

富国裕利债券型证券投资基金

二〇二三年第3季度报告

2023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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2023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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 7 月 1 日起至 2023 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	4,841,368,441.47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	2,595,747,280.56份	423,270,022.48份	1,822,351,138.43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（2023年07月01日-2023年09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	15,810,151.70	2,143,390.55	8,349,652.59
2. 本期利润	-620,295.21	-576,484.31	-4,118,996.84
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0003	-0.0016	-0.0033
4. 期末基金资产净值	2,710,220,468.72	439,101,814.55	1,902,427,643.88
5. 期末基金份额净值	1.0441	1.0374	1.0439

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	0.21%	0.16%	-0.67%	0.14%	0.88%	0.02%
过去六个月	0.28%	0.16%	-0.49%	0.13%	0.77%	0.03%
过去一年	3.34%	0.19%	0.71%	0.16%	2.63%	0.03%
自基金合同生效起至今	4.41%	0.17%	-1.20%	0.18%	5.61%	-0.01%

###### (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	0.12%	0.16%	-0.67%	0.14%	0.79%	0.02%
过去六个月	0.08%	0.16%	-0.49%	0.13%	0.57%	0.03%
过去一年	2.92%	0.19%	0.71%	0.16%	2.21%	0.03%
自基金合同生效起至今	3.74%	0.17%	-1.20%	0.18%	4.94%	-0.01%

###### (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	0.21%	0.16%	-0.67%	0.14%	0.88%	0.02%
自基金分级生效日起至今	0.12%	0.16%	-0.59%	0.14%	0.71%	0.02%

### 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

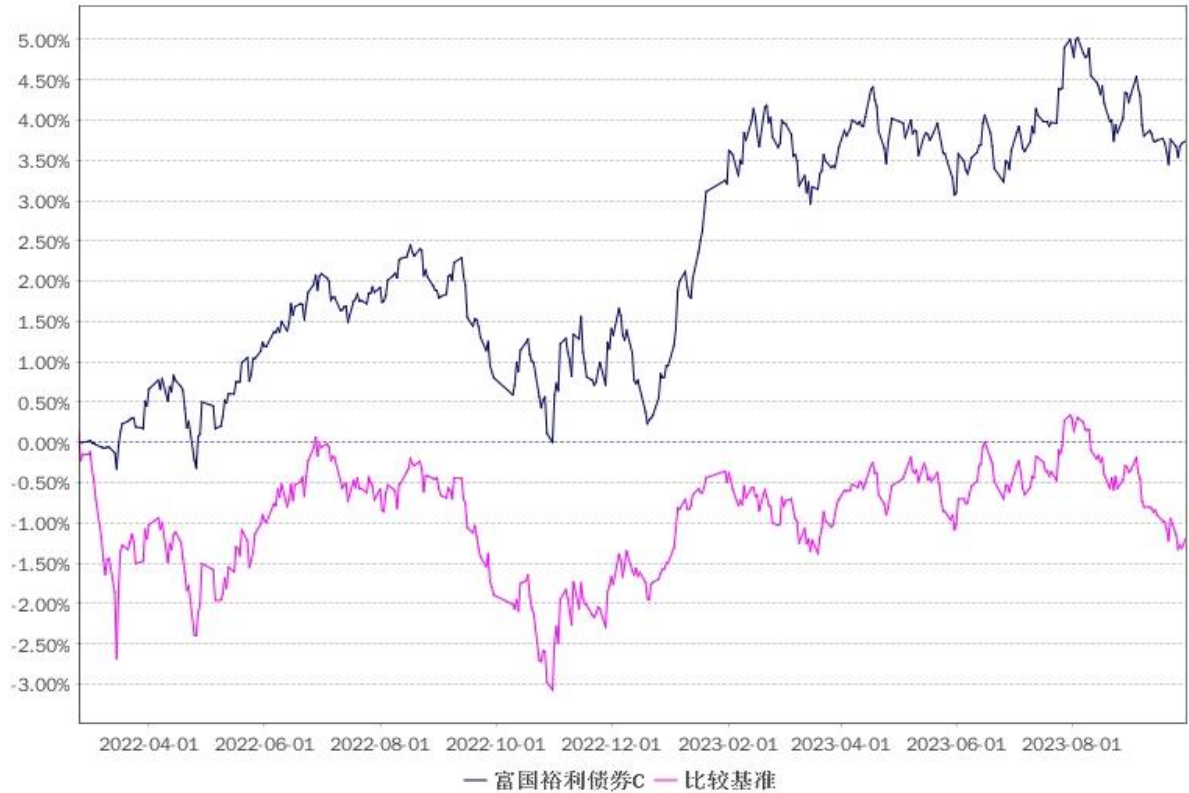
(1) 自基金合同生效以来富国裕利债券 A 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为 2023 年 9 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。

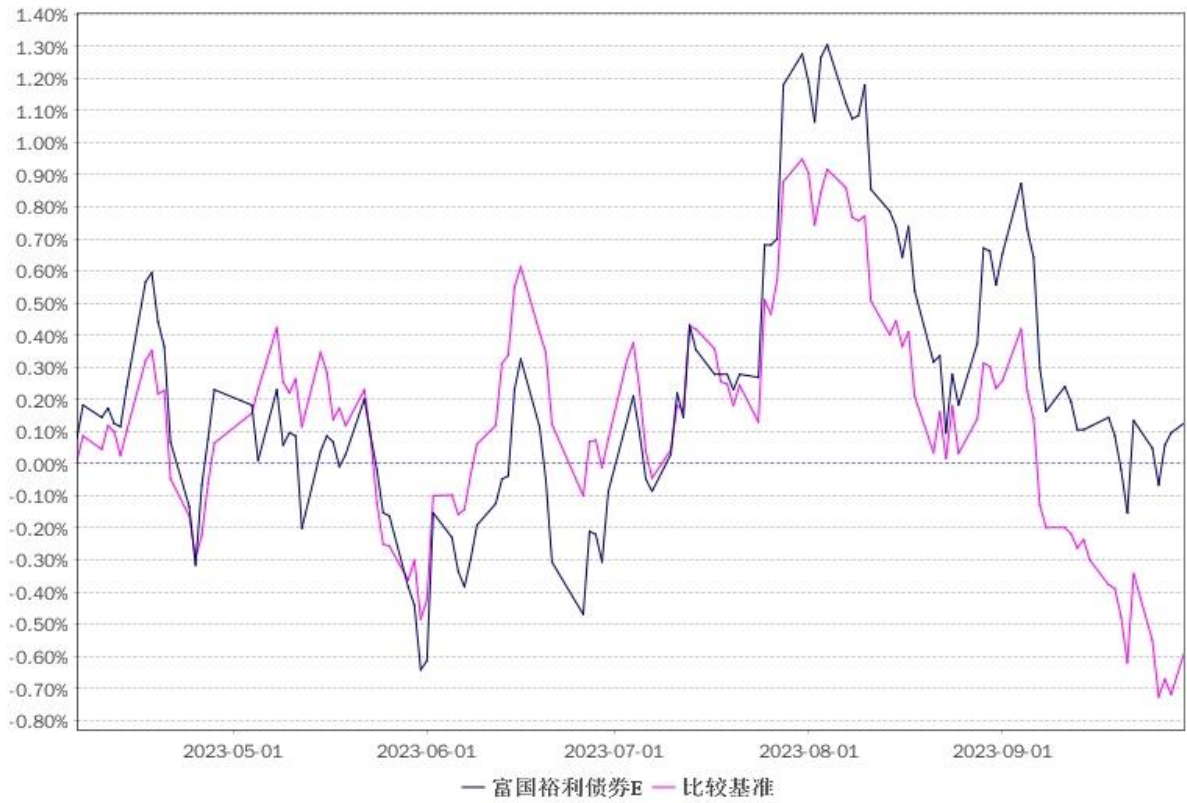
(2) 自基金合同生效以来富国裕利债券 C 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为 2023 年 9 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 2023 年 9 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		
黄纪亮	本基金现任基金经理	2022-02-23	—	15	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



					<p>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 2019 年 09 月起任富国投资级信用债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。</p>
刘兴旺	本基金现任基金经理	2022-07-28	—	18	<p>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</p>

				<p>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。</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中国证监会《证券基金经营机构董事、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**

2023 年三季度，国内经济温和修复，宏观政策加大调控力度，着力扩大内需、提振信心、防范风险。货币政策方面，7 月流动性保持充裕、8 月 MLF 和 OMO 分别降息 15bps 和 10bps、9 月降准 25bps；财政政策方面，优化减税降费政策、有序推进化解地方债务风险；地产政策方面，调整存量房贷利率、因城施策优化房地产政策。三季度海外扰动因素较多，美联储 7 月加息 25bps，9 月未加息但表态偏鹰，美债利率持续上行、美元指数明显走高。三季度债券收益率先下后上，7-8 月货币政策持续发力，十年国债一度下行触及 2.54%，9 月地产等政策调整，经济预期改善，PMI、CPI 等指标边际回升，十年国债收益率反弹到 2.65%以上。三季度政策逐步发力，但效果尚在传导，外部影响因素复杂，风险偏好仍处低位，股票市场震荡走弱。投资操作上，本基金注重大类资产配置，优化股票和转债持仓，适时调整组合久期和杠杆，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 0.21%，C 级为 0.12%，E 级为 0.21%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 -0.67%，C 级为 -0.67%，E 级为 -0.67%。

#### **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	307,781,262.73	5.26
	其中：股票	307,781,262.73	5.26
2	基金投资	401,936,324.19	6.86
3	固定收益投资	4,667,799,612.24	79.71
	其中：债券	4,637,567,835.49	79.19
	资产支持证券	30,231,776.75	0.52
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	130,006,763.55	2.22
	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	23,968,272.06	0.41
8	其他资产	324,624,367.26	5.54
9	合计	5,856,116,602.03	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 86,621,959.00 元，占资产净值比例为 1.71%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 10,595,925.00 元，占资产净值比例为 0.21%。

### 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	3,031,200.00	0.06
B	采矿业	—	—
C	制造业	128,611,183.13	2.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,030,000.00	0.16
E	建筑业	3,410,000.00	0.07
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	24,182,560.00	0.48
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,082,667.60	0.04
J	金融业	28,194,389.00	0.56
K	房地产业	2,803,749.00	0.06

L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	6,782,366.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	3,435,264.00	0.07
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	210,563,378.73	4.17

## 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（%）
医疗保健	31,369,480.00	0.62
金融	19,705,144.00	0.39
通信服务	15,172,920.00	0.30
房地产	11,920,000.00	0.24
原材料	9,704,640.00	0.19
工业	3,989,700.00	0.08
非日常生活消费品	3,392,000.00	0.07
公用事业	1,193,000.00	0.02
信息技术	771,000.00	0.02
合计	97,217,884.00	1.92

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	600036	招商银行	394,100	12,993,477.00	0.26
1	03968	招商银行	160,000	4,801,600.00	0.10
2	601816	京沪高铁	3,280,000	16,826,400.00	0.33
3	300059	东方财富	1,000,060	15,200,912.00	0.30
4	00700	腾讯控股	54,000	15,172,920.00	0.30
5	00688	中国海外发展	800,000	11,920,000.00	0.24
6	03958	东方证券	3,011,200	10,900,544.00	0.22
7	601636	旗滨集团	1,300,000	10,660,000.00	0.21

8	01378	中国宏桥	1,378,500	9,704,640.00	0.19
9	600519	贵州茅台	5,000	8,992,750.00	0.18
10	002532	天山铝业	1,280,000	8,384,000.00	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	271,954,466.03	5.38
2	央行票据	—	—
3	金融债券	2,785,364,113.48	55.14
	其中：政策性金融债	262,926,898.91	5.20
4	企业债券	415,552,214.26	8.23
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	555,537,387.39	11.00
7	可转债(可交换债)	609,159,654.33	12.06
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	4,637,567,835.49	91.80

#### 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	2028006	20 邮储银行永续债	1,600,000	165,038,268.85	3.27
2	110059	浦发转债	1,450,000	157,782,802.74	3.12
3	2028017	20 农业银行永续债 01	1,500,000	153,390,196.72	3.04
4	210406	21 农发 06	1,000,000	100,916,885.25	2.00
5	019678	22 国债 13	989,000	99,488,766.60	1.97

#### 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	20,207,208.27	0.40
2	135099	22 金泰优	100,000	10,024,568.48	0.20

## **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，中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。



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、中国人民银行的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，南京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江苏省分局的处罚。

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	502,199.46
2	应收证券清算款	238,324,809.74
3	应收股利	428,882.01
4	应收利息	—
5	应收申购款	85,349,834.48
6	其他应收款	18,641.57
7	其他	—
8	合计	324,624,367.26

#### 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	157,782,802.74	3.12

2	110093	神马转债	65,173,729.91	1.29
3	113056	重银转债	50,347,039.45	1.00
4	110085	通22转债	45,030,760.00	0.89
5	110087	天业转债	22,121,534.25	0.44
6	127040	国泰转债	17,093,534.15	0.34
7	118026	利元转债	15,936,947.18	0.32
8	128129	青农转债	14,285,530.22	0.28
9	110063	鹰19转债	11,615,452.00	0.23
10	113048	晶科转债	10,256,460.21	0.20
11	113051	节能转债	9,477,322.69	0.19
12	113059	福莱转债	8,087,428.56	0.16
13	110047	山鹰转债	7,617,533.58	0.15
14	110043	无锡转债	7,592,384.11	0.15
15	127049	希望转2	7,541,834.22	0.15
16	127073	天赐转债	6,949,306.90	0.14
17	118022	锂科转债	6,604,716.02	0.13
18	118028	会通转债	6,019,996.93	0.12
19	113042	上银转债	5,073,872.67	0.10
20	113640	苏利转债	4,018,266.74	0.08
21	123107	温氏转债	3,725,330.14	0.07
22	110079	杭银转债	3,491,884.11	0.07
23	113052	兴业转债	3,095,811.78	0.06
24	132018	G三峡EB1	2,946,035.62	0.06
25	113037	紫银转债	1,761,446.58	0.03
26	113044	大秦转债	1,736,632.67	0.03
27	113660	寿22转债	1,634,821.33	0.03
28	127006	敖东转债	1,553,647.56	0.03
29	110053	苏银转债	1,378,455.78	0.03
30	113663	新化转债	1,106,236.20	0.02
31	123168	惠云转债	983,453.14	0.02
32	128048	张行转债	247,230.09	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	510300	华泰柏瑞沪 深 300ETF	交易型开放 式	36,500,000 .00	137,386,00 0.00	2.72	否
2	013291	富国沪深 300 增强 C	契约型开放 式	19,982,111 .54	29,113,936 .51	0.58	是
3	159792	港股通互联 网 ETF	契约型, 交 易型开放式	31,276,600 .00	18,640,853 .60	0.37	是
4	159755	电池 ETF	交易型开放 式	23,950,200 .00	16,238,235 .60	0.32	否
5	159949	创业板 50ETF	交易型开放 式	19,102,234 .00	16,026,774 .33	0.32	否
6	515030	华夏中证新 能源汽车 ETF	交易型开放 式	9,000,000. 00	11,592,000 .00	0.23	否
7	510310	易方达沪深 300 发起式 ETF	交易型开放 式	6,000,000. 00	10,782,000 .00	0.21	否
8	000880	富国研究精 选灵活配置 混合	契约型开放 式	3,978,894. 05	10,424,702 .41	0.21	是
9	512710	富国中证军 工龙头 ETF	契约型, 交 易型开放式	16,000,000 .00	10,208,000 .00	0.20	是
10	001508	富国新动力 灵活配置混 合 A	契约型开放 式	3,459,654. 72	10,074,514 .54	0.20	是

### 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 (2023 年 07 月 01 日至 2023 年 09 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)	72,628.73	72,628.73
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	20,447.20	20,447.20
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	467,316.89	245,435.55
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	88,963.83	43,985.69
当期交易基金产生的交易费	12,895.92	683.77

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

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	1,869,375,456.26	321,231,881.71	719,303,608.94
报告期期间基金总申购份额	1,156,706,470.39	196,629,014.45	1,160,521,769.58
报告期期间基金总赎回份额	430,334,646.09	94,590,873.68	57,474,240.09
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	2,595,747,280.56	423,270,022.48	1,822,351,138.43

## § 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  
2023 年 10 月 25 日