

# 富国丰利增强债券型发起式证券投资基金

## 二〇二五年中期报告

2025 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： 交通银行股份有限公司

送出日期： 2025 年 08 月 30 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 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	14
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	48

7.1	期末基金资产组合情况.....	48
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	49
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	70
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
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.....	72
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..	72
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..	72
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.....	72
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	72
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
7.12	投资组合报告附注.....	73
§ 8	基金份额持有人信息 .....	77
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
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.....	77
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况.....	77
§ 9	开放式基金份额变动 .....	79
§ 10	重大事件揭示.....	80
10.1	基金份额持有人大会决议.....	80
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.....	80
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	80
10.4	基金投资策略的改变.....	80
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	80
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.....	80
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	80
10.8	其他重大事件.....	83
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	84
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 .....	84
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	84
§ 12	备查文件目录.....	86



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国丰利增强债券型发起式证券投资基金	
基金简称	富国丰利增强债券	
基金主代码	004902	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 09 月 05 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	
报告期末基金份额总额	789,001,744.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国丰利增强债券 A	富国丰利增强债券 E
下属分级基金的交易代码	004902	022159
报告期末下属分级基金的份额总额	449,167,764.51 份	339,833,980.25 份

### 2.2 基金产品说明

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。本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*80%+中证 500 指数收益率*20%。
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。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	方圆
	联系电话	021-20361818	95559
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95559
传真		021-20361616	021-62701216
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	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188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	中国(上海)长宁区仙霞路18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		裴长江	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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 交通银行股份有限公司 中国(上海)长宁区仙霞路18号

## 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) 富国丰利增强债券 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	14,030,699.84
本期利润	17,518,396.63
加权平均基金份额本期利润	0.0267
本期加权平均净值利润率	2.09%
本期基金份额净值增长率	3.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	115,642,899.65
期末可供分配基金份额利润	0.2575
期末基金资产净值	584,602,569.92
期末基金份额净值	1.3015
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	36.49%

##### (2) 富国丰利增强债券 E

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	10,276,481.02
本期利润	12,312,039.91
加权平均基金份额本期利润	0.0328
本期加权平均净值利润率	2.57%
本期基金份额净值增长率	3.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	87,365,428.46
期末可供分配基金份额利润	0.2571
期末基金资产净值	442,134,870.29
期末基金份额净值	1.3010
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	11.74%

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) 富国丰利增强债券 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
过去一个月	1.74%	0.23%	1.11%	0.14%	0.63%	0.09%
过去三个月	1.95%	0.53%	1.17%	0.26%	0.78%	0.27%
过去六个月	3.01%	0.44%	0.73%	0.25%	2.28%	0.19%
过去一年	9.50%	0.54%	6.24%	0.32%	3.26%	0.22%
过去三年	6.97%	0.39%	4.99%	0.26%	1.98%	0.13%
自基金合同生效起至今	36.49%	0.34%	13.18%	0.27%	23.31%	0.07%

#### (2) 富国丰利增强债券 E

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	1.74%	0.23%	1.11%	0.14%	0.63%	0.09%
过去三个月	1.95%	0.53%	1.17%	0.26%	0.78%	0.27%
过去六个月	3.00%	0.44%	0.73%	0.25%	2.27%	0.19%
自基金分级生效日起至今	11.74%	0.57%	6.39%	0.34%	5.35%	0.23%

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丰利增强债券 A 基金累计净值增长率变动及其与

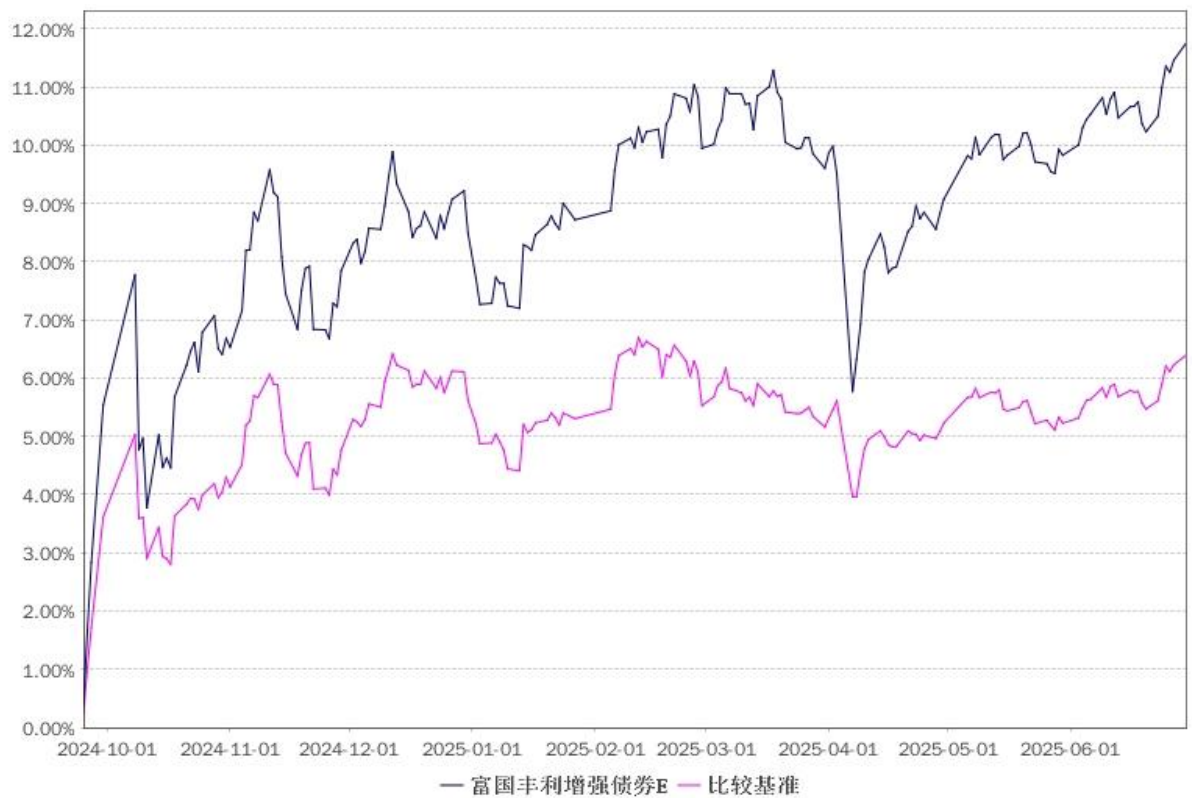
### 同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2017 年 9 月 5 日成立，建仓期 6 个月，从 2017 年 9 月 5 日起至 2018 年 3 月 4 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丰利增强债券 E 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 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2024 年 9 月 24 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。

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安（以下简称“存续公司”）承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持本公司股权亦归属于存续公司，即存续公司成为本公司的主要股东。根据 2025 年 4 月 4 日《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，存续公司正式更名为“国泰海通证券股份有限公司”。

截至 2025 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 391 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		
陈斯扬	本基金现任基金经理	2018-03-19	—	12	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；现任富国基金量化投资部债券投资总监助理兼定量基金经理。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；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丰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》、《富国丰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 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，出现 36 次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况，为投资组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平对待投资组合或利益输送等情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内市场经历了一轮快跌后的反转修复，风险资产普遍回到年内高点位置，驱动力一方面来自于全球关税事件冲击和随后的预期修复，另一方面也来自于国内自身的经济企稳改善和包括 AI 模型在内的科技领域进步。中国资产的估值折价逐渐被修复，市场信心得到进一步提振。

在策略方面，组合的权益仓位维持指数增强的配置，上半年市场风格从红利切换到科技，随后海外事件冲击再度引发了风格的反转，指增策略因此受到了一定的挑战，不过模型在克服这段波折后，整体超额收益还是稳健回升的。

组合的转债仓位继续运用择券模型，但挑战较大的还是整个转债市场估值逐渐走高的状况，一方面使得资产性价比显著不及去年四季度，一方面也使得择券的难度在提升。但整体而言，上半年转债资产的表现还是较为突出的，无论是权重银行板块还是数量占比较大的小市值风格，都贡献了不错的收益。

组合的纯债方面，继续在维持信用底仓配置的同时，择机参与了利率的交易。

上半年利率出现了一波较大的回调和震荡，使得去年以来的利率下行趋势有戛然而止的势头，组合依据模型上的变化，也及时调整了组合久期的暴露，使得上半年纯债整体上表现稳健。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金份额净值富国丰利增强债券 A 为 1.3015 元，富国丰利增强债券 E 为 1.301 元；份额累计净值富国丰利增强债券 A 为 1.3595 元，富国丰利增强债券 E 为 1.301 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国丰利增强债券 A 为 3.01%，富国丰利增强债券 E 为 3.00%；同期业绩比较基准收益率情况：富国丰利增强债券 A 为 0.73%，富国丰利增强债券 E 为 0.73%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前国内风险资产的修复更多还是以权益资产估值抬升的方式来实现的，盈利层面仍有待改善，不过货币和财政政策维持积极，政策在供给端推动反内卷，在需求端推动包括雅江水电站在内的重大基建项目，合力之下有望推动工业品价格的回升和企业盈利的改善，如果逻辑逐渐得到印证，市场的风险偏好仍有抬升的空间。

策略端，组合的权益仓位继续维持指数增强配置；转债或视估值水平的进一步动向调整仓位权重，后续高估值仍然是转债市场面临的最大挑战，也使得市场的脆弱性有所积累，不过若正股能延续趋势性的上行，估值也有可能会进入被动压缩的正向循环，但当前我们只能拭目以待；纯债仓位继续维持灵活的交易操作，目前利率水平在绝对低位，通胀水平又存在低位回升的潜在可能，对债券市场可能是较大的潜在威胁，因此组合久期有必要保持灵活的调整空间，以应对未来变化。

#### 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

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，基金托管人在富国丰利增强债券型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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，富国基金管理有限公司在富国丰利增强债券型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，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信息的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由富国基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富国丰利增强债券型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 中期财务报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：富国丰利增强债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
货币资金	391,350.17	102,186.81
结算备付金	18,638,806.41	11,993,132.68
存出保证金	214,520.29	152,154.13
交易性金融资产	1,189,156,724.86	1,228,088,601.18
其中：股票投资	204,187,451.75	233,464,736.49
基金投资	—	—
债券投资	984,969,273.11	994,623,864.69
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	9,900,000.00	17,797,944.52
应收清算款	32,445,398.11	9,450,025.15
应收股利	—	—
应收申购款	60,002,045.62	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	1,310,748,845.46	1,267,584,044.47
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	2025 年 06 月 30 日	2024 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	250,000,000.00	49,995,906.85
应付清算款	18,448,844.58	9,446,889.35
应付赎回款	14,040,105.24	29,522.86
应付管理人报酬	350,500.95	356,660.43
应付托管费	87,625.23	89,165.08
应付销售服务费	3,235.51	21,704.24
应付投资顾问费	—	—
应交税费	18,579.87	12,681.12
应付利润	—	—

递延所得税负债	—	—
其他负债	1,062,513.87	685,632.22
负债合计	284,011,405.25	60,638,162.15
<b>净资产：</b>		
实收基金	789,001,744.76	955,339,020.38
其他综合收益	—	—
未分配利润	237,735,695.45	251,606,861.94
净资产合计	1,026,737,440.21	1,206,945,882.32
负债和净资产总计	1,310,748,845.46	1,267,584,044.47

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3013 元，基金份额总额 789,001,744.76 份。其中：富国丰利增强债券 A 份额净值 1.3015 元，份额总额 449,167,764.51 份；富国丰利增强债券 E 份额净值 1.3010 元，份额总额 339,833,980.25 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国丰利增强债券型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)
<b>一、营业总收入</b>	34,333,604.73	8,209,388.73
1. 利息收入	347,669.51	758,359.20
其中：存款利息收入	115,685.30	391,621.36
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	231,984.21	366,737.84
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	28,407,660.50	-15,866,439.18
其中：股票投资收益	-997,938.96	-19,605,929.30
基金投资收益	—	—
债券投资收益	26,794,705.14	-696,277.26
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	2,610,894.32	4,435,767.38
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）	5,523,255.68	23,302,318.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	55,019.04	15,149.76
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>4,503,168.19</b>	<b>9,435,689.70</b>
1. 管理人报酬	2,612,338.22	4,222,144.07
2. 托管费	653,084.51	1,055,535.96
3. 销售服务费	36,814.83	—
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	1,078,420.72	4,015,659.21
其中：卖出回购金融资产支出	1,078,420.72	4,015,659.21
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	10,783.41	25,670.01
8. 其他费用	111,726.50	116,680.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>29,830,436.54</b>	<b>-1,226,300.97</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>29,830,436.54</b>	<b>-1,226,300.97</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>29,830,436.54</b>	<b>-1,226,300.97</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：富国丰利增强债券型发起式证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2025年01月01日至2025年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	955,339,020.38	251,606,861.94	1,206,945,882.32
二、本期期初净资产	955,339,020.38	251,606,861.94	1,206,945,882.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	166,337,275.62	13,871,166.49	180,208,442.11
（一）、综合收益总额	—	29,830,436.54	29,830,436.54
（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）	166,337,275.62	43,701,603.03	210,038,878.65
其中：1. 基金申购款	791,518,786.80	217,792,014.26	1,009,310,801.06
2. 基金赎回款	—	—	—

	957,856,062.42	261,493,617.29	1,219,349,679.71
(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	789,001,744.76	237,735,695.45	1,026,737,440.21
项目	上年度可比期间 (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	2,849,042,081.39	524,983,297.79	3,374,025,379.18
二、本期期初净资产	2,849,042,081.39	524,983,297.79	3,374,025,379.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,962,393,530.73	357,748,042.86	2,320,141,573.59
(一)、综合收益总额	—	-1,226,300.97	-1,226,300.97
(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)	1,962,393,530.73	356,521,741.89	2,318,915,272.62
其中:1.基金申购款	236,718,246.54	43,153,616.60	279,871,863.14
2.基金赎回款	2,199,111,777.27	399,675,358.49	2,598,787,135.76
(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	886,648,550.66	167,235,254.93	1,053,883,805.59

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

基金管理公司负责人

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

富国丰利增强债券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[2017]769号《关于准予富国丰利增强债券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募集，基金合同于2017年9月5日生效，首次设立募集规模为150,004,400.62份基金份额。根据基金管理人于2024年09月20日发布的《富国基金管理有限公司关于富国丰利增强债券型发起式证券投资基金增加E类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自2024年09月24日起，本基金增加E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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券等）、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、股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、权证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。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；投资于股票、存托凭证、权证等资产的比例不超过基金资产的20%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如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\*80%+中证500指数收益率\*20%。

### 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2025年6月30日的财务状况以及2025年1月1日至2025年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### **6.4.5 会计差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **6.4.6 税项**

##### **1 印花税**

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

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

## 2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》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。

### 6.4.7 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 (2025年06月30日)
活期存款	391,350.17

等于：本金	390,489.08
加：应计利息	861.09
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	391,350.17

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（2025 年 06 月 30 日）			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		197,579,230.96	—	204,187,451.75	6,608,220.79
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	535,977,681.42	3,793,855.14	544,938,684.49	5,167,147.93
	银行间市场	434,813,372.13	5,220,088.62	440,030,588.62	-2,872.13
	合计	970,791,053.55	9,013,943.76	984,969,273.11	5,164,275.80
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		1,168,370,284.51	9,013,943.76	1,189,156,724.86	11,772,496.59

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末（2025 年 06 月 30 日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	9,900,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	9,900,000.00	—

##### 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（2025 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	798,230.86
其中：交易所市场	792,530.86
银行间市场	5,700.00
应付利息	—
预提信息披露费	180,000.00
预提审计费	84,283.01
合计	1,062,513.87

#### 6.4.7.7 实收基金

富国丰利增强债券 A：

金额单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	669,344,676.57	669,344,676.57
本期申购	292,514,567.43	292,514,567.43
本期赎回（以“-”号填列）	-512,691,479.49	-512,691,479.49
本期末	449,167,764.51	449,167,764.51

富国丰利增强债券 E：

金额单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	285,994,343.81	285,994,343.81
本期申购	499,004,219.37	499,004,219.37
本期赎回（以“-”号填列）	-445,164,582.93	-445,164,582.93
本期末	339,833,980.25	339,833,980.25

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

富国丰利增强债券 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
上年度末	156,762,090.04	19,591,919.10	176,354,009.14
本期期初	156,762,090.04	19,591,919.10	176,354,009.14
本期利润	14,030,699.84	3,487,696.79	17,518,396.63
本期基金份额交易产生的变动数	55,149,890.23	3,287,710.13	-58,437,600.36
其中：基金申购款	72,041,853.18	7,679,737.58	79,721,590.76
基金赎回款	127,191,743.41	10,967,447.71	-138,159,191.12
本期已分配利润	—	—	—
本期末	115,642,899.65	19,791,905.76	135,434,805.41

富国丰利增强债券 E：

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	66,913,612.89	8,339,239.91	75,252,852.80
本期期初	66,913,612.89	8,339,239.91	75,252,852.80
本期利润	10,276,481.02	2,035,558.89	12,312,039.91
本期基金份额交易产生的变动数	10,175,334.55	4,560,662.78	14,735,997.33
其中：基金申购款	121,930,318.81	16,140,104.69	138,070,423.50
基金赎回款	—	—	-123,334,426.17

	111,754,984.26	11,579,441.91	
本期已分配利润	—	—	—
本期末	87,365,428.46	14,935,461.58	102,300,890.04

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
活期存款利息收入	68,923.73
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	27,186.33
其他	19,575.24
合计	115,685.30

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
卖出股票成交总额	1,935,255,150.15
减：卖出股票成本总额	1,933,484,705.90
减：交易费用	2,768,383.21
买卖股票差价收入	-997,938.96

#### 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（2025年01月01日至2025年06月30日）
债券投资收益——利息收入	13,787,385.02
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	13,007,320.12
合计	26,794,705.14

##### 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（2025年01月01日至2025年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,507,812,908.29

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,480,301,826.07
减：应计利息总额	14,436,739.40
减：交易费用	67,022.70
买卖债券差价收入	13,007,320.12

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
股票投资产生的股利收益	2,610,894.32
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	2,610,894.32

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
1. 交易性金融资产	5,523,255.68
股票投资	8,280,088.72
债券投资	-2,756,833.04
资产支持证券投资	—
基金投资	—

贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	5, 523, 255. 68

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
基金赎回费收入	54, 980. 18
基金转换费收入	38. 86
合计	55, 019. 04

#### 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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
审计费用	26, 283. 01
信息披露费	60, 000. 00
证券出借违约金	—
银行费用	6, 828. 37
债券账户维护费	18, 000. 00
其他	615. 12
合计	111, 726. 50

### 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

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰海通证券股份有限公司（由国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 4 月变更名称而来，以下简称“国泰海通”）承继及承接海通证券股份有限公司的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持本公司股权亦归属于国泰海通，即国泰海通成为本公司的主要股东。变更后，本公司的股东为国泰海通证券股份有限公司，出资比例为 27.775%；申万宏源证券有限公司，出资比例为 27.775%；加拿大蒙特利尔银行，出资比例为 27.775%；山东省金融资产管理股份有限公司，出资比例为 16.675%。

### 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（2025 年 3 月 14 日前）
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	基金管理人的股东、基金代销机构（自 2025 年 3 月 14 日起）
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金

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。关联方国泰海通证券有限公司（简称“国泰海通”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原关联方海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

## 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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国泰海通	651,691,284.68	17.01	—	—
海通证券	78,288,318.11	2.04	387,556,358.57	9.98
申万宏源	430,408,464.69	11.23	194,022,083.85	4.99

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

关联方名称	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
国泰海通	216,173,316.50	14.08	—	—
海通证券	40,766,802.52	2.65	282,212,384.99	8.79
申万宏源	284,886,682.24	18.55	212,560,095.57	6.62

6.4.10.1.4 债券回购交易

关联方名称	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2024年01月01日至2024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（%）
国泰海通	1,441,700,000.00	8.31	—	—
海通证券	110,200,000.00	0.64	1,068,000,000.00	3.22
申万宏源	2,545,460,000.00	14.67	2,500,000,000.00	7.55

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（2025年01月01日至2025年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国泰海通	264,523.85	17.01	195,815.79	24.71
海通证券	31,777.96	2.04	—	—
申万宏源	174,704.43	11.23	32,581.04	4.11
关联方名称	上年度可比期间（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	285,205.26	9.98	8,301.32	0.76
申万宏源	142,771.29	4.99	13,038.00	1.19

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

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的管理费	2,612,338.22	4,222,144.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	174,928.92	200,304.40
应支付基金管理人的净管理费	2,437,409.30	4,021,839.67

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.4%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.4\%/ \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	653,084.51	1,055,535.96

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国丰利增强债券 A	富国丰利增强债券 E	合计
富国基金管理有限公司	—	22,081.63	22,081.63
交通银行股份有限公司	—	2,451.50	2,451.50
合计	—	24,533.13	24,533.13

注：自 2024 年 9 月 24 日起，本基金增加收取销售服务费的 E 类基金份额。

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，E 类基金份额的销售服务费按前一日 E 类基金份额的基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为 E 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 E 类基金份额前一日的基金资产净值

E 类基金份额的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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)	
	富国丰利增强债券 A	富国丰利增强债券 E	富国丰利增强债券 A	富国丰利增强债券 E
基金合同生效日（2017 年 09 月 05 日）持有的基金份额	10,006,200.62	—	10,006,200.62	—
期初持有的基金份额	10,006,200.62	858.89	10,006,200.62	—
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	10,006,200.62	858.89	10,006,200.62	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.23%	0.00%	1.13%	—

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

富国丰利增强债券 A:

份额单位：份

关联方名称	本期末（2025 年 06 月 30 日）		上年度末（2024 年 12 月 31 日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	858,985.10	0.19	858,985.10	0.13

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 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
交通银行股份有限公司	391,350.17	68,923.73	20,728,683.55	96,965.06

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118057	甬矽转债	2025-06-26	1 个月内 (含)	认购新发 证券	100.00	100.00	190	19,000.00	19,000.42	—
123257	安克转债	2025-06-16	1 个月内 (含)	认购新发 证券	100.00	100.01	42	4,200.00	4,200.28	—

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
688313	仕佳光子	2025 年 06 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 07 月 11 日	39.98	2,678.00	82,831.22	101,897.90	—

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 2025 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 2025 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 250,000,000.00 元，于 2025 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元		
长期信用评级	本期末（2025 年 06 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
AAA	443,665,879.21	454,935,835.26
AAA 以下	190,025,999.25	267,970,539.07
未评级	30,507,969.86	30,526,200.00
合计	664,199,848.32	753,432,574.33

注：本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### **6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，



其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末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（2025 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	391,350.17	—	—	—	—	—	391,350.17
结算备付金	18,638,806.41	—	—	—	—	—	18,638,806.41
存出保证金	214,520.29	—	—	—	—	—	214,520.29
交易性金融资产	55,108,198.71	10,627,228.96	419,448,471.61	356,747,183.83	143,038,190.00	204,187,451.75	1,189,156,724.86
买入返售金融资产	9,900,000.00	—	—	—	—	—	9,900,000.00
应收清算款	—	—	—	—	—	32,445,398.11	32,445,398.11
应收申购款	—	—	—	—	—	60,002,045.62	60,002,045.62
资产总计	84,252,875.58	10,627,228.96	419,448,471.61	356,747,183.83	143,038,190.00	296,634,895.48	1,310,748,845.46
负债							
卖出回购金融资产款	250,000,000.00	—	—	—	—	—	250,000,000.00
应付清算款	—	—	—	—	—	18,448,844.58	18,448,844.58
应付赎回款	—	—	—	—	—	14,040,105.24	14,040,105.24
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	350,500.95	350,500.95
应付托管费	—	—	—	—	—	87,625.23	87,625.23
应付销售服务费	—	—	—	—	—	3,235.51	3,235.51
应交税费	—	—	—	—	—	18,579.87	18,579.87
其他负债	—	—	—	—	—	1,062,513.87	1,062,513.87
负债总计	250,000,000.00	—	—	—	—	34,011,405.25	284,011,405.25
利率敏感度缺口	-165,747,124.42	10,627,228.96	419,448,471.61	356,747,183.83	143,038,190.00	262,623,490.23	1,026,737,440.21

上年度末（2024 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	102,186.81	—	—	—	—	—	102,186.81
结算备付金	11,993,132.68	—	—	—	—	—	11,993,132.68
存出保证金	152,154.13	—	—	—	—	—	152,154.13
交易性金融资产	25,551,285.68	122,093,561.98	455,070,031.83	284,404,164.42	107,504,820.78	233,464,736.49	1,228,088,601.18
买入返售金融资产	17,797,944.52	—	—	—	—	—	17,797,944.52
应收清算款	—	—	—	—	—	9,450,025.15	9,450,025.15
资产总计	55,596,703.82	122,093,561.98	455,070,031.83	284,404,164.42	107,504,820.78	242,914,761.64	1,267,584,044.47
负债							
卖出回购金融资产款	49,995,906.85	—	—	—	—	—	49,995,906.85
应付清算款	—	—	—	—	—	9,446,889.35	9,446,889.35
应付赎回款	—	—	—	—	—	29,522.86	29,522.86
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	356,660.43	356,660.43
应付托管费	—	—	—	—	—	89,165.08	89,165.08
应付销售服务费	—	—	—	—	—	21,704.24	21,704.24
应交税费	—	—	—	—	—	12,681.12	12,681.12
其他负债	—	—	—	—	—	685,632.22	685,632.22
负债总计	49,995,906.85	—	—	—	—	10,642,255.30	60,638,162.15
利率敏感度缺口	5,600,796.97	122,093,561.98	455,070,031.83	284,404,164.42	107,504,820.78	232,272,506.34	1,206,945,882.32

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下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。

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 (2025 年 06 月 30 日)	上年度末 (2024 年 12 月 31 日)
	1. 基准点利率增加 0.1%	-4,098,835.27	-1,975,387.65
	2. 基准点利率减少 0.1%	4,098,835.27	1,975,387.65

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

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券等）、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、股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、

存托凭证、权证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：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票、存托凭证、权证等资产的比例不超过基金资产的 20%。本基金持有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。

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 (2025 年 06 月 30 日)		上年度末 (2024 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	204,187,451.75	19.89	233,464,736.49	19.34
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	984,969,273.11	95.93	994,623,864.69	82.41
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	1,189,156,724.86	115.82	1,228,088,601.18	101.75

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，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。

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 (2025年06月30日)	上年度末 (2024年12月31日)

	1. 业绩比较基准增加 1%	17,012,038.15	17,338,175.78
	2. 业绩比较基准减少 1%	-17,012,038.15	-17,338,175.78

#### 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 (2025 年 06 月 30 日)	上年度末 (2024 年 12 月 31 日)
第一层次	430,884,146.94	569,449,543.76
第二层次	758,272,577.92	658,639,057.42
第三层次	—	—
合计	1,189,156,724.86	1,228,088,601.18

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公

---

允价值应属第二层次或第三层次。

#### **6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### **6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

### **6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

#### **6.4.15.1 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### **6.4.15.2 其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	204,187,451.75	15.58
	其中：股票	204,187,451.75	15.58
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	984,969,273.11	75.15
	其中：债券	984,969,273.11	75.15
	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	9,900,000.00	0.76
	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	19,030,156.58	1.45
8	其他各项资产	92,661,964.02	7.07
9	合计	1,310,748,845.46	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	886,062.00	0.09
B	采矿业	4,326,851.00	0.42
C	制造业	123,898,687.23	12.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,692,725.68	0.36
E	建筑业	2,174,488.00	0.21
F	批发和零售业	5,951,039.00	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	5,938,417.00	0.58
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,787,198.07	2.61
J	金融业	15,038,939.80	1.46
K	房地产业	2,204,673.00	0.21
L	租赁和商务服务业	3,513,523.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	3,605,051.45	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	2,587,174.52	0.25



O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	66,528.00	0.01
Q	卫生和社会工作	72,692.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	3,443,402.00	0.34
S	综合	—	—
	合计	204,187,451.75	19.89

### 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	603323	苏农银行	295,480	1,657,642.80	0.16
2	688029	南微医学	21,543	1,455,229.65	0.14
3	601107	四川成渝	233,700	1,406,874.00	0.14
4	002545	东方铁塔	149,900	1,332,611.00	0.13
5	002174	游族网络	106,900	1,296,697.00	0.13
6	300229	拓尔思	68,600	1,264,984.00	0.12
7	600267	海正药业	136,100	1,258,925.00	0.12
8	000089	深圳机场	174,600	1,204,740.00	0.12
9	603699	纽威股份	37,600	1,171,992.00	0.11
10	600273	嘉化能源	132,500	1,120,950.00	0.11
11	603636	南威软件	88,500	1,118,640.00	0.11
12	601528	瑞丰银行	188,600	1,091,994.00	0.11
13	002516	旷达科技	208,800	1,075,320.00	0.10
14	000988	华工科技	22,800	1,071,828.00	0.10
15	688128	中国电研	43,045	1,054,602.50	0.10
16	688343	云天励飞	21,204	1,047,901.68	0.10
17	300502	新易盛	8,200	1,041,564.00	0.10
18	002487	大金重工	31,600	1,039,640.00	0.10
19	000685	中山公用	116,200	1,020,236.00	0.10
20	688327	云从科技	71,983	992,645.57	0.10
21	301338	凯格精机	20,800	992,368.00	0.10
22	600531	豫光金铅	125,800	973,692.00	0.09
23	000030	富奥股份	164,200	967,138.00	0.09
24	601311	骆驼股份	105,400	951,762.00	0.09
25	600057	厦门象屿	135,000	949,050.00	0.09
26	002947	恒铭达	28,500	945,915.00	0.09
27	300303	聚飞光电	147,600	935,784.00	0.09
28	603328	依顿电子	94,100	923,121.00	0.09
29	300657	弘信电子	32,500	906,425.00	0.09

30	601609	金田股份	128,600	901,486.00	0.09
31	001203	大中矿业	94,900	896,805.00	0.09
32	002913	奥士康	30,400	894,064.00	0.09
33	688183	生益电子	17,337	887,654.40	0.09
34	002315	焦点科技	19,300	881,817.00	0.09
35	300232	洲明科技	117,000	847,080.00	0.08
36	300383	光环新网	59,200	846,560.00	0.08
37	688321	微芯生物	35,482	843,761.96	0.08
38	000657	中钨高新	70,400	834,944.00	0.08
39	600064	南京高科	107,000	824,970.00	0.08
40	002010	传化智联	146,500	817,470.00	0.08
41	600335	国机汽车	126,700	817,215.00	0.08
42	300613	富瀚微	16,500	806,520.00	0.08
43	000719	中原传媒	63,200	784,312.00	0.08
44	600961	株冶集团	70,000	782,600.00	0.08
45	601919	中远海控	51,100	768,544.00	0.07
46	601519	大智慧	73,800	752,022.00	0.07
47	002815	崇达技术	64,900	735,317.00	0.07
48	688668	鼎通科技	11,761	734,592.06	0.07
49	688123	聚辰股份	8,940	724,050.60	0.07
50	002063	远光软件	119,300	709,835.00	0.07
51	002414	高德红外	69,230	709,607.50	0.07
52	688630	芯碁微装	8,904	706,710.48	0.07
53	603306	华懋科技	16,000	696,000.00	0.07
54	603612	索通发展	37,500	689,250.00	0.07
55	300251	光线传媒	34,000	689,180.00	0.07
56	300738	奥飞数据	32,700	684,411.00	0.07
57	000567	海德股份	113,400	671,328.00	0.07
58	002075	沙钢股份	114,900	668,718.00	0.07
59	603187	海容冷链	56,500	664,440.00	0.06
60	300779	惠城环保	3,700	660,413.00	0.06
61	002091	江苏国泰	90,700	659,389.00	0.06
62	002045	国光电器	41,200	657,552.00	0.06
63	605296	神农集团	21,100	648,614.00	0.06
64	688037	芯源微	6,004	643,628.80	0.06
65	002461	珠江啤酒	56,800	641,272.00	0.06
66	600771	广誉远	31,400	633,024.00	0.06
67	002539	云图控股	67,200	630,336.00	0.06
68	688503	聚和材料	15,166	627,720.74	0.06
69	600710	苏美达	64,600	620,806.00	0.06
70	603466	风语筑	60,900	614,481.00	0.06

71	688766	普冉股份	9,595	606,404.00	0.06
72	300236	上海新阳	15,600	605,280.00	0.06
73	002326	永太科技	46,900	603,603.00	0.06
74	002925	盈趣科技	33,400	600,532.00	0.06
75	600475	华光环能	57,500	599,150.00	0.06
76	002405	四维图新	69,875	596,732.50	0.06
77	600866	星湖科技	86,300	596,333.00	0.06
78	601857	中国石油	68,900	589,095.00	0.06
79	002777	久远银海	32,100	586,146.00	0.06
80	600482	中国动力	25,100	579,057.00	0.06
81	603881	数据港	22,580	576,919.00	0.06
82	603601	再升科技	142,000	576,520.00	0.06
83	300548	长芯博创	8,600	574,222.00	0.06
84	301069	凯盛新材	35,100	565,461.00	0.06
85	688322	奥比中光	9,544	563,191.44	0.05
86	688208	道通科技	18,366	561,999.60	0.05
87	600577	精达股份	75,300	560,232.00	0.05
88	300827	上能电气	18,200	556,010.00	0.05
89	605168	三人行	18,700	550,341.00	0.05
90	688025	杰普特	7,657	547,475.50	0.05
91	300319	麦捷科技	50,500	542,370.00	0.05
92	000901	航天科技	42,900	533,247.00	0.05
93	002597	金禾实业	22,600	532,230.00	0.05
94	000681	视觉中国	26,400	531,696.00	0.05
95	300416	苏试试验	36,900	528,777.00	0.05
96	002701	奥瑞金	88,800	528,360.00	0.05
97	603236	移远通信	6,100	523,380.00	0.05
98	300620	光库科技	11,100	522,921.00	0.05
99	300041	回天新材	55,000	518,100.00	0.05
100	605123	派克新材	6,600	514,140.00	0.05
101	605080	浙江自然	18,400	511,520.00	0.05
102	600602	云赛智联	25,300	510,301.00	0.05
103	000885	城发环境	38,000	506,160.00	0.05
104	601398	工商银行	66,400	503,976.00	0.05
105	603267	鸿远电子	10,000	502,700.00	0.05
106	300360	炬华科技	31,900	502,425.00	0.05
107	688049	炬芯科技	8,229	497,854.50	0.05
108	688392	骄成超声	7,271	495,373.23	0.05
109	300972	万辰集团	2,700	486,648.00	0.05
110	301327	华宝新能	9,474	486,584.64	0.05
111	000690	宝新能源	106,500	484,575.00	0.05

112	300777	中简科技	13,300	482,125.00	0.05
113	600039	四川路桥	48,500	480,150.00	0.05
114	301195	北路智控	13,400	479,720.00	0.05
115	688538	和辉光电	204,838	479,320.92	0.05
116	688122	西部超导	9,231	478,904.28	0.05
117	601187	厦门银行	69,800	473,942.00	0.05
118	002807	江阴银行	99,200	471,200.00	0.05
119	002036	联创电子	43,200	466,992.00	0.05
120	688591	泰凌微	9,690	464,151.00	0.05
121	002351	漫步者	35,200	461,824.00	0.04
122	600633	浙数文化	33,000	456,720.00	0.04
123	600058	五矿发展	58,600	452,978.00	0.04
124	603444	吉比特	1,500	452,925.00	0.04
125	002249	大洋电机	68,800	452,704.00	0.04
126	000498	山东路桥	76,500	449,820.00	0.04
127	688252	天德钰	18,450	449,811.00	0.04
128	601677	明泰铝业	35,800	444,636.00	0.04
129	001301	尚太科技	9,100	443,716.00	0.04
130	300166	东方国信	40,700	443,630.00	0.04
131	688141	杰华特	13,597	442,990.26	0.04
132	600535	天士力	28,300	442,895.00	0.04
133	301510	固高科技	14,600	438,730.00	0.04
134	300755	华致酒行	22,700	438,110.00	0.04
135	688088	虹软科技	9,052	436,759.00	0.04
136	002206	海利得	85,400	436,394.00	0.04
137	603508	思维列控	16,400	434,272.00	0.04
138	600186	莲花控股	72,000	432,000.00	0.04
139	002488	金固股份	31,300	431,940.00	0.04
140	002649	博彦科技	29,700	431,541.00	0.04
141	300101	振芯科技	19,000	429,970.00	0.04
142	600331	宏达股份	49,200	429,516.00	0.04
143	002396	星网锐捷	19,100	428,795.00	0.04
144	300803	指南针	5,300	427,498.00	0.04
145	300725	药石科技	11,000	425,700.00	0.04
146	688739	成大生物	16,109	425,277.60	0.04
147	002245	蔚蓝锂芯	33,000	423,390.00	0.04
148	300134	大富科技	34,400	420,712.00	0.04
149	001339	智微智能	8,700	420,471.00	0.04
150	300475	香农芯创	11,800	420,434.00	0.04
151	688582	芯动联科	6,212	417,446.40	0.04
152	002139	拓邦股份	29,900	412,919.00	0.04

153	300357	我武生物	20,000	412,800.00	0.04
154	002324	普利特	38,500	409,255.00	0.04
155	300024	机器人	23,800	408,884.00	0.04
156	688256	寒武纪	678	407,817.00	0.04
157	002716	湖南白银	103,500	403,650.00	0.04
158	001236	弘业期货	25,200	402,696.00	0.04
159	301205	联特科技	4,200	402,612.00	0.04
160	300850	新强联	11,200	401,184.00	0.04
161	300990	同飞股份	8,000	399,200.00	0.04
162	002839	张家港行	88,500	398,250.00	0.04
163	605090	九丰能源	15,400	397,474.00	0.04
164	301171	易点天下	14,800	395,604.00	0.04
165	300369	绿盟科技	50,500	392,385.00	0.04
166	000600	建投能源	56,400	389,724.00	0.04
167	688023	安恒信息	6,841	388,158.34	0.04
168	688213	思特威	3,794	387,822.68	0.04
169	301220	亚香股份	8,500	381,650.00	0.04
170	603678	火炬电子	10,000	380,300.00	0.04
171	603766	隆鑫通用	29,800	380,248.00	0.04
172	688501	青达环保	13,642	379,929.70	0.04
173	301345	涛涛车业	3,500	378,350.00	0.04
174	002588	史丹利	42,900	377,949.00	0.04
175	000829	天音控股	37,000	377,770.00	0.04
176	300035	中科电气	22,300	376,424.00	0.04
177	300570	太辰光	3,900	375,882.00	0.04
178	600246	万通发展	61,500	375,765.00	0.04
179	300470	中密控股	10,200	375,054.00	0.04
180	002215	诺普信	36,200	373,946.00	0.04
181	688403	汇成股份	35,894	372,938.66	0.04
182	603920	世运电路	12,200	372,222.00	0.04
183	603667	五洲新春	11,100	371,961.00	0.04
184	600643	爱建集团	49,900	370,258.00	0.04
185	301339	通行宝	21,600	370,008.00	0.04
186	601899	紫金矿业	18,900	368,550.00	0.04
187	600323	瀚蓝环境	14,900	362,815.00	0.04
188	603516	淳中科技	10,100	362,590.00	0.04
189	688131	皓元医药	7,495	362,383.25	0.04
190	301291	明阳电气	8,800	362,120.00	0.04
191	688185	康希诺	6,062	361,477.06	0.04
192	688332	中科蓝讯	3,501	360,883.08	0.04
193	688286	敏芯股份	5,105	360,872.45	0.04

194	688008	澜起科技	4,374	358,668.00	0.03
195	000758	中色股份	71,300	358,639.00	0.03
196	300638	广和通	12,500	357,875.00	0.03
197	605507	国邦医药	18,100	357,837.00	0.03
198	002948	青岛银行	71,700	357,066.00	0.03
199	301078	孩子王	27,200	355,504.00	0.03
200	688019	安集科技	2,334	354,301.20	0.03
201	300088	长信科技	59,443	354,280.28	0.03
202	000597	东北制药	68,600	353,976.00	0.03
203	002668	TCL 智家	36,200	353,674.00	0.03
204	688608	恒玄科技	1,016	353,547.68	0.03
205	600728	佳都科技	64,100	349,345.00	0.03
206	688048	长光华芯	6,049	349,269.26	0.03
207	300666	江丰电子	4,700	348,270.00	0.03
208	600016	民生银行	72,900	346,275.00	0.03
209	688225	亚信安全	16,976	346,140.64	0.03
210	300133	华策影视	46,000	345,460.00	0.03
211	688372	伟测科技	5,702	344,400.80	0.03
212	002125	湘潭电化	23,600	342,908.00	0.03
213	300718	长盛轴承	4,900	340,501.00	0.03
214	300045	华力创通	17,800	339,802.00	0.03
215	000426	兴业银锡	21,500	339,700.00	0.03
216	301606	绿联科技	6,600	339,438.00	0.03
217	688696	极米科技	2,963	338,848.68	0.03
218	600641	万业企业	24,400	338,672.00	0.03
219	002484	江海股份	16,500	338,085.00	0.03
220	600888	新疆众和	49,300	336,226.00	0.03
221	688095	福昕软件	4,948	336,018.68	0.03
222	600782	新钢股份	94,700	335,238.00	0.03
223	603368	柳药集团	19,700	333,127.00	0.03
224	301109	军信股份	22,300	331,824.00	0.03
225	600757	长江传媒	35,700	331,296.00	0.03
226	002698	博实股份	21,200	329,448.00	0.03
227	002881	美格智能	7,100	329,440.00	0.03
228	301080	百普赛斯	4,600	329,038.00	0.03
229	601555	东吴证券	37,600	329,000.00	0.03
230	300033	同花顺	1,200	327,612.00	0.03
231	600428	中远海特	52,200	326,250.00	0.03
232	300926	博俊科技	12,300	325,581.00	0.03
233	000090	天健集团	91,500	323,910.00	0.03
234	600338	西藏珠峰	29,200	323,828.00	0.03

235	600020	中原高速	67,700	323,606.00	0.03
236	002637	赞宇科技	32,400	323,352.00	0.03
237	300772	运达股份	25,100	323,288.00	0.03
238	000680	山推股份	35,800	321,126.00	0.03
239	002079	苏州固锔	32,900	320,775.00	0.03
240	600422	昆药集团	22,300	319,113.00	0.03
241	002906	华阳集团	9,800	318,598.00	0.03
242	301526	国际复材	87,400	318,136.00	0.03
243	000791	甘肃能源	49,700	317,086.00	0.03
244	603309	维力医疗	24,900	316,728.00	0.03
245	300702	天宇股份	13,600	316,336.00	0.03
246	601678	滨化股份	76,400	316,296.00	0.03
247	688196	卓越新能	6,578	316,204.46	0.03
248	300763	锦浪科技	5,500	315,645.00	0.03
249	000828	东莞控股	29,400	314,286.00	0.03
250	002399	海普瑞	26,200	312,042.00	0.03
251	300705	九典制药	20,000	311,400.00	0.03
252	600301	华锡有色	15,500	309,535.00	0.03
253	300418	昆仑万维	9,200	309,396.00	0.03
254	000156	华数传媒	38,900	308,866.00	0.03
255	301215	中汽股份	49,400	306,280.00	0.03
256	688063	派能科技	6,790	306,093.20	0.03
257	300604	长川科技	6,800	305,388.00	0.03
258	000029	深深房A	16,200	304,884.00	0.03
259	603118	共进股份	27,000	304,290.00	0.03
260	600597	光明乳业	36,100	303,601.00	0.03
261	300456	赛微电子	17,600	302,544.00	0.03
262	688114	华大智造	4,662	302,237.46	0.03
263	600908	无锡银行	47,800	301,618.00	0.03
264	688408	中信博	6,449	301,039.32	0.03
265	002468	申通快递	27,900	298,251.00	0.03
266	600389	江山股份	15,900	295,740.00	0.03
267	002643	万润股份	25,500	293,505.00	0.03
268	688692	达梦数据	1,309	291,763.01	0.03
269	002821	凯莱英	3,300	291,225.00	0.03
270	300017	网宿科技	27,100	290,512.00	0.03
271	600623	华谊集团	38,200	289,174.00	0.03
272	002352	顺丰控股	5,900	287,684.00	0.03
273	603567	珍宝岛	24,200	284,350.00	0.03
274	301031	中熔电气	3,556	283,235.40	0.03
275	688209	英集芯	15,317	282,904.99	0.03

276	600901	江苏金租	46,300	280,578.00	0.03
277	601126	四方股份	17,200	279,844.00	0.03
278	002230	科大讯飞	5,800	277,704.00	0.03
279	002896	中大力德	4,790	277,388.90	0.03
280	300590	移为通信	21,300	277,113.00	0.03
281	600595	中孚实业	62,500	273,750.00	0.03
282	688206	概伦电子	9,402	273,410.16	0.03
283	000682	东方电子	26,600	272,384.00	0.03
284	603259	药明康德	3,900	271,245.00	0.03
285	002967	广电计量	15,400	270,886.00	0.03
286	603799	华友钴业	7,300	270,246.00	0.03
287	301261	恒工精密	3,700	269,693.00	0.03
288	601717	中创智领	16,200	269,244.00	0.03
289	002212	天融信	34,800	267,960.00	0.03
290	688779	五矿新能	48,925	266,152.00	0.03
291	601838	成都银行	13,200	265,320.00	0.03
292	002151	北斗星通	9,200	263,948.00	0.03
293	002170	芭田股份	25,700	263,425.00	0.03
294	002014	永新股份	21,707	263,088.84	0.03
295	300183	东软载波	15,600	262,236.00	0.03
296	601369	陕鼓动力	29,900	262,223.00	0.03
297	688235	百济神州	1,110	259,340.40	0.03
298	002402	和而泰	11,100	257,187.00	0.03
299	000612	焦作万方	33,200	256,968.00	0.03
300	000672	上峰水泥	32,400	255,960.00	0.02
301	002314	南山控股	96,900	254,847.00	0.02
302	002895	川恒股份	11,200	252,672.00	0.02
303	002416	爱施德	21,000	252,420.00	0.02
304	002966	苏州银行	28,600	251,108.00	0.02
305	002222	福晶科技	7,300	249,660.00	0.02
306	688220	翱捷科技	3,176	248,680.80	0.02
307	000915	华特达因	7,000	247,450.00	0.02
308	600012	皖通高速	14,400	244,512.00	0.02
309	002400	省广集团	32,000	244,480.00	0.02
310	600900	长江电力	8,100	244,134.00	0.02
311	600741	华域汽车	13,800	243,570.00	0.02
312	000650	仁和药业	44,800	242,816.00	0.02
313	002865	钧达股份	6,200	241,800.00	0.02
314	002243	力合科创	29,400	239,904.00	0.02
315	603283	赛腾股份	7,020	238,258.80	0.02
316	300034	钢研高纳	14,300	237,809.00	0.02



317	300627	华测导航	6,780	237,300.00	0.02
318	300993	玉马科技	15,600	236,496.00	0.02
319	688636	智明达	6,990	236,192.10	0.02
320	001389	广合科技	4,000	235,080.00	0.02
321	301368	丰立智能	3,800	234,954.00	0.02
322	002275	桂林三金	16,400	234,684.00	0.02
323	601577	长沙银行	23,500	233,590.00	0.02
324	002410	广联达	17,400	233,334.00	0.02
325	601728	中国电信	30,000	232,500.00	0.02
326	002233	塔牌集团	31,400	232,360.00	0.02
327	603087	甘李药业	4,200	230,076.00	0.02
328	600350	山东高速	21,400	228,124.00	0.02
329	688536	思瑞浦	1,632	226,391.04	0.02
330	300454	深信服	2,400	226,032.00	0.02
331	600919	江苏银行	18,900	225,666.00	0.02
332	603009	北特科技	5,400	225,180.00	0.02
333	600941	中国移动	2,000	225,100.00	0.02
334	300768	迪普科技	13,100	224,665.00	0.02
335	603808	歌力思	27,000	224,100.00	0.02
336	002371	北方华创	500	221,105.00	0.02
337	603132	金徽股份	16,600	220,282.00	0.02
338	002444	巨星科技	8,600	219,386.00	0.02
339	300226	上海钢联	9,600	219,264.00	0.02
340	688156	路德环境	12,838	217,090.58	0.02
341	601166	兴业银行	9,300	217,062.00	0.02
342	688981	中芯国际	2,450	216,016.50	0.02
343	301377	鼎泰高科	6,000	215,760.00	0.02
344	600000	浦发银行	15,400	213,752.00	0.02
345	300762	上海瀚讯	9,400	212,722.00	0.02
346	300761	立华股份	11,300	212,327.00	0.02
347	688488	艾迪药业	15,192	210,409.20	0.02
348	000969	安泰科技	16,300	209,944.00	0.02
349	600126	杭钢股份	23,300	209,700.00	0.02
350	002270	华明装备	12,500	209,250.00	0.02
351	000001	平安银行	17,200	207,604.00	0.02
352	002127	南极电商	52,200	207,234.00	0.02
353	002901	大博医疗	5,700	206,568.00	0.02
354	002242	九阳股份	21,700	206,150.00	0.02
355	601997	贵阳银行	33,000	205,920.00	0.02
356	002675	东诚药业	14,300	205,777.00	0.02
357	600015	华夏银行	25,900	204,869.00	0.02

358	601939	建设银行	21,700	204,848.00	0.02
359	601169	北京银行	29,800	203,534.00	0.02
360	601818	光大银行	48,900	202,935.00	0.02
361	002142	宁波银行	7,400	202,464.00	0.02
362	601916	浙商银行	59,700	202,383.00	0.02
363	601288	农业银行	34,400	202,272.00	0.02
364	000935	四川双马	11,100	202,242.00	0.02
365	600036	招商银行	4,400	202,180.00	0.02
366	601658	邮储银行	36,900	201,843.00	0.02
367	601988	中国银行	35,900	201,758.00	0.02
368	002327	富安娜	27,100	201,082.00	0.02
369	300049	福瑞股份	6,200	201,066.00	0.02
370	002335	科华数据	4,700	200,596.00	0.02
371	600926	杭州银行	11,900	200,158.00	0.02
372	000628	高新发展	4,700	199,891.00	0.02
373	002985	北摩高科	6,600	199,650.00	0.02
374	603166	福达股份	12,900	199,563.00	0.02
375	301349	信德新材	5,100	199,257.00	0.02
376	601009	南京银行	17,100	198,702.00	0.02
377	600956	新天绿能	25,700	198,404.00	0.02
378	601998	中信银行	23,300	198,050.00	0.02
379	603893	瑞芯微	1,300	197,418.00	0.02
380	300662	科锐国际	6,600	196,086.00	0.02
381	002958	青农商行	54,200	195,662.00	0.02
382	300079	数码视讯	33,200	194,220.00	0.02
383	000603	盛达资源	12,900	192,081.00	0.02
384	300151	昌红科技	15,600	192,036.00	0.02
385	300373	扬杰科技	3,700	192,030.00	0.02
386	002658	雪迪龙	24,500	191,835.00	0.02
387	600111	北方稀土	7,700	191,730.00	0.02
388	600050	中国联通	35,900	191,706.00	0.02
389	002434	万里扬	26,100	191,313.00	0.02
390	300580	贝斯特	7,700	189,189.00	0.02
391	600640	国脉文化	15,600	189,072.00	0.02
392	600718	东软集团	19,300	188,175.00	0.02
393	002736	国信证券	16,300	187,776.00	0.02
394	600875	东方电气	11,200	187,488.00	0.02
395	300124	汇川技术	2,900	187,253.00	0.02
396	601336	新华保险	3,200	187,200.00	0.02
397	000848	承德露露	20,500	187,165.00	0.02
398	600986	浙文互联	22,900	187,093.00	0.02

399	300672	国科微	2,200	186,824.00	0.02
400	603997	继峰股份	14,300	186,472.00	0.02
401	688362	甬矽电子	6,252	186,184.56	0.02
402	002407	多氟多	15,000	182,850.00	0.02
403	301508	中机认检	5,400	182,520.00	0.02
404	300986	志特新材	14,400	181,440.00	0.02
405	002384	东山精密	4,800	181,296.00	0.02
406	600783	鲁信创投	14,500	181,250.00	0.02
407	600100	同方股份	25,000	181,000.00	0.02
408	600153	建发股份	17,400	180,438.00	0.02
409	600739	辽宁成大	16,300	179,300.00	0.02
410	600704	物产中大	33,900	178,653.00	0.02
411	300027	华谊兄弟	66,600	178,488.00	0.02
412	002595	豪迈科技	3,000	177,660.00	0.02
413	600660	福耀玻璃	3,100	176,731.00	0.02
414	688627	精智达	2,002	176,196.02	0.02
415	688800	瑞可达	3,579	176,086.80	0.02
416	600645	中源协和	7,500	174,000.00	0.02
417	002466	天齐锂业	5,400	173,016.00	0.02
418	688677	海泰新光	4,416	172,268.16	0.02
419	688076	ST 诺泰	4,609	171,546.98	0.02
420	600750	江中药业	7,800	170,274.00	0.02
421	300274	阳光电源	2,500	169,425.00	0.02
422	600210	紫江企业	24,800	169,384.00	0.02
423	600867	通化东宝	20,500	168,100.00	0.02
424	688522	纳睿雷达	3,266	167,284.52	0.02
425	603297	永新光学	1,900	165,965.00	0.02
426	688200	华峰测控	1,142	164,676.40	0.02
427	688484	南芯科技	4,140	163,737.00	0.02
428	600499	科达制造	16,700	163,660.00	0.02
429	600873	梅花生物	15,300	163,557.00	0.02
430	601133	柏诚股份	12,800	162,688.00	0.02
431	600055	万东医疗	9,400	162,432.00	0.02
432	600977	中国电影	15,100	161,872.00	0.02
433	002080	中材科技	8,300	161,850.00	0.02
434	300624	万兴科技	2,600	161,330.00	0.02
435	601330	绿色动力	21,100	161,204.00	0.02
436	002020	京新药业	12,300	160,515.00	0.02
437	600817	宇通重工	13,500	159,840.00	0.02
438	603662	柯力传感	2,500	159,825.00	0.02
439	301551	无线传媒	3,252	158,502.48	0.02

440	002050	三花智控	6,000	158,280.00	0.02
441	002281	光迅科技	3,200	157,824.00	0.02
442	600570	恒生电子	4,700	157,638.00	0.02
443	688162	巨一科技	5,775	157,311.00	0.02
444	600201	生物股份	19,500	156,390.00	0.02
445	688150	莱特光电	6,308	155,933.76	0.02
446	300409	道氏技术	9,200	155,848.00	0.02
447	601208	东材科技	16,400	155,472.00	0.02
448	002081	金螳螂	44,700	153,321.00	0.01
449	601200	上海环境	19,301	153,249.94	0.01
450	301498	乖宝宠物	1,400	153,118.00	0.01
451	600993	马应龙	5,400	152,712.00	0.01
452	000100	TCL 科技	35,200	152,416.00	0.01
453	600380	健康元	13,700	151,111.00	0.01
454	002236	大华股份	9,500	150,860.00	0.01
455	601020	华钰矿业	8,300	150,064.00	0.01
456	002001	新 和 成	7,000	148,890.00	0.01
457	300019	硅宝科技	7,500	148,050.00	0.01
458	301165	锐捷网络	2,400	147,504.00	0.01
459	688498	源杰科技	755	147,225.00	0.01
460	300678	中科信息	4,200	145,236.00	0.01
461	600098	广州发展	23,200	145,000.00	0.01
462	301188	力诺药包	6,700	144,921.00	0.01
463	601096	宏盛华源	35,000	144,900.00	0.01
464	300770	新媒股份	3,600	143,964.00	0.01
465	600882	妙可蓝多	4,700	143,491.00	0.01
466	300363	博腾股份	8,400	143,472.00	0.01
467	600160	巨化股份	5,000	143,400.00	0.01
468	002051	中工国际	16,400	141,532.00	0.01
469	688326	经纬恒润	1,552	138,500.48	0.01
470	000408	藏格矿业	3,200	136,544.00	0.01
471	000970	中科三环	11,600	136,532.00	0.01
472	301035	润丰股份	2,300	136,482.00	0.01
473	300263	隆华科技	17,600	136,400.00	0.01
474	300866	安克创新	1,200	136,320.00	0.01
475	300618	寒锐钴业	3,800	135,736.00	0.01
476	001308	康冠科技	6,000	135,720.00	0.01
477	300938	信测标准	6,400	134,464.00	0.01
478	600114	东睦股份	6,600	134,244.00	0.01
479	600329	达仁堂	4,000	133,440.00	0.01
480	301207	华兰疫苗	7,900	133,194.00	0.01

481	301090	华润材料	17,600	132,528.00	0.01
482	000902	新洋丰	9,500	131,385.00	0.01
483	002635	安洁科技	9,700	131,338.00	0.01
484	300687	赛意信息	4,700	130,566.00	0.01
485	300185	通裕重工	45,500	130,130.00	0.01
486	603129	春风动力	600	129,900.00	0.01
487	003021	兆威机电	1,200	129,780.00	0.01
488	301500	飞南资源	6,000	128,520.00	0.01
489	600874	创业环保	21,300	127,161.00	0.01
490	600075	新疆天业	29,800	126,054.00	0.01
491	000893	亚钾国际	4,100	123,574.00	0.01
492	002463	沪电股份	2,900	123,482.00	0.01
493	600925	苏能股份	23,600	123,428.00	0.01
494	000762	西藏矿业	6,400	122,752.00	0.01
495	002920	德赛西威	1,200	122,556.00	0.01
496	000928	中钢国际	19,500	122,460.00	0.01
497	300212	易华录	5,600	121,856.00	0.01
498	601860	紫金银行	40,300	120,900.00	0.01
499	688506	百利天恒	404	119,632.48	0.01
500	688052	纳芯微	685	119,525.65	0.01
501	300681	英搏尔	4,300	118,938.00	0.01
502	688428	诺诚健华	4,803	117,337.29	0.01
503	600362	江西铜业	5,000	117,150.00	0.01
504	000810	创维数字	9,900	116,622.00	0.01
505	688007	光峰科技	8,049	116,388.54	0.01
506	688599	天合光能	7,963	115,702.39	0.01
507	000962	东方钨业	7,000	114,870.00	0.01
508	002034	旺能环境	6,800	114,172.00	0.01
509	301328	维峰电子	2,700	113,805.00	0.01
510	002130	沃尔核材	4,700	111,954.00	0.01
511	601958	金钼股份	10,200	111,588.00	0.01
512	300463	迈克生物	9,200	109,480.00	0.01
513	603103	横店影视	6,800	109,140.00	0.01
514	002475	立讯精密	3,100	107,539.00	0.01
515	301029	怡合达	4,700	107,442.00	0.01
516	688222	成都先导	6,645	106,851.60	0.01
517	600269	赣粤高速	21,100	106,766.00	0.01
518	300811	铂科新材	2,300	106,743.00	0.01
519	000099	中信海直	4,900	106,722.00	0.01
520	002626	金达威	5,200	106,392.00	0.01
521	300080	易成新能	25,400	106,172.00	0.01

522	300841	康华生物	1,600	105,552.00	0.01
523	688017	绿的谐波	844	105,407.16	0.01
524	002851	麦格米特	2,100	105,294.00	0.01
525	603071	物产环能	8,200	104,386.00	0.01
526	000686	东北证券	13,600	103,768.00	0.01
527	300100	双林股份	2,200	103,576.00	0.01
528	688313	仕佳光子	2,678	101,897.90	0.01
529	300953	震裕科技	1,000	101,350.00	0.01
530	600760	中航沈飞	1,700	99,654.00	0.01
531	002239	奥特佳	34,200	99,180.00	0.01
532	300442	润泽科技	2,000	99,060.00	0.01
533	601928	凤凰传媒	8,800	98,296.00	0.01
534	300284	苏交科	10,700	97,370.00	0.01
535	002459	晶澳科技	9,700	96,806.00	0.01
536	688629	华丰科技	1,676	95,867.20	0.01
537	002970	锐明技术	1,900	93,860.00	0.01
538	601515	东峰集团	24,500	93,590.00	0.01
539	601969	海南矿业	12,900	93,525.00	0.01
540	301611	珂玛科技	1,700	93,517.00	0.01
541	300001	特锐德	3,900	93,483.00	0.01
542	600826	兰生股份	11,400	93,480.00	0.01
543	603588	高能环境	16,300	91,932.00	0.01
544	002368	太极股份	3,900	91,338.00	0.01
545	601963	重庆银行	8,400	91,224.00	0.01
546	002790	瑞尔特	12,500	90,875.00	0.01
547	002203	海亮股份	8,800	90,816.00	0.01
548	301316	慧博云通	2,100	90,468.00	0.01
549	601236	红塔证券	10,600	89,782.00	0.01
550	688300	联瑞新材	1,895	88,212.25	0.01
551	300296	利亚德	14,400	87,840.00	0.01
552	003012	东鹏控股	15,300	87,516.00	0.01
553	600572	康恩贝	19,900	87,162.00	0.01
554	688016	心脉医疗	972	85,944.24	0.01
555	600377	宁沪高速	5,600	85,904.00	0.01
556	002705	新宝股份	5,800	85,260.00	0.01
557	600664	哈药股份	23,000	84,640.00	0.01
558	300068	南都电源	5,300	84,376.00	0.01
559	601033	永兴股份	5,300	83,793.00	0.01
560	000990	诚志股份	11,000	83,160.00	0.01
561	688380	中微半导	3,049	82,627.90	0.01
562	301332	德尔玛	8,000	81,920.00	0.01

563	600037	歌华有线	10,700	81,748.00	0.01
564	600675	中华企业	28,200	81,216.00	0.01
565	300496	中科创达	1,400	80,108.00	0.01
566	002941	新疆交建	7,100	79,094.00	0.01
567	600556	天下秀	15,500	79,050.00	0.01
568	002518	科士达	3,400	76,806.00	0.01
569	301061	匠心家居	990	76,764.60	0.01
570	601568	北元集团	18,430	76,484.50	0.01
571	300036	超图软件	5,000	76,300.00	0.01
572	600330	天通股份	10,600	76,002.00	0.01
573	002611	东方精工	6,300	75,978.00	0.01
574	002099	海翔药业	13,800	75,900.00	0.01
575	300182	捷成股份	13,700	75,487.00	0.01
576	002583	海能达	6,100	75,091.00	0.01
577	603730	岱美股份	13,030	74,140.70	0.01
578	300679	电连技术	1,600	72,608.00	0.01
579	688378	奥来德	4,288	72,252.80	0.01
580	603277	银都股份	4,485	71,760.00	0.01
581	002428	云南锗业	3,600	71,640.00	0.01
582	002452	长高电新	10,200	70,890.00	0.01
583	603055	台华新材	7,700	70,301.00	0.01
584	603515	欧普照明	3,900	70,161.00	0.01
585	300685	艾德生物	3,200	68,896.00	0.01
586	301217	铜冠铜箔	5,500	68,805.00	0.01
587	605555	德昌股份	4,150	68,765.50	0.01
588	603005	晶方科技	2,400	68,136.00	0.01
589	002221	东华能源	7,000	67,620.00	0.01
590	300083	创世纪	8,200	67,404.00	0.01
591	002706	良信股份	7,500	66,825.00	0.01
592	688698	伟创电气	1,414	66,740.80	0.01
593	002659	凯文教育	13,200	66,528.00	0.01
594	603197	保隆科技	1,700	66,419.00	0.01
595	002498	汉缆股份	19,200	64,896.00	0.01
596	601606	长城军工	2,200	63,910.00	0.01
597	300547	川环科技	2,100	63,462.00	0.01
598	688523	航天环宇	2,924	62,895.24	0.01
599	605499	东鹏饮料	200	62,810.00	0.01
600	600928	西安银行	16,000	62,720.00	0.01
601	300623	捷捷微电	2,100	62,580.00	0.01
602	600682	南京新百	9,300	62,496.00	0.01
603	688390	固德威	1,430	62,133.50	0.01

604	688018	乐鑫科技	425	62,092.50	0.01
605	003022	联泓新科	3,900	61,737.00	0.01
606	300493	润欣科技	2,900	61,683.00	0.01
607	002959	小熊电器	1,300	60,372.00	0.01
608	600115	中国东航	14,900	60,047.00	0.01
609	000338	潍柴动力	3,900	59,982.00	0.01
610	002681	奋达科技	8,600	58,222.00	0.01
611	600763	通策医疗	1,400	57,792.00	0.01
612	600118	中国卫星	2,000	57,140.00	0.01
613	601827	三峰环境	6,800	57,120.00	0.01
614	688793	倍轻松	1,680	55,927.20	0.01
615	000968	蓝焰控股	7,500	54,375.00	0.01
616	001311	多利科技	2,590	53,535.30	0.01
617	600033	福建高速	15,000	53,100.00	0.01
618	605305	中际联合	1,900	52,782.00	0.01
619	002926	华西证券	5,900	52,746.00	0.01
620	688108	赛诺医疗	4,696	52,689.12	0.01
621	688676	金盘科技	1,566	52,382.70	0.01
622	600418	江淮汽车	1,300	52,117.00	0.01
623	300492	华图山鼎	760	51,588.80	0.01
624	600850	电科数字	2,100	50,799.00	0.00
625	002747	埃斯顿	2,500	50,600.00	0.00
626	000333	美的集团	700	50,540.00	0.00
627	000729	燕京啤酒	3,900	50,427.00	0.00
628	603876	鼎胜新材	5,500	49,995.00	0.00
629	301297	富乐德	1,200	49,596.00	0.00
630	000661	长春高新	500	49,590.00	0.00
631	300973	立高食品	1,000	48,770.00	0.00
632	605020	永和股份	2,100	48,384.00	0.00
633	688315	诺禾致源	3,419	48,276.28	0.00
634	000726	鲁泰A	7,600	48,184.00	0.00
635	600004	白云机场	5,200	47,320.00	0.00
636	688352	顾中科技	4,147	46,570.81	0.00
637	603915	国茂股份	3,200	46,528.00	0.00
638	603393	新天然气	1,600	46,320.00	0.00
639	000792	盐湖股份	2,700	46,116.00	0.00
640	600795	国电电力	9,500	45,980.00	0.00
641	603859	能科科技	1,400	45,248.00	0.00
642	300140	节能环保	7,300	45,041.00	0.00
643	300913	兆龙互连	960	44,947.20	0.00
644	300788	中信出版	1,400	44,912.00	0.00



645	301550	斯菱股份	500	44,645.00	0.00
646	601137	博威合金	2,500	44,475.00	0.00
647	688586	江航装备	3,847	43,278.75	0.00
648	301004	嘉益股份	640	42,387.20	0.00
649	688563	航材股份	722	40,886.86	0.00
650	000623	吉林敖东	2,400	40,680.00	0.00
651	605598	上海港湾	1,900	40,603.00	0.00
652	002003	伟星股份	3,700	40,367.00	0.00
653	000050	深天马A	4,700	40,044.00	0.00
654	603908	牧高笛	1,600	39,616.00	0.00
655	688347	华虹公司	719	39,480.29	0.00
656	600435	北方导航	2,500	38,975.00	0.00
657	600717	天津港	8,300	37,848.00	0.00
658	002267	陕天然气	4,924	37,274.68	0.00
659	001322	箭牌家居	4,400	37,180.00	0.00
660	688279	峰昭科技	200	37,100.00	0.00
661	000423	东阿阿胶	700	36,610.00	0.00
662	300393	中来股份	6,300	36,288.00	0.00
663	000063	中兴通讯	1,100	35,739.00	0.00
664	603883	老百姓	1,700	35,717.00	0.00
665	601222	林洋能源	6,200	35,340.00	0.00
666	300652	雷迪克	600	35,334.00	0.00
667	601375	中原证券	8,400	34,944.00	0.00
668	600486	扬农化工	600	34,800.00	0.00
669	002543	万和电气	3,100	34,441.00	0.00
670	300809	华辰装备	900	33,822.00	0.00
671	300969	恒帅股份	500	33,490.00	0.00
672	300576	容大感光	900	33,435.00	0.00
673	300184	力源信息	3,400	33,388.00	0.00
674	300674	宇信科技	1,100	33,319.00	0.00
675	688306	均普智能	3,367	33,131.28	0.00
676	600996	贵广网络	3,900	32,526.00	0.00
677	603203	快克智能	1,300	32,331.00	0.00
678	301091	深城交	1,100	32,164.00	0.00
679	300171	东富龙	2,400	31,896.00	0.00
680	688031	星环科技	684	31,894.92	0.00
681	300455	航天智装	2,200	31,680.00	0.00
682	688486	龙迅股份	473	31,634.24	0.00
683	688169	石头科技	200	31,310.00	0.00
684	002648	卫星化学	1,800	31,194.00	0.00
685	603025	大豪科技	2,200	30,844.00	0.00

686	603848	好太太	2,000	30,800.00	0.00
687	300253	卫宁健康	2,900	30,740.00	0.00
688	002544	普天科技	1,300	30,485.00	0.00
689	600869	远东股份	6,000	30,480.00	0.00
690	688050	爱博医疗	442	30,431.70	0.00
691	002690	美亚光电	1,800	30,366.00	0.00
692	300188	国投智能	2,200	30,360.00	0.00
693	600392	盛和资源	2,300	30,291.00	0.00
694	002876	三利谱	1,200	30,228.00	0.00
695	603698	航天工程	1,700	29,954.00	0.00
696	600618	氯碱化工	3,100	29,853.00	0.00
697	600063	皖维高新	6,500	29,770.00	0.00
698	300039	上海凯宝	4,800	29,088.00	0.00
699	300708	聚灿光电	2,400	28,800.00	0.00
700	000813	德展健康	8,900	28,658.00	0.00
701	000776	广发证券	1,700	28,577.00	0.00
702	603530	神马电力	1,100	28,512.00	0.00
703	002978	安宁股份	900	28,422.00	0.00
704	002949	华阳国际	2,100	28,308.00	0.00
705	601991	大唐发电	8,900	28,213.00	0.00
706	603229	奥翔药业	3,200	27,904.00	0.00
707	300735	光弘科技	1,100	27,610.00	0.00
708	603219	富佳股份	1,900	27,569.00	0.00
709	600167	联美控股	4,800	26,976.00	0.00
710	688702	盛科通信	434	26,508.72	0.00
711	688472	阿特斯	2,879	26,342.85	0.00
712	603889	新澳股份	4,500	26,100.00	0.00
713	603327	福蓉科技	2,760	25,530.00	0.00
714	300406	九强生物	1,800	25,470.00	0.00
715	688046	药康生物	1,693	25,462.72	0.00
716	688778	厦钨新能	453	25,331.76	0.00
717	600252	中恒集团	10,000	25,300.00	0.00
718	600635	大众公用	6,300	24,570.00	0.00
719	603099	长白山	600	22,836.00	0.00
720	605183	确成股份	1,300	22,750.00	0.00
721	603993	洛阳钼业	2,700	22,734.00	0.00
722	688584	上海合晶	1,259	22,510.92	0.00
723	605089	味知香	900	22,356.00	0.00
724	301268	铭利达	1,200	22,260.00	0.00
725	603181	皇马科技	1,700	21,862.00	0.00
726	300113	顺网科技	1,100	21,736.00	0.00

727	688102	斯瑞新材	1,612	21,729.76	0.00
728	688266	泽璟制药	202	21,717.02	0.00
729	301155	海力风电	300	21,570.00	0.00
730	688236	春立医疗	1,158	21,527.22	0.00
731	002192	融捷股份	700	21,448.00	0.00
732	000960	锡业股份	1,400	21,420.00	0.00
733	300119	瑞普生物	1,100	21,362.00	0.00
734	002073	软控股份	2,400	21,336.00	0.00
735	600987	航民股份	3,000	21,210.00	0.00
736	603383	顶点软件	500	21,200.00	0.00
737	002714	牧原股份	500	21,005.00	0.00
738	002390	信邦制药	6,000	20,880.00	0.00
739	600276	恒瑞医药	400	20,760.00	0.00
740	601456	国联民生	2,000	20,700.00	0.00
741	688581	安杰思	316	20,486.28	0.00
742	603966	法兰泰克	2,200	20,416.00	0.00
743	688289	圣湘生物	991	20,295.68	0.00
744	600011	华能国际	2,800	19,992.00	0.00
745	601686	友发集团	3,500	19,880.00	0.00
746	601901	方正证券	2,500	19,775.00	0.00
747	002727	一心堂	1,200	19,608.00	0.00
748	002004	华邦健康	4,700	19,599.00	0.00
749	301600	慧翰股份	200	19,592.00	0.00
750	600426	华鲁恒升	900	19,503.00	0.00
751	600352	浙江龙盛	1,900	19,304.00	0.00
752	688686	奥普特	200	19,124.00	0.00
753	002891	中宠股份	300	18,561.00	0.00
754	002745	木林森	2,300	18,124.00	0.00
755	603916	苏博特	2,000	18,120.00	0.00
756	002120	韵达股份	2,700	18,090.00	0.00
757	600458	时代新材	1,300	17,836.00	0.00
758	600073	光明肉业	2,400	17,712.00	0.00
759	000725	京东方A	4,403	17,567.97	0.00
760	600416	湘电股份	1,300	17,472.00	0.00
761	002654	万润科技	1,400	17,458.00	0.00
762	688549	中巨芯	2,255	17,453.70	0.00
763	301580	爱迪特	420	17,400.60	0.00
764	300737	科顺股份	3,600	17,352.00	0.00
765	600461	洪城环境	1,800	17,352.00	0.00
766	301511	德福科技	800	16,560.00	0.00
767	688556	高测股份	2,303	16,535.54	0.00

768	300276	三丰智能	1,500	16,500.00	0.00
769	300075	数字政通	900	16,038.00	0.00
770	688551	科威尔	536	15,753.04	0.00
771	300432	富临精工	1,200	15,684.00	0.00
772	600459	贵研铂业	1,000	15,510.00	0.00
773	300170	汉得信息	900	15,489.00	0.00
774	002600	领益智造	1,800	15,462.00	0.00
775	002456	欧菲光	1,300	15,405.00	0.00
776	301413	安培龙	200	15,290.00	0.00
777	600120	浙江东方	2,500	15,125.00	0.00
778	300058	蓝色光标	2,300	15,088.00	0.00
779	002302	西部建设	2,600	15,080.00	0.00
780	600316	洪都航空	400	15,080.00	0.00
781	002761	浙江建投	1,700	15,079.00	0.00
782	600169	太原重工	6,200	15,004.00	0.00
783	000058	深赛格	1,800	14,958.00	0.00
784	301071	力量钻石	500	14,905.00	0.00
785	300244	迪安诊断	1,000	14,900.00	0.00
786	603298	杭叉集团	700	14,665.00	0.00
787	688308	欧科亿	794	14,649.30	0.00
788	600549	厦门钨业	700	14,644.00	0.00
789	603583	捷昌驱动	400	14,608.00	0.00
790	688789	宏华数科	200	14,608.00	0.00
791	300138	晨光生物	1,200	14,544.00	0.00
792	603303	得邦照明	1,200	14,484.00	0.00
793	002053	云南能投	1,300	14,313.00	0.00
794	002378	章源钨业	1,800	14,238.00	0.00
795	600481	双良节能	2,800	13,496.00	0.00
796	600094	大名城	4,300	13,330.00	0.00
797	002993	奥海科技	300	12,441.00	0.00
798	000429	粤高速A	900	11,997.00	0.00
799	002311	海大集团	200	11,718.00	0.00
800	688116	天奈科技	253	11,579.81	0.00
801	688146	中船特气	397	11,477.27	0.00
802	688400	凌云光	407	11,220.99	0.00
803	300655	晶瑞电材	1,100	11,011.00	0.00
804	000560	我爱我家	3,700	10,989.00	0.00
805	002489	浙江永强	3,000	10,980.00	0.00
806	002026	山东威达	900	10,935.00	0.00
807	002939	长城证券	1,300	10,894.00	0.00
808	002223	鱼跃医疗	300	10,680.00	0.00

809	688348	昱能科技	248	10,656.56	0.00
810	000712	锦龙股份	800	10,504.00	0.00
811	601921	浙版传媒	1,300	10,478.00	0.00
812	000778	新兴铸管	2,800	10,416.00	0.00
813	300573	兴齐眼药	200	10,358.00	0.00
814	600166	福田汽车	3,800	10,298.00	0.00
815	601881	中国银河	600	10,290.00	0.00
816	688432	有研硅	925	10,212.00	0.00
817	002803	吉宏股份	700	9,982.00	0.00
818	300260	新莱应材	300	9,864.00	0.00
819	600217	中再资环	2,200	9,856.00	0.00
820	600998	九州通	1,900	9,766.00	0.00
821	603858	步长制药	600	9,744.00	0.00
822	603909	建发合诚	1,000	9,740.00	0.00
823	300258	精锻科技	700	9,674.00	0.00
824	603600	永艺股份	900	9,576.00	0.00
825	603888	新华网	400	9,576.00	0.00
826	002511	中顺洁柔	1,400	9,408.00	0.00
827	002946	新乳业	500	9,385.00	0.00
828	002332	仙琚制药	1,000	9,170.00	0.00
829	600285	羚锐制药	400	9,068.00	0.00
830	601061	中信金属	1,100	8,701.00	0.00
831	003006	百亚股份	300	8,214.00	0.00
832	688526	科前生物	527	8,210.66	0.00
833	600662	外服控股	1,600	8,176.00	0.00
834	600578	京能电力	1,800	8,082.00	0.00
835	002847	盐津铺子	100	8,040.00	0.00
836	301160	翔楼新材	100	8,008.00	0.00
837	601326	秦港股份	2,400	7,752.00	0.00
838	002674	兴业科技	700	6,993.00	0.00
839	300622	博士眼镜	200	6,954.00	0.00
840	002061	浙江交科	1,500	5,940.00	0.00
841	300059	东方财富	200	4,626.00	0.00
842	603477	巨星农牧	200	4,116.00	0.00
843	002892	科力尔	200	2,786.00	0.00
844	300593	新雷能	200	2,680.00	0.00
845	688697	纽威数控	200	2,668.00	0.00
846	000420	吉林化纤	600	2,340.00	0.00
847	300203	聚光科技	100	2,213.00	0.00
848	000821	京山轻机	100	1,159.00	0.00
849	600775	南京熊猫	100	1,089.00	0.00

850	002373	千方科技	100	930.00	0.00
851	601319	中国人保	100	871.00	0.00
852	002274	华昌化工	100	728.00	0.00
853	601665	齐鲁银行	100	632.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600267	海正药业	5,723,893.00	0.47
2	688183	生益电子	5,656,203.57	0.47
3	688235	百济神州	5,565,622.96	0.46
4	300303	聚飞光电	5,505,710.00	0.46
5	300502	新易盛	5,494,432.60	0.46
6	603323	苏农银行	5,466,340.00	0.45
7	000685	中山公用	5,427,657.00	0.45
8	688608	恒玄科技	5,260,267.69	0.44
9	603893	瑞芯微	5,131,094.00	0.43
10	002001	新 和 成	4,993,574.00	0.41
11	002008	大族激光	4,858,316.00	0.40
12	002967	广电计量	4,759,802.00	0.39
13	002675	东诚药业	4,748,397.00	0.39
14	688392	骄成超声	4,728,780.56	0.39
15	002245	蔚蓝锂芯	4,691,534.00	0.39
16	300972	万辰集团	4,681,625.00	0.39
17	600535	天士力	4,605,402.00	0.38
18	688256	寒武纪	4,515,857.76	0.37
19	601998	中信银行	4,463,143.00	0.37
20	002312	川发龙蟒	4,429,252.00	0.37

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	600096	云天化	6,692,372.00	0.55
2	603893	瑞芯微	6,435,191.00	0.53
3	688235	百济神州	5,936,730.33	0.49
4	002273	水晶光电	5,867,443.00	0.49
5	300476	胜宏科技	5,432,537.06	0.45

6	601577	长沙银行	5,344,102.00	0.44
7	002008	大族激光	5,206,659.00	0.43
8	300001	特锐德	5,201,507.00	0.43
9	002001	新 和 成	5,156,860.00	0.43
10	300502	新易盛	5,123,595.00	0.42
11	601998	中信银行	5,039,949.00	0.42
12	688608	恒玄科技	5,038,366.58	0.42
13	688183	生益电子	4,957,250.57	0.41
14	300972	万辰集团	4,921,873.00	0.41
15	300866	安克创新	4,876,077.20	0.40
16	002261	拓维信息	4,849,575.00	0.40
17	002532	天山铝业	4,771,624.00	0.40
18	002967	广电计量	4,771,311.00	0.40
19	600267	海正药业	4,673,297.00	0.39
20	002675	东诚药业	4,669,298.00	0.39

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	1,895,927,332.44
卖出股票收入（成交）总额	1,935,255,150.15

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	227,386,542.60	22.15
2	央行票据	—	—
3	金融债券	357,833,894.52	34.85
	其中：政策性金融债	93,382,882.19	9.10
4	企业债券	172,927,042.20	16.84
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	226,821,793.79	22.09
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	984,969,273.11	95.93

## 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	230023	23 付息国债 23	500,000	62,390,573.77	6.08
2	200219	20 国开 19	600,000	61,803,567.12	6.02
3	282480011	24 平安人寿永续 债 01	600,000	60,873,770.96	5.93
4	019766	25 国债 01	540,000	54,237,999.45	5.28
5	232380015	23 工行二级资本 债 01A	500,000	52,615,972.60	5.12

## 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

本基金根据基金合同的约定，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 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局北京监管局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国进出口银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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中国人民银行的处罚。

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

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

### 7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	214,520.29
2	应收清算款	32,445,398.11
3	应收股利	—
4	应收利息	—

5	应收申购款	60,002,045.62
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	92,661,964.02

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113042	上银转债	8,610,432.28	0.84
2	113641	华友转债	6,097,701.88	0.59
3	127020	中金转债	6,036,817.62	0.59
4	127049	希望转2	6,008,457.19	0.59
5	110081	闻泰转债	5,991,741.76	0.58
6	113632	鹤21转债	5,930,095.46	0.58
7	113058	友发转债	5,849,894.66	0.57
8	113052	兴业转债	5,828,692.35	0.57
9	123247	万凯转债	5,814,722.00	0.57
10	113056	重银转债	5,781,224.47	0.56
11	110093	神马转债	5,570,122.77	0.54
12	123119	康泰转2	5,277,242.79	0.51
13	127040	国泰转债	5,266,588.23	0.51
14	113647	禾丰转债	5,161,814.56	0.50
15	118031	天23转债	4,935,115.89	0.48
16	113605	大参转债	4,852,531.15	0.47
17	111010	立昂转债	4,667,028.40	0.45
18	127103	东南转债	4,620,938.32	0.45
19	127086	恒邦转债	4,571,145.41	0.45
20	110082	宏发转债	4,548,555.62	0.44
21	113054	绿动转债	4,525,811.62	0.44
22	111018	华康转债	4,442,806.48	0.43
23	127022	恒逸转债	4,211,649.50	0.41
24	118038	金宏转债	4,183,863.48	0.41
25	113631	皖天转债	4,111,338.68	0.40

26	110086	精工转债	4,027,238.58	0.39
27	123212	立中转债	3,772,872.04	0.37
28	111007	永和转债	3,618,376.59	0.35
29	123120	隆华转债	3,586,999.22	0.35
30	113627	太平转债	3,505,909.49	0.34
31	123161	强联转债	3,281,494.54	0.32
32	113661	福 22 转债	3,248,260.59	0.32
33	128141	旺能转债	2,957,476.66	0.29
34	118013	道通转债	2,941,789.20	0.29
35	123113	仙乐转债	2,935,500.00	0.29
36	127105	龙星转债	2,882,515.00	0.28
37	113065	齐鲁转债	2,694,412.05	0.26
38	118041	星球转债	2,672,319.56	0.26
39	113606	荣泰转债	2,657,968.08	0.26
40	113625	江山转债	2,622,332.28	0.26
41	113663	新化转债	2,574,052.51	0.25
42	127082	亚科转债	2,480,379.29	0.24
43	123178	花园转债	2,475,212.16	0.24
44	113068	金铜转债	2,424,818.67	0.24
45	127041	弘亚转债	2,372,114.47	0.23
46	113667	春 23 转债	2,343,955.93	0.23
47	127052	西子转债	2,335,275.49	0.23
48	123236	家联转债	2,314,392.58	0.23
49	128132	交建转债	2,310,497.98	0.23
50	123063	大禹转债	2,286,075.05	0.22
51	127018	本钢转债	2,213,849.62	0.22
52	113037	紫银转债	2,199,531.07	0.21
53	123249	英搏转债	1,984,128.98	0.19
54	123149	通裕转债	1,930,000.55	0.19
55	127067	恒逸转 2	1,729,919.98	0.17
56	111017	蓝天转债	1,719,346.44	0.17
57	127024	盈峰转债	1,717,107.37	0.17

58	128095	恩捷转债	1,555,830.19	0.15
59	123145	药石转债	1,339,276.89	0.13
60	113584	家悦转债	1,317,018.25	0.13
61	111014	李子转债	1,306,266.73	0.13
62	128105	长集转债	950,105.15	0.09
63	127089	晶澳转债	859,596.08	0.08
64	113656	嘉诚转债	756,119.75	0.07
65	123186	志特转债	524,633.82	0.05
66	127054	双箭转债	122,000.27	0.01
67	123107	温氏转债	88,603.81	0.01
68	123076	强力转债	74,122.67	0.01
69	110060	天路转债	68,679.06	0.01
70	111005	富春转债	38,519.45	0.00
71	127064	杭氧转债	14,386.96	0.00
72	123215	铭利转债	13,752.62	0.00
73	123193	海能转债	13,475.35	0.00
74	128131	崇达转 2	12,790.17	0.00
75	113648	巨星转债	9,504.82	0.00

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
富国丰利增强债券 A	1,647	272,718.74	446,728,94 3.63	99.46	2,438,820 .88	0.54
富国丰利增强债券 E	34	9,995,117.0 7	339,815,45 9.35	99.99	18,520.90	0.01
合计	1,681	469,364.51	786,544,40 2.98	99.69	2,457,341 .78	0.31

### 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	富国丰利增强债券 A	9,359.95	0.0021
	富国丰利增强债券 E	—	—
	合计	9,359.95	0.0012

### 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	富国丰利增强债券 A	0
	富国丰利增强债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富国丰利增强债券 A	0~10
	富国丰利增强债券 E	0
	合计	0~10

### 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	10,007,059.51	1.27	10,006,200.62	1.27	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	10,007,059.51	1.27	10,006,200.62	1.27	3 年

注：截至 2020 年 9 月 5 日，本基金的基金合同生效届满 3 年。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国丰利增强债券 A	富国丰利增强债券 E
基金合同生效日(2017 年 09 月 05 日) 基金份额总额	150,004,400.62	—
报告期期初基金份额总额	669,344,676.57	285,994,343.81
本报告期基金总申购份额	292,514,567.43	499,004,219.37
减：本报告期基金总赎回份额	512,691,479.49	445,164,582.93
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	449,167,764.51	339,833,980.25

## § 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

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 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 (%)	
长城证券	1	201,104,927.70	5.25	81,630.11	5.25	—



方正证券	2	91,687,168.00	2.39	37,216.47	2.39	—
国盛证券	1	—	—	—	—	—
国泰海通	3	651,691,284.68	17.01	264,523.85	17.01	—
国泰君安	2	129,123,853.96	3.37	52,413.72	3.37	—
海通证券	1	78,288,318.11	2.04	31,777.96	2.04	—
华福证券	2	665,651,256.95	17.37	270,185.29	17.37	—
华泰证券	1	296,481,632.31	7.74	120,345.87	7.74	—
摩根大通	2	10,837,476.60	0.28	4,398.94	0.28	—
平安证券	2	294,917,560.24	7.70	119,710.20	7.70	—
申万宏源	2	430,408,464.69	11.23	174,704.43	11.23	—
银河证券	2	272,788,442.28	7.12	110,725.98	7.12	—
招商证券	1	187,668,183.18	4.90	76,177.50	4.90	—
浙商证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	1	122,593,776.53	3.20	49,760.66	3.20	—
中泰证券	1	15,508,768.69	0.40	6,295.49	0.40	—
中信证券	1	382,431,368.67	9.98	155,230.94	9.98	—

注：1、我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金新增券商交易单元：摩根大通（019228、63153）。

2、国泰海通证券股份有限公司（简称“国泰海通”）是由国泰君安证券股份有限公司与海通证券股份有限公司于2025年3月14日合并组建而成。上表显示的国泰海通数据为自2025年3月15日至2025年6月30日通过国泰海通证券席位交易的情况，本期海通证券、国泰君安数据为自2025年1月1日至2025年3月14日通过海通证券、国泰君安席位交易的情况。

#### 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 (%)
长城证券	24,607,200.73	1.60	248,100,000.00	1.43	—	—
方正证券	20,768,301.63	1.35	233,200,000.00	1.34	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰海通	216,173,316.50	14.08	1,441,700,000.00	8.31	—	—
国泰君安	65,241,579.57	4.25	681,300,000.00	3.93	—	—
海通证券	40,766,802.52	2.65	110,200,000.00	0.64	—	—
华福证券	241,052,872.86	15.70	2,492,110,000.00	14.36	—	—
华泰证券	154,630,424.05	10.07	3,013,000,000.00	17.36	—	—
摩根大通	7,927,422.14	0.52	28,600,000.00	0.16	—	—
平安证券	82,082,347.00	5.34	653,800,000.00	3.77	—	—
申万宏源	284,886,682.24	18.55	2,545,460,000.00	14.67	—	—
银河证券	78,749,569.34	5.13	521,100,000.00	3.00	—	—
招商证券	70,179,482.56	4.57	930,000,000.00	5.36	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	14,000,569.73	0.91	220,000,000.00	1.27	—	—
中泰证券	79,436,442.34	5.17	1,019,200,000.00	5.87	—	—
中信证券	155,191,978.72	10.11	3,214,500,000.00	18.52	—	—

## 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	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	规定披露媒介	2025年01月02日
2	富国基金管理有限公司关于变更主要股东事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告	规定披露媒介	2025年01月21日
3	富国基金管理有限公司关于公司主要股东变更的公告	规定披露媒介	2025年03月18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	2025-06-27 至 2025-06-29	118,016,010.85	31,884,416.10	—	149,900,426.95	19.00%
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>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，根据中国证券监督管理委员会于 2025 年 1 月 17 日出具的《关于同意国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司并募集配套资金注册、核准国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司、海富通基金管理有限公司变更主要股东及实际控制人、富国基金管理有限公司变更主要股东、海通期货股份有限公司变更主要股东及实际控制人的批复》，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司，并依法承接富国基金管理有限公司 14,443 万元出资（占注册资本比例 27.775%）。自吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安成为基金管理人的主要股东。具体可参见基金管理人于 2025 年 1 月 21 日发布的《富国基金管理有限公司关于变更主要股东事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告》、2025 年 3 月 18 日发布的《富国基金管理有限公司关于公司主要股东变更的公告》。根据国泰海通证券股份有限公司于 2025 年 4 月 4 日发布的相关公告，国泰君安的公司名称变更为国泰海通证券

---

股份有限公司。

## § 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丰利增强债券型发起式证券投资基金的文件 2、富国丰利增强债券型发起式证券投资基金基金合同 3、富国丰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、富国丰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	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> 。