58	241,076.45
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	64,799.37	46,439.62
当期交易基金产生的交易费	2,805.49	382.52

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

注：本基金本报告期所持有的基金未发生具有重大影响的事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国裕利债券 A	富国裕利债券 C	富国裕利债券 E
报告期期初基金份额总额	2,046,815,914.77	143,344,240.07	1,062,910,349.16
报告期期间基金总申购份额	566,943,614.83	6,794,346.31	1,374,053,651.35
报告期期间基金总赎回份额	342,360,229.14	36,824,616.82	437,963,271.06
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	2,271,399,300.46	113,313,969.56	1,999,000,729.45

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 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	959.14
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	959.14
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.00

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。

8.2 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。

§ 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。

§ 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裕利债券型证券投资基金的文件
- 2、富国裕利债券型证券投资基金基金合同
- 3、富国裕利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、富国裕利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

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 07 月 19 日