

富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

二〇二五年中期报告

2025 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： 兴业银行股份有限公司

送出日期： 2025 年 08 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | | |
|-----|-------------------------------------|----|
| § 1 | 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 | 重要提示..... | 2 |
| 1.2 | 目录..... | 3 |
| § 2 | 基金简介 | 6 |
| 2.1 | 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 | 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 | 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 | 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 | 其他相关资料..... | 7 |
| § 3 | 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 | 基金净值表现..... | 8 |
| § 4 | 管理人报告 | 10 |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 4.4 | 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明..... | 12 |
| 4.5 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 4.8 | 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 13 |
| § 5 | 托管人报告 | 14 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 14 |
| 5.2 | 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 | 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 14 |
| § 6 | 中期财务报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 | 资产负债表..... | 15 |
| 6.2 | 利润表..... | 16 |
| 6.3 | 净资产变动表..... | 17 |
| 6.4 | 报表附注..... | 18 |
| § 7 | 投资组合报告 | 42 |

| | | |
|------|-------------------------------------|----|
| 7.1 | 期末基金资产组合情况..... | 42 |
| 7.2 | 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 42 |
| 7.3 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 42 |
| 7.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 42 |
| 7.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 43 |
| 7.6 | 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..... | 43 |
| 7.7 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.. | 43 |
| 7.8 | 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贵金属投资明细.. | 44 |
| 7.9 | 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..... | 44 |
| 7.10 | 本基金投资股指期货的投资政策..... | 44 |
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 44 |
| 7.12 | 投资组合报告附注..... | 44 |
| § 8 | 基金份额持有人信息 | 46 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 46 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 46 |
| 8.3 | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 46 |
| 8.4 | 发起式基金发起资金持有份额情况..... | 46 |
| § 9 | 开放式基金份额变动 | 47 |
| § 10 | 重大事件揭示..... | 48 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议..... | 48 |
| 10.2 | 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 48 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 48 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变..... | 48 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 48 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 48 |
| 10.7 | 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 48 |
| 10.8 | 其他重大事件..... | 50 |
| § 11 | 影响投资者决策的其他重要信息..... | 51 |
| 11.1 | 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 | 51 |
| 11.2 | 影响投资者决策的其他重要信息..... | 51 |
| § 12 | 备查文件目录..... | 53 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---------------------------|
| 基金名称 | 富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称 | 富国聚利纯债三个月定期开放债券发起式 |
| 基金主代码 | 004978 |
| 交易代码 | 004978 |
| 基金运作方式 | 契约型，定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 08 月 10 日 |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,545,514,034.60 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 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 | 本基金奉行“自上而下”和“自下而上”相结合的主动式投资管理理念，采用价值分析方法，在分析和判断财政、货币、利率、通货膨胀等宏观经济运行指标的基础上，自上而下确定和动态调整大类资产比例和债券的组合目标久期、期限结构配置及类属配置；同时，采用“自下而上”的投资理念，在研究分析信用风险、流动性风险、供求关系、收益率水平、税收水平等因素基础上，自下而上的精选个券，把握固定收益类金融工具投资机会。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富（总值）指数收益率 \times 90%+1 年期定期存款利率（税后） \times 10% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|--|----------------------------|
| 名称 | | 富国基金管理有限公司 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 赵瑛 | 冯萌 |
| | 联系电话 | 021-20361818 | 021-52629999-213310 |
| | 电子邮箱 | public@fullgoal.com.cn | fengmeng@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 95105686、4008880688 | 95561 |
| 传真 | | 021-20361616 | 021-62159217 |
| 注册地址 | | 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 | 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区世纪大道 | 上海市浦东新区银城路 |

| | | |
|-------|---------------------------|-----------|
| | 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 | 167 号 4 楼 |
| 邮政编码 | 200120 | 200120 |
| 法定代表人 | 裴长江 | 吕家进 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.fullgoal.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 兴业银行股份有限公司 上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|--|
| 注册登记机构 | 富国基金管理有限公司 | 上海市浦东新区世纪大道 1196 号 世纪汇办公楼二座 27-30 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日) |
|---------------|---|
| 本期已实现收益 | 30,448,531.89 |
| 本期利润 | 11,003,122.59 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0071 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.65% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.66% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025 年 06 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 153,418,339.86 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0993 |
| 期末基金资产净值 | 1,698,932,374.46 |
| 期末基金份额净值 | 1.0993 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2025 年 06 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 40.05% |

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。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

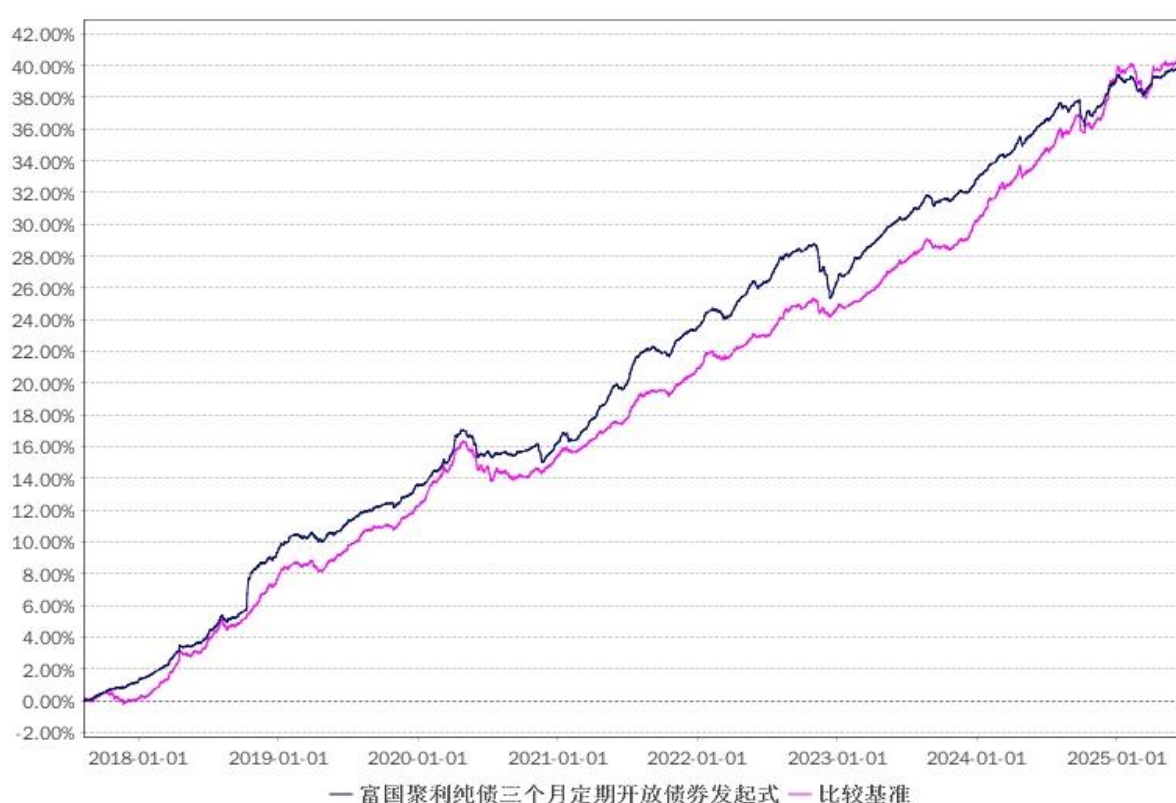
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.25% | 0.02% | 0.46% | 0.03% | -0.21% | -0.01% |
| 过去三个月 | 0.92% | 0.04% | 1.54% | 0.09% | -0.62% | -0.05% |
| 过去六个月 | 0.66% | 0.05% | 1.02% | 0.10% | -0.36% | -0.05% |
| 过去一年 | 2.53% | 0.07% | 4.47% | 0.09% | -1.94% | -0.02% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去三年 | 10.84% | 0.06% | 14.44% | 0.07% | -3.60% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 40.05% | 0.06% | 40.75% | 0.06% | -0.70% | 0.00% |

注：本基金业绩比较基准根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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2025年6月30日。

2、本基金于2017年8月10日成立，建仓期6个月，从2017年8月10日起至2018年2月9日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月，加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：国泰海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省金融资产管理股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安（以下简称“存续公司”）承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持本公司股权亦归属于存续公司，即存续公司成为本公司的主要股东。根据 2025 年 4 月 4 日《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，存续公司正式更名为“国泰海通证券股份有限公司”。

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、

富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 391 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 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 | | |
| 刘瀚驰 | 本基金现任基金经理 | 2020-11-20 | — | 10 | 硕士，曾任职于招商银行总行资产管理部、招银理财有限责任公司；自 2020 年 6 月加入富国基金管理有限公司，历任固定收益基金经理助理、固定收益基金经理；现任富国基金固定收益投资部固定收益基金经理。自 2020 年 11 月起任富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金（原富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金）基金经理；自 2021 年 04 月起任富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2021 年 11 月起任富国达利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 06 月起任富国碳中和一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2024 年 12 月起任富国中债优选投资级信用债指数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聚利纯债三个月定期开放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》、《富国聚利纯债三个月定期开放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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和相关法规要求，制定了《证券投资公平交易管理办法》，保证公司旗下不同投资组合在系统控制、日常操作层面享有公平的交易机会，并保持各投资组合的独立投资决策权。

本报告期内公司旗下基金严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，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。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025年上半年债券市场收益率整体呈现先上后下的震荡态势，利率债方面，10年期国债指数下行3bps收于1.65%，期间最高曾到达1.9关口，30年期国债指数下行5bps收于1.86%，期限利差有所压缩，曲线进一步平坦化。信用债方面，3年期AAA中短期票据指数上行9bps收于1.83%，10年期AAA中短期票据指数下行2bps收于2.09%，3年期AA中短期票据指数下行2bps收于2.04%，高等级信用中短端收益率有所抬升，长端则有所下行，曲线进一步平坦化，中低评级信用利差有所压缩。复盘来看，主要是1月开年以来银行间资金面有一波较为明显的收紧，市场在1月短端资产回调明显，长端由于基本面方面因素实际上行并不多，2月春节以来deepseek以及机器人等热门板块带动了中国权益资产的价格重估，股票快速上涨，债券市场整体承压，10年国债在3月17日达到了最高1.9的区间内高点。4月初，美国总统特朗普宣布对中国征收关税，贸易战阴云打击了权益市场情绪，债券市场相应走强，收益率开始下行。5月7日，央行

降准降息同步落地，6月5日，央行买断式回购提前续作，市场在这一阶段明显下行，信用利差和期限利差压缩。报告期内，我们根据市场实际情况，灵活调整组合久期和杠杆仓位，积极参与一二级市场投资机会，报告期内净值有所增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2025年6月30日，本基金份额净值为1.0993元；份额累计净值为1.3586元；本报告期，本基金份额净值增长率为0.66%；同期业绩比较基准收益率为1.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2025年下半年，我们认为债券市场可能维持一个窄幅震荡的态势。基本面方面，年内宏观指标并不算弱，但微观仍有一些结构性问题，受益于“反内卷”供给性政策预期，大宗商品价格从低位有所抬升，但是否有需求来匹配需要观察。资金面方面，第三季度的政府债券发行量仍大，需要资金进行配合。政策事件方面可能要关注重要会议，以及权益市场是否持续有超预期的表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末 2025 年 06 月 30 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 资 产： | | |
| 货币资金 | 199,286.14 | 148,925.95 |
| 结算备付金 | 23,344,497.16 | 10,005,602.93 |
| 存出保证金 | 2,568.04 | 41,341.18 |
| 交易性金融资产 | 2,300,747,641.84 | 2,324,450,549.20 |
| 其中：股票投资 | — | — |
| 基金投资 | — | — |
| 债券投资 | 2,300,747,641.84 | 2,324,450,549.20 |
| 资产支持证券投资 | — | — |
| 贵金属投资 | — | — |
| 其他投资 | — | — |
| 衍生金融资产 | — | — |
| 买入返售金融资产 | — | — |
| 应收清算款 | — | — |
| 应收股利 | — | — |
| 应收申购款 | — | — |
| 递延所得税资产 | — | — |
| 其他资产 | — | — |
| 资产总计 | 2,324,293,993.18 | 2,334,646,419.26 |
| 负债和净资产 | 本期末 2025 年 06 月 30 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | |
| 短期借款 | — | — |
| 交易性金融负债 | — | — |
| 衍生金融负债 | — | — |
| 卖出回购金融资产款 | 624,504,713.63 | 645,126,019.19 |
| 应付清算款 | 22,462.18 | 21,196.71 |
| 应付赎回款 | — | — |
| 应付管理人报酬 | 418,523.96 | 427,332.77 |
| 应付托管费 | 139,507.97 | 142,444.25 |
| 应付销售服务费 | — | — |
| 应付投资顾问费 | — | — |
| 应交税费 | 99,491.53 | 92,962.95 |
| 应付利润 | — | — |

| | | |
|-------------|------------------|------------------|
| 递延所得税负债 | — | — |
| 其他负债 | 176,919.45 | 207,053.05 |
| 负债合计 | 625,361,618.72 | 646,017,008.92 |
| 净资产： | | |
| 实收基金 | 1,545,514,034.60 | 1,546,158,332.38 |
| 其他综合收益 | — | — |
| 未分配利润 | 153,418,339.86 | 142,471,077.96 |
| 净资产合计 | 1,698,932,374.46 | 1,688,629,410.34 |
| 负债和净资产总计 | 2,324,293,993.18 | 2,334,646,419.26 |

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0993 元，基金份额总额 1,545,514,034.60 份。

6.2 利润表

会计主体：富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 (2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日) | 上年度可比期间 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日) |
|----------------------------|--|---|
| 一、营业总收入 | 20,066,093.69 | 107,208,876.87 |
| 1. 利息收入 | 33,727.69 | 303,139.07 |
| 其中：存款利息收入 | 30,434.66 | 295,284.88 |
| 债券利息收入 | — | — |
| 资产支持证券利息收入 | — | — |
| 买入返售金融资产收入 | 3,293.03 | 7,854.19 |
| 其他利息收入 | — | — |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 39,477,775.30 | 81,717,467.50 |
| 其中：股票投资收益 | — | — |
| 基金投资收益 | — | — |
| 债券投资收益 | 39,477,775.30 | 80,966,326.83 |
| 资产支持证券投资收益 | — | 751,140.67 |
| 贵金属投资收益 | — | — |
| 衍生工具收益 | — | — |
| 股利收益 | — | — |
| 以摊余成本计量的金融资产终止 确认产生的收益 | — | — |
| 其他投资收益 | — | — |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填 列） | -19,445,409.30 | 25,188,270.30 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | — | — |

| | | |
|----------------------------|---------------|---------------|
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | — | — |
| 减：二、营业总支出 | 9,062,971.10 | 17,223,305.22 |
| 1. 管理人报酬 | 2,512,792.28 | 4,803,994.85 |
| 2. 托管费 | 837,597.40 | 1,601,331.64 |
| 3. 销售服务费 | — | — |
| 4. 投资顾问费 | — | — |
| 5. 利息支出 | 5,533,513.92 | 10,484,065.85 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 5,533,513.92 | 10,484,065.85 |
| 6. 信用减值损失 | — | — |
| 7. 税金及附加 | 58,058.98 | 204,819.96 |
| 8. 其他费用 | 121,008.52 | 129,092.92 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 11,003,122.59 | 89,985,571.65 |
| 减：所得税费用 | — | — |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 11,003,122.59 | 89,985,571.65 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | — | — |
| 六、综合收益总额 | 11,003,122.59 | 89,985,571.65 |

6.3 净资产变动表

会计主体：富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 (2025年01月01日至2025年06月30日) | | |
|--|---------------------------------|----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 1,546,158,332.38 | 142,471,077.96 | 1,688,629,410.34 |
| 二、本期期初净资产 | 1,546,158,332.38 | 142,471,077.96 | 1,688,629,410.34 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -644,297.78 | 10,947,261.90 | 10,302,964.12 |
| （一）、综合收益总额 | — | 11,003,122.59 | 11,003,122.59 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -644,297.78 | -55,860.69 | -700,158.47 |
| 其中：1. 基金申购款 | — | — | — |
| 2. 基金赎回款 | -644,297.78 | -55,860.69 | -700,158.47 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | — | — | — |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | — | — | — |
| 四、本期期末净资产 | 1,545,514,034.60 | 153,418,339.86 | 1,698,932,374.46 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |

| | (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日) | | |
|--|--------------------------------------|----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 3,046,158,336.88 | 129,910,468.85 | 3,176,068,805.73 |
| 二、本期期初净资产 | 3,046,158,336.88 | 129,910,468.85 | 3,176,068,805.73 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -3.60 | 89,985,571.45 | 89,985,567.85 |
| (一)、综合收益总额 | — | 89,985,571.65 | 89,985,571.65 |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列) | -3.60 | -0.20 | -3.80 |
| 其中：1. 基金申购款 | — | — | — |
| 2. 基金赎回款 | -3.60 | -0.20 | -3.80 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | — | — | — |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | — | — | — |
| 四、本期期末净资产 | 3,046,158,333.28 | 219,896,040.30 | 3,266,054,373.58 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈 戈

林志松

徐慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）由富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金转型而成，富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1158 号文《关于准予富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2017 年 8 月 10 日正式生效，首次设立募集规模为 3,010,000,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》

及《关于富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金自 2019 年 8 月 28 日起转型并更名为富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金。

转型后富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金以定期开放的方式运作。首个封闭期为自基金合同生效日（含该日）起至基金合同生效日所对应的 3 个月月度对日的前一日。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日（含该日）起至首个开放期结束之日次日所对应的 3 个月月度对日的前一日，以此类推。如该对应日期为非工作日，则顺延至下一个工作日，若该日历月度中不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日。本基金在封闭期内不办理申购与赎回等业务，也不上市交易。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、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、可分离交易可转债的纯债部分、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

本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%，每个开放期之前的 10 个工作日和之后的 10 个工作日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制；在开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，在封闭期内，本基金不受前述 5% 的限制。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率 \times 90%+1 年期定期存款利率（税后） \times 10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和中期报告》》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2025年6月30日的财务状况以及2025年1月1日至2025年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以

及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人作为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政

策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 (2025 年 06 月 30 日) |
|----------------|---------------------------|
| 活期存款 | 199,286.14 |
| 等于：本金 | 199,262.18 |
| 加：应计利息 | 23.96 |
| 减：坏账准备 | — |
| 定期存款 | — |
| 等于：本金 | — |
| 加：应计利息 | — |
| 减：坏账准备 | — |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | — |
| 存款期限 1-3 个月 | — |
| 存款期限 3 个月以上 | — |
| 其他存款 | — |
| 等于：本金 | — |
| 加：应计利息 | — |
| 减：坏账准备 | — |
| 合计 | 199,286.14 |

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 (2025 年 06 月 30 日) | | | |
|---------------|------------------------|------|------|--------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | — | — | — | — |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | — | — | — | — |

| | | | | | |
|--------|-------|------------------|---------------|------------------|---------------|
| 债券 | 交易所市场 | 514,036,875.07 | 5,736,865.76 | 528,699,865.76 | 8,926,124.93 |
| | 银行间市场 | 1,738,515,251.17 | 24,545,076.08 | 1,772,047,776.08 | 8,987,448.83 |
| | 合计 | 2,252,552,126.24 | 30,281,941.84 | 2,300,747,641.84 | 17,913,573.76 |
| 资产支持证券 | | — | — | — | — |
| 基金 | | — | — | — | — |
| 其他 | | — | — | — | — |
| 合计 | | 2,252,552,126.24 | 30,281,941.84 | 2,300,747,641.84 | 17,913,573.76 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2025年06月30日） |
|-------------|------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | — |
| 应付赎回费 | — |
| 应付证券出借违约金 | — |
| 应付交易费用 | 37,636.44 |
| 其中：交易所市场 | — |
| 银行间市场 | 37,636.44 |
| 应付利息 | — |
| 预提信息披露费 | 60,000.00 |
| 预提审计费 | 79,283.01 |
| 合计 | 176,919.45 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日） | |
|---------------|--|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,546,158,332.38 | 1,546,158,332.38 |
| 本期申购 | — | — |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -644,297.78 | -644,297.78 |
| 本期末 | 1,545,514,034.60 | 1,545,514,034.60 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末 | 188,142,182.82 | 45,671,104.86 | 142,471,077.96 |
| 本期期初 | 188,142,182.82 | 45,671,104.86 | 142,471,077.96 |
| 本期利润 | 30,448,531.89 | 19,445,409.30 | 11,003,122.59 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -83,049.05 | 27,188.36 | -55,860.69 |
| 其中：基金申购款 | — | — | — |
| 基金赎回款 | -83,049.05 | 27,188.36 | -55,860.69 |
| 本期已分配利润 | — | — | — |
| 本期末 | 218,507,665.66 | 65,089,325.80 | 153,418,339.86 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日） |
|-----------|--|
| 活期存款利息收入 | 1,288.60 |
| 定期存款利息收入 | — |
| 其他存款利息收入 | — |
| 结算备付金利息收入 | 29,125.43 |
| 其他 | 20.63 |

| | |
|----|-----------|
| 合计 | 30,434.66 |
|----|-----------|

6.4.7.10 股票投资收益

注：本基金本报告期无买卖股票差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2025年01月01日至2025年06月30日） |
|------------------------------|-----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 34,507,611.20 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 4,970,164.10 |
| 合计 | 39,477,775.30 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2025年01月01日至2025年06月30日） |
|------------------------|-----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 696,957,166.45 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 679,180,799.88 |
| 减：应计利息总额 | 12,796,502.47 |
| 减：交易费用 | 9,700.00 |
| 买卖债券差价收入 | 4,970,164.10 |

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期（2025年01月01日至2025年06月30日） |
|------------------------|-----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -19,445,409.30 |
| 股票投资 | — |
| 债券投资 | -19,445,409.30 |
| 资产支持证券投资 | — |
| 基金投资 | — |
| 贵金属投资 | — |
| 其他 | — |
| 2. 衍生工具 | — |
| 权证投资 | — |
| 3. 其他 | — |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | — |
| 合计 | -19,445,409.30 |

6.4.7.17 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2025年01月01日至2025年06月30日） |
|------|-----------------------------|
| 审计费用 | 26,283.01 |

| | |
|---------|------------|
| 信息披露费 | 60,000.00 |
| 证券出借违约金 | — |
| 银行费用 | 16,125.51 |
| 债券账户维护费 | 18,000.00 |
| 其他 | 600.00 |
| 合计 | 121,008.52 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰海通证券股份有限公司（由国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 4 月变更名称而来，以下简称“国泰海通”）承继及承接海通证券股份有限公司的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持本公司股权亦归属于国泰海通，即国泰海通成为本公司的主要股东。变更后，本公司的股东为国泰海通证券股份有限公司，出资比例为 27.775%；申万宏源证券有限公司，出资比例为 27.775%；加拿大蒙特利尔银行，出资比例为 27.775%；山东省金融资产管理股份有限公司，出资比例为 16.675%。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|------------------------------|
| 富国基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构、基金发起人 |
| 海通证券股份有限公司（“海通证券”） | 基金管理人的股东（2025 年 3 月 14 日前） |
| 国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”） | 基金管理人的股东（自 2025 年 3 月 14 日起） |
| 申万宏源证券有限公司（“申万宏源”） | 基金管理人的股东 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。关联方国泰海通证券有限公司（简称“国泰海通”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原关联方

海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日） | | 上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日） | |
|-------|--|-----------------|---|-----------------|
| | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例（%） |
| 申万宏源 | 3,891,200,000.00 | 17.72 | 4,920,600,000.00 | 11.22 |

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日） | 上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日） |
|------------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,512,792.28 | 4,803,994.85 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 746,141.52 | 1,402,408.18 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 1,766,650.76 | 3,401,586.67 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.3%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.3\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日） | 上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日） |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 837,597.40 | 1,601,331.64 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.3与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

| 项目 | 本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日） | 份额单位：份 |
|----------------------------------|---|---|
| | | 上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日） |
| 基金合同生效日（2017 年 08 月 10 日）持有的基金份额 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 期初持有的基金份额 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 期间申购/买入总份额 | — | — |
| 期间因拆分变动份额 | — | — |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | — | — |
| 期末持有的基金份额 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 期末持有的基金份额占基金 总份额比例 | 0.65% | 0.33% |

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

| 关联方名称 | 本期末（2025 年 06 月 30 日） | | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） | |
|------------|-----------------------|----------------------|------------------------|----------------------|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 (%) | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 (%) |
| 兴业银行股份有限公司 | 1,530,000,000.00 | 99.00 | 1,530,000,000.00 | 98.95 |

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

| 关联方名称 | 本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日） | | 上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日） | |
|------------|--|----------|---|----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 兴业银行股份有限公司 | 199,286.14 | 1,288.60 | 36,963.15 | 9,331.32 |

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 394,104,713.63 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量 (单位：张) | 期末估值总额 |
|-----------|----------------|------------|--------|--------------|----------------|
| 102281725 | 22 广晟 MTN001 | 2025-07-01 | 105.68 | 500,000 | 52,841,739.73 |
| 102382535 | 23 芜湖建设 MTN003 | 2025-07-01 | 104.05 | 112,000 | 11,653,166.73 |
| 102481748 | 24 格力 MTN004 | 2025-07-01 | 101.13 | 500,000 | 50,566,219.18 |
| 198552 | 24 广东债 70 | 2025-07-01 | 104.27 | 464,000 | 48,381,254.79 |
| 240210 | 24 国开 10 | 2025-07-01 | 105.11 | 500,000 | 52,555,273.97 |
| 2128028 | 21 邮储银行二级 01 | 2025-07-02 | 104.85 | 800,000 | 83,881,915.62 |
| 2228006 | 22 中国银行二级 01 | 2025-07-02 | 103.68 | 253,000 | 26,229,896.31 |
| 2228024 | 22 工商银行二级 03 | 2025-07-07 | 103.74 | 53,000 | 5,498,132.88 |
| 2228041 | 22 农业银行二级 01 | 2025-07-07 | 103.28 | 1,000,000 | 103,275,616.44 |
| 合计 | | | | 4,182,000 | 434,883,215.65 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 230,400,000.00 元，于 2025 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回

购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

| 单位：人民币元 | | |
|---------|-----------------------|------------------------|
| 短期信用评级 | 本期末（2025 年 06 月 30 日） | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |
| A-1 | — | — |
| A-1 以下 | — | — |

| | | |
|-----|---------------|---|
| 未评级 | 10,076,770.96 | — |
| 合计 | 10,076,770.96 | — |

注：本表主要列示短期融资券和超短期融资券，债券评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券列示超短期融资券。本基金上年度末未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末（2025 年 06 月 30 日） | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |
|--------|-----------------------|------------------------|
| AAA | 1,221,723,043.53 | 1,281,511,972.70 |
| AAA 以下 | 113,641,032.84 | 106,670,687.17 |
| 未评级 | 892,828,526.02 | 633,814,226.31 |
| 合计 | 2,228,192,602.39 | 2,021,996,886.18 |

注：本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末（2025 年 06 月 30 日） | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |
|--------|-----------------------|------------------------|
| AAA | — | 98,966,936.99 |
| AAA 以下 | — | — |
| 未评级 | — | — |
| 合计 | — | 98,966,936.99 |

注：本基金本报告期末未持有同业存单。本表主要列示同业存单，评级取自第三方评级机构的主体评级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要

求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金采用定期开放的运作方式，封闭期内不得申请申购、赎回本基金。在开放期内，本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

| 本期末（2025 年 06 月 30 日） | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|-----------------|---------------|----------------|------------------|----------------|-------------|------------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 199,286.14 | — | — | — | — | — | 199,286.14 |
| 结算备付金 | 23,344,497.16 | — | — | — | — | — | 23,344,497.16 |
| 存出保证金 | 2,568.04 | — | — | — | — | — | 2,568.04 |
| 交易性金融资产 | — | 41,482,435.07 | 409,201,010.96 | 1,631,488,848.19 | 218,575,347.62 | — | 2,300,747,641.84 |
| 资产总计 | 23,546,351.34 | 41,482,435.07 | 409,201,010.96 | 1,631,488,848.19 | 218,575,347.62 | — | 2,324,293,993.18 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 624,504,713.63 | — | — | — | — | — | 624,504,713.63 |
| 应付清算款 | — | — | — | — | — | 22,462.18 | 22,462.18 |
| 应付管理人报酬 | — | — | — | — | — | 418,523.96 | 418,523.96 |
| 应付托管费 | — | — | — | — | — | 139,507.97 | 139,507.97 |
| 应交税费 | — | — | — | — | — | 99,491.53 | 99,491.53 |
| 其他负债 | — | — | — | — | — | 176,919.45 | 176,919.45 |
| 负债总计 | 624,504,713.63 | — | — | — | — | 856,905.09 | 625,361,618.72 |
| 利率敏感度缺口 | -600,958,362.29 | 41,482,435.07 | 409,201,010.96 | 1,631,488,848.19 | 218,575,347.62 | -856,905.09 | 1,698,932,374.46 |
| 上年度末（2024 年 12 月 31 日） | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|-----------|-----------------|---|----------------|------------------|----------------|-------------|------------------|
| 货币资金 | 148,925.95 | — | — | — | — | — | 148,925.95 |
| 结算备付金 | 10,005,602.93 | — | — | — | — | — | 10,005,602.93 |
| 存出保证金 | 41,341.18 | — | — | — | — | — | 41,341.18 |
| 交易性金融资产 | — | — | 589,043,766.04 | 1,518,470,273.03 | 216,936,510.13 | — | 2,324,450,549.20 |
| 资产总计 | 10,195,870.06 | — | 589,043,766.04 | 1,518,470,273.03 | 216,936,510.13 | — | 2,334,646,419.26 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 645,126,019.19 | — | — | — | — | — | 645,126,019.19 |
| 应付清算款 | — | — | — | — | — | 21,196.71 | 21,196.71 |
| 应付管理人报酬 | — | — | — | — | — | 427,332.77 | 427,332.77 |
| 应付托管费 | — | — | — | — | — | 142,444.25 | 142,444.25 |
| 应交税费 | — | — | — | — | — | 92,962.95 | 92,962.95 |
| 其他负债 | — | — | — | — | — | 207,053.05 | 207,053.05 |
| 负债总计 | 645,126,019.19 | — | — | — | — | 890,989.73 | 646,017,008.92 |
| 利率敏感度缺口 | -634,930,149.13 | — | 589,043,766.04 | 1,518,470,273.03 | 216,936,510.13 | -890,989.73 | 1,688,629,410.34 |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

| 假设 | 1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。 | | |
|----|---|---------------------------------|----------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元) | |
| | | 本期末 (2025 年 06 月 30 日) | 上年度末 (2024 年 12 月 31 日) |
| | 1. 基准点利率增加 0.1% | -4,646,957.66 | -4,735,127.93 |
| | 2. 基准点利率减少 0.1% | 4,646,957.66 | 4,735,127.93 |

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大的市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、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、可分离交易可转债的纯债部分、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的

相关规定）。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。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%，每个开放期之前的 10 个工作日和之后的 10 个工作日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制；在开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内，本基金不受前述 5%的限制。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 (2025 年 06 月 30 日) | | 上年度末 (2024 年 12 月 31 日) | |
|---------------|---------------------------|---------------|----------------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—基金投资 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—债券投资 | 2,300,747,641.84 | 135.42 | 2,324,450,549.20 | 137.65 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | — | — | — | — |
| 衍生金融资产—权证投资 | — | — | — | — |
| 其他 | — | — | — | — |
| 合计 | 2,300,747,641.84 | 135.42 | 2,324,450,549.20 | 137.65 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金本期末及上期末未持有交易性权益投资、可转换债券及可交换债券，因此其他价格风险因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果 所属的层次 | 本期末 (2025 年 06 月 30 日) | 上年度末 (2024 年 12 月 31 日) |
|-------------------|---------------------------|----------------------------|
| 第一层次 | — | — |
| 第二层次 | 2,300,747,641.84 | 2,324,450,549.20 |
| 第三层次 | — | — |
| 合计 | 2,300,747,641.84 | 2,324,450,549.20 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。本基金本报告期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | — | — |
| | 其中：股票 | — | — |
| 2 | 基金投资 | — | — |
| 3 | 固定收益投资 | 2,300,747,641.84 | 98.99 |
| | 其中：债券 | 2,300,747,641.84 | 98.99 |
| | 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 | 23,543,783.30 | 1.01 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,568.04 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 2,324,293,993.18 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票资产。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未进行买入股票投资。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未进行卖出股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 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 | — | — |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | 979,176,686.59 | 57.63 |
| | 其中：政策性金融债 | 62,478,268.49 | 3.68 |
| 4 | 企业债券 | 559,204,860.25 | 32.92 |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,076,770.96 | 0.59 |
| 6 | 中期票据 | 700,154,351.21 | 41.21 |
| 7 | 可转债（可交换债） | — | — |
| 8 | 同业存单 | — | — |
| 9 | 其他 | 52,134,972.83 | 3.07 |
| 10 | 合计 | 2,300,747,641.84 | 135.42 |

7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|-----------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 2128039 | 21 中国银行二级 03 | 1,100,000 | 115,193,235.62 | 6.78 |
| 2 | 2228004 | 22 工商银行二级 01 | 1,100,000 | 114,130,087.12 | 6.72 |
| 3 | 2228041 | 22 农业银行二级 01 | 1,000,000 | 103,275,616.44 | 6.08 |
| 4 | 2128028 | 21 邮储银行二级 01 | 800,000 | 83,881,915.62 | 4.94 |
| 5 | 2228039 | 22 建设银行二级 01 | 700,000 | 72,307,104.11 | 4.26 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 声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，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局北京监管局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设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，中国光大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中国人民银行的处罚。

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。

7.12.2 声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

本基金本报告期末未持有股票资产。

7.12.3 期末其他各项资产构成

| 单位：人民币元 | | |
|---------|-------|----------|
| 序号 | 名称 | 金额 |
| 1 | 存出保证金 | 2,568.04 |
| 2 | 应收清算款 | — |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | — |
| 5 | 应收申购款 | — |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 2,568.04 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|---------------|------------------|-------------------|-------|-------------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额 比例 (%) | 持有份额 | 占总份额 比例 (%) |
| 205 | 7,539,092.85 | 1,545,514,034.60 | 100.00 | — | — |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|-----------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | — | — |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

8.4 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 | 10,000,000.00 | 0.65 | 10,000,000.00 | 0.65 | 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 | 10,000,000.00 | 0.65 | 10,000,000.00 | 0.65 | 3年 |

注：截至2020年8月10日，本基金的基金合同生效届满3年。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2017年08月10日)基金份额总额 | 3,010,000,000.00 |
| 报告期期初基金份额总额 | 1,546,158,332.38 |
| 本报告期基金总申购份额 | — |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 644,297.78 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,545,514,034.60 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 东方证券 | 2 | — | — | — | — | — |
| 国金证券 | 1 | — | — | — | — | — |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 国信证券 | 2 | — | — | — | — | — |
| 华泰证券 | 2 | — | — | — | — | — |
| 申万宏源 | 2 | — | — | — | — | — |
| 野村证券 | 2 | — | — | — | — | — |
| 中泰证券 | 2 | — | — | — | — | — |

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金退租券商交易单元：野村证券（014329、57854）。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|---------------|-----------------|-------------------|-------------------|------|-----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例（%） |
| 东方证券 | — | — | 2,088,400,000.00 | 9.51 | — | — |
| 国金证券 | — | — | — | — | — | — |
| 国信证券 | 91,004,976.18 | 100.00 | 5,429,000,000.00 | 24.73 | — | — |
| 华泰证券 | — | — | 10,283,453,000.00 | 46.84 | — | — |
| 申万宏源 | — | — | 3,891,200,000.00 | 17.72 | — | — |
| 野村证券 | — | — | 262,000,000.00 | 1.19 | — | — |
| 中泰证券 | — | — | — | — | — | — |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|--------|-------------|
| 1 | 富国基金管理有限公司关于变更主要股东事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告 | 规定披露媒介 | 2025年01月21日 |
| 2 | 富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金第二十一个开放期开放申购、赎回及转换业务的公告 | 规定披露媒介 | 2025年02月24日 |
| 3 | 富国基金管理有限公司关于公司主要股东变更的公告 | 规定披露媒介 | 2025年03月18日 |
| 4 | 富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金第二十一个开放期开放申购、赎回及转换业务的公告 | 规定披露媒介 | 2025年05月23日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--|----------------|-------------------------|--------------|------|------|--------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2025-01-01 至 2025-06-30 | 1,530,000.00 | — | — | 1,530,000.00 | 99.00% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p> | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，根据中国证券监督管理委员会于 2025 年 1 月 17 日出具的《关于同意国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司并募集配套资金注册、核准国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司、海富通基金管理有限公司变更主要股东及实际控制人、富国基金管理有限公司变更主要股东、海通期货股份有限公司变更主要股东及实际控制人的批复》，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司，并依法承接富国基金管理有限公司 14,443 万元出资（占注册资本比例 27.775%）。自吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安成为基金管理人的主要股东。具体可参见基金管理人于 2025 年 1 月 21 日发布的《富国基金管理有限公司关于变更主要股东事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告》、2025 年 3 月 18 日发布的《富国基金管理有限公司关于公司主要股东变更的公告》。根据国泰海通证券股份有限公司于 2025 年 4 月 4 日发布的相关公告，国泰君安的公司名称变更为国泰海通证券

股份有限公司。

§ 12 备查文件目录

| 备查文件名称 | 备查文件存放地点 | 备查文件查阅方式 |
|--|--|---|
| 1、中国证监会批准设立富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的文件 | 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 | 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 。 |
| 2、富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同 | | |
| 3、富国聚利纯债定期开放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、富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同 | | |
| 6、富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议 | | |
| 7、中国证监会《关于准予富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金变更注册的批复》 | | |
| 8、富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金财务报表及报表附注 | | |
| 9、报告期内在指定报刊上披露的各项公告 | | |