# 富国宝利增强债券型发起式证券投资基金

# 二 0 二六年第 3 季度报告

2026 年 09 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国建设银行股份有限公司

报告送出日期： 2026 年 10 月 27 日

# §1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 7 月 1 日起至 2026 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 | 富国宝利增强债券 | |
| 基金主代码 | 005078 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018 年 02 月 08 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 18,063,694,827.60 份 | |
| 投资目标 | 本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。 | |
| 投资策略 | 本基金按照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。本基金在债券投资过程中突出主动性的投资管理，在对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势进行客观判断的基础上，通过合理配置收益率相对较高的企业债、公司债、资产支持证券，以及风险收益特征优异的可转换公司债券、可分离交易可转债、中小企业私募债券、可交换债券等债券品种，加以对国家债券、金融债券、中央银行票据以及质押及买断式回购等高流动性品种的投资，灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略，在保证基金流动性的前提下，积极把握固定收益证券市场中投资机会，获取各类债券的超额投资收益。当本基金管理人判断市场出现明显的趋势性投资机会时，本基金可以直接参与股票市场投资，努力获取超额收益。在股票市场投资过程中，本基金主要采取自下而上的投资策略，利用数量化投资技术与基本面研究相结合的研究方法进行投资。本基金的资产证券化产品投资策略、存托凭证投资策略、权证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*90%+沪深 300 指数收益率*10%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 富国宝利增强债券 A | 富国宝利增强债券 E |
| 下属分级基金的交易代码 | 005078 | 022175 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 8,142,420,068.93 份 | 9,921,274,758.67 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（2026 年 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日） | |
|---|---|---|
| | 富国宝利增强债券 A | 富国宝利增强债券 E |
| 1.本期已实现收益 | 10,225,907.09 | 2,313,067.89 |
| 2.本期利润 | -171,582,215.79 | -148,553,785.05 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0208 | -0.0168 |
| 4.期末基金资产净值 | 11,768,448,449.97 | 14,333,557,616.44 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.4453 | 1.4447 |

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）富国宝利增强债券 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -1.75% | 0.32% | -0.81% | 0.13% | -0.94% | 0.19% |
| 过去六个月 | 1.27% | 0.30% | 0.91% | 0.14% | 0.36% | 0.16% |
| 过去一年 | 2.80% | 0.27% | 0.84% | 0.12% | 1.96% | 0.15% |
| 过去三年 | 16.81% | 0.36% | 7.32% | 0.12% | 9.49% | 0.24% |
| 过去五年 | 15.38% | 0.32% | 6.88% | 0.11% | 8.50% | 0.21% |
| 过去七年 | 35.02% | 0.32% | 11.96% | 0.12% | 23.06% | 0.20% |
| 自基金合同生效起至今 | 49.20% | 0.31% | 16.92% | 0.12% | 32.28% | 0.19% |

（2）富国宝利增强债券 E

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -1.75% | 0.32% | -0.81% | 0.13% | -0.94% | 0.19% |
| 过去六个月 | 1.26% | 0.30% | 0.91% | 0.14% | 0.35% | 0.16% |
| 过去一年 | 2.79% | 0.27% | 0.84% | 0.12% | 1.95% | 0.15% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自基金分级生效日起至今 | 17.90% | 0.39% | 3.99% | 0.13% | 13.91% | 0.26% |

## 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）富国宝利增强债券 A




注：1、截止日期为 2026 年 9 月 30 日。

（2）富国宝利增强债券 E




注：1、截止日期为 2026 年 9 月 30 日。

2、本基金自 2024 年 9 月 25 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 | | |
| 陈斯扬 | 本基金现任基金经理 | 2018-03-19 | — | 14 | 硕士，曾任交银施罗德基金管理有限公司研究员、投资经理；自 2016 年 10 月加入富国基金管理有限公司，历任定量投资经理、定量基金经理、量化投资部债券投资总监助理；现任富国基金量化投资部量化多资产投资部总经理，兼任富国基金定量基金经理。自 2018 年 03 月起任富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2018 年 03 月起任富国丰利增强债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2018 年 04 月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2024 年 03 月起任富国盛利增强债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2026 年 06 月起任富国裕丰回报混合型证券投资基金基金经理；自 2026 年 07 月起任富国和信回报 3 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；自 2026 年 07 月起任富国鸿利增强债券型证券投资基金基金经理；自 2026 年 08 月起任富国稳悦回报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宝利增强债券型发起式证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

## 4.3 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《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，出现 125 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，国内经济整体呈现弱修复态势，制造业 PMI 由 7 月的 49.2 逐步回升至 9 月的 50.1；与此同时，海外长端利率上行、地缘局势扰动能源供给，市场风险偏好反复波动。A 股整体震荡回落、结构分化加剧。AI 产业链景气持续性与估值消化预期交织，前期涨幅较大、交易较拥挤的科技成长板块回撤较为明显；红利及能源、公用事业、银行等防御方向在风险偏

好偏弱阶段相对占优。

7 月市场调整较快，动量风格回撤明显，对前期动量特征较强的组合策略形成挑战。8 至 9 月市场波动有所收敛，但风格轮动仍较频繁，趋势延续性不足，绝对收益获取难度较大。面对市场变化，组合积极调整权益策略约束和风险敞口，力求适度降低组合波动，并将风格向均衡、偏价值方向调整。

可转债方面，市场延续二季度以来的调整，估值有所回吐，但整体绝对估值仍难言便宜，市场整体流动性有所下降，获取超额收益的难度仍维持高位。因此，组合转债敞口维持在历史低位。

纯债方面，国内债市在基本面偏弱和流动性支持下表现较强，收益率整体处于低位，9 月超长期利率债表现尤为突出。组合适时拉长久期，为组合提供了一定对冲。考虑到国内通胀仍处低位、经济修复偏缓，债券配置或仍有支撑；同时，当前收益率水平较低，后续将审慎把握长端机会并关注久期风险。

## 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情况：富国宝利增强债券 A 为-1.75%，富国宝利增强债券 E 为-1.75%；同期业绩比较基准收益率情况：富国宝利增强债券 A 为-0.81%，富国宝利增强债券 E 为-0.81%。

## 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 | 5,136,278,473.22 | 18.43 |
| | 其中：股票 | 5,136,278,473.22 | 18.43 |
| 2 | 固定收益投资 | 21,622,300,762.08 | 77.57 |
| | 其中：债券 | 21,622,300,762.08 | 77.57 |
| | 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 | 19,200,000.00 | 0.07 |
| | 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 | 703,844,061.95 | 2.53 |
| 7 | 其他资产 | 392,023,494.50 | 1.41 |
| 8 | 合计 | 27,873,646,791.75 | 100.00 |

## 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 | 11,091,049.00 | 0.04 |
| B | 采矿业 | 314,405,660.95 | 1.20 |
| C | 制造业 | 2,946,982,980.48 | 11.29 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 176,981,472.38 | 0.68 |
| E | 建筑业 | 53,844,160.30 | 0.21 |
| F | 批发和零售业 | 29,893,207.41 | 0.11 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 250,564,000.24 | 0.96 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 297,696,195.96 | 1.14 |
| J | 金融业 | 932,514,496.01 | 3.57 |
| K | 房地产业 | 4,401,033.00 | 0.02 |
| L | 租赁和商务服务业 | 4,243,302.00 | 0.02 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 99,772,596.49 | 0.38 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 3,803,122.00 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 2,805,273.00 | 0.01 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| Q | 卫生和社会工作 | 7,279,924.00 | 0.03 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 5,136,278,473.22 | 19.68 |

## 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 | 300308 | 中际旭创 | 187,202 | 151,341,584.88 | 0.58 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 2,340,535 | 124,727,110.15 | 0.48 |
| 3 | 688041 | 海光信息 | 441,664 | 100,169,395.20 | 0.38 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 1,234,083 | 98,850,048.30 | 0.38 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 71,369 | 89,826,450.78 | 0.34 |
| 6 | 601899 | 紫金矿业 | 3,008,673 | 89,628,368.67 | 0.34 |
| 7 | 601857 | 中国石油 | 7,927,800 | 88,870,638.00 | 0.34 |
| 8 | 601919 | 中远海控 | 5,286,400 | 86,538,368.00 | 0.33 |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 3,296,815 | 85,255,635.90 | 0.33 |
| 10 | 600919 | 江苏银行 | 6,879,354 | 85,166,402.52 | 0.33 |

## 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 | 1,556,611,953.14 | 5.96 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 17,427,505,504.47 | 66.77 |
| | 其中：政策性金融债 | 9,636,175,843.84 | 36.92 |
| 4 | 企业债券 | 2,116,135,824.44 | 8.11 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 522,047,480.03 | 2.00 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 21,622,300,762.08 | 82.84 |

## 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 | 260401 | 26 农发 01 | 30,400,000 | 3,075,001,643.84 | 11.78 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 2 | 260205 | 26 国开 05 | 22,500,000 | 2,306,236,438.36 | 8.84 |
| 3 | 250215 | 25 国开 15 | 18,000,000 | 1,799,003,835.62 | 6.89 |
| 4 | 250220 | 25 国开 20 | 13,000,000 | 1,314,471,671.23 | 5.04 |
| 5 | 250430 | 25 农发 30 | 8,100,000 | 818,458,397.26 | 3.14 |

## 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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

### 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 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的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通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、中共上海市委网络安全和信息化委员会办公室的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海浦东发展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、国家外汇管理局上海市分局的处罚。

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

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 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。

## 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,678,234.21 |
| 2 | 应收证券清算款 | 101,252,311.73 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 289,092,948.56 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 392,023,494.50 |

## 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 | 113052 | 兴业转债 | 15,931,417.34 | 0.06 |
| 2 | 113056 | 重银转债 | 15,880,824.66 | 0.06 |
| 3 | 127056 | 中特转债 | 15,697,912.90 | 0.06 |
| 4 | 113062 | 常银转债 | 15,669,398.89 | 0.06 |
| 5 | 127110 | 广核转债 | 15,663,276.15 | 0.06 |
| 6 | 113696 | 伯 25 转债 | 15,310,652.58 | 0.06 |
| 7 | 127049 | 希望转 2 | 15,267,825.76 | 0.06 |
| 8 | 110099 | 福能转债 | 15,146,298.99 | 0.06 |
| 9 | 113661 | 福 22 转债 | 14,741,039.63 | 0.06 |
| 10 | 110087 | 天业转债 | 14,609,350.33 | 0.06 |
| 11 | 127045 | 牧原转债 | 13,821,801.73 | 0.05 |
| 12 | 113054 | 绿动转债 | 13,406,489.98 | 0.05 |
| 13 | 113067 | 燃 23 转债 | 12,669,635.37 | 0.05 |
| 14 | 127040 | 国泰转债 | 12,200,504.73 | 0.05 |
| 15 | 113051 | 节能转债 | 11,389,210.31 | 0.04 |
| 16 | 127050 | 麒麟转债 | 11,260,630.28 | 0.04 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 17 | 113066 | 平煤转债 | 9,042,223.40 | 0.03 |
| 18 | 113682 | 益丰转债 | 7,841,291.05 | 0.03 |
| 19 | 123107 | 温氏转债 | 7,814,708.55 | 0.03 |
| 20 | 127111 | 金威转债 | 7,755,690.79 | 0.03 |
| 21 | 127030 | 盛虹转债 | 7,536,936.54 | 0.03 |
| 22 | 123257 | 安克转债 | 7,432,300.72 | 0.03 |
| 23 | 127083 | 山路转债 | 7,343,363.33 | 0.03 |
| 24 | 113659 | 莱克转债 | 7,215,985.60 | 0.03 |
| 25 | 123150 | 九强转债 | 6,824,543.00 | 0.03 |
| 26 | 118031 | 天 23 转债 | 6,523,427.32 | 0.02 |
| 27 | 127046 | 百润转债 | 6,377,647.07 | 0.02 |
| 28 | 110097 | 天润转债 | 6,328,130.63 | 0.02 |
| 29 | 123119 | 康泰转 2 | 6,321,894.90 | 0.02 |
| 30 | 118062 | 天淮转债 | 6,277,162.88 | 0.02 |
| 31 | 127082 | 亚科转债 | 6,183,380.88 | 0.02 |
| 32 | 113636 | 甬金转债 | 5,981,237.40 | 0.02 |
| 33 | 127064 | 杭氧转债 | 5,867,724.63 | 0.02 |
| 34 | 123104 | 卫宁转债 | 5,516,987.27 | 0.02 |
| 35 | 123194 | 百洋转债 | 5,362,430.65 | 0.02 |
| 36 | 113058 | 友发转债 | 5,276,558.40 | 0.02 |
| 37 | 127085 | 韵达转债 | 5,262,008.71 | 0.02 |
| 38 | 123178 | 花园转债 | 5,245,673.15 | 0.02 |
| 39 | 127031 | 洋丰转债 | 5,240,727.18 | 0.02 |
| 40 | 113042 | 上银转债 | 5,215,801.81 | 0.02 |
| 41 | 123165 | 回天转债 | 5,135,352.88 | 0.02 |
| 42 | 123113 | 仙乐转债 | 5,092,666.79 | 0.02 |
| 43 | 113048 | 晶科转债 | 5,069,438.10 | 0.02 |
| 44 | 123114 | 三角转债 | 5,001,722.65 | 0.02 |
| 45 | 113640 | 苏利转债 | 4,367,421.99 | 0.02 |
| 46 | 123133 | 佩蒂转债 | 4,273,767.91 | 0.02 |
| 47 | 111004 | 明新转债 | 4,116,498.92 | 0.02 |
| 48 | 111002 | 特纸转债 | 4,103,122.64 | 0.02 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 49 | 127095 | 广泰转债 | 3,970,787.55 | 0.02 |
| 50 | 111017 | 蓝天转债 | 3,964,054.35 | 0.02 |
| 51 | 113691 | 和邦转债 | 3,894,314.32 | 0.01 |
| 52 | 110086 | 精工转债 | 3,679,506.47 | 0.01 |
| 53 | 113631 | 皖天转债 | 3,626,228.27 | 0.01 |
| 54 | 113681 | 镇洋转债 | 3,470,786.73 | 0.01 |
| 55 | 127060 | 湘佳转债 | 3,407,623.46 | 0.01 |
| 56 | 123122 | 富瀚转债 | 3,391,748.65 | 0.01 |
| 57 | 127084 | 柳工转 2 | 3,303,272.90 | 0.01 |
| 58 | 127105 | 龙星转债 | 3,257,788.37 | 0.01 |
| 59 | 113643 | 风语转债 | 3,222,550.28 | 0.01 |
| 60 | 123091 | 长海转债 | 3,148,372.77 | 0.01 |
| 61 | 128142 | 新乳转债 | 3,004,938.69 | 0.01 |
| 62 | 113638 | 台 21 转债 | 2,996,971.92 | 0.01 |
| 63 | 127113 | 长高转债 | 2,850,229.82 | 0.01 |
| 64 | 127099 | 盛航转债 | 2,778,456.62 | 0.01 |
| 65 | 127061 | 美锦转债 | 2,737,765.27 | 0.01 |
| 66 | 123154 | 火星转债 | 2,440,970.04 | 0.01 |
| 67 | 127059 | 永东转 2 | 2,211,013.74 | 0.01 |
| 68 | 118035 | 国力转债 | 2,056,703.68 | 0.01 |
| 69 | 113692 | 保隆转债 | 1,999,157.35 | 0.01 |
| 70 | 118010 | 洁特转债 | 1,851,887.55 | 0.01 |
| 71 | 123171 | 共同转债 | 1,824,557.31 | 0.01 |
| 72 | 118052 | 浩瀚转债 | 1,773,166.71 | 0.01 |
| 73 | 113625 | 江山转债 | 1,747,364.55 | 0.01 |
| 74 | 123090 | 三诺转债 | 1,700,524.34 | 0.01 |
| 75 | 127044 | 蒙娜转债 | 1,550,623.54 | 0.01 |
| 76 | 113679 | 芯能转债 | 1,513,449.74 | 0.01 |
| 77 | 113650 | 博 22 转债 | 1,177,880.35 | 0.00 |
| 78 | 123199 | 山河转债 | 1,003,948.60 | 0.00 |
| 79 | 111003 | 聚合转债 | 974,760.44 | 0.00 |
| 80 | 113647 | 禾丰转债 | 805,637.91 | 0.00 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 81 | 113688 | 国检转债 | 733,185.45 | 0.00 |
| 82 | 113633 | 科沃转债 | 699,235.85 | 0.00 |
| 83 | 110090 | 爱迪转债 | 317,211.21 | 0.00 |
| 84 | 113648 | 巨星转债 | 297,937.21 | 0.00 |
| 85 | 123235 | 亿田转债 | 81,721.11 | 0.00 |
| 86 | 127069 | 小熊转债 | 69,302.18 | 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 | 富国宝利增强债券 A | 富国宝利增强债券 E |
| --- | --- | --- |
| 报告期期初基金份额总额 | 6,482,165,762.35 | 5,567,693,059.29 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,195,433,216.92 | 10,379,931,385.80 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1,535,178,910.34 | 6,026,349,686.42 |
| 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 | 8,142,420,068.93 | 9,921,274,758.67 |

# §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 | 10,000,000.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,000,000.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.06 |

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

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

# §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 | 10,000,000.00 | 0.06 | 10,000,000.00 | 0.06 | 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | — | — | — | — | — |
| 基金经理等人员 | — | — | — | — | — |
| 基金管理人股东 | — | — | — | — | — |
| 其他 | — | — | — | — | — |
| 合计 | 10,000,000.00 | 0.06 | 10,000,000.00 | 0.06 | 3 年 |

注：截至 2021 年 2 月 8 日，本基金的基金合同生效届满 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

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。

## 9.2 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七届十五次会议审议通过，李强先生自 2026 年 8 月 7 日起离任基金管理人首席信息官。具体可参见基金管理人于 2026 年 8 月 8 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》。

# §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宝利增强债券型发起式证券投资基金的文件

2、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金合同

3、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国宝利增强债券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

2026 年 10 月 27 日