富国嘉汇债券型证券投资基金

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： 财通证券股份有限公司

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。

基金托管人财通证券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 3 月 19 日（基金合同生效日）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 13
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 47
7.1 期末基金资产组合情况 47

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 47
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..... 48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 50
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..... 50
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..... 50
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..... 51
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..... 51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 51
7.12 本报告期投资基金情况 51
7.13 投资组合报告附注 52
§8 基金份额持有人信息 54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 54
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情况..... 54
§9 开放式基金份额变动 55
§10 重大事件揭示 56
10.1 基金份额持有人大会决议 56
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..... 56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 56
10.4 基金投资策略的改变 56
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 56
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 56
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 56
10.8 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..... 57
10.9 其他重大事件 57
§11 影响投资者决策的其他重要信息 59
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 59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 59
§12 备查文件目录 60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国嘉汇债券型证券投资基金	
基金简称	富国嘉汇债券	
基金主代码	026499	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 03 月 19 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	财通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	347,656,421.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国嘉汇债券 A	富国嘉汇债券 C
下属分级基金的交易代码	026499	026500
报告期末下属分级基金的份额总额	332,424,311.73 份	15,232,109.67 份

2.2 基金产品说明

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。在债券等固定收益类资产投资策略方面，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、公募 REITs，以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、国债期货投资策略、信用衍生品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×83%+中证 500 指数收益率×10%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×2%+银行活期存款利率（税后）×5%
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。

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	财通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	马坚岗
	联系电话	021-20361818	0571-85080360
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	cttg@ctsec.com

客户服务电话	95105686、4008880688	95336
传真	021-20361616	0571-87830199
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	浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼
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	浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼
邮政编码	200120	310007
法定代表人	陈戈	章启诚

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	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 财通证券股份有限公司　浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼

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

（1） 富国嘉汇债券 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2026 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日
本期已实现收益	4,681,890.59
本期利润	10,563,496.36
加权平均基金份额本期利润	0.0330
本期加权平均净值利润率	3.26%
本期基金份额净值增长率	3.29%
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	4,856,045.15
期末可供分配基金份额利润	0.0146
期末基金资产净值	343,373,779.62
期末基金份额净值	1.0329
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	3.29%

（2） 富国嘉汇债券 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2026 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日
本期已实现收益	48,293.34
本期利润	187,667.99
加权平均基金份额本期利润	0.0620
本期加权平均净值利润率	6.10%
本期基金份额净值增长率	3.21%
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	209,613.90
期末可供分配基金份额利润	0.0138
期末基金资产净值	15,720,778.68
期末基金份额净值	1.0321
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	3.21%

注：本基金于 2026 年 3 月 19 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足半年。 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） 富国嘉汇债券 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	3.23%	0.26%	2.13%	0.18%	1.10%	0.08%
自基金合同生效起至今	3.29%	0.24%	1.54%	0.20%	1.75%	0.04%

（2） 富国嘉汇债券 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	3.16%	0.26%	2.13%	0.18%	1.03%	0.08%
自基金合同生效起至今	3.21%	0.24%	1.54%	0.20%	1.67%	0.04%

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

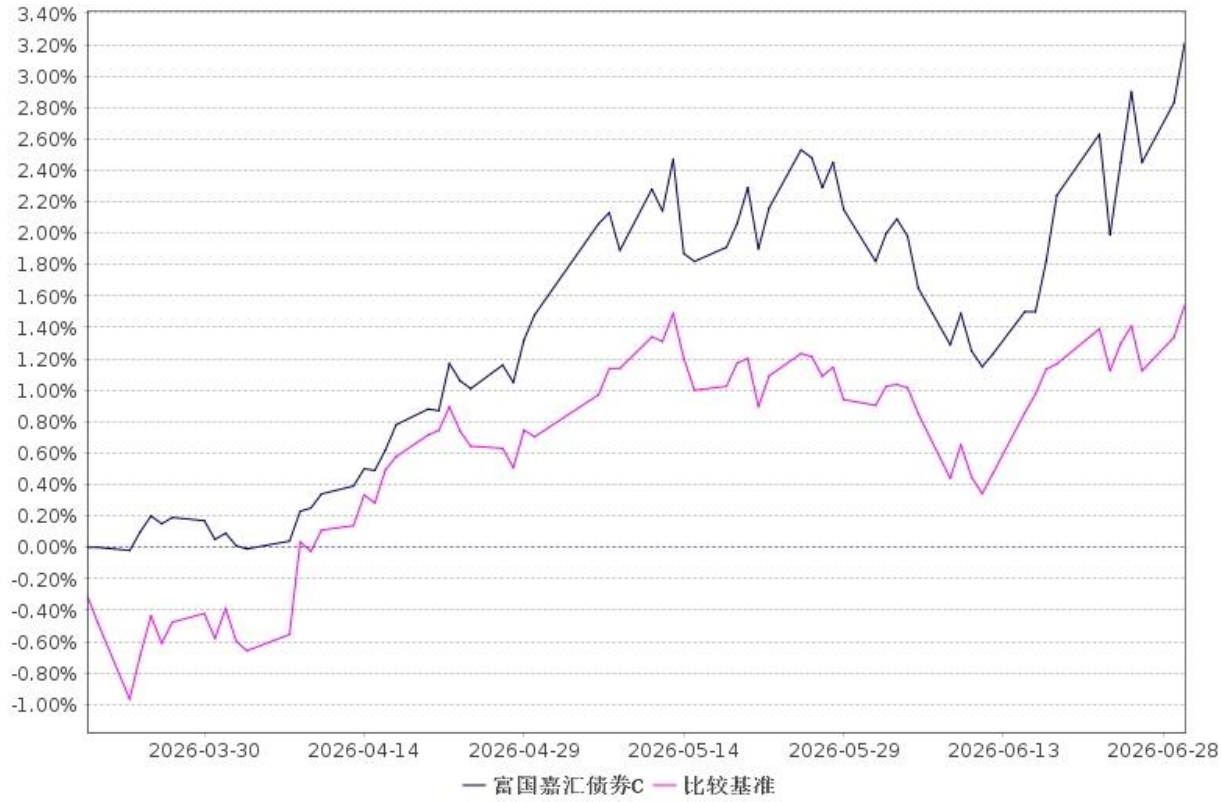
（1）富国嘉汇债券 A



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2026 年 3 月 19 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，截至本报告期末建仓期还未结束。

（2）富国嘉汇债券 C



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2026 年 3 月 19 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，截至本报告期末建仓期还未结束。

§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		
吕春杰	本基金现任基金经理	2026-03-19	-	18	硕士，曾任国泰君安证券股份有限公司研究员/董事，中国人保资产股份有限公司高级投资经理，上海证券有限责任公司资产管理总部副总经理；自 2021 年 6 月加入富国基金管理有限公司，自 2021 年 8 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副总经

					理，兼任富国基金高级固定收益基金经理。自 2021 年 08 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 月起任富国颐利纯债债券型证券投资基金基金经理；自 2021 年 12 月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 07 月起任富国汇享三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；自 2024 年 11 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 2024 年 12 月起任富国收益增强债券型证券投资基金基金经理；自 2025 年 09 月起任富国安景 120 天滚动持有债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2026 年 03 月起任富国丰泰债券型证券投资基金基金经理;自 2026 年 03 月起任富国嘉汇债券型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、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嘉汇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》、《富国嘉汇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 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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，经济增速保持在目标区间内运行，呈现出外需韧性强劲、增长动能焕新、产业结构优化的积极态势，有效应对了外部冲击和内部困难。上半年央行维持流动性充裕的态度，资金利率一度运行于中性偏低水平，二季度开始增加了隔夜逆回购品种的操作，流动性管理更加精准有效。得益于流动性整体均衡宽松，上半年债券市场表现较好，收益率整体下行。权益市场方面，上半年整体表现较好，内部结构分化显著，开年整体持续稳步上行，3 月受美伊冲突影响而有所波折，二季度风险偏好回升，以科技为代表的大盘成长风格引领市场。操作上，本基金灵活调整杠杆和久期及含权仓位，优化持仓结构，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 2026 年 6 月 30 日，本基金份额净值富国嘉汇债券 A 为 1.0329 元，富国嘉汇债券 C 为 1.0321 元；份额累计净值富国嘉汇债券 A 为 1.0329 元，富国嘉汇债券 C 为 1.0321 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国嘉汇债券 A 为 3.29%，富国嘉汇债券 C 为 3.21%；同期业绩比较基准收益率情况：富国嘉汇债券 A 为 1.54%，富国嘉汇债券 C 为 1.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观政策将继续发力提效，财政政策方面，有望加快财政支出和债券资金使用进度，同时央行将综合运用并适时调整货币政策工具，保持流动性合理充裕，强化财政与金融协同促内需。在总量和结构政策的合力下，经济仍有望保持平稳运行。其中，下半年扩大内需仍是重要的政策抓手。结构上，或将重视现代化产业体系的建设，巩固经济向新向优的趋势。随着经济结构的转变，社融的结构和增速也将区别于传统经济动能主导的时期，在货币维持宽松的基调下，债券面临的供需环境仍相对友好。本基金将适时调整组合持仓，力争为持有人获得长期可持续的投资回报。

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

本报告期内，财通证券股份有限公司（以下称“本托管人”）严格遵守法律法规、基金合同，认真履行了应尽的义务，不存在损害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

本报告期内，本托管人严格遵守相关法律法规和基金合同的规定对基金管理人的投资运作进行监督。在基金资产净值的计算、利润分配等方面，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本托管人对本报告中的财务数据均核对无误。

§6 半年度财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国嘉汇债券型证券投资基金

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
资产：	
货币资金	61,517,952.15
结算备付金	201,552.86
存出保证金	114,585.23
交易性金融资产	284,048,114.56
其中：股票投资	31,976,118.00
基金投资	20,860,488.50
债券投资	231,211,508.06
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	16,384,027.45
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	362,266,232.25
负债和净资产	**本期末** 2026 年 06 月 30 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	-
应付清算款	2,500,953.25
应付赎回款	340,579.16
应付管理人报酬	161,746.61
应付托管费	27,025.16
应付销售服务费	1,041.92
应付投资顾问费	-
应交税费	36,965.50

应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	103,362.35
负债合计	3,171,673.95
净资产：	
实收基金	347,656,421.40
未分配利润	11,438,136.90
净资产合计	359,094,558.30
负债和净资产总计	362,266,232.25

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0329 元，基金份额总额 347,656,421.40 份。其中：富国嘉汇债券 A 份额净值 1.0329 元，份额总额 332,424,311.73 份；富国嘉汇债券 C 份额净值 1.0321 元，份额总额 15,232,109.67 份。本基金合同生效日 2026 年 03 月 19 日。

6.2 利润表

会计主体：富国嘉汇债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 03 月 19 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）
一、营业总收入	11,463,872.65
1.利息收入	363,611.89
其中：存款利息收入	312,319.69
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	51,292.20
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	5,079,280.34
其中：股票投资收益	-31,960.67
基金投资收益	2,734,673.54
债券投资收益	2,337,616.97
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	38,950.50
其他投资收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6,020,980.42
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	712,708.30
1. 管理人报酬	552,399.84

2．托管费	92,341.75
3．销售服务费	2,609.44
4．投资顾问费	-
5．利息支出	606.16
其中：卖出回购金融资产支出	606.16
6．信用减值损失	-
7．税金及附加	11,711.06
8．其他费用	53,040.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	10,751,164.35
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	10,751,164.35
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	10,751,164.35

注：本基金合同生效日为 2026 年 3 月 19 日,无上年度同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：富国嘉汇债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 03 月 19 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、本期期初净资产	322,970,937.29	-	322,970,937.29
二、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	24,685,484.11	11,438,136.90	36,123,621.01
（一）、综合收益总额	-	10,751,164.35	10,751,164.35
（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）	24,685,484.11	686,972.55	25,372,456.66
其中：1.基金申购款	36,155,721.10	963,310.93	37,119,032.03
2.基金赎回款	-11,470,236.99	-276,338.38	-11,746,575.37
（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）	-	-	-
三、本期期末净资产	347,656,421.40	11,438,136.90	359,094,558.30

注：本基金合同生效日为 2026 年 3 月 19 日,无上年度同期对比数据。

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

富国嘉汇债券型证券投资基金（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〔2025〕2883 号《关于准予富国嘉汇债券型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自 2026 年 1 月 19 日 至 2026 年 3 月 17 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(26)第 00093 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 2026 年 3 月 19 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 322,961,998.59 元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币 8,938.70 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 322,970,937.29 元，折合 322,970,937.29 份基金份额，其中 A 类基金份额 320,386,600.10 份，C 类基金份额 2,584,337.19 份。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，基金托管人为财通证券股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、政府支持债券、政府支持机构债券、中期票据等）、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、现金等货币市场工具、信用衍生品、国债期货、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（包括全市场的股票型 ETF、公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”），以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，不含货币市场基金、QDII 基金、香港互认基金、基金中基金和可投资其他基金的基金）等，以及法律法规或中国证监会允许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：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产及可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券资产的比例合计为基金资产的 5%-20%；其中，投资于境内股票和股票型 ETF

的比例不低于基金资产的 5%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；本基金持有其他基金，其市值不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的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。其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一： 1、基金合同约定股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金； 2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票及存托凭证资产占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金。 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。

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率×83%+中证 500 指数收益率×10%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×2%+银行活期存款利率（税后）×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 3 月 19 日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2026 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增

加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3)股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4)处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5)买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6)公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7)其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。 以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配；若基金合同生效不满 3 个月，本基金可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权，由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在履行适当程序后，可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，应于变更实施日

前在规定媒介公告。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2)能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3)能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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	61,517,952.15
等于：本金	61,505,550.38

加：应计利息	12,401.77
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	61,517,952.15

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		27,913,034.88	-	31,976,118.00	4,063,083.12
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	46,192,425.72	255,467.13	46,561,688.33	113,795.48
	银行间市场	182,710,606.71	1,534,819.73	184,649,819.73	404,393.29
	合计	228,903,032.43	1,790,286.86	231,211,508.06	518,188.77
资产支持证券		-	-	-	-
基金		19,420,779.97	-	20,860,488.50	1,439,708.53
其他		-	-	-	-
合计		276,236,847.28	1,790,286.86	284,048,114.56	6,020,980.42

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（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	50,723.23
其中：交易所市场	42,978.23
银行间市场	7,745.00
应付利息	-
预提信息披露费	40,000.00
预提审计费	12,639.12
合计	103,362.35

6.4.7.7 实收基金

富国嘉汇债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期（2026 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日 2026 年 3 月 19 日	320,386,600.10	320,386,600.10
本期申购	23,021,873.06	23,021,873.06
本期赎回（以“-”号填列）	-10,984,161.43	-10,984,161.43
本期末	332,424,311.73	332,424,311.73

富国嘉汇债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期（2026 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日 2026 年 3 月 19 日	2,584,337.19	2,584,337.19
本期申购	13,133,848.04	13,133,848.04
本期赎回（以“-”号填列）	-486,075.56	-486,075.56
本期末	15,232,109.67	15,232,109.67

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

富国嘉汇债券 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
基金合同生效日 2026 年 3 月 19 日	-	-	-
本期利润	4,681,890.59	5,881,605.77	10,563,496.36
本期基金份额交易产生的变动数	174,154.56	211,816.97	385,971.53
其中：基金申购款	334,199.03	316,518.20	650,717.23
基金赎回款	-160,044.47	-104,701.23	-264,745.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,856,045.15	6,093,422.74	10,949,467.89

富国嘉汇债券 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
基金合同生效日 2026 年 3 月 19 日	-	-	-
本期利润	48,293.34	139,374.65	187,667.99
本期基金份额交易产生的变动数	161,320.56	139,680.46	301,001.02
其中：基金申购款	167,511.49	145,082.21	312,593.70
基金赎回款	-6,190.93	-5,401.75	-11,592.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	209,613.90	279,055.11	488,669.01

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）
活期存款利息收入	311,571.85
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	596.22
其他	151.62
合计	312,319.69

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）
卖出股票成交总额	41,026,165.31
减：卖出股票成本总额	40,984,964.81
减：交易费用	73,161.17
买卖股票差价收入	-31,960.67

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2026年3月19日(基金合同生效日)至2026年6月30日）
卖出/赎回基金成交总额	63,038,864.36
减：卖出/赎回基金成本总额	60,216,272.43
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	82,211.42
减：交易费用	5,706.97
基金投资收益	2,734,673.54

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）
债券投资收益——利息收入	1,204,927.01
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,132,689.96
合计	2,337,616.97

6.4.7.12.2 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3月19日(基金合同生效日)至2026年6月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	203,036,572.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	200,218,552.46
减：应计利息总额	1,677,502.70
减：交易费用	7,827.14
买卖债券差价收入	1,132,689.96

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）
股票投资产生的股利收益	38,950.50
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	38,950.50

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2026 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）
1.交易性金融资产	6,020,980.42
股票投资	4,063,083.12
债券投资	518,188.77
资产支持证券投资	-
基金投资	1,439,708.53
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	6,020,980.42

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 持有基金产生的费用

项目	本期（2026 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	16,862.04
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	3,695.49

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的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，该披露金额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的基金合同约定的费率和计算方法计算得出，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）
审计费用	12,639.12
信息披露费	40,000.00
证券出借违约金	-
其他	400.93
合计	53,040.05

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

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
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
财通证券股份有限公司（“财通证券”）	基金托管人
华安基金管理有限公司	基金管理人的股东控制的子公司（自 2025 年 3 月 14 日起）

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。

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 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
财通证券	109,924,165.00	100.00

注：本基金合同生效日为 2026 年 03 月 19 日，无上年度同期对比数据。

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 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
财通证券	53,638,692.32	100.00

注：本基金合同生效日为 2026 年 03 月 19 日，无上年度同期对比数据。

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 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
财通证券	285,000,000.00	100.00

注：本基金合同生效日为 2026 年 03 月 19 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2026 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）
财通证券	142,675,916.76	100.00

注：本基金合同生效日为 2026 年 03 月 19 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为 2026 年 03 月 19 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.6 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3月19日(基金合同生效日)至2026年6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（%）
财通证券	44,577.84	100.00	42,978.23	100.00

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。

本基金合同生效日为 2026 年 03 月 19 日，无上年度同期对比数据。

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 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）
当期发生的基金应支付的管理费	552,399.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	124,340.59
应支付基金管理人的净管理费	428,059.25

注：本基金对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日除基金管理人管理的基金外的基金资产净值的 0.6%的年费率计提。管理费的计

算方法如下：

H＝E×0.6%÷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减去持有基金管理人管理基金的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

本基金合同生效日为 2026 年 3 月 19 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	92,341.75

注：本基金对基金财产中持有的本基金托管人自身托管的基金部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日除基金托管人托管的基金外的基金资产净值的 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.1%÷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减去本基金持有的基金托管人自身托管基金的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

本基金合同生效日为 2026 年 3 月 19 日，无上年度同期对比数据。

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 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国嘉汇债券 A	富国嘉汇债券 C	合计
富国基金管理有限公司	-	61.18	61.18
合计	-	61.18	61.18

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该类基金份额资产净值的 0.3%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×该类基金份额销售服务费年费率÷当年天数

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费自基金合同生效日次日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

本基金合同生效日为 2026 年 3 月 19 日，无上年度同期对比数据。

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：本基金本报告期未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。本基金合同生效日 2026 年 03 月 19 日,无上年度同期对比数据。

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：本报告期内本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金合同生效日为 2026 年 3 月 19 日，无上年度同期对比数据。

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未投资本基金。本基金合同生效日为 2026 年 03 月 19 日，无上年度末对比数据。

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

注：本基金本报告期未发生关联方银行存款业务。本基金合同生效日为 2026 年 03 月 19 日，无上年度同期对比数据。

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

本期末，本基金持有基金管理人及其关联方管理的基金合计 10,211,500.00 元，占本基金资产净值的比例为 2.84%。本基金合同生效日为 2026 年 03 月 19 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.8.2 当期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

项目	本期（2026 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日）
当期交易基金产生的申购费（元）	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	4,030.98
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	814.31
当期交易基金产生的交易费	707.25

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。本基金合同生效日 2026 年 03 月 19 日,无上年度同期对比数据。

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

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

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
688072	拓荆科技	2026 年 06 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 07 月 13 日	890.99	1,500.00	1,245,000.00	1,248,000.00	-

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，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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。本基金本报告期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（2026 年 06 月 30 日）
AAA	160,491,025.86
AAA 以下	15,063.02
未评级	30,562,717.81
合计	191,068,806.69

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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。此表中资产支持证券的债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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	61,517,952.15	—	—	—	61,517,952.15
结算备付金	201,552.86	—	—	—	201,552.86
存出保证金	114,585.23	—	—	—	114,585.23
交易性金融资产	20,348,010.97	191,053,743.67	19,809,753.42	52,836,606.50	284,048,114.56
应收申购款	—	—	—	16,384,027.45	16,384,027.45
资产总计	82,182,101.21	191,053,743.67	19,809,753.42	69,220,633.95	362,266,232.25
负债					
应付清算款	—	—	—	2,500,953.25	2,500,953.25
应付赎回款	—	—	—	340,579.16	340,579.16
应付管理人报酬	—	—	—	161,746.61	161,746.61
应付托管费	—	—	—	27,025.16	27,025.16
应付销售服务费	—	—	—	1,041.92	1,041.92
应交税费	—	—	—	36,965.50	36,965.50
其他负债	—	—	—	103,362.35	103,362.35
负债总计	—	—	—	3,171,673.95	3,171,673.95
利率敏感度缺口	82,182,101.21	191,053,743.67	19,809,753.42	66,048,960.00	359,094,558.30

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）
	1.基准点利率增加 0.1%	-765,283.66
	2.基准点利率减少 0.1%	765,283.66

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。本基金合同生效日为2026 年 03 月 19 日，无上年度同期对比数据。

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。

6.4.13.4.3 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）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	31,976,118.00	8.90
交易性金融资产－基金投资	20,860,488.50	5.81
交易性金融资产－债券投资	231,211,508.06	64.39
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	284,048,114.56	79.10

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）

	1.业绩比较基准增加 1%	3,242,151.64
	2.业绩比较基准减少 1%	-3,242,151.64

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。基金合同生效日为 2026 年 03 月 19 日。

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）
第一层次	51,603,669.52
第二层次	232,444,445.04
第三层次	-
合计	284,048,114.56

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	31,976,118.00	8.83
	其中：股票	31,976,118.00	8.83
2	基金投资	20,860,488.50	5.76
3	固定收益投资	231,211,508.06	63.82
	其中：债券	231,211,508.06	63.82
	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	61,719,505.01	17.04
8	其他各项资产	16,498,612.68	4.55
9	合计	362,266,232.25	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

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	1,674,000.00	0.47
C	制造业	26,877,668.00	7.48
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	2,552,880.00	0.71
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	871,570.00	0.24
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	31,976,118.00	8.90

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	688256	寒武纪	1,600	2,552,880.00	0.71
2	300308	中际旭创	1,800	2,286,000.00	0.64
3	300567	精测电子	7,000	2,223,200.00	0.62
4	688008	澜起科技	7,000	2,169,300.00	0.60
5	688627	精智达	3,000	2,145,000.00	0.60
6	002916	深南电路	4,000	1,831,600.00	0.51
7	688347	华虹宏力	5,200	1,748,760.00	0.49
8	002384	东山精密	6,000	1,574,100.00	0.44
9	300750	宁德时代	4,000	1,572,040.00	0.44
10	688082	盛美上海	3,200	1,382,400.00	0.38
11	688072	拓荆科技	1,500	1,248,000.00	0.35
12	688525	佰维存储	2,500	1,236,825.00	0.34
13	603986	兆易创新	1,500	1,222,500.00	0.34
14	688126	沪硅产业	30,000	1,196,700.00	0.33
15	601088	中国神华	30,000	1,171,200.00	0.33
16	603259	药明康德	7,000	871,570.00	0.24
17	688041	海光信息	2,300	851,690.00	0.24
18	603678	火炬电子	10,000	830,000.00	0.23
19	002859	洁美科技	7,000	766,570.00	0.21
20	000630	铜陵有色	110,000	699,600.00	0.19
21	600362	江西铜业	15,000	649,500.00	0.18
22	300394	天孚通信	2,100	635,628.00	0.18
23	601899	紫金矿业	20,000	502,800.00	0.14
24	002709	天赐材料	9,200	473,156.00	0.13
25	002008	大族激光	900	135,099.00	0.04

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	2,891,732.00	0.81
2	002916	深南电路	2,431,374.00	0.68
3	688256	寒武纪	2,164,960.00	0.60

4	300308	中际旭创	2,074,361.00	0.58
5	601600	中国铝业	1,780,500.00	0.50
6	688008	澜起科技	1,698,118.91	0.47
7	601288	农业银行	1,692,500.00	0.47
8	688347	华虹宏力	1,688,453.92	0.47
9	603986	兆易创新	1,655,621.00	0.46
10	600089	特变电工	1,644,600.00	0.46
11	002384	东山精密	1,638,000.00	0.46
12	603019	中科曙光	1,637,624.00	0.46
13	688778	厦钨新能	1,622,362.92	0.45
14	601138	工业富联	1,613,201.00	0.45
15	688012	中微公司	1,604,828.78	0.45
16	000630	铜陵有色	1,562,000.00	0.43
17	300136	信维通信	1,557,000.00	0.43
18	000425	徐工机械	1,556,800.00	0.43
19	688627	精智达	1,556,616.00	0.43
20	600362	江西铜业	1,542,000.00	0.43

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	603986	兆易创新	2,131,025.00	0.59
2	300136	信维通信	2,060,505.00	0.57
3	688012	中微公司	2,057,131.11	0.57
4	601288	农业银行	1,717,570.00	0.48
5	601138	工业富联	1,591,000.00	0.44
6	603019	中科曙光	1,551,165.00	0.43
7	300274	阳光电源	1,540,000.00	0.43
8	603308	应流股份	1,478,380.00	0.41
9	688778	厦钨新能	1,434,231.10	0.40
10	000425	徐工机械	1,421,072.00	0.40
11	601600	中国铝业	1,418,485.00	0.40
12	600089	特变电工	1,399,800.00	0.39
13	300395	菲利华	1,221,969.00	0.34
14	688521	芯原股份	1,214,378.58	0.34
15	001203	大中矿业	1,180,770.00	0.33
16	000792	盐湖股份	1,176,514.00	0.33
17	000338	潍柴动力	1,119,200.00	0.31
18	601869	长飞光纤	1,112,000.00	0.31
19	300750	宁德时代	1,015,791.00	0.28

20	001979	招商蛇口	1,002,000.00	0.28

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	68,897,999.69
卖出股票收入（成交）总额	41,026,165.31

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	159,979,674.08	44.55
	其中：政策性金融债	40,142,701.37	11.18
4	企业债券	10,209,109.59	2.84
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	61,007,661.37	16.99
7	可转债（可交换债）	15,063.02	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	231,211,508.06	64.39

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	1928012	19 工商银行二级 04	200,000	21,839,688.77	6.08
2	232580026	25 建行二级资本债 02A(BC)	200,000	20,499,990.14	5.71
3	240202	24 国开 02	200,000	20,332,947.95	5.66
4	250215	25 国开 15	200,000	19,809,753.42	5.52
5	232480061	24 工行二级资本债 01A(BC)	100,000	10,365,904.11	2.89

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。

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金采用定量分析和定性分析相结合的方式，一方面通过严格的量化规则筛选有潜在投资价值的标的纳入研究范围，另一方面结合所选基金的基金管理人的基本情况和投研文化等定性因素进行二次研判，双重维度力求筛选出中长期业绩稳定的优秀基金。

本基金还将定期对投资组合进行回顾和动态调整，剔除不再符合筛选标准的标的基金，增加符合筛选标准的基金，以实现基金投资组合的优化。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，符合基金合同约定的投资政策，投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

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	159949	华安创业板50ETF	交易型开放式	4,000,000.00	8,352,000.00	2.33	是
2	515880	国泰中证全指通信设备ETF	交易型开放式	3,000,000.00	5,388,000.00	1.50	否
3	159516	国泰中证半导体材料设备主题ETF	交易型开放式	1,000,000.00	1,975,000.00	0.55	否
4	159870	化工ETF	交易型开放式	2,000,000.00	1,724,000.00	0.48	否
5	588380	富国中证科创创业50ETF	契约型，交易型开放式	1,000,000.00	1,499,000.00	0.42	是
6	588000	华夏上证科创板50成份ETF	交易型开放式	500,000.00	1,172,000.00	0.33	否
7	515220	国泰中证煤炭ETF	交易型开放式	365,500.00	389,988.50	0.11	否
8	159748	富国中证沪港深创新药产业ETF	契约型，交易型开放式	500,000.00	360,500.00	0.10	是

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设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，中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	114,585.23
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	16,384,027.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,498,612.68

7.13.4 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	127070	大中转债	15,063.02	0.00

7.13.5 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。

7.13.6 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（%）
富国嘉汇债券 A	403	824,874.22	326,560,453.93	98.24	5,863,857.80	1.76
富国嘉汇债券 C	209	72,880.91	12,698,322.80	83.37	2,533,786.87	16.63
合计	612	568,066.05	339,258,776.73	97.58	8,397,644.67	2.42

8.2 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	富国嘉汇债券 A	-	-
	富国嘉汇债券 C	-	-
	合计	-	-

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	富国嘉汇债券 A	0
	富国嘉汇债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富国嘉汇债券 A	0
	富国嘉汇债券 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国嘉汇债券 A	富国嘉汇债券 C
基金合同生效日（2026 年 03 月 19 日）基金份额总额	320,386,600.10	2,584,337.19
基金合同生效日 2026 年 3 月 19 日起至报告期期末基金总申购份额	23,021,873.06	13,133,848.04
减：基金合同生效日 2026 年 3 月 19 日起至报告期期末基金总赎回份额	10,984,161.43	486,075.56
基金合同生效日 2026 年 3 月 19 日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	332,424,311.73	15,232,109.67

§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未发生重大人事变动。

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，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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 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。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 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。

10.7.2 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。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人未受到调查或处罚。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人的相关从业人员未受到调查或处罚。

10.8 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

10.8.1 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（%）	
财通证券	2	109,924,165.00	100.00	44,577.84	100.00	-

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。本基金合同生效日为 2026 年 3 月 19 日，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

10.8.2 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		基金交易	
	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（%）	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）
财通证券	53,638,692.32	100.00	285,000,000.00	100.00	-	-	142,675,916.76	100.00

10.9 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	富国嘉汇债券型证券投资基金基金合同生效公告	规定披露媒介	2026 年 03 月 20 日

2	富国嘉汇债券型证券投资基金开放申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2026 年 06 月 16 日
3	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

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	2026-03-19至2026-06-30	94,996,583.32	-	-	94,996,583.32	27.32%
产品特有风险							
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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嘉汇债券型证券投资基金的文件 2、富国嘉汇债券型证券投资基金基金合同 3、富国嘉汇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、富国嘉汇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	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。