富国利享回报 12 个月持有期混合型证券投资基金

二 0 二六年中期报告

2026 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

送出日期： 2026 年 08 月 31 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。

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 8 月 27 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 2026 年 1 月 1 日起至 2026 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 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
§4 管理人报告 11
4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
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的说明 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
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 14
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
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 15
§6 半年度财务报告（未经审计） 16
6.1 资产负债表 16
6.2 利润表 17
6.3 净资产变动表 18
6.4 报表附注 19
§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..... 43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 45
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..... 46
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..... 46
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..... 46
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..... 46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 46
7.12 投资组合报告附注 47
§8 基金份额持有人信息 50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 50
8.2 盈利投资者数量占比 50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 50
8.4 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情况..... 50
§9 开放式基金份额变动 51
§10 重大事件揭示 52
10.1 基金份额持有人大会决议 52
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..... 52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 52
10.4 基金投资策略的改变 52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 52
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况..... 53
10.8 其他重大事件 54
§11 影响投资者决策的其他重要信息 56
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 56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 56
§12 备查文件目录 57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国利享回报 12 个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	富国利享回报 12 个月持有期混合	
基金主代码	013632	
基金运作方式	契约型开放式，本基金每个工作日开放申购，但对每份基金份额设置 12 个月的最短持有期限	
基金合同生效日	2022 年 04 月 26 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	
报告期末基金份额总额	39,515,119.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国利享回报 12 个月持有期混合 A	富国利享回报 12 个月持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	013632	013633
报告期末下属分级基金的份额总额	30,061,058.33 份	9,454,061.10 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争为基金份额持有人提供长期稳定和超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、存托凭证、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。在债券投资方面，本基金将采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断和信用风险评估等管理手段。在严格控制整体资产风险的基础上，根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合整体框架；对债券市场、收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。本基金的股票投资策略、存托凭证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。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。

注：自 2026 年 6 月 1 日起，本基金业绩比较基准由“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%”调整为“中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%”。

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	中国银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	赵瑛	许俊
	联系电话	021-20361818	010-66596688
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95566
传真		021-20361616	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		陈戈	葛海蛟

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

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

（1） 富国利享回报 12 个月持有期混合 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	4,783,911.56
本期利润	8,433,138.51
加权平均基金份额本期利润	0.1987
本期加权平均净值利润率	18.69%
本期基金份额净值增长率	21.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	4,356,097.93
期末可供分配基金份额利润	0.1449
期末基金资产净值	36,671,598.16
期末基金份额净值	1.2199
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	21.99%

（2） 富国利享回报 12 个月持有期混合 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	602,042.73
本期利润	1,214,267.67
加权平均基金份额本期利润	0.2519
本期加权平均净值利润率	23.20%
本期基金份额净值增长率	21.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	1,188,916.76
期末可供分配基金份额利润	0.1258
期末基金资产净值	11,341,177.22
期末基金份额净值	1.1996
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	19.96%

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

（1） 富国利享回报 12 个月持有期混合 A

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
过去三个月	19.81%	0.86%	1.34%	0.21%	18.47%	0.65%
过去六个月	21.70%	0.71%	0.94%	0.18%	20.76%	0.53%
过去一年	26.78%	0.57%	1.67%	0.16%	25.11%	0.41%
过去三年	24.89%	0.48%	8.69%	0.16%	16.20%	0.32%
自基金合同生效起至今	21.99%	0.42%	10.76%	0.16%	11.23%	0.26%

（2） 富国利享回报 12 个月持有期混合 C

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
过去三个月	19.70%	0.86%	1.34%	0.21%	18.36%	0.65%
过去六个月	21.45%	0.71%	0.94%	0.18%	20.51%	0.53%
过去一年	26.27%	0.57%	1.67%	0.16%	24.60%	0.41%
过去三年	23.39%	0.48%	8.69%	0.16%	14.70%	0.32%
自基金合同生效起至今	19.96%	0.42%	10.76%	0.16%	9.20%	0.26%

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。

根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定与基金合同的约定，基于本基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等因素，经与基金托管人协商一致，自 2026 年 6 月 1 日起，本基金业绩比较基准由“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%”调整为“中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

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

（1）富国利享回报 12 个月持有期混合 A



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定与基金合同的约定，基于本基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等因素，经与基金托管人协商一致，自 2026 年 6 月 1 日起，本基金业绩比较基准由“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%”调整为“中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

（2）富国利享回报 12 个月持有期混合 C



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定与基金合同的约定，基于本基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等因素，经与基金托管人协商一致，自 2026 年 6 月 1 日起，本基金业绩比较基准由“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%”调整为“中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

§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。

截至 2026 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 464 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		
祝祯哲	本基金现任基金经理	2023-06-16	-	11	硕士，自 2015 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任组合管理助理、助理债券研究员、债券研究员、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 2023 年 04 月起任富国可转换债券证券投资基金基金经理；自 2023

					年 06 月起任富国利享回报 12 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。
张明凯	本基金现任基金经理	2022-04-26	—	13	硕士，曾任南京银行信用研究员，鑫元基金管理有限公司研究员、基金经理；自 2018 年 2 月加入富国基金管理有限公司，自 2018 年 5 月起历任固定收益基金经理；现任富国基金固定收益投资部固定收益投资总监助理兼固定收益基金经理。自 2019 年 03 月起任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理；自 2022 年 04 月起任富国利享回报 12 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。

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利享回报 12 个月持有期混合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》、《富国利享回报 12 个月持有期混合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 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

本报告期，公司严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规和内部管理办法的要求，通过自动化系统、人工审核等方式在各投资业务环节加强管控，确保公平对待旗下管理的所有投资组合。 管理人对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析评估。在同向交易价差分析方面，采集连续四个季度不同时间窗口（1 日内、3 日内、5 日内）的同向交易样本，对同向交易价差进行假设检验并对检验结果进行分析。分析结果表明在同向交易价差方面，本投资组合与公司管理的其他投资组合未出现可能导致不公平交易、利益输送的交易事项。 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，出现 1 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，为投资组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平对待投资组合或利益输送等情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2026 年经济取得开门红，主要体现在外需更强、消费不弱、投资增速明显修复，表现整体好于市场预期，但二季度以来经济有所走弱，经济 K 型分化显著，消费和投资增速均转负，且投资三大项均深度负增，仅出口增速仍维持高位，经济结构分化。与此同时，PPI 和 CPI 有所回升。预计下半年的经济增长动能将有所放缓，四季度由于低基数经济增速或阶段性回升，全年经济增长将是“前高中低后升”的节奏特征。

利率方面，预计 2026 年下半年中长期国债利率仍在区间波动。第一，我国宏观经济向上弹性仍待修复。第二，通胀方面核心关注下游需求的接受程度，目前为止还是供给侧推升的价格上涨。GDP 平减指数三季度预计维持高位震荡，四季度或转为下行。PPI 同比有望在 6-7 月见顶，后续在高位震荡后逐步回落。第三，当前资金维持低位宽松已成为托底 2026 年债市的关键力量，考虑到当前资金已经回到政策利率以上，央行再度大幅收紧资金的概率较低。第四，国内目前超储率回到 2019 年以来偏低位，结合经济与财政成本考虑，今年可能仍会有降准降息操作。第五，机构总体来看对债券的配置需求仍在边际上升。

报告期内，纯债仓位择机调整利率债久期和信用债持仓结构。股票仓位基本平稳，行业配置上依旧更偏好基本面处于景气上升周期、行业供给格局较优，符合当前政策支持方向的优质行业投资机会。转债仓位亦维持平稳，力争在回撤可控条件下实现有效的风险暴露。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金份额净值富国利享回报 12 个月持有期混合 A 为 1.2199 元，富国利享回报 12 个月持有期混合 C 为 1.1996 元；份额累计净值富国利享回报 12 个月持有期混合 A 为 1.2199 元，富国利享回报 12 个月持有期混合 C 为 1.1996 元；本报告期，本基

金份额净值增长率情况：富国利享回报 12 个月持有期混合 A 为 21.70%，富国利享回报 12 个月持有期混合 C 为 21.45%；同期业绩比较基准收益率情况：富国利享回报 12 个月持有期混合 A 为 0.94%，富国利享回报 12 个月持有期混合 C 为 0.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期海外算力行情节奏有所放缓，需要产业趋势进一步的催化累积，但中期结构演绎大概率不会发生大的变化，科技风格仍将贯穿大波段行情始终，且中期向上突破行情中，发酵的乐观预期可能会更全面，上涨的层次可能也会更丰富。当前容易凝聚市场共识方向依旧围绕科技成长，此时应多思考边际改善，敢于定价长期积极因素，应该更加关注中期景气线索。

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

1、本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2、自 2026 年 3 月 4 日至 2026 年 5 月 12 日，2026 年 5 月 21 日至 2026 年 6 月 30 日本基金存在资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况。

§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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富国利享回报 12 个月持有期混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“ 关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国利享回报 12 个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	478,313.70	706,601.22
结算备付金	600,200.96	761,825.78
存出保证金	21,607.98	13,235.26
交易性金融资产	47,959,666.12	54,215,802.34
其中：股票投资	14,400,038.73	12,482,464.30
基金投资	-	-
债券投资	33,559,627.39	41,733,338.04
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	1,100,000.00	10,399,148.98
应收清算款	1,073,503.54	2,387,127.01
应收股利	3,477.68	-
应收申购款	74,189.05	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	51,310,959.03	68,483,740.59
负债和净资产	**本期末** 2026 年 06 月 30 日	**上年度末** 2025 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	2,000,000.00	-
应付清算款	1,176,665.46	-
应付赎回款	2.44	2,027,227.21
应付管理人报酬	31,629.79	48,476.55
应付托管费	5,930.57	9,089.36
应付销售服务费	3,547.16	1,776.71
应付投资顾问费	-	-
应交税费	660.93	668.89

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	79,747.30	190,685.37
负债合计	3,298,183.65	2,277,924.09
净资产：		
实收基金	39,515,119.43	66,113,263.53
未分配利润	8,497,655.95	92,552.97
净资产合计	48,012,775.38	66,205,816.50
负债和净资产总计	51,310,959.03	68,483,740.59

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2150 元，基金份额总额 39,515,119.43 份。其中：富国利享回报 12 个月持有期混合 A 份额净值 1.2199 元，份额总额 30,061,058.33 份；富国利享回报 12 个月持有期混合 C 份额净值 1.1996 元，份额总额 9,454,061.10 份。

6.2 利润表

会计主体：富国利享回报 12 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 （2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	上年度可比期间 （2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
一、营业总收入	9,952,924.94	2,252,180.18
1.利息收入	33,695.00	92,875.43
其中：存款利息收入	3,083.79	8,837.20
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	30,611.21	84,038.23
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	5,657,778.05	1,846,836.18
其中：股票投资收益	4,499,610.10	-296,100.49
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,132,126.23	2,051,633.34
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	26,041.72	91,303.33
其他投资收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	4,261,451.89	312,468.57
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	305,518.76	597,195.55
1．管理人报酬	200,428.07	388,528.81

2．托管费	37,580.19	72,849.18
3．销售服务费	10,081.32	15,296.89
4．投资顾问费	-	-
5．利息支出	4,854.65	15,053.40
其中：卖出回购金融资产支出	4,854.65	15,053.40
6．信用减值损失	-	-
7．税金及附加	312.50	1,937.91
8．其他费用	52,262.03	103,529.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	9,647,406.18	1,654,984.63
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	9,647,406.18	1,654,984.63
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	9,647,406.18	1,654,984.63

6.3 净资产变动表

会计主体：富国利享回报 12 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 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	66,113,263.53	92,552.97	66,205,816.50
二、本期期初净资产	66,113,263.53	92,552.97	66,205,816.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-26,598,144.10	8,405,102.98	-18,193,041.12
（一）、综合收益总额	-	9,647,406.18	9,647,406.18
（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）	-26,598,144.10	-1,242,303.20	-27,840,447.30
其中：1.基金申购款	14,307,610.15	1,228,386.42	15,535,996.57
2.基金赎回款	-40,905,754.25	-2,470,689.62	-43,376,443.87
（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、本期期末净资产	39,515,119.43	8,497,655.95	48,012,775.38
项目	**上年度可比期间（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	110,063,340.10	-6,070,513.76	103,992,826.34
二、本期期初净资产	110,063,340.10	-6,070,513.76	103,992,826.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-14,817,078.18	2,373,696.47	-12,443,381.71
（一）、综合收益总额	-	1,654,984.63	1,654,984.63
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净	-14,817,078.18	718,711.84	-14,098,366.34

资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	2,400.81	-140.82	2,259.99
2.基金赎回款	-14,819,478.99	718,852.66	-14,100,626.33
（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、本期期末净资产	95,246,261.92	-3,696,817.29	91,549,444.63

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

富国利享回报 12 个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，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[2021]2825 号《关于准予富国利享回报 12 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》注册，由基金管理人富国基金管理有限公司自 2022 年 2 月 25 日至 2022 年 4 月 22 日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具德师报(验)字(22)第 00197 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2022 年 4 月 26 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 278,500,640.82 元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币 70,330.02 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 278,570,970.84 元，折合 278,570,970.84 份基金份额，其中 A 类基金份额 245,461,077.60 份，C 类基金份额 33,109,893.24 份。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板以及其他经中国证监会允许上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券)、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、衍生工具(股指期货、国债期货、股票期权等)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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票及存托凭证资产的比例不高于基金资产的30%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%)；本基金同业存单的投资比例占基金资产的比例不超过 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券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。如果法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中债-综合全价（总值）指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%。

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发布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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发布的其他相关规定。

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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 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 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3%的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

3 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。

4 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。

5 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税

[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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（2026 年 06 月 30 日）
活期存款	478,313.70
等于：本金	478,267.74
加：应计利息	45.96
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	478,313.70

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（2026 年 06 月 30 日）			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		10,744,113.74	-	14,400,038.73	3,655,924.99
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	22,973,106.77	191,017.63	23,213,189.03	49,064.63
	银行间市场	10,208,570.00	328,438.36	10,346,438.36	-190,570.00
	合计	33,181,676.77	519,455.99	33,559,627.39	-141,505.37
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		43,925,790.51	519,455.99	47,959,666.12	3,514,419.62

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

单位：人民币元

项目	本期末（2026 年 06 月 30 日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,100,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,100,000.00	-

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（2026 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	17,820.38
其中：交易所市场	17,820.38
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	20,000.00
预提审计费	41,926.92
合计	79,747.30

6.4.7.7 实收基金

富国利享回报 12 个月持有期混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	61,628,053.13	61,628,053.13

本期申购	5,981,071.96	5,981,071.96
本期赎回（以“-”号填列）	-37,548,066.76	-37,548,066.76
本期末	30,061,058.33	30,061,058.33

富国利享回报 12 个月持有期混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,485,210.40	4,485,210.40
本期申购	8,326,538.19	8,326,538.19
本期赎回（以“-”号填列）	-3,357,687.49	-3,357,687.49
本期末	9,454,061.10	9,454,061.10

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

富国利享回报 12 个月持有期混合 A

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	1,413,551.69	-1,265,713.72	147,837.97
本期期初	1,413,551.69	-1,265,713.72	147,837.97
本期利润	4,783,911.56	3,649,226.95	8,433,138.51
本期基金份额交易产生的变动数	-1,841,365.32	-129,071.33	-1,970,436.65
其中：基金申购款	353,022.83	38,288.28	391,311.11
基金赎回款	-2,194,388.15	-167,359.61	-2,361,747.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,356,097.93	2,254,441.90	6,610,539.83

富国利享回报 12 个月持有期混合 C

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	34,920.19	-90,205.19	-55,285.00
本期期初	34,920.19	-90,205.19	-55,285.00
本期利润	602,042.73	612,224.94	1,214,267.67
本期基金份额交易产生的变动数	551,953.84	176,179.61	728,133.45
其中：基金申购款	666,392.73	170,682.58	837,075.31
基金赎回款	-114,438.89	5,497.03	-108,941.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,188,916.76	698,199.36	1,887,116.12

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）

活期存款利息收入	1,582.85
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	1,373.94
其他	127.00
合计	3,083.79

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
卖出股票成交总额	53,870,074.95
减：卖出股票成本总额	49,294,280.70
减：交易费用	76,184.15
买卖股票差价收入	4,499,610.10

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（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
债券投资收益——利息收入	405,523.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	726,602.87
合计	1,132,126.23

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（2026年01月01日至2026年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	44,932,592.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	43,975,676.26
减：应计利息总额	228,045.39
减：交易费用	2,268.01
买卖债券差价收入	726,602.87

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

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
股票投资产生的股利收益	26,041.72
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	26,041.72

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
1.交易性金融资产	4,261,451.89
股票投资	4,057,670.71
债券投资	203,781.18
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	4,261,451.89

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（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
审计费用	8,926.92
信息披露费	20,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	4,690.30
债券账户维护费	18,000.00
其他	644.81
合计	52,262.03

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、关联关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

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
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构（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、基金代销机构（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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：（1）关联方国泰海通证券股份有限公司（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。

（2）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2025年01月01日至2025年06月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国泰海通	11,454,601.29	11.37	11,162,509.30	3.75
海通证券	-	-	815,416.00	0.27
申万宏源	10,170,962.00	10.10	738,145.00	0.25

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2025年01月01日至2025年06月30日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
国泰海通	3,994,806.18	5.68	17,581,120.51	12.04
海通证券	-	-	1,715,729.80	1.18
申万宏源	2,529,189.73	3.60	1,338,282.24	0.92

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2025年01月01日至2025年06月30日）	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
国泰海通	78,259,000.00	14.90	53,500,000.00	4.23

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国泰海通	4,649.47	11.40	3,888.79	21.82
申万宏源	4,128.43	10.13	3,745.51	21.02
关联方名称	上年度可比期间（2025年01月01日至2025年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国泰海通	4,531.00	3.79	2,973.87	4.49
海通证券	331.03	0.28	-	-
申万宏源	299.62	0.25	164.09	0.25

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的管理费	200,428.07	388,528.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	82,356.32	190,957.77
应支付基金管理人的净管理费	118,071.75	197,571.04

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.80%÷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，逐日累计至每个月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至	上年度可比期间（2025 年 01 月 01 日

	2026 年 06 月 30 日）	至 2025 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	37,580.19	72,849.18

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.15%÷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，逐日累计至每个月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国利享回报 12 个月持有期混合 A	富国利享回报 12 个月持有期混合 C	合计
富国基金管理有限公司	-	65.96	65.96
国泰海通证券股份有限公司	-	1.81	1.81
中国银行股份有限公司	-	6,661.48	6,661.48
合计	-	6,729.25	6,729.25

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国利享回报 12 个月持有期混合 A	富国利享回报 12 个月持有期混合 C	合计
富国基金管理有限公司	-	99.15	99.15
国泰海通证券股份有限公司	-	1.08	1.08
海通证券股份有限公司	-	0.73	0.73
中国银行股份有限公司	-	14,749.33	14,749.33
合计	-	14,850.29	14,850.29

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.40%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，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

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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

单位：人民币元

关联方名称	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2025 年 01 月 01 日至 2025 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
中国银行股份有限公司	478,313.70	1,582.85	604,883.53	5,102.06

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：本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118072	鼎通转债	2026-06-24	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.00	190	19,000.00	19,000.58	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
06606	诺辉健康	-	-	0.01	-	-	50,000.00	848,306.81	500.00	2025 年 10 月 27 日起退市

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

注：截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 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 2,000,000.00 元，于 2026 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

注：本基金本报告期末及上年度末均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（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
AAA	6,639,734.34	16,321,296.17
AAA 以下	8,125,679.33	-
未评级	4,687,145.30	-
合计	19,452,558.97	16,321,296.17

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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

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，并于开放日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 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。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

单位：人民币元

本期末（2026 年 06 月 30 日）	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	478,313.70	—	—	—	478,313.70
结算备付金	600,200.96	—	—	—	600,200.96
存出保证金	21,607.98	—	—	—	21,607.98
交易性金融资产	22,310,034.97	5,860,578.80	5,389,013.62	14,400,038.73	47,959,666.12
买入返售金融资产	1,100,000.00	—	—	—	1,100,000.00
应收清算款	—	—	—	1,073,503.54	1,073,503.54
应收股利	—	—	—	3,477.68	3,477.68
应收申购款	—	—	—	74,189.05	74,189.05
资产总计	24,510,157.61	5,860,578.80	5,389,013.62	15,551,209.00	51,310,959.03
负债					
卖出回购金融资产款	2,000,000.00	—	—	—	2,000,000.00
应付清算款	—	—	—	1,176,665.46	1,176,665.46
应付赎回款	—	—	—	2.44	2.44
应付管理人报酬	—	—	—	31,629.79	31,629.79
应付托管费	—	—	—	5,930.57	5,930.57
应付销售服务费	—	—	—	3,547.16	3,547.16
应交税费	—	—	—	660.93	660.93
其他负债	—	—	—	79,747.30	79,747.30
负债总计	2,000,000.00	—	—	1,298,183.65	3,298,183.65
利率敏感度缺口	22,510,157.61	5,860,578.80	5,389,013.62	14,253,025.35	48,012,775.38
上年度末（2025 年 12 月 31 日）	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	706,601.22	—	—	—	706,601.22
结算备付金	761,825.78	—	—	—	761,825.78
存出保证金	13,235.26	—	—	—	13,235.26
交易性金融资产	21,529,655.46	8,192,751.51	12,010,931.07	12,482,464.30	54,215,802.34
买入返售金融资产	10,399,148.98	—	—	—	10,399,148.98
应收清算款	—	—	—	2,387,127.01	2,387,127.01
资产总计	33,410,466.70	8,192,751.51	12,010,931.07	14,869,591.31	68,483,740.59
负债					
应付赎回款	—	—	—	2,027,227.21	2,027,227.21
应付管理人报酬	—	—	—	48,476.55	48,476.55
应付托管费	—	—	—	9,089.36	9,089.36
应付销售服务费	—	—	—	1,776.71	1,776.71
应交税费	—	—	—	668.89	668.89
其他负债	—	—	—	190,685.37	190,685.37
负债总计	—	—	—	2,277,924.09	2,277,924.09
利率敏感度缺口	33,410,466.70	8,192,751.51	12,010,931.07	12,591,667.22	66,205,816.50

注：上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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1.基准点利率增加 0.1%	-83,106.34	-249,861.28
	2.基准点利率减少 0.1%	83,106.34	249,861.28

注：上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。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，本基金的基金管理人每日对本基金的外

汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末（2026 年 06 月 30 日）				
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产					
交易性金融资产	-	318,296.00	-	-	318,296.00
应收股利	-	3,477.68	-	-	3,477.68
资产合计	-	321,773.68	-	-	321,773.68
以外币计价的负债					
-	-	-		-	-
负债合计	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	321,773.68	-	-	321,773.68
项目	上年度末（2025 年 12 月 31 日）				
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产					
交易性金融资产	-	2,847,722.00	-	-	2,847,722.00
资产合计	-	2,847,722.00	-	-	2,847,722.00
以外币计价的负债					
-	-	-		-	-
负债合计	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	2,847,722.00	-	-	2,847,722.00

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化 1%，其他变量不变； (2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口。		
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（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币贬值 1%	-3,217.74	-28,477.22
	港币相对人民币升值 1%	3,217.74	28,477.22

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股票和债券，所面临的最大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

金额单位：人民币元

项目	本期末（2026 年 06 月 30 日）		上年度末（2025 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	14,400,038.73	29.99	12,482,464.30	18.85
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	33,559,627.39	69.90	41,733,338.04	63.04
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	47,959,666.12	99.89	54,215,802.34	81.89

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
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（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准增加 1%	1,346,800.21	1,319,001.90
	2.业绩比较基准减少 1%	-1,346,800.21	-1,319,001.90

注：本基金管理人运用资本资产定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

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（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
第一层次	23,287,547.69	13,930,786.77
第二层次	24,671,618.43	40,284,515.57
第三层次	500.00	500.00
合计	47,959,666.12	54,215,802.34

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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

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	14,400,038.73	28.06
	其中：股票	14,400,038.73	28.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	33,559,627.39	65.40
	其中：债券	33,559,627.39	65.40
	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	1,100,000.00	2.14
	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	1,078,514.66	2.10
8	其他各项资产	1,172,778.25	2.29
9	合计	51,310,959.03	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 318,296.00 元，占资产净值比例为 0.66%。

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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	13,254,482.58	27.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	827,260.15	1.72
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	14,081,742.73	29.33

7.2.2 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（%）
房地产	209,400.00	0.44
信息技术	108,396.00	0.23
医疗保健	500.00	0.00
合计	318,296.00	0.66

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	1,000	1,270,000.00	2.65
2	002384	东山精密	4,500	1,180,575.00	2.46
3	600522	中天科技	18,200	1,104,376.00	2.30
4	601869	长飞光纤	2,000	1,091,800.00	2.27
5	688668	鼎通科技	2,800	1,045,240.00	2.18
6	600487	亨通光电	9,500	1,038,730.00	2.16
7	688403	汇成股份	25,000	992,500.00	2.07
8	688041	海光信息	2,000	740,600.00	1.54
9	688012	中微公司	1,288	603,428.00	1.26
10	688256	寒武纪	373	595,140.15	1.24
11	300604	长川科技	1,500	512,130.00	1.07
12	688347	华虹宏力	1,500	504,450.00	1.05
13	002409	雅克科技	1,800	404,100.00	0.84
14	600498	烽火通信	5,000	368,000.00	0.77
15	002290	禾盛新材	3,100	284,797.00	0.59
16	603228	景旺电子	3,900	282,399.00	0.59
17	300570	太辰光	1,100	271,381.00	0.57
18	002371	北方华创	300	265,368.00	0.55
19	300502	新易盛	400	242,800.00	0.51
20	688082	盛美上海	544	235,008.00	0.49
21	688627	精智达	325	232,375.00	0.48

22	301396	宏景科技	700	232,120.00	0.48
23	600345	长江通信	3,300	216,183.00	0.45
24	00688	中国海外发展	20,000	209,400.00	0.44
25	688266	泽璟制药	1,613	188,172.58	0.39
26	301611	珂玛科技	1,000	180,070.00	0.38
27	02676	纳芯微	600	108,396.00	0.23
28	06606	诺辉健康	50,000	500.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688387	信科移动	1,986,191.72	3.00
2	688809	强一股份	1,950,619.56	2.95
3	688403	汇成股份	1,945,003.17	2.94
4	002384	东山精密	1,428,113.00	2.16
5	300308	中际旭创	1,324,505.00	2.00
6	300900	广联航空	1,260,754.00	1.90
7	688668	鼎通科技	1,245,395.00	1.88
8	688627	精智达	1,230,042.99	1.86
9	002943	宇晶股份	1,136,149.00	1.72
10	605090	九丰能源	1,078,243.00	1.63
11	300502	新易盛	1,057,965.00	1.60
12	000333	美的集团	968,461.00	1.46
13	600498	烽火通信	927,266.00	1.40
14	000688	国城矿业	868,925.00	1.31
15	002738	中矿资源	850,312.00	1.28
16	601318	中国平安	849,941.00	1.28
17	300751	迈为股份	832,329.00	1.26
18	688375	国博电子	824,865.32	1.25
19	002683	广东宏大	810,422.00	1.22
20	301611	珂玛科技	783,516.00	1.18

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002384	东山精密	2,767,680.00	4.18
2	688809	强一股份	2,339,437.17	3.53

3	688387	信科移动	2,226,492.25	3.36
4	688403	汇成股份	2,135,591.03	3.23
5	300308	中际旭创	1,975,131.00	2.98
6	688627	精智达	1,433,603.41	2.17
7	300502	新易盛	1,376,388.00	2.08
8	605196	华通线缆	1,316,805.00	1.99
9	300900	广联航空	1,249,924.00	1.89
10	000688	国城矿业	1,126,933.00	1.70
11	605090	九丰能源	1,107,045.00	1.67
12	002943	宇晶股份	1,091,677.00	1.65
13	688256	寒武纪	1,067,294.00	1.61
14	600498	烽火通信	1,010,548.00	1.53
15	600547	山东黄金	977,579.00	1.48
16	000333	美的集团	969,015.00	1.46
17	300136	信维通信	906,083.00	1.37
18	09988	阿里巴巴－W	883,446.78	1.33
19	002683	广东宏大	857,905.00	1.30
20	002738	中矿资源	855,776.00	1.29

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	47,154,184.42
卖出股票收入（成交）总额	53,870,074.95

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,760,630.06	7.83
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,346,438.36	21.55
	其中：政策性金融债	10,346,438.36	21.55
4	企业债券	8,816,234.28	18.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	8,907,009.54	18.55
8	同业存单	-	-
9	其他	1,729,315.15	3.60
10	合计	33,559,627.39	69.90

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	210316	21 进出 16	100,000	10,346,438.36	21.55
2	019547	16 国债 19	30,090	3,573,659.87	7.44
3	524395	25 招路 K2	26,000	2,643,397.35	5.51
4	148203	23 光大 Y2	20,000	2,094,589.59	4.36
5	148463	23 深投 05	20,000	2,043,747.95	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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，降低投资组合的整体风险。

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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

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，中国进出口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、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

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。

7.12.2 声明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

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。

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	21,607.98
2	应收清算款	1,073,503.54
3	应收股利	3,477.68
4	应收利息	-
5	应收申购款	74,189.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,172,778.25

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123178	花园转债	608,282.89	1.27
2	128136	立讯转债	587,978.57	1.22
3	113066	平煤转债	466,426.70	0.97
4	113697	应流转债	397,428.70	0.83

5	113677	华懋转债	388,035.62	0.81
6	127067	恒逸转 2	361,385.62	0.75
7	118056	路维转债	360,096.78	0.75
8	118062	天准转债	330,739.20	0.69
9	123091	长海转债	326,804.37	0.68
10	128127	文科转债	316,019.81	0.66
11	113673	岱美转债	315,947.37	0.66
12	123183	海顺转债	285,597.41	0.59
13	127109	电化转债	279,604.73	0.58
14	118058	微导转债	272,782.11	0.57
15	113048	晶科转债	271,786.80	0.57
16	123176	精测转 2	268,638.90	0.56
17	118040	宏微转债	264,171.84	0.55
18	118044	赛特转债	256,565.63	0.53
19	127108	太能转债	245,488.18	0.51
20	113667	春 23 转债	209,955.52	0.44
21	113661	福 22 转债	201,436.67	0.42
22	127110	广核转债	197,544.74	0.41
23	123149	通裕转债	159,364.08	0.33
24	111022	锡振转债	150,601.40	0.31
25	113680	丽岛转债	144,169.73	0.30
26	127103	东南转债	144,062.33	0.30
27	110099	福能转债	140,424.41	0.29
28	127061	美锦转债	137,676.78	0.29
29	111017	蓝天转债	119,641.37	0.25
30	127045	牧原转债	117,358.77	0.24
31	110092	三房转债	113,613.81	0.24
32	127105	龙星转债	106,076.50	0.22
33	113691	和邦转债	70,924.79	0.15
34	113695	华辰转债	59,555.86	0.12
35	127082	亚科转债	49,143.42	0.10
36	123199	山河转债	47,250.86	0.10

37	113686	泰瑞转债	44,189.67	0.09
38	113631	皖天转债	39,410.14	0.08
39	113649	丰山转债	31,826.88	0.07

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

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

份额级别	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（%）
富国利享回报 12 个月持有期混合 A	936	32,116.52	7,245,517.65	24.10	22,815,540.68	75.90
富国利享回报 12 个月持有期混合 C	130	72,723.55	1,779,676.10	18.82	7,674,385.00	81.18
合计	1,066	37,068.59	9,025,193.75	22.84	30,489,925.68	77.16

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	99.87%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数，该指标计算时剔除持有期限不满 7 个自然日的交易，剔除场内基金账户（如有）产生的盈亏。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	富国利享回报 12 个月持有期混合 A	309,139.21	1.0284
	富国利享回报 12 个月持有期混合 C	-	-
	合计	309,139.21	0.7823

8.4 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情况

项目	份额级别	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	富国利享回报 12 个月持有期混合 A	0
	富国利享回报 12 个月持有期混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富国利享回报 12 个月持有期混合 A	10~50
	富国利享回报 12 个月持有期混合 C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国利享回报 12 个月持有期混合 A	富国利享回报 12 个月持有期混合 C
基金合同生效日（2022 年 04 月 26 日）基金份额总额	245,461,077.60	33,109,893.24
本报告期期初基金份额总额	61,628,053.13	4,485,210.40
本报告期基金总申购份额	5,981,071.96	8,326,538.19
减：本报告期基金总赎回份额	37,548,066.76	3,357,687.49
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	30,061,058.33	9,454,061.10

§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，本基金基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布公告，王苏龙先生自 2026 年 6 月 26 日起担任公司董事长，同日起裴长江先生不再担任公司董事长。

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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期内，无涉及本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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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（%）	
长江证券	3	17,311,353.00	17.19	7,026.99	17.24	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	4	14,283,619.56	14.18	5,797.29	14.22	-
东吴证券	2	12,612,759.20	12.52	5,085.71	12.47	-
方正证券	1	622,043.00	0.62	252.46	0.62	-
广发证券	2	7,101,247.66	7.05	2,838.20	6.96	-
国盛证券	2	1,675,277.05	1.66	664.50	1.63	-
国泰海通	2	11,454,601.29	11.37	4,649.47	11.40	-
华泰证券	2	7,495,999.71	7.44	3,042.39	7.46	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	3	6,263,720.58	6.22	2,542.61	6.24	-
申万宏源	2	10,170,962.00	10.10	4,128.43	10.13	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	4,049,397.48	4.02	1,628.81	4.00	-
中金公司	2	90,808.00	0.09	36.87	0.09	-
中信建投	2	3,765,028.27	3.74	1,528.17	3.75	-
中信证券	2	3,808,761.17	3.78	1,545.98	3.79	-

注：我公司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：国泰海通（018520、60244）。

10.7.2 基金租用或者通过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（%）
长江证券	5,395,436.42	7.67	6,323,000.00	1.20	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	12,493,189.92	17.76	148,630,000.00	28.29	-	-
东吴证券	7,405,681.70	10.53	120,762,000.00	22.99	-	-
方正证券	788,784.53	1.12	1,700,000.00	0.32	-	-
广发证券	7,757,589.72	11.03	85,131,000.00	16.21	-	-
国盛证券	5,311,464.61	7.55	3,001,000.00	0.57	-	-
国泰海通	3,994,806.18	5.68	78,259,000.00	14.90	-	-
华泰证券	4,071,768.77	5.79	24,081,000.00	4.58	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	7,258,534.15	10.32	33,136,000.00	6.31	-	-
申万宏源	2,529,189.73	3.60	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	5,036,326.98	7.16	-	-	-	-
浙商证券	4,758,619.22	6.77	11,310,000.00	2.15	-	-
中金公司	700,705.01	1.00	1,233,000.00	0.23	-	-
中信建投	1,140,575.45	1.62	3,922,000.00	0.75	-	-
中信证券	1,685,069.43	2.40	7,800,000.00	1.48	-	-

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	关于富国利享回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金资产净值低于 5000 万元的提示性公告	规定披露媒介	2026 年 04 月 17 日
2	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩	规定披露媒介	2026 年 05 月 01 日

	比较基准并修订基金合同等法律文件的公告		
3	关于富国利享回报 12 个月持有期混合型证券投资基金资产净值低于 5000 万元的提示性公告	规定披露媒介	2026 年 05 月 01 日
4	关于富国利享回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金资产净值低于 5000 万元的提示性公告	规定披露媒介	2026 年 05 月 13 日
5	富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定披露媒介	2026 年 06 月 27 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

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定，为更好地反映基金投资风格，提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，经与基金托管人协商一致，本基金管理人决定自2026年6月1日起调整本基金的业绩比较基准并对基金合同等法律文件有关条款进行修订。具体可参见基金管理人于2026年5月1日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》及修订后的基金法律文件。

二、本报告期内，截至2026年5月11日，本基金已连续45个工作日基金资产净值低于5000万元，可能触发基金合同终止的情形。具体可参见基金管理人于2026年5月13日发布的《关于富国利享回报12个月持有期混合型证券投资基金基金资产净值低于5000万元的提示性公告》。

三、本报告期内，经基金管理人董事会第七届十四次会议审议通过，王苏龙先生自2026年6月26日起担任公司董事长，同日起裴长江先生不再担任公司董事长。具体可参见基金管理人于2026年6月27日发布的《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

§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利享回报 12 个月持有期混合型证券投资基金的文件 2、富国利享回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金合同 3、富国利享回报 12 个月持有期混合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、富国利享回报 12 个月持有期混合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	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。