

# 富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金

## 二〇二四年中期报告

2024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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024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，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录 .....	2
1.1	重要提示 .....	2
1.2	目录 .....	3
§2	基金简介 .....	6
2.1	基金基本情况 .....	6
2.2	基金产品说明 .....	6
2.3	基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4	信息披露方式 .....	7
2.5	其他相关资料 .....	7
§3	主要财务指标和基金净值表现 .....	8
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	8
3.2	基金净值表现 .....	9
§4	管理人报告 .....	12
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
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 .....	16
§5	托管人报告 .....	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	17
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	17
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	17
§6	中期财务报告（未经审计） .....	18
6.1	资产负债表 .....	18
6.2	利润表 .....	19
6.3	净资产变动表 .....	20
6.4	报表附注 .....	22
§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.....	55
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	56
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12	市场中性策略执行情况.....	57
7.13	投资组合报告附注.....	57
§8	基金份额持有人信息.....	59
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	59
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况.....	60
§9	开放式基金份额变动.....	61
§10	重大事件揭示.....	62
10.1	基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4	基金投资策略的改变.....	62
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	62
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8	其他重大事件.....	66
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	67
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.....	67
§12	备查文件目录.....	68



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金	
基金简称	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式	
基金主代码	001641	
基金运作方式	契约型，本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。	
基金合同生效日	2015年09月17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	
报告期末基金份额总额	73,573,169.52份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式A	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式C
下属分级基金的交易代码	001641	009149
报告期末下属分级基金的份额总额	53,196,184.53份	20,376,984.99份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的基础上，利用股指期货等金融工具对冲市场波动风险，力争为投资人实现较高的投资收益。
投资策略	本基金根据对市场的判断，采用“多空对冲”等投资策略，在控制基金资产的股票系统性风险暴露的前提下，实现基金资产的保值增值。在股票投资方面，本基金采取自下而上的方法，精选具备基本面健康、核心竞争力强、成长潜力大的投资标的，主动承担“自下而上”的股票选择风险，构建本基金的现货组合；在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。本基金的存托凭证投资策略、对冲策略、套利策略及其他投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中国人民银行公布的一年期银行定期存款基准利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，利用股指期货等金融工具对冲市场波动风险，相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。

### 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	中国建设银行股份有限公司

			司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	王小飞
	联系电话	021-20361818	021-60637103
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	95105686、4008880688	021-60637228	
传真	021-20361616	021-60635778	
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼	
邮政编码	200120	100033	
法定代表人	裴长江	张金良	

#### 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

#### 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) 富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年01月01日至2024年06月30日)
本期已实现收益	-2,946,224.26
本期利润	-1,268,913.39
加权平均基金份额本期利润	-0.0219
本期加权平均净值利润率	-1.79%
本期基金份额净值增长率	-1.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)
期末可供分配利润	4,663,006.29
期末可供分配基金份额利润	0.0877
期末基金资产净值	65,361,694.58
期末基金份额净值	1.229
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	22.90%

##### (2) 富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年01月01日至2024年06月30日)
本期已实现收益	-1,000,103.76
本期利润	-459,558.51
加权平均基金份额本期利润	-0.0224
本期加权平均净值利润率	-1.90%
本期基金份额净值增长率	-1.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)
期末可供分配利润	944,637.35
期末可供分配基金份额利润	0.0464
期末基金资产净值	24,199,056.50
期末基金份额净值	1.188
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-3.10%

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) 富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 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
过去一个月	0.82%	0.26%	0.37%	0.01%	0.45%	0.25%
过去三个月	1.82%	0.26%	1.12%	0.01%	0.70%	0.25%
过去六个月	-1.44%	0.40%	2.24%	0.02%	-3.68%	0.38%
过去一年	-2.07%	0.30%	4.51%	0.01%	-6.58%	0.29%
过去三年	-8.49%	0.31%	13.51%	0.01%	-22.00%	0.30%
自基金合同生效起至今	22.90%	0.30%	39.58%	0.01%	-16.68%	0.29%

##### (2) 富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 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
过去一个月	0.76%	0.25%	0.37%	0.01%	0.39%	0.24%
过去三个月	1.63%	0.26%	1.12%	0.01%	0.51%	0.25%
过去六个月	-1.82%	0.40%	2.24%	0.02%	-4.06%	0.38%
过去一年	-2.86%	0.30%	4.51%	0.01%	-7.37%	0.29%
过去三年	-10.68%	0.30%	13.51%	0.01%	-24.19%	0.29%
自基金分级生效日起至今	-3.10%	0.34%	19.22%	0.01%	-22.32%	0.33%

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) 自基金合同生效以来富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A 基金累计

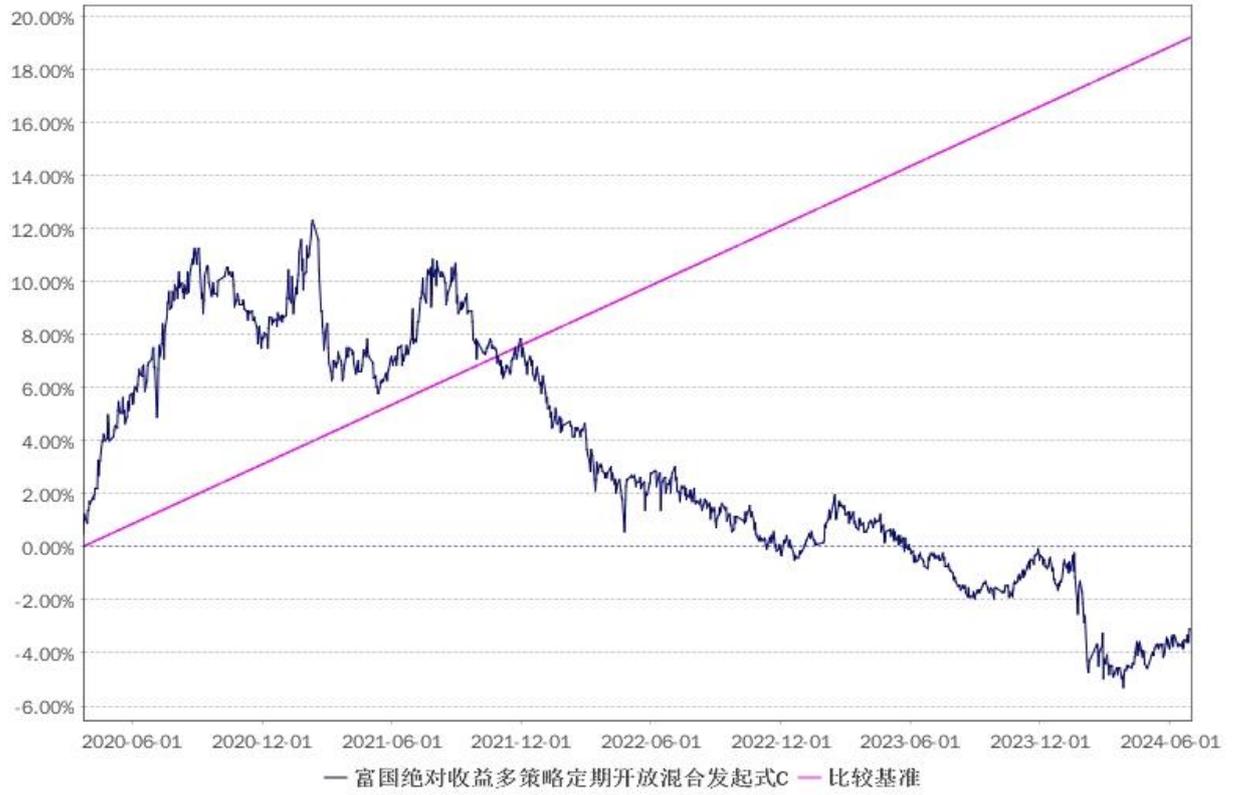
### 净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2024年6月30日。

2、本基金于2015年9月17日成立，建仓期6个月，从2015年9月17日起至2016年3月16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绝对收益多策略定期开放混合发起式C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



注：1、截止日期为2024年6月30日。

2、本基金自2020年3月23日起增加C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：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 2024 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 350 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		
于鹏	本基金现任基金经理	2015-11-26	—	16	博士，曾任 HSBC BANK PLC（汇丰银行）固定收益证券策略分析师，中国国际金融（香港）有限公司高级固定收益证券策略分析师，Millennium Capital Partners

					LLP（英国千禧资本）固定收益策略分析师；自2013年4月加入富国基金管理有限公司，历任固定收益投资经理、权益基金经理；现任富国基金权益投资部权益投资总监助理兼高级权益基金经理。自2015年11月起任富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理；自2017年11月起任富国研究量化精选混合型证券投资基金基金经理；自2022年07月起任富国中证500基本面精选股票型发起式证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的涵义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、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绝对收益多策略定期开放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》、《富国绝对收益多策略定期开放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 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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现5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。

#### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

##### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

在报告期内，国内市场整体流动性承压，伴随着雪球等事件冲击，融资买入收缩比较明显，北上净买入也体现前高后低特征。报告期内二月初微盘股调整对本基金净值冲击比较大，一定程度多头暴露形成负贡献。

国内权益市场在报告期内经历比较显著的流动性收缩，市场交易量和融资规模都有超预期流失。市场风格变化也在极端微观结构下比较激进，整体上中小市值个股压力比较大。在风格激进演绎下，本基金在报告期内没有获得相应超额收

益和绝对收益。

本基金主要选择沪深 300 合约和中证 500 合约进行对冲。围绕不同对冲标的，本基金通过跟踪误差管理构建优选个股组合。

和以往报告期比较，股指期货基差环境在这个季度大幅改善，例如上证 50 和沪深 300 合约整体维持温和升水环境，这有利于市场中性产品运作。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值 A 级为 1.229 元，C 级为 1.188 元；份额累计净值 A 级为 1.229 元，C 级为 1.188 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为-1.44%，C 级为-1.82%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 2.24%，C 级为 2.24%。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

A 股市场在报告期内呈现与以往不一样的特征。相对而言，以高盈利和高成长为代表的质量特征，开始体现超额收益。这和本基金的选股策略相一致，在选股维度我们注重行业内优质个股筛选，更加关注标的基本面信息。从长期来看，基本面扎实的成长个股会为组合贡献利润和业绩驱动的超额收益。

国内权益市场正在经历结构性改变，国九条的推出促进上市公司以“提质增效重回报”为目标的措施。这有利于具备业绩质量优先，成长稳定性优异相关标的输出相对基准的收益。这与本基金个股筛选策略吻合。

在组合管理过程中，本基金会应用跟踪误差管理等风险管理工具，提高组合整体风险收益比。本基金也在报告期内注重个股成长性和估值等特征的匹配度。

#### **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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 6 中期财务报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2024年06月 30日	上年度末 2023年12月31 日
<b>资产：</b>		
货币资金	7,172,586.56	7,875,351.49
结算备付金	11,738,933.78	6,110,214.48
存出保证金	6,081,631.71	8,399,861.48
交易性金融资产	58,867,285.84	80,126,617.58
其中：股票投资	58,867,285.84	80,118,617.05
基金投资	—	—
债券投资	—	8,000.53
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	8,000,000.00	—
应收清算款	—	—
应收股利	—	—
应收申购款	2,131.99	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	91,862,569.88	102,512,045.03
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末</b> 2024年06月 30日	<b>上年度末</b> 2023年12月31 日
<b>负债：</b>		
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	998,351.82	—
应付赎回款	936,008.02	—
应付管理人报酬	74,728.20	92,607.86
应付托管费	14,945.64	18,521.57
应付销售服务费	15,847.52	19,786.01
应付投资顾问费	—	—
应交税费	—	35,519.43

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	261,937.60	376,807.90
负债合计	2,301,818.80	543,242.77
<b>净资产：</b>		
实收基金	73,573,169.52	82,400,349.52
其他综合收益	—	—
未分配利润	15,987,581.56	19,568,452.74
净资产合计	89,560,751.08	101,968,802.26
负债和净资产总计	91,862,569.88	102,512,045.03

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.217 元，基金份额总额 73,573,169.52 份。其中：富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A 份额净值 1.229 元，份额总额 53,196,184.53 份；富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C 份额净值 1.188 元，份额总额 20,376,984.99 份。基金资产净值（暂估附加管理费前）89,560,751.08 元，暂估附加管理费金额 0.00 元，基金资产净值（暂估附加管理费后）89,560,751.08 元。

实际计提时的附加管理费金额可能会与此处暂估附加管理费金额有差异。其中，基金资产净值（暂估附加管理费后）=基金资产净值（暂估附加管理费前）-暂估附加管理费金额；暂估附加管理费为假设本基金于本报告期末按照当日的基金份额净值(计提附加管理费前)清算，根据基金份额持有人持有的基金份额(包括未到期份额)至该日止持有期间的收益情况估算的附加管理费。该金额是各基金份额持有人的暂估附加管理费的合计，各基金份额持有人实际应承担的附加管理费金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认。

## 6.2 利润表

会计主体：富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	-962,584.09	1,274,069.02
1.利息收入	147,341.90	78,533.42
其中：存款利息收入	83,483.41	78,533.42
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	63,858.49	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	-3,333,789.77	1,018,482.37
其中：股票投资收益	-5,270,553.40	2,767,829.99
基金投资收益	—	—
债券投资收益	2,304.90	38,938.24
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	995,469.70	-2,784,030.64
股利收益	938,989.03	995,744.78
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	—	—
其他投资收益	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,217,856.12	176,851.13
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6,007.66	202.10
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>765,887.81</b>	<b>998,562.23</b>
1. 管理人报酬	472,600.74	622,445.38
2. 托管费	94,520.18	155,611.40
3. 销售服务费	96,429.70	125,161.21
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	16,991.28	0.03
8. 其他费用	85,345.91	95,344.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-1,728,471.90</b>	<b>275,506.79</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-1,728,471.90</b>	<b>275,506.79</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>	<b>—</b>	<b>—</b>
<b>六、综合收益总额</b>	<b>-1,728,471.90</b>	<b>275,506.79</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2024年01月01日至2024年06月30日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、上期期末净资产	82,400,349.52	19,568,452.74	101,968,802.26
二、本期期初净资产	82,400,349.52	19,568,452.74	101,968,802.26

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,827,180.00	-3,580,871.18	-12,408,051.18
（一）、综合收益总额	—	-1,728,471.90	-1,728,471.90
（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）	-8,827,180.00	-1,852,399.28	-10,679,579.28
其中：1.基金申购款	29,668.64	6,147.36	35,816.00
2.基金赎回款	-8,856,848.64	-1,858,546.64	-10,715,395.28
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—
（四）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	73,573,169.52	15,987,581.56	89,560,751.08
项目	上年度可比期间 (2023年01月01日至2023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	99,828,359.91	24,357,706.31	124,186,066.22
二、本期期初净资产	99,828,359.91	24,357,706.31	124,186,066.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,117,615.84	-468,555.27	-3,586,171.11
（一）、综合收益总额	—	275,506.79	275,506.79
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-3,117,615.84	-744,062.06	-3,861,677.90
其中：1.基金申购款	4,287,247.13	1,139,166.02	5,426,413.15
2.基金赎回款	-7,404,862.97	-1,883,228.08	-9,288,091.05
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—
（四）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	96,710,744.07	23,889,151.04	120,599,895.11

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  
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

富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金（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[2015]425号文《关于准予富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2015年9月17日生效，首次设立募集规模为465,664,314.43份基金份额。根据基金管理人于2020年3月19日发布的《关于富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》，自2020年3月23日起，本基金增加C类份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、股指期货、权证、债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，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：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%-120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票及存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类空头工具价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票及存托凭证市值、买入股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类多头工具价值的合计值。

开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%。其中，有价证券指

股票、存托凭证、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。

开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的一年期银行定期存款基准利率（税后）+3%（如遇中国人民银行就该等基准利率进行调整则作相应调整）。

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 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；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## 2 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投

资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

### 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费附加的单位外）及地方教育费附加。

### 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；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。

#### 6.4.7 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 (2024年06月30日)
活期存款	7,172,586.56
等于：本金	7,171,976.49
加：应计利息	610.07
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	7,172,586.56

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 (2024年06月30日)
----	-------------------

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	61,100,967.62	—	58,867,285.84	— 2,233,681.78
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	61,100,967.62	—	58,867,285.84	— 2,233,681.78

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	-53,402,680.35	—	—	—
股指期货	-53,402,680.35	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	-53,402,680.35	—	—	—

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2409	IC2409	-1.00	— 975,040.00	31,560.00
IF2407	IF2407	-7.00	7,217,700. 00	285,705.00
IC2407	IC2407	-43.00	— 42,291,360. .00	2,601,315.35
合计				2,918,580.35

减：可抵销期货暂收款				2,918,580.35
净额				—

#### 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（2024年06月30日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,000,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	8,000,000.00	—

##### 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（2024年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	8.33
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	162,520.15
其中：交易所市场	162,520.15
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	50,000.00
预提审计费	49,409.12
合计	261,937.60

#### 6.4.7.7 实收基金

富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A：

金额单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	61,836,276.02	61,836,276.02
本期申购	27,954.84	27,954.84
本期赎回（以“-”号填列）	-8,668,046.33	-8,668,046.33
本期末	53,196,184.53	53,196,184.53

富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C：

金额单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,564,073.50	20,564,073.50
本期申购	1,713.80	1,713.80
本期赎回（以“-”号填列）	-188,802.31	-188,802.31
本期末	20,376,984.99	20,376,984.99

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

富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 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	8,212,301.93	7,041,723.81	15,254,025.74
本期期初	8,212,301.93	7,041,723.81	15,254,025.74
本期利润	2,946,224.26	1,677,310.87	-1,268,913.39
本期基金份额交易产生的变动数	-603,071.38	1,216,530.92	-1,819,602.30
其中：基金申购款	1,917.90	3,943.26	5,861.16
基金赎回款	-604,989.28	1,220,474.18	-1,825,463.46
本期已分配利润	—	—	—
本期末	4,663,006.29	7,502,503.76	12,165,510.05

富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 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	1,951,257.82	2,363,169.18	4,314,427.00
本期期初	1,951,257.82	2,363,169.18	4,314,427.00
本期利润	1,000,103.76	540,545.25	-459,558.51
本期基金份额交易产生的变动数	-6,516.71	-26,280.27	-32,796.98
其中：基金申购款	47.54	238.66	286.20
基金赎回款	-6,564.25	-26,518.93	-33,083.18
本期已分配利润	—	—	—
本期末	944,637.35	2,877,434.16	3,822,071.51

#### 6.4.7.9存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
活期存款利息收入	19,814.05
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	63,507.70
其他	161.66
合计	83,483.41

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出股票成交总额	300,985,684.95
减：卖出股票成本总额	305,636,989.39
减：交易费用	619,248.96
买卖股票差价收入	-5,270,553.40

#### 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（2024年01月01日至2024年06月30日）
债券投资收益——利息收入	4.20
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,300.70
合计	2,304.90

##### 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（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,305.84
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,000.00
减：应计利息总额	4.73
减：交易费用	0.41
买卖债券差价收入	2,300.70

#### 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

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
股指期货投资收益	995,469.70

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
股票投资产生的股利收益	938,989.03
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	938,989.03

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
1. 交易性金融资产	-538,527.66
股票投资	-538,527.66
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	2,756,383.78
权证投资	—
股指期货	2,756,383.78
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	2,217,856.12

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
基金赎回费收入	5,988.61
基金转换费收入	19.05
合计	6,007.66

#### 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（2024年01月01日至2024年06月30日）
审计费用	16,409.12
信息披露费	50,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	335.00
债券账户维护费	18,000.00
其他	601.79
合计	85,345.91

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023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（%）
海通证券	21,282,182.17	3.63	57,153,358.08	11.51
申万宏源	19,020,489.17	3.25	52,531,868.44	10.58

#### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023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（%）
申万宏源	—	—	17,406.15	8.88

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
海通证券	26,000,000.00	4.72	—	—
申万宏源	34,000,000.00	6.17	—	—

#### 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（2024年01月01日至2024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（%）
海通证券	15,661.19	3.63	6,806.25	4.19

申万宏源	13,997.27	3.25	5,789.72	3.56
关联方名称	上年度可比期间（2023年01月01日至2023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（%）
海通证券	41,223.64	11.45	4,084.21	2.40
申万宏源	37,891.13	10.53	13,924.19	8.19

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

2、自2024年7月1日起，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 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（2024年01月01日至2024年06月30日）	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	472,600.74	622,445.38
其中：支付销售机构的客户维护费	177,759.54	229,851.37
应支付基金管理人的净管理费	294,841.20	392,594.01

注：本基金管理人的管理费为基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之和。其中，基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费计提方法、计提标准和支付方式如下：

（1）本基金的基本管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金基本管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

(2) 附加管理费是在每一提取评价日（提取评价日为每次基金封闭期的最后一个工作日）计算并计提。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	94,520.18	155,611.40

注：2023年7月10日前，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提，自2023年7月10日起，基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 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（2024年01月01日至2024年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	合计
富国基金管理有限公司	—	94.37	94.37
合计	—	94.37	94.37

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（2023年01月01日至2023年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	合计

富国基金管理有限公司	—	18,167.72	18,167.72
合计	—	18,167.72	18,167.72

注：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将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.80% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，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

份额单位：份

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式A	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式C	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式A	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式C
基金合同生效日（2015年09月17日）持有的基金份额	10,007,200.72	—	10,007,200.72	—
期初持有的基金份额	—	—	—	—
期间申购/买入总份额	—	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	—	—	—

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023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
中国建设银行股份有限公司	7,172,586.56	19,814.05	9,376,959.39	9,809.72

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

#### **6.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### **6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券**

##### **6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

注：截至本报告期末 2024 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 2024 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（2024 年 06 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
AAA	—	—
AAA 以下	—	8,000.53
未评级	—	—
合计	—	8,000.53

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的信用债。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。

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

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### **6.4.13.4 市场风险**

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

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

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

###### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

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

单位：人民币元

本期末（2024年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	7,172,586.56	—	—	—	—	—	7,172,586.56
结算备付金	11,738,933.78	—	—	—	—	—	11,738,933.78
存出保证金	23,539.71	—	—	—	—	6,058,092.00	6,081,631.71
交易性金融资产	—	—	—	—	—	58,867,285.84	58,867,285.84
买入返售金融资产	8,000,000.00	—	—	—	—	—	8,000,000.00
应收申购款	—	—	—	—	—	2,131.99	2,131.99
资产总计	26,935,060.05	—	—	—	—	64,927,509.83	91,862,569.88
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	998,351.82	998,351.82
应付赎回款	—	—	—	—	—	936,008.02	936,008.02
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	74,728.20	74,728.20
应付托管费	—	—	—	—	—	14,945.64	14,945.64
应付销售服务费	—	—	—	—	—	15,847.52	15,847.52
其他负债	—	—	—	—	—	261,937.60	261,937.60
负债总计	—	—	—	—	—	2,301,818.80	2,301,818.80
利率敏感度缺口	26,935,060.05	—	—	—	—	62,625,691.03	89,560,751.08
上年度末（2023年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	7,875,351.49	—	—	—	—	—	7,875,351.49

结算备付金	6,110,214.48	—	—	—	—	—	6,110,214.48
存出保证金	17,921.48	—	—	—	—	8,381,940.00	8,399,861.48
交易性金融资产	—	—	8,000.53	—	—	80,118,617.05	80,126,617.58
资产总计	14,003,487.45	—	8,000.53	—	—	88,500,557.05	102,512,045.03
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	92,607.86	92,607.86
应付托管费	—	—	—	—	—	18,521.57	18,521.57
应付销售服务费	—	—	—	—	—	19,786.01	19,786.01
应交税费	—	—	—	—	—	35,519.43	35,519.43
其他负债	—	—	—	—	—	376,807.90	376,807.90
负债总计	—	—	—	—	—	543,242.77	543,242.77
利率敏感度缺口	14,003,487.45	—	8,000.53	—	—	87,957,314.28	101,968,802.26

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、权证、债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，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相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类空头工具价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类多头工具价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2024 年 06 月 30 日）		上年度末（2023 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	58,867,285.84	65.73	80,118,617.05	78.57
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	8,000.53	0.01
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	58,867,285.84	65.73	80,126,617.58	78.58

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下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，市场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。

假设	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	相关风险变量的变动	本期末（2024 年 06 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
分析	1. 市场基准增加 1%	133,458.51	88,594.26
	2. 市场基准减少 1%	-133,458.51	-88,594.26

## 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 (2024年06月30日)	上年度末 (2023年12月31日)
第一层次	58,867,285.84	80,118,617.05
第二层次	—	8,000.53
第三层次	—	—
合计	58,867,285.84	80,126,617.58

#### 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业务等情况，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	58,867,285.84	64.08
	其中：股票	58,867,285.84	64.08
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	8,000,000.00	8.71
	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	18,911,520.34	20.59
8	其他各项资产	6,083,763.70	6.62
9	合计	91,862,569.88	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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	96,173.00	0.11
B	采矿业	3,267,467.00	3.65
C	制造业	38,491,575.26	42.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,719,538.00	3.04
E	建筑业	531,669.00	0.59
F	批发和零售业	440,062.80	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	1,752,166.00	1.96
H	住宿和餐饮业	410,020.00	0.46
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,345,456.12	4.85
J	金融业	5,284,809.38	5.90
K	房地产业	723,079.00	0.81
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	24,340.28	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	151,065.00	0.17
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	398,953.00	0.45
S	综合	230,912.00	0.26
	合计	58,867,285.84	65.73

### 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	601058	赛轮轮胎	52,400	733,600.00	0.82
2	603228	景旺电子	23,000	731,400.00	0.82
3	002138	顺络电子	26,400	724,944.00	0.81
4	600066	宇通客车	28,000	722,400.00	0.81
5	002128	电投能源	32,900	694,190.00	0.78
6	002340	格林美	107,300	683,501.00	0.76
7	300394	天孚通信	7,580	670,223.60	0.75
8	002273	水晶光电	38,600	655,428.00	0.73
9	600988	赤峰黄金	39,200	640,528.00	0.72
10	000400	许继电气	18,500	636,585.00	0.71
11	601231	环旭电子	39,600	635,580.00	0.71
12	002532	天山铝业	78,300	635,013.00	0.71
13	000738	航发控制	31,500	632,205.00	0.71
14	000830	鲁西化工	53,400	618,906.00	0.69
15	601000	唐山港	127,900	601,130.00	0.67
16	300207	欣旺达	39,600	600,732.00	0.67
17	688099	晶晨股份	9,986	592,369.52	0.66
18	600642	申能股份	67,000	591,610.00	0.66
19	601108	财通证券	88,100	582,341.00	0.65
20	300502	新易盛	5,500	580,525.00	0.65
21	600282	南钢股份	115,400	574,692.00	0.64
22	002008	大族激光	27,600	574,080.00	0.64
23	000703	恒逸石化	79,400	562,946.00	0.63
24	601717	郑煤机	38,000	562,400.00	0.63
25	600985	淮北矿业	33,500	560,790.00	0.63
26	600529	山东药玻	22,100	560,014.00	0.63
27	002155	湖南黄金	30,900	559,290.00	0.62
28	688525	佰维存储	8,700	558,105.00	0.62
29	688188	柏楚电子	3,000	553,650.00	0.62
30	300017	网宿科技	70,000	553,000.00	0.62
31	300677	英科医疗	20,600	552,286.00	0.62
32	600038	中直股份	13,400	550,874.00	0.62

33	600521	华海药业	31,900	543,895.00	0.61
34	002444	巨星科技	22,000	543,400.00	0.61
35	000960	锡业股份	34,800	539,052.00	0.60
36	601198	东兴证券	67,200	534,912.00	0.60
37	000598	兴蓉环境	70,900	533,168.00	0.60
38	000883	湖北能源	88,300	530,683.00	0.59
39	600820	隧道股份	80,800	527,624.00	0.59
40	002152	广电运通	50,400	527,184.00	0.59
41	600369	西南证券	147,000	526,260.00	0.59
42	300529	健帆生物	19,300	525,153.00	0.59
43	002958	青农商行	192,400	515,632.00	0.58
44	600862	中航高科	27,400	514,572.00	0.57
45	601966	玲珑轮胎	27,900	512,523.00	0.57
46	002984	森麒麟	21,200	510,708.00	0.57
47	300001	特锐德	25,300	509,036.00	0.57
48	300253	卫宁健康	84,000	495,600.00	0.55
49	002028	思源电气	7,400	495,060.00	0.55
50	603298	杭叉集团	25,100	492,964.00	0.55
51	600901	江苏金租	97,200	490,860.00	0.55
52	000887	中鼎股份	39,900	488,376.00	0.55
53	000997	新大陆	34,900	485,459.00	0.54
54	601567	三星医疗	13,800	483,000.00	0.54
55	600299	安迪苏	49,700	482,090.00	0.54
56	000563	陕国投A	174,100	478,775.00	0.53
57	002019	亿帆医药	38,700	478,332.00	0.53
58	600737	中粮糖业	49,700	476,623.00	0.53
59	001872	招商港口	24,700	475,475.00	0.53
60	600399	抚顺特钢	84,400	475,172.00	0.53
61	601128	常熟银行	62,270	471,383.90	0.53
62	002078	太阳纸业	33,500	467,325.00	0.52
63	601636	旗滨集团	72,200	465,690.00	0.52
64	300390	天华新能	27,000	463,860.00	0.52
65	600566	济川药业	14,600	462,966.00	0.52
66	600582	天地科技	66,700	459,563.00	0.51
67	601666	平煤股份	40,900	458,080.00	0.51
68	002557	洽洽食品	16,200	456,678.00	0.51
69	600967	内蒙一机	62,900	452,880.00	0.51
70	603650	彤程新材	15,200	449,160.00	0.50
71	600519	贵州茅台	306	449,021.34	0.50
72	688029	南微医学	7,200	443,232.00	0.49
73	600315	上海家化	24,800	440,944.00	0.49

74	688281	华秦科技	5,240	436,596.80	0.49
75	600612	老凤祥	7,300	424,787.00	0.47
76	603317	天味食品	36,660	418,290.60	0.47
77	600258	首旅酒店	33,200	410,020.00	0.46
78	688276	百克生物	14,445	409,804.65	0.46
79	000921	海信家电	12,700	409,448.00	0.46
80	688819	天能股份	17,100	408,006.00	0.46
81	002563	森马服饰	69,500	403,795.00	0.45
82	300002	神州泰岳	49,400	401,128.00	0.45
83	600707	彩虹股份	58,700	399,747.00	0.45
84	688516	奥特维	9,440	394,686.40	0.44
85	002558	巨人网络	41,000	387,040.00	0.43
86	300251	光线传媒	45,300	380,973.00	0.43
87	000728	国元证券	60,400	366,024.00	0.41
88	601665	齐鲁银行	66,400	326,024.00	0.36
89	600325	华发股份	50,000	325,000.00	0.36
90	600872	中炬高新	13,500	306,315.00	0.34
91	688169	石头科技	780	306,228.00	0.34
92	000423	东阿阿胶	4,800	300,480.00	0.34
93	600909	华安证券	66,800	281,228.00	0.31
94	300750	宁德时代	1,515	272,745.45	0.30
95	601728	中国电信	42,600	261,990.00	0.29
96	600535	天士力	20,500	257,890.00	0.29
97	002244	滨江集团	35,200	255,552.00	0.29
98	603087	甘李药业	5,500	254,760.00	0.28
99	601615	明阳智能	26,600	251,104.00	0.28
100	689009	九号公司	6,500	239,265.00	0.27
101	603893	瑞芯微	4,000	236,680.00	0.26
102	600483	福能股份	20,200	235,532.00	0.26
103	600900	长江电力	8,000	231,360.00	0.26
104	600673	东阳光	32,800	230,912.00	0.26
105	000725	京东方A	53,000	216,770.00	0.24
106	002608	江苏国信	26,600	206,150.00	0.23
107	600699	均胜电子	13,800	204,516.00	0.23
108	603883	老百姓	10,530	193,330.80	0.22
109	002867	周大生	13,300	173,698.00	0.19
110	002517	恺英网络	18,100	172,855.00	0.19
111	603979	金诚信	3,400	171,802.00	0.19
112	601989	中国重工	33,800	166,634.00	0.19
113	601816	京沪高铁	30,700	164,859.00	0.18
114	600941	中国移动	1,500	161,250.00	0.18

115	000513	丽珠集团	4,100	152,561.00	0.17
116	002415	海康威视	4,861	150,253.51	0.17
117	603225	新凤鸣	9,618	149,944.62	0.17
118	600406	国电南瑞	5,860	146,265.60	0.16
119	000060	中金岭南	32,700	138,648.00	0.15
120	688981	中芯国际	3,000	138,300.00	0.15
121	600999	招商证券	9,600	133,536.00	0.15
122	601006	大秦铁路	18,500	132,460.00	0.15
123	600886	国投电力	7,200	131,328.00	0.15
124	600060	海信视像	5,300	131,122.00	0.15
125	600795	国电电力	21,700	129,983.00	0.15
126	603501	韦尔股份	1,300	129,181.00	0.14
127	600989	宝丰能源	7,300	126,509.00	0.14
128	300433	蓝思科技	6,900	125,925.00	0.14
129	002241	歌尔股份	6,400	124,864.00	0.14
130	600584	长电科技	3,800	120,498.00	0.13
131	600019	宝钢股份	18,100	120,365.00	0.13
132	600029	南方航空	20,000	117,800.00	0.13
133	600219	南山铝业	30,800	117,348.00	0.13
134	600760	中航沈飞	2,900	116,290.00	0.13
135	600025	华能水电	10,600	114,268.00	0.13
136	002179	中航光电	3,000	114,150.00	0.13
137	600018	上港集团	19,700	113,866.00	0.13
138	300408	三环集团	3,900	113,841.00	0.13
139	600875	东方电气	6,100	112,545.00	0.13
140	600183	生益科技	5,300	111,618.00	0.12
141	600583	海油工程	18,700	110,517.00	0.12
142	600372	中航机载	9,200	110,124.00	0.12
143	002423	中粮资本	14,100	105,609.00	0.12
144	000776	广发证券	8,600	104,662.00	0.12
145	000009	中国宝安	12,100	104,060.00	0.12
146	000636	风华高科	7,700	100,562.00	0.11
147	002139	拓邦股份	9,400	99,828.00	0.11
148	603658	安图生物	2,100	96,747.00	0.11
149	600598	北大荒	7,700	96,173.00	0.11
150	688567	孚能科技	9,200	88,320.00	0.10
151	600323	瀚蓝环境	4,100	85,690.00	0.10
152	600050	中国联通	18,000	84,600.00	0.09
153	002635	安洁科技	4,900	75,656.00	0.08
154	002745	木林森	8,900	71,734.00	0.08
155	600377	宁沪高速	5,400	68,040.00	0.08

156	603379	三美股份	1,700	66,538.00	0.07
157	000333	美的集团	1,000	64,500.00	0.07
158	300274	阳光电源	1,000	62,030.00	0.07
159	603328	依顿电子	7,400	58,164.00	0.06
160	600015	华夏银行	8,900	56,960.00	0.06
161	600663	陆家嘴	6,200	54,684.00	0.06
162	601311	骆驼股份	6,400	51,328.00	0.06
163	000858	五粮液	400	51,216.00	0.06
164	603050	科林电气	2,100	50,946.00	0.06
165	603160	汇顶科技	700	48,125.00	0.05
166	600276	恒瑞医药	1,200	46,152.00	0.05
167	300708	聚灿光电	5,100	45,900.00	0.05
168	601318	中国平安	1,093	45,206.48	0.05
169	601827	三峰环境	5,200	44,148.00	0.05
170	600028	中国石化	6,600	41,712.00	0.05
171	603056	德邦股份	3,100	40,610.00	0.05
172	603738	泰晶科技	2,900	39,556.00	0.04
173	600007	中国国贸	1,800	39,528.00	0.04
174	002120	韵达股份	4,900	37,926.00	0.04
175	600016	民生银行	9,900	37,521.00	0.04
176	000338	潍柴动力	2,300	37,352.00	0.04
177	601169	北京银行	6,300	36,792.00	0.04
178	300124	汇川技术	700	35,910.00	0.04
179	605198	安德利	1,300	34,320.00	0.04
180	300902	国安达	1,700	33,779.00	0.04
181	688036	传音控股	420	32,146.80	0.04
182	002371	北方华创	100	31,989.00	0.04
183	002017	东信和平	3,700	30,821.00	0.03
184	301391	卡莱特	700	30,646.00	0.03
185	600510	黑牡丹	8,100	30,132.00	0.03
186	601916	浙商银行	10,900	30,084.00	0.03
187	300559	佳发教育	3,100	29,667.00	0.03
188	688236	春立医疗	2,000	28,360.00	0.03
189	601319	中国人保	5,400	27,810.00	0.03
190	600765	中航重机	1,300	26,520.00	0.03
191	002950	奥美医疗	4,000	26,400.00	0.03
192	600215	派斯林	3,600	25,668.00	0.03
193	002441	众业达	3,300	25,014.00	0.03
194	001203	大中矿业	2,600	24,986.00	0.03
195	300690	双一科技	1,300	24,427.00	0.03
196	601865	福莱特	1,200	24,120.00	0.03

197	600036	招商银行	700	23,933.00	0.03
198	688639	华恒生物	300	22,917.00	0.03
199	000920	沃顿科技	3,000	21,990.00	0.02
200	600609	金杯汽车	6,300	21,861.00	0.02
201	600809	山西汾酒	100	21,088.00	0.02
202	603987	康德莱	3,400	20,774.00	0.02
203	603758	秦安股份	2,700	20,520.00	0.02
204	603289	泰瑞机器	2,300	20,516.00	0.02
205	603017	中衡设计	2,100	18,606.00	0.02
206	002462	嘉事堂	1,700	18,598.00	0.02
207	001212	中旗新材	900	18,270.00	0.02
208	000014	沙河股份	1,900	18,183.00	0.02
209	603380	易德龙	900	18,072.00	0.02
210	002905	金逸影视	2,900	17,980.00	0.02
211	002159	三特索道	1,400	17,962.00	0.02
212	300560	中富通	1,600	17,312.00	0.02
213	600386	北巴传媒	6,200	17,298.00	0.02
214	603811	诚意药业	2,500	15,625.00	0.02
215	603053	成都燃气	1,600	15,456.00	0.02
216	002203	海亮股份	1,900	15,162.00	0.02
217	600273	嘉化能源	2,000	14,280.00	0.02
218	301227	森鹰窗业	700	13,167.00	0.01
219	300519	新光药业	1,200	13,020.00	0.01
220	603949	雪龙集团	1,100	12,386.00	0.01
221	002498	汉缆股份	2,900	9,541.00	0.01
222	000661	长春高新	100	9,177.00	0.01
223	002833	弘亚数控	500	9,120.00	0.01
224	605118	力鼎光电	600	8,934.00	0.01
225	300809	华辰装备	400	8,104.00	0.01
226	002009	天奇股份	700	7,938.00	0.01
227	605056	咸亨国际	700	7,546.00	0.01
228	300430	诚益通	500	7,540.00	0.01
229	301261	恒工精密	200	7,414.00	0.01
230	002645	华宏科技	1,000	6,360.00	0.01
231	300354	东华测试	200	6,214.00	0.01
232	600201	生物股份	800	5,768.00	0.01
233	002779	中坚科技	200	5,668.00	0.01
234	002978	安宁股份	200	5,572.00	0.01
235	300953	震裕科技	100	5,420.00	0.01
236	603093	南华期货	600	5,196.00	0.01
237	301533	威马农机	200	5,138.00	0.01

238	301279	金道科技	200	4,876.00	0.01
239	688121	卓然股份	400	4,808.00	0.01
240	300997	欢乐家	400	4,728.00	0.01
241	300572	安车检测	400	4,648.00	0.01
242	000034	神州数码	200	4,578.00	0.01
243	300993	玉马遮阳	500	4,470.00	0.00
244	002849	威星智能	400	4,464.00	0.00
245	603173	福斯达	200	4,342.00	0.00
246	301289	国缆检测	100	4,337.00	0.00
247	002730	电光科技	600	4,224.00	0.00
248	688433	华曙高科	200	4,172.00	0.00
249	301398	星源卓镁	100	4,055.00	0.00
250	601611	中国核建	500	4,045.00	0.00
251	300952	恒辉安防	200	3,468.00	0.00
252	300250	初灵信息	300	3,270.00	0.00
253	300774	倍杰特	500	3,265.00	0.00
254	300539	横河精密	400	3,220.00	0.00
255	301161	唯万密封	200	3,106.00	0.00
256	300176	派生科技	700	3,087.00	0.00
257	601798	蓝科高新	600	2,970.00	0.00
258	300594	朗进科技	200	2,804.00	0.00
259	603029	天鹅股份	200	2,778.00	0.00
260	688501	青达环保	200	2,736.00	0.00
261	688310	迈得医疗	200	2,628.00	0.00
262	688533	上声电子	100	2,587.00	0.00
263	300553	集智股份	100	2,449.00	0.00
264	603112	华翔股份	200	2,102.00	0.00
265	000895	双汇发展	85	2,020.45	0.00
266	300515	三德科技	200	1,974.00	0.00
267	002050	三花智控	98	1,869.84	0.00
268	688375	国博电子	26	1,836.64	0.00
269	301273	瑞晨环保	100	1,557.00	0.00
270	300866	安克创新	20	1,424.20	0.00
271	688153	唯捷创芯	36	1,332.00	0.00
272	688105	诺唯赞	48	960.48	0.00
273	000651	格力电器	23	902.06	0.00
274	000157	中联重科	75	576.00	0.00
275	688315	诺禾致源	40	436.80	0.00
276	688389	普门科技	5	81.30	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	600887	伊利股份	1,990,712.00	1.95
2	601318	中国平安	1,785,703.00	1.75
3	601058	赛轮轮胎	1,670,915.00	1.64
4	601229	上海银行	1,599,278.00	1.57
5	600873	梅花生物	1,572,788.00	1.54
6	601728	中国电信	1,531,732.00	1.50
7	600529	山东药玻	1,523,137.00	1.49
8	002155	湖南黄金	1,496,111.00	1.47
9	600566	济川药业	1,419,177.00	1.39
10	002128	电投能源	1,325,232.00	1.30
11	000333	美的集团	1,319,625.00	1.29
12	600582	天地科技	1,298,436.00	1.27
13	601717	郑煤机	1,298,185.00	1.27
14	000157	中联重科	1,295,949.00	1.27
15	601668	中国建筑	1,294,248.00	1.27
16	002415	海康威视	1,271,157.00	1.25
17	601398	工商银行	1,253,455.00	1.23
18	002958	青农商行	1,178,815.00	1.16
19	000776	广发证券	1,146,732.00	1.12
20	600406	国电南瑞	1,127,670.00	1.11

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	600887	伊利股份	2,133,474.00	2.09
2	600519	贵州茅台	2,020,058.00	1.98
3	601728	中国电信	1,969,790.00	1.93
4	002027	分众传媒	1,929,690.00	1.89
5	601318	中国平安	1,898,198.00	1.86
6	002415	海康威视	1,874,442.00	1.84
7	601229	上海银行	1,821,930.00	1.79
8	002736	国信证券	1,753,895.00	1.72
9	600104	上汽集团	1,675,399.00	1.64
10	300750	宁德时代	1,654,204.00	1.62

11	000933	神火股份	1,627,414.00	1.60
12	600873	梅花生物	1,622,599.00	1.59
13	601668	中国建筑	1,613,917.00	1.58
14	601857	中国石油	1,587,921.00	1.56
15	000157	中联重科	1,548,403.00	1.52
16	600845	宝信软件	1,538,180.00	1.51
17	000651	格力电器	1,506,843.00	1.48
18	000725	京东方A	1,468,987.00	1.44
19	600219	南山铝业	1,399,583.00	1.37
20	600582	天地科技	1,355,673.00	1.33

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	284,924,185.84
卖出股票收入（成交）总额	300,985,684.95

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利

于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

## 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

本基金不允许投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 58,867,285.84 元，占基金资产净值的比例为 65.73%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 50,484,100.00 元，占基金资产净值的比例为 56.37%，空头合约市值占股票资产的比例为 85.76%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-4,275,083.70 元，公允价值变动损益为 2,217,856.12 元。

## 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

### 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	6,081,631.71
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	2,131.99
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,083,763.70

---

#### **7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### **7.13.5 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(%)
富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	7,213	7,375.04	2,239,465.10	4.21	50,956,719.43	95.79
富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	208	97,966.27	16,116,035.46	79.09	4,260,949.53	20.91
合计	7,421	9,914.19	18,355,500.56	24.95	55,217,668.96	75.05

### 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	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	64,600.30	0.1214
	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	8.93	0.0000
	合计	64,609.23	0.0878

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	0
	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 A	0

	富国绝对收益多策略定期开放混合发起式 C	0
	合计	0

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数 (份)	持有份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额总数 (份)	发起份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国绝对收益多策略 定期开放混合发起式 A	富国绝对收益多策略 定期开放混合发起式 C
基金合同生效日(2015年09月17日) 基金份额总额	465,664,314.43	—
报告期期初基金份额总额	61,836,276.02	20,564,073.50
本报告期基金总申购份额	27,954.84	1,713.80
减：本报告期基金总赎回份额	8,668,046.33	188,802.31
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	53,196,184.53	20,376,984.99

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	富国基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-02-02
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	—
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	督察长
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-02-02
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	—

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
渤海证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	3	36,055,455.20	6.15	26,533.06	6.15	—
东北证券	2	24,202,777.96	4.13	17,810.24	4.13	—
东财证券	2	31,996,455.95	5.46	23,546.59	5.46	—
方正证券	2	24,504,195.93	4.18	18,032.52	4.18	—
高盛中国	1	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—
广发证券	2	38,988,262.47	6.65	28,690.60	6.65	—
国海证券	2	54,427,421.78	9.29	40,053.56	9.29	—
国盛证券	2	119,506,654.10	20.40	87,948.03	20.40	—
国泰君安	2	11,394,669.88	1.94	8,385.35	1.94	—
国投证券	2	—	—	—	—	—
国信证券	2	19,436,086.36	3.32	14,302.80	3.32	—
海通证券	2	21,282,182.17	3.63	15,661.19	3.63	—
华泰证券	1	27,951,487.85	4.77	20,569.96	4.77	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	19,020,489.17	3.25	13,997.27	3.25	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	41,080,140.90	7.01	30,230.87	7.01	—
西南证券	2	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—
信达证券	2	13,710,544.30	2.34	10,090.06	2.34	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—

招商证券	1	9,683,916.00	1.65	7,126.77	1.65	—
中航证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	32,429,390.99	5.53	23,864.68	5.53	—
中泰证券	2	3,408,876.00	0.58	2,508.46	0.58	—
中信建投	1	14,000,645.04	2.39	10,303.31	2.39	—
中信证券	4	42,830,218.74	7.31	31,518.84	7.31	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金退租券商交易单元：德邦证券（012561）。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
渤海证券	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	33,000,000.00	5.99	—	—
东财证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	33,000,000.00	5.99	—	—
高盛中国	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	130,000,000.00	23.59	—	—
国海证券	—	—	41,000,000.00	7.44	—	—
国盛证券	—	—	62,000,000.00	11.25	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
国投证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	37,000,000.00	6.72	—	—
海通证券	—	—	26,000,000.00	4.72	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—

上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	34,000,000.00	6.17	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	10,305.84	100.00	40,000,000.00	7.26	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	30,000,000.00	5.44	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中航证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	51,000,000.00	9.26	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	34,000,000.00	6.17	—	—
中银证券	—	—	—	—	—	—

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金第 34 个开放期开放申购、赎回和转换业务的公告	规定披露媒介	2024 年 03 月 14 日
2	富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金第 35 个开放期开放申购、赎回和转换业务的公告	规定披露媒介	2024 年 06 月 21 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	2024-03-19 至 2024-06-30	16,116,035.46	—	—	16,116,035.46	21.90%

#### 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。

## § 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绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金的文件	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话:95105686、4008880688(全国统一,免长途话费)公司网址: <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。
2、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同		
3、富国绝对收益多策略定期开放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、富国绝对收益多策略定期开放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		