

富国腾享回报 6 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金

二〇二四年第 3 季度报告

2024 年 09 月 30 日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式		
基金主代码	012270		
基金运作方式	契约型开放式。每个交易日开放申购，每份基金份额设定 6 个月的滚动运作期。		
基金合同生效日	2021 年 07 月 29 日		
报告期末基金份额总额	207,167,617.84 份		
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	本基金的大类资产配置策略将作为“自下而上”选股的补充，目的是帮助基金把握市场整体的系统性机会或规避市场整体的系统性风险。其基本原理为比较和分析各大类资产的预期收益和风险（包括股票、存托凭证、债券、货币市场工具、金融衍生品和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种），以确定投资组合中各类资产的配置比例。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，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；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；本基金的存托凭证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略和资产支持证券投资策略详见法律文件。		
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×80%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+沪深 300 指数收益率×15%		
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低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 A	富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 C	富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 E
下属分级基金的交易代码	012270	012271	019148
报告期末下属分级基金的份额总额	64,367,451.31 份	142,798,264.60 份	1,901.93 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：

人民币元

主要财务指标	报告期（2024年07月01日-2024年09月30日）		
	富国腾享回报6个月滚动持有混合发起式A	富国腾享回报6个月滚动持有混合发起式C	富国腾享回报6个月滚动持有混合发起式E
1. 本期已实现收益	195,726.49	186,165.99	-1.95
2. 本期利润	715,999.96	1,492,533.60	22.45
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0145	0.0124	0.0118
4. 期末基金资产净值	68,826,482.72	151,244,747.20	2,033.72
5. 期末基金份额净值	1.0693	1.0591	1.0693

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国腾享回报6个月滚动持有混合发起式A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.12%	0.07%	3.45%	0.25%	-2.33%	-0.18%
过去六个月	2.11%	0.12%	4.43%	0.21%	-2.32%	-0.09%
过去一年	1.62%	0.18%	5.25%	0.20%	-3.63%	-0.02%
过去三年	6.00%	0.15%	2.38%	0.22%	3.62%	-0.07%
自基金合同生效起至今	6.93%	0.15%	2.59%	0.22%	4.34%	-0.07%

(2) 富国腾享回报6个月滚动持有混合发起式C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.04%	0.07%	3.45%	0.25%	-2.41%	-0.18%
过去六个月	1.95%	0.12%	4.43%	0.21%	-2.48%	-0.09%
过去一年	1.31%	0.18%	5.25%	0.20%	-3.94%	-0.02%

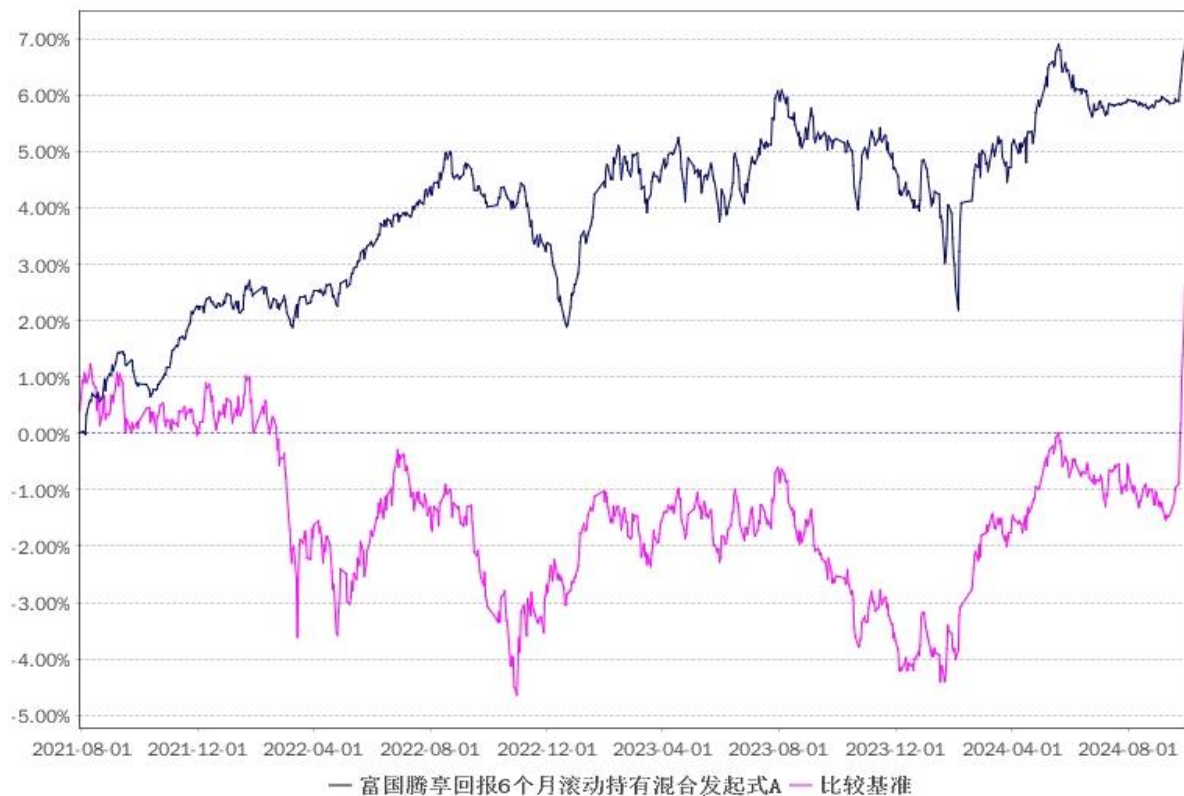
过去三年	5.04%	0.15%	2.38%	0.22%	2.66%	-0.07%
自基金合同生效起至今	5.91%	0.15%	2.59%	0.22%	3.32%	-0.07%

(3) 富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 E

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.12%	0.07%	3.45%	0.25%	-2.33%	-0.18%
过去六个月	2.11%	0.12%	4.43%	0.21%	-2.32%	-0.09%
过去一年	1.62%	0.18%	5.25%	0.20%	-3.63%	-0.02%
自基金分级生效日起至今	1.56%	0.18%	4.57%	0.20%	-3.01%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

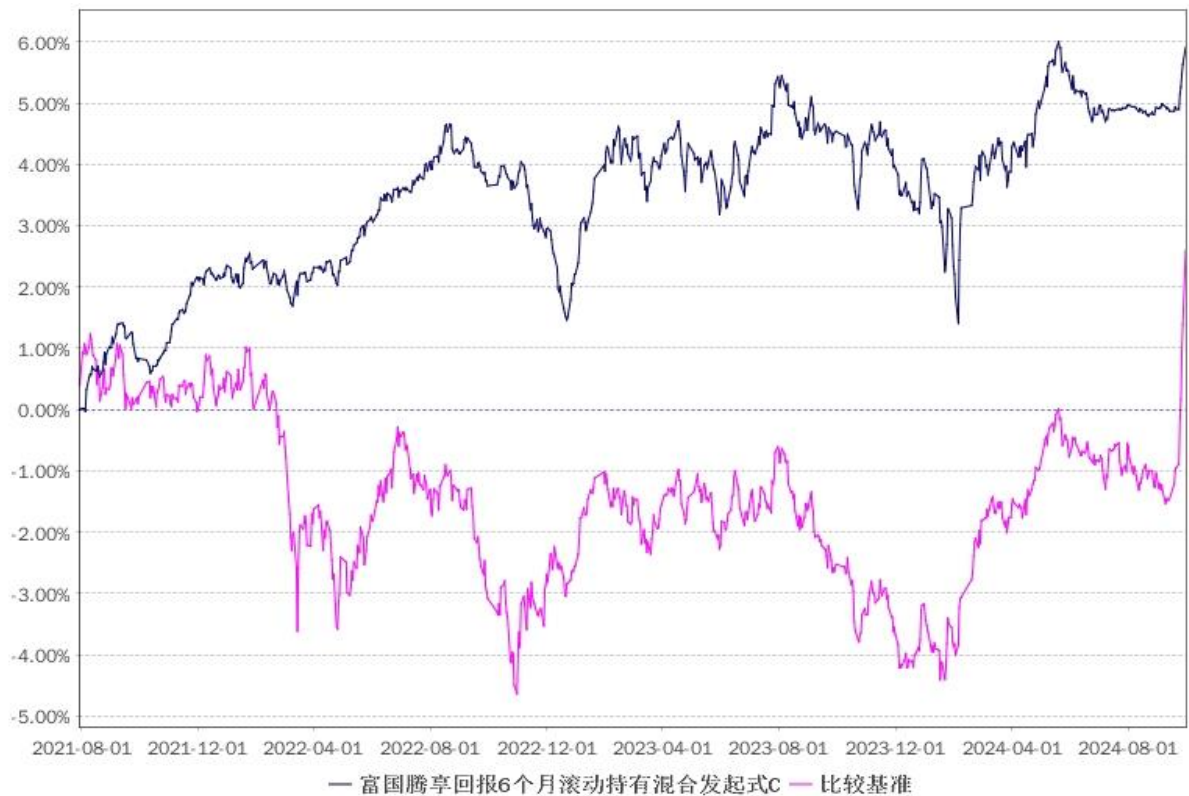
(1) 自基金合同生效以来富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 A 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为 2024 年 9 月 30 日。

2、本基金于 2021 年 7 月 29 日成立，建仓期 6 个月，从 2021 年 7 月 29 日起至 2022 年 1 月 28 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

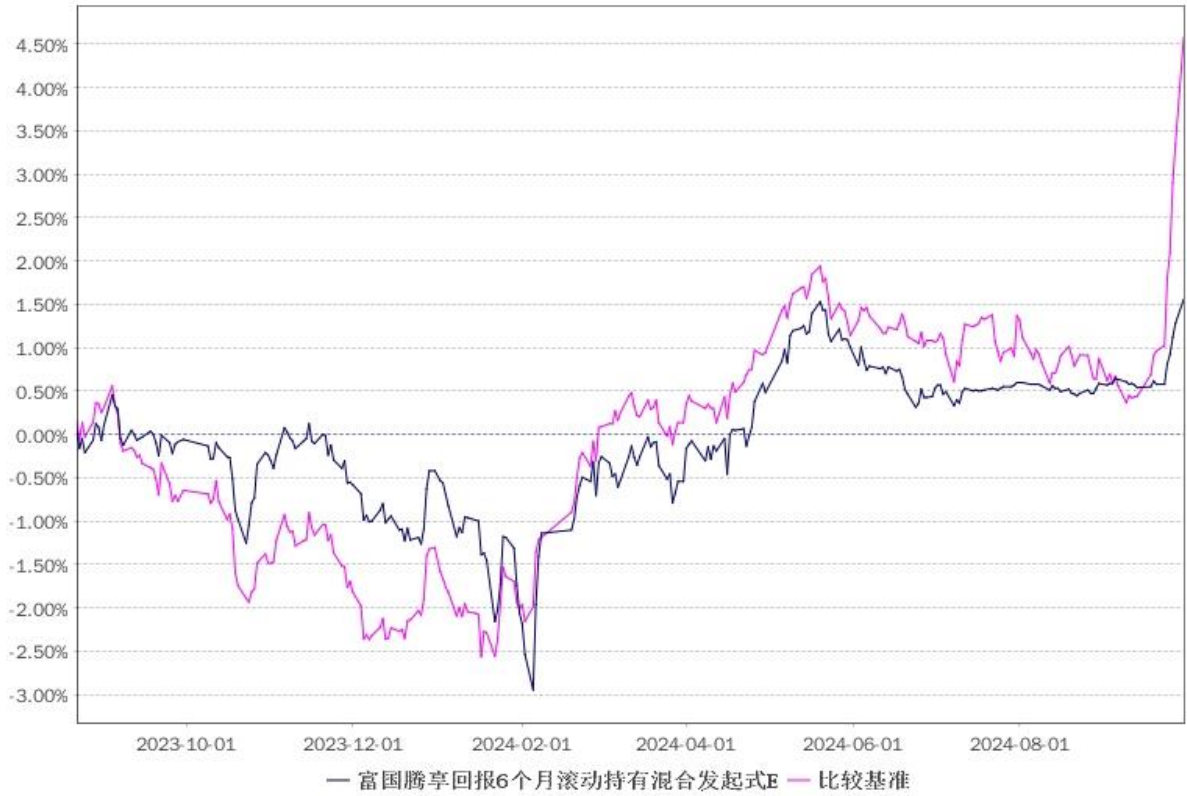
(2) 自基金合同生效以来富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 C 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为 2024 年 9 月 30 日。

2、本基金于 2021 年 7 月 29 日成立，建仓期 6 个月，从 2021 年 7 月 29 日起至 2022 年 1 月 28 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(3) 自基金 E 级份额生效以来富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 E 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、截止日期为2024年9月30日。

2、本基金自2023年8月21日起增加E类份额，相关数据按实际存续期计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
张育浩	本基金现任基金经理	2022-01-26	—	7	硕士，曾任 IHS Markit 宏观经济学家，Goldenwise Capital 首席经济学家，西部证券股份有限公司宏观首席分析师；自 2021 年 7 月加入富国基金管理有限公司，现任富国基金固定收益投资部固定收益基金经理。自 2021 年 12 月起任富国悦享回报 12 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 01 月起任富国腾享回报 6 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 月起任富国稳健双盈债券型发起式证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
刘兴旺	本基金现任基金经理	2022-11-11	—	19	硕士，曾任申银万国证券股份有限公司固定收益研究员，华宝兴业基金管理有限公司基金经理助理兼债券研究员，泰信基金管理有限公司基金经理，国投瑞银基金管理有限公司基

					<p>金经理，国联证券股份有限公司资产管理部副总经理，长安基金管理有限公司固定收益总监；自 2021 年 11 月加入富国基金管理有限公司，自 2022 年 5 月起历任固定收益投资经理；现任富国基金固定收益投资部固定收益基金经理。自 2022 年 07 月起任富国裕利债券型证券投资基金基金经理；自 2022 年 09 月起任富国双利增强债券型证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 月起任富国腾享回报 6 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 月起任富国久利稳健配置混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 月起任富国优化增强债券型证券投资基金基金经理；自 2023 年 05 月起任富国稳健添利债券型证券投资基金基金经理；自 2023 年 07 月起任富国兴享回报 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。</p>
朱晨杰	本基金现任基金经理	2023-06-28	—	11	<p>硕士，曾任法国兴业银行（巴黎）交易助理，海通证券股份有限公司债券销售、交易岗，</p>

				<p>平安证券股份有限公司自营交易员，中欧基金管理有限公司基金经理、投资经理，工银瑞信基金管理有限公司基金经理、投资经理；自 2022 年 2 月加入富国基金管理有限公司，自 2022 年 6 月起历任固定收益投资经理；现任富国基金固定收益投资部固定收益基金经理。自 2023 年 06 月起任富国腾享回报 6 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2023 年 09 月起任富国双利增强债券型证券投资基金基金经理；自 2024 年 08 月起任富国稳健双鑫债券型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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

2、证券从业的涵义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国腾享回报 6 个月滚动持有混合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》、《富国腾享回报 6 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度权益市场波动较大，在经历了四个月的调整后，整体指数在9月末迎来了大反弹。期间沪深300上涨16.07%，创业板指上涨29.21%，前期超跌的成长股表现优于价值股；上证50上涨15.05%，国证2000上涨16.36%，小盘股领先大盘股。受益于经济政策的边际调整，宽基指数整体涨幅集中在9月末。债券方面，收益率先下后上，10年期国债收益率较季初下行10BP左右，3-5年期AAA信用债收益率较季初上行20-25BP左右，信用利差有所拉大。

组合季初维持了较低的权益敞口，并在8月、9月市场调整过程中逐步增持了个股及转债标的。行业配置方面，超配了非银金融及顺周期行业，低配了上游资源类及公用事业。转债方面，主要以有一定债底保护的中低价品种为主。债券方面，组合以中短久期利率债及高等级信用债为主，久期暴露相对谨慎。

政治局会议后，预期三季度各项稳增长措施将加速落地，随着财政政策力度的提升及货币政策的配合，基本面有望走出周期低位，并完成全年既定的增速目标。随着流动性的注入以及经济预期的改善，资本市场亦有望走出估值修复的行情。债券方面，随着收益率的调整，部分中高等级信用债的票息价值逐渐显现，值得关注。组合权益方面立足于寻找经营稳健，估值阶段性低估的优质企业。债券方面以票息策略为主，积极利用杠杆。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金份额净值增长率A级为1.12%，C级为1.04%，E级为1.12%，同期业绩比较基准收益率A级为3.45%，C级为3.45%，E级为3.45%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,048,388.86	2.17
	其中：股票	5,048,388.86	2.17
2	固定收益投资	223,579,917.35	96.18
	其中：债券	223,579,917.35	96.18
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	1,339,551.23	0.58
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	1,410,481.45	0.61
7	其他资产	1,090,981.39	0.47
8	合计	232,469,320.28	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 36,144.01 元，占资产净值比例为 0.02%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	2,215,507.85	1.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	360,693.00	0.16
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	—	—
J	金融业	2,436,044.00	1.11
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	5,012,244.85	2.28

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
工业	31,310.15	0.01
医疗保健	4,833.86	0.00
合计	36,144.01	0.02

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明

细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601688	华泰证券	109,900	1,934,240.00	0.88
2	601658	邮储银行	95,400	501,804.00	0.23
3	000848	承德露露	56,900	484,788.00	0.22
4	601390	中国中铁	54,900	360,693.00	0.16
5	600887	伊利股份	10,000	290,700.00	0.13
6	603187	海容冷链	22,000	259,820.00	0.12
7	688349	三一重能	8,901	256,793.85	0.12
8	000725	京东方A	51,200	228,864.00	0.10
9	002078	太阳纸业	15,000	226,200.00	0.10
10	600528	中铁工业	16,100	132,986.00	0.06

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,410,956.82	0.64
2	央行票据	—	—
3	金融债券	133,210,785.75	60.53
	其中：政策性金融债	47,852,410.67	21.74
4	企业债券	16,246,413.32	7.38

5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	10,681,231.41	4.85
7	可转债（可交换债）	32,293,995.84	14.67
8	同业存单	29,736,534.21	13.51
9	其他	—	—
10	合计	223,579,917.35	101.59

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	190311	19 进出 11	215,000	22,234,154.51	10.10
2	110059	浦发转债	161,740	17,922,511.32	8.14
3	220208	22 国开 08	150,000	15,451,286.30	7.02
4	2028024	20 中信银行二级	120,000	12,230,057.42	5.56
5	1928033	19 中国银行二级 03	100,000	10,371,221.86	4.71

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,484.02
2	应收证券清算款	1,076,199.54
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	10,297.83
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	1,090,981.39

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	17,922,511.32	8.14
2	127016	鲁泰转债	1,215,529.79	0.55
3	128048	张行转债	895,126.92	0.41
4	123214	东宝转债	618,803.96	0.28
5	127070	大中转债	553,516.54	0.25
6	123108	乐普转2	486,477.77	0.22
7	123169	正海转债	475,000.26	0.22
8	127102	浙建转债	469,635.60	0.21
9	123150	九强转债	430,972.30	0.20
10	111014	李子转债	379,076.73	0.17
11	127035	濮耐转债	358,907.40	0.16
12	113660	寿22转债	344,512.31	0.16
13	123212	立中转债	343,609.06	0.16
14	110090	爱迪转债	341,661.48	0.16
15	113632	鹤21转债	337,951.44	0.15

16	127020	中金转债	334,252.60	0.15
17	123119	康泰转 2	327,420.92	0.15
18	123233	凯盛转债	320,911.07	0.15
19	113679	芯能转债	311,946.56	0.14
20	127090	兴瑞转债	295,448.47	0.13
21	113627	太平转债	272,355.18	0.12
22	118025	奕瑞转债	251,387.53	0.11
23	123211	阳谷转债	250,177.15	0.11
24	113658	密卫转债	249,518.27	0.11
25	110075	南航转债	246,497.26	0.11
26	127083	山路转债	236,485.82	0.11
27	123133	佩蒂转债	230,112.56	0.10
28	113047	旗滨转债	225,574.59	0.10
29	127042	嘉美转债	224,090.96	0.10
30	127039	北港转债	221,611.25	0.10
31	123149	通裕转债	187,727.39	0.09
32	127073	天赐转债	183,187.89	0.08
33	118029	富淼转债	181,447.50	0.08
34	118022	锂科转债	175,033.32	0.08
35	113563	柳药转债	160,694.69	0.07
36	127031	洋丰转债	160,466.61	0.07
37	128130	景兴转债	159,983.48	0.07
38	123225	翔丰转债	156,318.83	0.07
39	127027	能化转债	150,015.43	0.07
40	110064	建工转债	145,356.95	0.07
41	123180	浙矿转债	144,537.31	0.07
42	123204	金丹转债	126,882.15	0.06
43	128134	鸿路转债	112,863.99	0.05
44	111009	盛泰转债	109,939.95	0.05
45	127068	顺博转债	93,178.39	0.04
46	118011	银微转债	92,315.59	0.04
47	118031	天 23 转债	78,763.09	0.04

48	111010	立昂转债	54,242.13	0.02
49	127089	晶澳转债	50,784.58	0.02
50	127066	科利转债	49,723.34	0.02
51	127040	国泰转债	47,671.15	0.02
52	123113	仙乐转债	46,677.56	0.02
53	127076	中宠转 2	46,187.58	0.02
54	113067	燃 23 转债	25,522.95	0.01
55	113664	大元转债	24,160.90	0.01
56	113059	福莱转债	21,569.88	0.01
57	113663	新化转债	6,378.82	0.00
58	110092	三房转债	2,812.95	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 A	富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 C	富国腾享回报 6 个月滚动持有混合发起式 E
报告期期初基金份额总额	15,641,041.89	40,741,998.52	1,901.93
报告期期间基金总申购份额	51,411,100.18	110,286,147.31	—
报告期期间基金总赎回份额	2,684,690.76	8,229,881.23	—
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	—	—	—
报告期期末基金份额总额	64,367,451.31	142,798,264.60	1,901.93

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,006,366.97
报告期期间买入/申购总份额	37,791,950.11
报告期期间卖出/赎回总份额	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	47,798,317.08
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	23.07

注：买入/申购含红利再投资、转换入份额；卖出/赎回含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位：份

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	申购	2024-07- 26	37,791,950 .11	40,000,000 .00	—
合计			37,791,950 .11	40,000,000 .00	

注：A类基金份额申购适用固定费用1000元

§ 8 报告期末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	47,798,317.08	23.07	10,005,417.21	4.83	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	47,798,317.08	23.07	10,005,417.21	4.83	3年

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	2024-07-26 至 2024-09-30	10,006,366.97	37,791,950.11	—	47,798,317.08	23.07%
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>							

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国腾享回报 6 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金的文件
- 2、富国腾享回报 6 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金基金合同
- 3、富国腾享回报 6 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 5、富国腾享回报 6 个月滚动持有混合型发起式证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

10.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

10.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。
咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址：
<http://www.fullgoal.com.cn>。

富国基金管理有限公司
2024 年 10 月 25 日