

富国宝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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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遵规守信情况的说明.....	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遵规守信情况声明.....	17
5.2  托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、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.....	61
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
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.....	63
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..	63
7.8	报告期内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..	64
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.....	64
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	64
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.12	投资组合报告附注.....	64
§ 8	基金份额持有人信息 .....	69
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
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.....	69
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况.....	69
§ 9	开放式基金份额变动 .....	71
§ 10	重大事件揭示.....	72
10.1	基金份额持有人大会决议.....	72
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.....	72
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	72
10.4	基金投资策略的改变.....	72
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	72
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.....	72
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	72
10.8	其他重大事件.....	77
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	78
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 .....	78
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	78
§ 12	备查文件目录.....	79



## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国宝利增强债券型发起式证券投资基金	
基金简称	富国宝利增强债券	
基金主代码	005078	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年02月08日	
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	2,490,502,455.14份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国宝利增强债券 A	富国宝利增强债券 E
下属分级基金的交易代码	005078	022175
报告期末下属分级基金的份额总额	1,471,127,426.80份	1,019,375,028.34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。本基金的资产证券化产品投资策略、存托凭证投资策略、权证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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
信息披露负责人	姓名	赵瑛	王小飞
	联系电话	021-20361818	021-6063 7103
	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) 富国宝利增强债券 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	23,249,950.62
本期利润	22,869,103.90
加权平均基金份额本期利润	0.0134
本期加权平均净值利润率	1.01%
本期基金份额净值增长率	1.50%
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	385,123,009.62
期末可供分配基金份额利润	0.2618
期末基金资产净值	1,969,542,728.49
期末基金份额净值	1.3388
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	38.21%

#### (2) 富国宝利增强债券 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	18,590,382.04
本期利润	10,397,531.69
加权平均基金份额本期利润	0.0079
本期加权平均净值利润率	0.60%
本期基金份额净值增长率	1.49%
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	266,471,203.65
期末可供分配基金份额利润	0.2614
期末基金资产净值	1,364,364,518.38
期末基金份额净值	1.3384
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	9.22%

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) 富国宝利增强债券 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	1.21%	0.17%	0.53%	0.05%	0.68%	0.12%
过去三个月	0.99%	0.48%	1.12%	0.08%	-0.13%	0.40%
过去六个月	1.50%	0.40%	-0.06%	0.10%	1.56%	0.30%
过去一年	8.28%	0.49%	3.67%	0.13%	4.61%	0.36%
过去三年	5.68%	0.34%	5.45%	0.11%	0.23%	0.23%
自基金合同生效起至今	38.21%	0.31%	15.58%	0.12%	22.63%	0.19%

##### (2) 富国宝利增强债券 E

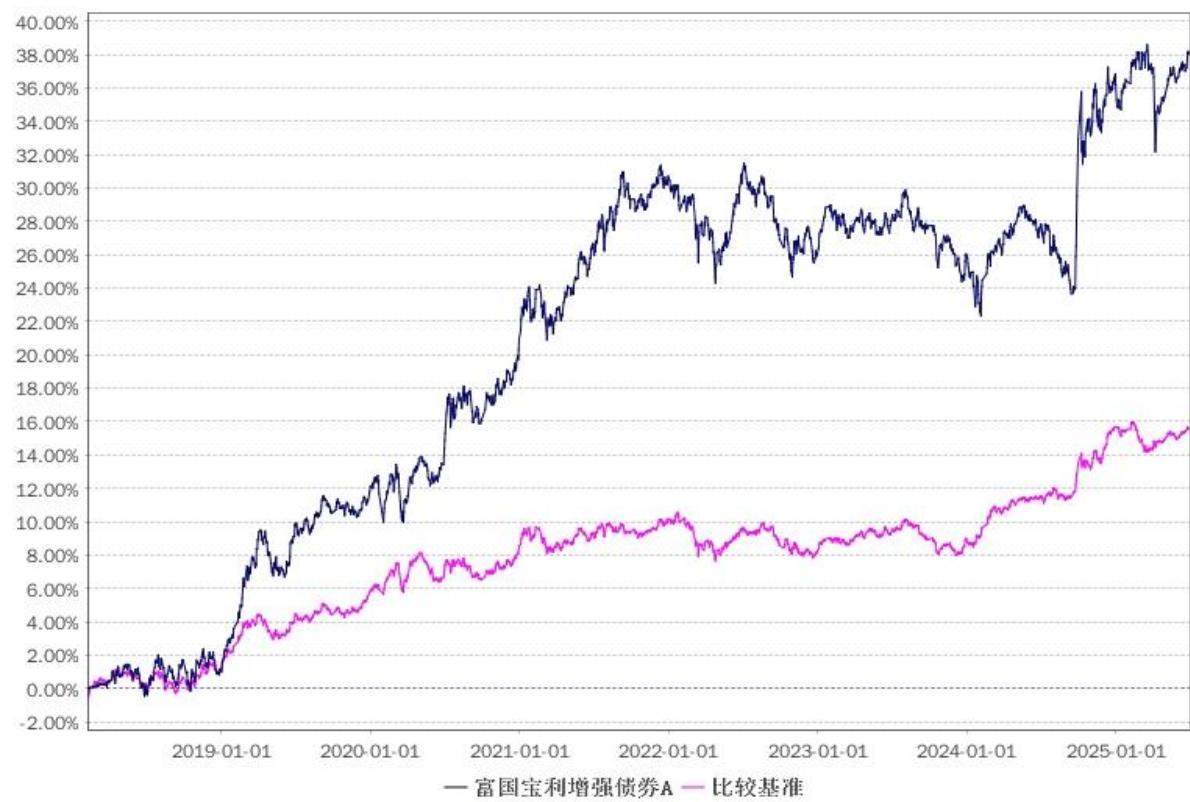
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.21%	0.17%	0.53%	0.05%	0.68%	0.12%
过去三个月	0.99%	0.48%	1.12%	0.08%	-0.13%	0.40%
过去六个月	1.49%	0.40%	-0.06%	0.10%	1.55%	0.30%
自基金分级生效日起至今	9.22%	0.53%	2.80%	0.14%	6.42%	0.39%

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宝利增强债券 A 基金累计净值增长率变动及其与

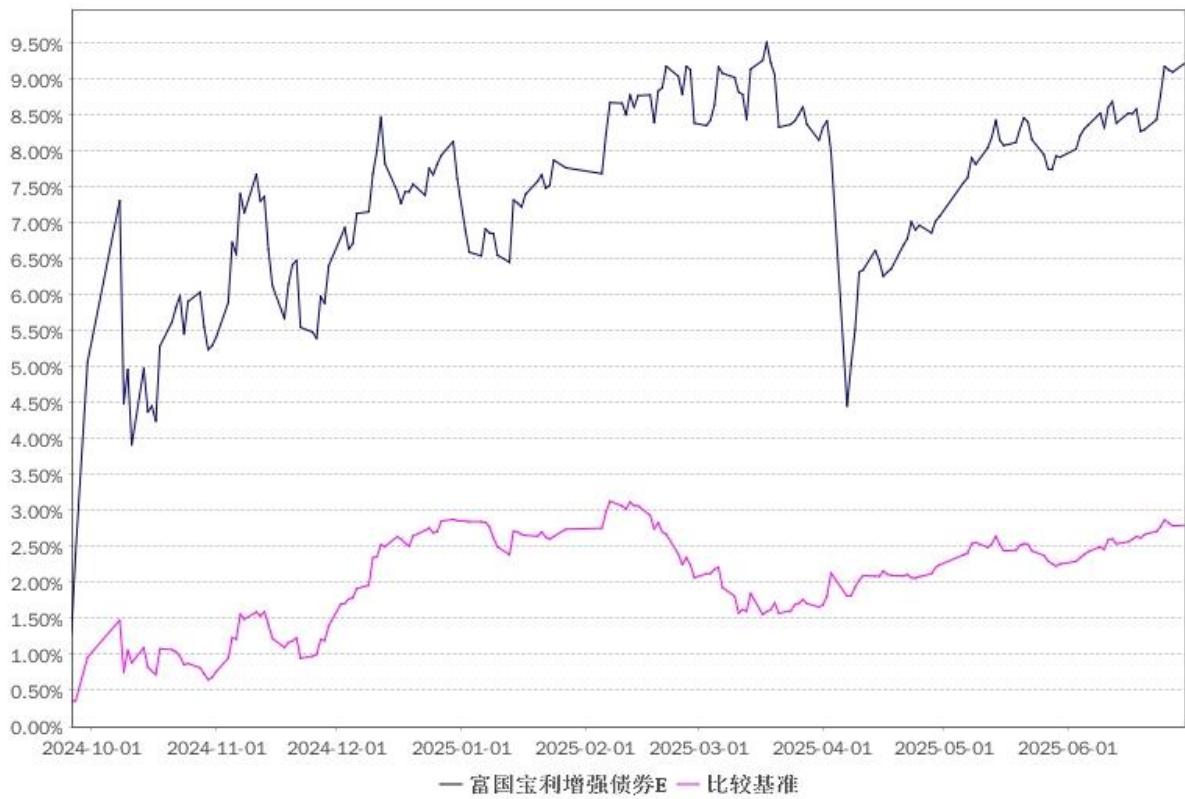
## 同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2018 年 2 月 8 日成立，建仓期 6 个月，从 2018 年 2 月 8 日起至 2018 年 8 月 7 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宝利增强债券 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 25 日起增加 E 类份额，相关数据按实际存续期计算。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金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

本报告期内，富国基金管理有限公司作为富国宝利增强债券型发起式证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

## 4.3 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宝利增强债券 A 为 1.3388 元，富国宝利增强债券 E 为 1.3384 元；份额累计净值富国宝利增强债券 A 为 1.3788 元，富国宝利增强债券 E 为 1.3384 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国宝利增强债券 A 为 1.50%，富国宝利增强债券 E 为 1.49%；同期业绩比较基准收益率情况：富国宝利增强债券 A 为 -0.06%，富国宝利增强债券 E 为 -0.06%。

### 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：富国宝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	上年度末
	2025年06月30日	2024年12月31日
<b>资产：</b>		
货币资金	94,094,572.07	99,251,426.55
结算备付金	37,088,253.21	29,866,892.16
存出保证金	395,350.44	270,867.16
交易性金融资产	3,536,992,998.77	3,237,206,114.11
其中：股票投资	658,995,890.05	614,538,563.62
基金投资	—	—
债券投资	2,877,997,108.72	2,622,667,550.49
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	30,900,000.00	39,696,471.39
应收清算款	—	2,764,307.84
应收股利	—	—
应收申购款	709.24	45,927,689.53
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	3,699,471,883.73	3,454,983,768.74
<b>负债和净资产</b>		
<b>负债：</b>	本期末	上年度末
	2025年06月30日	2024年12月31日
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	300,000,000.00	149,983,758.92
应付清算款	49,040,733.05	101,755,594.62
应付赎回款	13,786,818.66	54,401.87
应付管理人报酬	1,026,696.31	888,829.14
应付托管费	256,674.12	222,207.32
应付销售服务费	10,407.67	73,541.58
应付投资顾问费	—	—
应交税费	68,460.34	53,161.87
应付利润	—	—

递延所得税负债	—	—
其他负债	1, 374, 846. 71	724, 909. 79
负债合计	365, 564, 636. 86	253, 756, 405. 11
<b>净资产：</b>		
实收基金	2, 490, 502, 455. 14	2, 427, 202, 098. 41
其他综合收益	—	—
未分配利润	843, 404, 791. 73	774, 025, 265. 22
净资产合计	3, 333, 907, 246. 87	3, 201, 227, 363. 63
负债和净资产总计	3, 699, 471, 883. 73	3, 454, 983, 768. 74

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3386 元，基金份额总额 2, 490, 502, 455. 14 份。其中：富国宝利增强债券 A 份额净值 1.3388 元，份额总额 1, 471, 127, 426. 80 份；富国宝利增强债券 E 份额净值 1.3384 元，份额总额 1, 019, 375, 028. 34 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国宝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>	46, 115, 940. 39	41, 943, 321. 81
1. 利息收入	675, 817. 80	985, 752. 01
其中：存款利息收入	302, 378. 00	551, 316. 24
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	373, 439. 80	434, 435. 77
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	53, 941, 995. 48	-62, 981, 822. 76
其中：股票投资收益	-31, 133, 637. 15	-71, 550, 579. 95
基金投资收益	—	—
债券投资收益	75, 911, 566. 75	2, 551, 146. 58
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	9, 164, 065. 88	6, 017, 610. 61
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）	-8,573,697.07	103,724,048.38
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	71,824.18	215,344.18
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>12,849,304.80</b>	<b>15,181,275.73</b>
1. 管理人报酬	7,972,412.75	7,275,967.62
2. 托管费	1,993,103.23	1,818,991.92
3. 销售服务费	136,981.44	—
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	2,584,129.90	5,935,485.58
其中：卖出回购金融资产支出	2,584,129.90	5,935,485.58
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	37,628.31	34,746.24
8. 其他费用	125,049.17	116,084.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>33,266,635.59</b>	<b>26,762,046.08</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>33,266,635.59</b>	<b>26,762,046.08</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>33,266,635.59</b>	<b>26,762,046.08</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：富国宝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	2,427,202,098 .41	774,025,265.2 2	3,201,227,363 .63
二、本期期初净资产	2,427,202,098 .41	774,025,265.2 2	3,201,227,363 .63
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	63,300,356.73	69,379,526.51	132,679,883.2 4
(一)、综合收益总额	—	33,266,635.59	33,266,635.59
(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)	63,300,356.73	36,112,890.92	99,413,247.65
其中：1. 基金申购款	3,749,391,541 .93	1,217,624,980 .73	4,967,016,522 .66
2. 基金赎回款	3,686,091,185 .20	1,181,512,089 .81	4,867,603,275 .01

(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	2,490,502,455 .14	843,404,791.7 3	3,333,907,246 .87
上年度可比期间 (2024年01月01日至2024年06月30日)			
项目	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,610,710,179 .83	1,017,291,065 .79	5,628,001,245 .62
二、本期期初净资产	4,610,710,179 .83	1,017,291,065 .79	5,628,001,245 .62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,551,581,762 .64	530,495,970.9 1	3,082,077,733 .55
(一)、综合收益总额	-	26,762,046.08	26,762,046.08
(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)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	2,551,581,762 .64	557,258,016.9 9	3,108,839,779 .63
2. 基金赎回款	998,420,601.5 1	227,983,785.0 9	1,226,404,386 .60
(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	2,059,128,417 .19	486,795,094.8 8	2,545,923,512 .07

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

富国宝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]1252号《关于准予富国宝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发行募集，基金合同于2018年2月8日生效，首次设立募集规模为73,996,883.34份基金份额。根据基金管理人于2024年09月23日发布的《富国基金管理有限公司关于富国宝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25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债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债（含中小企业集合债）、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）、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。

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\*90%+沪深300指数收

益率\*10%。

#### **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管理业务的指导意见》、《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	94,094,572.07
等于：本金	94,086,187.96
加：应计利息	8,384.11
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	94,094,572.07

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	644,522,741.05	—	658,995,890.05	14,473,149.00
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	1,439,293,461.94	10,788,170.25	15,340,644.31
	银行间市场	1,399,550,997.53	17,232,332.22	4,208,497.53
	合计	2,838,844,459.47	28,020,502.47	11,132,146.78
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—

合计	3,483,367.20 0.52	28,020,502.47	3,536,992.99 8.77	25,605,295.78
----	----------------------	---------------	----------------------	---------------

### 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

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	30,900,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	30,900,000.00	—

#### 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	1,223,563.70
其中：交易所市场	1,214,976.20
银行间市场	8,587.50
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	91,283.01
合计	1,374,846.71

### 6.4.7.7 实收基金

富国宝利增强债券 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	1,431,540,361.73	1,431,540,361.73
本期申购	1,152,730,512.67	1,152,730,512.67
本期赎回(以“-”号填列)	-1,113,143,447.60	-1,113,143,447.60
本期末	1,471,127,426.80	1,471,127,426.80

富国宝利增强债券 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	995,661,736.68	995,661,736.68
本期申购	2,596,661,029.26	2,596,661,029.26
本期赎回(以“-”号填列)	-2,572,947,737.60	-2,572,947,737.60
本期末	1,019,375,028.34	1,019,375,028.34

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

富国宝利增强债券 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	355,281,809 .05	101,410,58 6.11	456,692,395.16
本期期初	355,281,809 .05	101,410,58 6.11	456,692,395.16
本期利润	23,249,950. 62	- 380,846.72	22,869,103.90
本期基金份额交易产生的变动数	6,591,249.9 5	12,262,552 .68	18,853,802.63
其中: 基金申购款	293,767,077 .59	74,887,984 .15	368,655,061.74
基金赎回款	- 287,175,827 .64	- 62,625,431 .47	-349,801,259.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	385,123,009 .62	113,292,29 2.07	498,415,301.69

富国宝利增强债券 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	246,784,215 .68	70,548,654. 38	317,332,870.06
本期期初	246,784,215 .68	70,548,654. 38	317,332,870.06
本期利润	18,590,382.	-	10,397,531.69

	04	8,192,850.35	
本期基金份额交易产生的变动数	1,096,605.93	16,162,482.36	17,259,088.29
其中：基金申购款	668,713,144.04	180,256,774.95	848,969,918.99
基金赎回款	667,616,538.11	164,094,292.59	-831,710,830.70
本期已分配利润	—	—	—
本期末	266,471,203.65	78,518,286.39	344,989,490.04

#### 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	111,135.28
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	62,995.34
其他	128,247.38
合计	302,378.00

#### 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	2,978,256,070.34
减：卖出股票成本总额	3,005,069,229.06
减：交易费用	4,320,478.43
买卖股票差价收入	-31,133,637.15

#### 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	40,644,247.56
债券投资收益——买卖债券（债券转股及债券到期兑付）差价收入	35,267,319.19
合计	75,911,566.75

### 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	4,178,500,520.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,106,351,973.14
减：应计利息总额	36,676,852.34
减：交易费用	204,376.13
买卖债券差价收入	35,267,319.19

### 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	9,164,065.88
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	9,164,065.88

### 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	-8,573,697.07
股票投资	3,846,467.15
债券投资	-12,420,164.22
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	-8,573,697.07

#### 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	43,522.22
基金转换费收入	28,301.96
合计	71,824.18

#### 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	20,165.73
债券账户维护费	18,000.00
其他	600.43
合计	125,049.17

### 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、基金代销机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人
富国鑫汇养老目标日期 2045 五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
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	674,164,743.30	11.19	—	—
海通证券	343,868,716.17	5.71	132,697,067.23	4.22
申万宏源	1,047,266,706.45	17.39	79,929,404.20	2.54

#### 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（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	566,481,333.25	11.80	—	—
海通证券	479,801,574.15	10.00	561,197,901.90	10.25
申万宏源	655,829,051.55	13.66	187,357,886.97	3.42

#### 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（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	7,109,274,000.00	17.84	—	—
海通证券	1,196,600,000.00	3.00	1,422,500,000.00	2.96
申万宏源	6,358,900,000.00	15.96	1,453,700,000.00	3.03

#### 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	273,643.72	11.19	273,643.72	22.52
海通证券	139,577.45	5.71	—	—
申万宏源	425,086.76	17.39	258,670.96	21.29
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	97,656.17	4.22	70,254.90	6.31
申万宏源	58,819.58	2.54	46,486.72	4.18

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	7,972,412.75	7,275,967.62
其中：应支付销售机构的客户维护费	422,715.96	139,776.25
应支付基金管理人的净管理费	7,549,696.79	7,136,191.37

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.4%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

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	1,993,103.23	1,818,991.92

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，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		
	富国宝利增强债券 A	富国宝利增强债券 E	合计
富国基金管理有限公司	—	102,063.96	102,063.96
合计	—	102,063.96	102,063.96

注：自 2024 年 9 月 25 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，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)	
	富国宝利增强债券A	富国宝利增强债券E	富国宝利增强债券A	富国宝利增强债券E
基金合同生效日（2018年02月08日）持有的基金份额	10,000,000.00	—	10,000,000.00	—
期初持有的基金份额	10,000,000.00	816.06	10,000,000.00	—
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	—	816.06	—	—
期末持有的基金份额	10,000,000.00	—	10,000,000.00	—
期末持有的基金份额占基	0.68%	—	0.49%	—

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

富国宝利增强债券 A:

关联方名称	本期末（2025年06月30日）		上年度末（2024年12月31日）		份额单位：份
	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(%)	
富国鑫汇养老目标日期2045五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	—	—	3,483,145.74	0.24	
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）	3,229,974.16	0.22	3,229,974.16	0.23	
申万宏源证券有限公司	61,863,109.65	4.21	61,863,109.65	4.32	

#### 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

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）		单位：人民币元
	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	94,094,572.07	111,135.28	2,200,081.05	86,939.22	

#### 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：本基金本报告期未进行利润分配。

#### 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	290	29,000.00	29,000.64	—
123257	安克转债	2025-06-16	1个月内 (含)	认购新发 证券	100. 00	100.01	121	12,100.00	12,100.80	—

##### 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 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 300,000,000.00 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）	上年度末（2024年12月）
--------	-----------------	----------------

	日)	31 日)
AAA	1,097,348,291.41	1,209,020,987.76
AAA 以下	564,329,707.23	655,318,909.68
未评级	245,225,189.61	224,776,686.04
合计	1,906,903,188.25	2,089,116,583.48

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	94,094,572.07	—	—	—	—	—	94,094,572.07
结算备付金	37,088,253.21	—	—	—	—	—	37,088,253.21
存出保证金	395,350.44	—	—	—	—	—	395,350.44
交易性金融资产	166,139,857.38	162,053,350.50	1,122,735,162.42	840,145,529.04	586,923,209.38	658,995,890.05	3,536,992,998.77
买入返售金融资产	30,900,000.00	—	—	—	—	—	30,900,000.00
应收申购款	—	—	—	—	—	709.24	709.24
资产总计	328,618,033.10	162,053,350.50	1,122,735,162.42	840,145,529.04	586,923,209.38	658,996,599.29	3,699,471,883.73
负债							
卖出回购金融资产款	300,000,000.00	—	—	—	—	—	300,000,000.00
应付清算款	—	—	—	—	—	49,040,733.05	49,040,733.05
应付赎回款	—	—	—	—	—	13,786,818.66	13,786,818.66
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,026,696.31	1,026,696.31
应付托管费	—	—	—	—	—	256,674.12	256,674.12
应付销售服务费	—	—	—	—	—	10,407.67	10,407.67
应交税费	—	—	—	—	—	68,460.34	68,460.34
其他负债	—	—	—	—	—	1,374,846.71	1,374,846.71
负债总计	300,000,000.00	—	—	—	—	65,564,636.86	365,564,636.86
利率敏感度缺口	28,618,033.10	162,053,350.50	1,122,735,162.42	840,145,529.04	586,923,209.38	593,431,962.43	3,333,907,246.87
上年度末（2024年）	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

12月31日)							
资产							
货币资金	99,251,426.55	—	—	—	—	—	99,251,426.55
结算备付金	29,866,892.16	—	—	—	—	—	29,866,892.16
存出保证金	270,867.16	—	—	—	—	—	270,867.16
交易性金融资产	86,886,320.50	155,862,025.19	1,320,338,270.25	864,388,838.39	195,192,096.16	614,538,563.62	3,237,206,114.11
买入返售金融资产	39,696,471.39	—	—	—	—	—	39,696,471.39
应收清算款	—	—	—	—	—	2,764,307.84	2,764,307.84
应收申购款	—	—	—	—	—	45,927,689.53	45,927,689.53
资产总计	255,971,977.76	155,862,025.19	1,320,338,270.25	864,388,838.39	195,192,096.16	663,230,560.99	3,454,983,768.74
负债							
卖出回购金融资产款	149,983,758.92	—	—	—	—	—	149,983,758.92
应付清算款	—	—	—	—	—	101,755,594.62	101,755,594.62
应付赎回款	—	—	—	—	—	54,401.87	54,401.87
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	888,829.14	888,829.14
应付托管费	—	—	—	—	—	222,207.32	222,207.32
应付销售服务费	—	—	—	—	—	73,541.58	73,541.58
应交税费	—	—	—	—	—	53,161.87	53,161.87
其他负债	—	—	—	—	—	724,909.79	724,909.79
负债总计	149,983,758.92	—	—	—	—	103,772,646.19	253,756,405.11
利率敏感度缺口	105,988,218.84	155,862,025.19	1,320,338,270.25	864,388,838.39	195,192,096.16	559,457,914.80	3,201,227,363.63

#### 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)
分析	1. 基准点利率增加 0.1%	-12,400,188.70	-4,535,333.55
	2. 基准点利率减少 0.1%	12,400,188.70	4,535,333.55

#### 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债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债（含中小企业集合债）、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）、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)。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	658,995,890.05	19.77	614,538,563.62	19.20
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	2,877,997,108.72	86.33	2,622,667,550.49	81.93
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	3,536,992,998.77	106.09	3,237,206,114.11	101.12

#### 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	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，除市场基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)		
分析	相关风险变量的变动		本期末 (2025年06月30日)
			上年度末 (2024年12月31日)
	1. 市场基准增加 1%	12,231,668.85	10,066,139.63

	2. 市场基准减少 1%	-12,231,668.85	-10,066,139.63
--	--------------	----------------	----------------

#### 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	1,347,663,354.14	1,440,476,750.46
第二层次	2,189,329,644.63	1,796,729,363.65
第三层次	—	—
合计	3,536,992,998.77	3,237,206,114.11

###### 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	658,995,890.05	17.81
	其中：股票	658,995,890.05	17.81
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	2,877,997,108.72	77.79
	其中：债券	2,877,997,108.72	77.79
	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	30,900,000.00	0.84
	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	131,182,825.28	3.55
8	其他各项资产	396,059.68	0.01
9	合计	3,699,471,883.73	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	3,183,322.00	0.10
B	采矿业	29,695,897.00	0.89
C	制造业	321,309,153.33	9.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,727,122.16	0.59
E	建筑业	8,748,681.00	0.26
F	批发和零售业	1,983,725.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	29,411,502.32	0.88
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,429,388.93	1.24
J	金融业	177,486,954.85	5.32
K	房地产业	911,397.00	0.03
L	租赁和商务服务业	5,149,425.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	11,118,526.55	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	2,017,445.91	0.06

0	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	23,688.00	0.00
Q	卫生和社会工作	2,446,158.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	4,353,503.00	0.13
S	综合	—	—
	合计	658,995,890.05	19.77

### 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	600519	贵州茅台	16,649	23,467,098.48	0.70
2	300750	宁德时代	76,177	19,213,362.94	0.58
3	601318	中国平安	268,835	14,914,965.80	0.45
4	600900	长江电力	420,744	12,681,224.16	0.38
5	000333	美的集团	154,279	11,138,943.80	0.33
6	601166	兴业银行	470,000	10,969,800.00	0.33
7	600036	招商银行	236,100	10,848,795.00	0.33
8	600919	江苏银行	861,500	10,286,310.00	0.31
9	601899	紫金矿业	465,100	9,069,450.00	0.27
10	603259	药明康德	123,500	8,589,425.00	0.26
11	000725	京东方A	2,083,349	8,312,562.51	0.25
12	002230	科大讯飞	169,300	8,106,084.00	0.24
13	000776	广发证券	481,400	8,092,334.00	0.24
14	000100	TCL 科技	1,850,390	8,012,188.70	0.24
15	002352	顺丰控股	164,000	7,996,640.00	0.24
16	002736	国信证券	617,700	7,115,904.00	0.21
17	600276	恒瑞医药	130,700	6,783,330.00	0.20
18	601857	中国石油	783,400	6,698,070.00	0.20
19	601288	农业银行	1,076,900	6,332,172.00	0.19
20	600016	民生银行	1,203,000	5,714,250.00	0.17
21	601688	华泰证券	318,200	5,667,142.00	0.17
22	002142	宁波银行	194,800	5,329,728.00	0.16
23	000538	云南白药	95,200	5,311,208.00	0.16
24	688008	澜起科技	64,672	5,303,104.00	0.16
25	002001	新 和 成	249,000	5,296,230.00	0.16
26	600000	浦发银行	379,000	5,260,520.00	0.16
27	601919	中远海控	335,900	5,051,936.00	0.15
28	000063	中兴通讯	151,300	4,915,737.00	0.15
29	605499	东鹏饮料	15,610	4,902,320.50	0.15

30	000651	格力电器	108,885	4,891,114.20	0.15
31	601658	邮储银行	893,200	4,885,804.00	0.15
32	600941	中国移动	43,200	4,862,160.00	0.15
33	601998	中信银行	572,000	4,862,000.00	0.15
34	603993	洛阳钼业	577,000	4,858,340.00	0.15
35	601336	新华保险	77,000	4,504,500.00	0.14
36	600482	中国动力	190,300	4,390,221.00	0.13
37	600887	伊利股份	147,400	4,109,512.00	0.12
38	601319	中国人保	469,100	4,085,861.00	0.12
39	601838	成都银行	200,900	4,038,090.00	0.12
40	300502	新易盛	30,720	3,902,054.40	0.12
41	601009	南京银行	332,400	3,862,488.00	0.12
42	601728	中国电信	486,600	3,771,150.00	0.11
43	601818	光大银行	875,000	3,631,250.00	0.11
44	600875	东方电气	215,100	3,600,774.00	0.11
45	000625	长安汽车	281,300	3,589,388.00	0.11
46	600741	华域汽车	199,600	3,522,940.00	0.11
47	000001	平安银行	291,700	3,520,819.00	0.11
48	601169	北京银行	499,800	3,413,634.00	0.10
49	300274	阳光电源	50,100	3,395,277.00	0.10
50	601989	中国重工	723,500	3,357,040.00	0.10
51	600039	四川路桥	335,900	3,325,410.00	0.10
52	688256	寒武纪	5,522	3,321,483.00	0.10
53	600660	福耀玻璃	58,115	3,313,136.15	0.10
54	601328	交通银行	413,320	3,306,560.00	0.10
55	000408	藏格矿业	76,700	3,272,789.00	0.10
56	000977	浪潮信息	62,700	3,190,176.00	0.10
57	601236	红塔证券	373,400	3,162,698.00	0.09
58	601995	中金公司	88,000	3,111,680.00	0.09
59	601901	方正证券	376,800	2,980,488.00	0.09
60	688396	华润微	63,089	2,975,277.24	0.09
61	601601	中国太保	75,900	2,847,009.00	0.09
62	000568	泸州老窖	25,100	2,846,340.00	0.09
63	688041	海光信息	20,067	2,835,266.43	0.09
64	002600	领益智造	323,000	2,774,570.00	0.08
65	600926	杭州银行	164,720	2,770,590.40	0.08
66	600901	江苏金租	455,000	2,757,300.00	0.08
67	002475	立讯精密	78,900	2,737,041.00	0.08
68	002714	牧原股份	64,400	2,705,444.00	0.08
69	300059	东方财富	116,800	2,701,584.00	0.08
70	600111	北方稀土	106,000	2,639,400.00	0.08

71	603195	公牛集团	54, 552	2, 632, 134. 00	0. 08
72	000792	盐湖股份	153, 200	2, 616, 656. 00	0. 08
73	600050	中国联通	482, 900	2, 578, 686. 00	0. 08
74	601825	沪农商行	263, 700	2, 557, 890. 00	0. 08
75	601988	中国银行	450, 490	2, 531, 753. 80	0. 08
76	300383	光环新网	173, 600	2, 482, 480. 00	0. 07
77	688599	天合光能	169, 773	2, 466, 801. 69	0. 07
78	601816	京沪高铁	428, 800	2, 465, 600. 00	0. 07
79	600015	华夏银行	302, 675	2, 394, 159. 25	0. 07
80	601881	中国银河	136, 900	2, 347, 835. 00	0. 07
81	601390	中国中铁	415, 100	2, 328, 711. 00	0. 07
82	300033	同花顺	8, 300	2, 265, 983. 00	0. 07
83	600690	海尔智家	91, 200	2, 259, 936. 00	0. 07
84	300015	爱尔眼科	179, 900	2, 245, 152. 00	0. 07
85	601225	陕西煤业	113, 700	2, 187, 588. 00	0. 07
86	300442	润泽科技	44, 100	2, 184, 273. 00	0. 07
87	002415	海康威视	78, 500	2, 176, 805. 00	0. 07
88	600999	招商证券	122, 900	2, 161, 811. 00	0. 06
89	603893	瑞芯微	14, 100	2, 141, 226. 00	0. 06
90	000858	五 粮 液	17, 700	2, 104, 530. 00	0. 06
91	688122	西部超导	40, 557	2, 104, 097. 16	0. 06
92	600760	中航沈飞	35, 700	2, 092, 734. 00	0. 06
93	600115	中国东航	512, 600	2, 065, 778. 00	0. 06
94	600109	国金证券	233, 500	2, 047, 795. 00	0. 06
95	601229	上海银行	191, 160	2, 028, 207. 60	0. 06
96	002463	沪电股份	47, 400	2, 018, 292. 00	0. 06
97	688037	芯源微	18, 672	2, 001, 638. 40	0. 06
98	002241	歌尔股份	85, 500	1, 993, 860. 00	0. 06
99	002648	卫星化学	113, 700	1, 970, 421. 00	0. 06
100	002027	分众传媒	269, 000	1, 963, 700. 00	0. 06
101	000807	云铝股份	122, 800	1, 962, 344. 00	0. 06
102	600153	建发股份	188, 500	1, 954, 745. 00	0. 06
103	300476	胜宏科技	14, 500	1, 948, 510. 00	0. 06
104	300251	光线传媒	95, 200	1, 929, 704. 00	0. 06
105	000089	深圳机场	274, 700	1, 895, 430. 00	0. 06
106	603699	纽威股份	60, 000	1, 870, 200. 00	0. 06
107	600066	宇通客车	75, 200	1, 869, 472. 00	0. 06
108	000988	华工科技	39, 300	1, 847, 493. 00	0. 06
109	601877	正泰电器	80, 800	1, 831, 736. 00	0. 05
110	601006	大秦铁路	277, 500	1, 831, 500. 00	0. 05
111	605117	德业股份	34, 400	1, 811, 504. 00	0. 05

112	600176	中国巨石	158,400	1,805,760.00	0.05
113	000338	潍柴动力	115,800	1,781,004.00	0.05
114	603288	海天味业	45,300	1,762,623.00	0.05
115	002459	晶澳科技	174,480	1,741,310.40	0.05
116	002304	洋河股份	26,900	1,736,395.00	0.05
117	601668	中国建筑	298,900	1,724,653.00	0.05
118	600905	三峡能源	394,400	1,680,144.00	0.05
119	002966	苏州银行	190,300	1,670,834.00	0.05
120	000885	城发环境	125,400	1,670,328.00	0.05
121	601138	工业富联	77,600	1,659,088.00	0.05
122	603529	爱玛科技	48,100	1,654,640.00	0.05
123	600018	上港集团	289,492	1,652,999.32	0.05
124	603799	华友钴业	44,600	1,651,092.00	0.05
125	600428	中远海特	263,600	1,647,500.00	0.05
126	002155	湖南黄金	92,200	1,645,770.00	0.05
127	002468	申通快递	152,600	1,631,294.00	0.05
128	002050	三花智控	60,100	1,585,438.00	0.05
129	002252	上海莱士	228,700	1,571,169.00	0.05
130	000426	兴业银锡	97,500	1,540,500.00	0.05
131	000423	东阿阿胶	28,800	1,506,240.00	0.05
132	002311	海大集团	25,700	1,505,763.00	0.05
133	002701	奥瑞金	250,500	1,490,475.00	0.04
134	601088	中国神华	36,000	1,459,440.00	0.04
135	002594	比亚迪	4,357	1,446,131.87	0.04
136	002444	巨星科技	56,100	1,431,111.00	0.04
137	688220	翱捷科技	17,827	1,395,854.10	0.04
138	002595	豪迈科技	22,900	1,356,138.00	0.04
139	002384	东山精密	35,200	1,329,504.00	0.04
140	600031	三一重工	73,400	1,317,530.00	0.04
141	600104	上汽集团	79,100	1,269,555.00	0.04
142	300972	万辰集团	7,000	1,261,680.00	0.04
143	600867	通化东宝	153,800	1,261,160.00	0.04
144	601766	中国中车	179,000	1,260,160.00	0.04
145	688578	艾力斯	13,458	1,252,132.32	0.04
146	688082	盛美上海	10,841	1,235,223.54	0.04
147	002466	天齐锂业	37,700	1,207,908.00	0.04
148	688114	华大智造	18,273	1,184,638.59	0.04
149	000719	中原传媒	95,000	1,178,950.00	0.04
150	688183	生益电子	22,975	1,176,320.00	0.04
151	600028	中国石化	206,000	1,161,840.00	0.03
152	688271	联影医疗	9,087	1,160,773.38	0.03

153	600019	宝钢股份	173,800	1,145,342.00	0.03
154	601991	大唐发电	355,000	1,125,350.00	0.03
155	601633	长城汽车	51,700	1,110,516.00	0.03
156	601238	广汽集团	144,800	1,084,552.00	0.03
157	600795	国电电力	219,400	1,061,896.00	0.03
158	688049	炬芯科技	17,161	1,038,240.50	0.03
159	688235	百济神州	4,436	1,036,427.04	0.03
160	600011	华能国际	145,100	1,036,014.00	0.03
161	600633	浙数文化	74,600	1,032,464.00	0.03
162	601111	中国国航	127,200	1,003,608.00	0.03
163	300418	昆仑万维	29,800	1,002,174.00	0.03
164	002236	大华股份	62,400	990,912.00	0.03
165	600236	桂冠电力	153,600	963,072.00	0.03
166	600061	国投资本	125,600	944,512.00	0.03
167	688506	百利天恒	3,179	941,365.48	0.03
168	688591	泰凌微	19,640	940,756.00	0.03
169	603612	索通发展	51,000	937,380.00	0.03
170	600377	宁沪高速	59,700	915,798.00	0.03
171	600487	亨通光电	59,500	910,350.00	0.03
172	000560	我爱我家	302,100	897,237.00	0.03
173	601066	中信建投	37,100	892,255.00	0.03
174	688126	沪硅产业	47,502	889,237.44	0.03
175	600150	中国船舶	26,900	875,326.00	0.03
176	300803	指南针	10,790	870,321.40	0.03
177	300357	我武生物	41,600	858,624.00	0.03
178	000768	中航西飞	31,400	858,476.00	0.03
179	601360	三六零	83,500	851,700.00	0.03
180	601555	东吴证券	96,800	847,000.00	0.03
181	003022	联泓新科	53,000	838,990.00	0.03
182	600893	航发动力	21,600	832,464.00	0.02
183	688582	芯动联科	12,377	831,734.40	0.02
184	600160	巨化股份	28,400	814,512.00	0.02
185	600362	江西铜业	34,700	813,021.00	0.02
186	300001	特锐德	33,900	812,583.00	0.02
187	002407	多氟多	65,700	800,883.00	0.02
188	300990	同飞股份	16,000	798,400.00	0.02
189	300017	网宿科技	74,100	794,352.00	0.02
190	688213	思特威	7,765	793,738.30	0.02
191	688501	青达环保	28,454	792,443.90	0.02
192	603605	珀莱雅	9,400	778,226.00	0.02
193	301220	亚香股份	17,140	769,586.00	0.02

194	600219	南山铝业	197,100	754,893.00	0.02
195	688223	晶科能源	145,350	754,366.50	0.02
196	688392	骄成超声	10,459	712,571.67	0.02
197	688608	恒玄科技	2,032	707,095.36	0.02
198	688372	伟测科技	11,592	700,156.80	0.02
199	688472	阿特斯	75,954	694,979.10	0.02
200	300124	汇川技术	10,600	684,442.00	0.02
201	688029	南微医学	9,994	675,094.70	0.02
202	002881	美格智能	14,404	668,345.60	0.02
203	002340	格林美	104,200	661,670.00	0.02
204	688111	金山办公	2,328	651,956.40	0.02
205	300763	锦浪科技	11,200	642,768.00	0.02
206	300760	迈瑞医疗	2,800	629,300.00	0.02
207	300604	长川科技	13,700	615,267.00	0.02
208	002429	兆驰股份	139,300	610,134.00	0.02
209	300657	弘信电子	21,800	608,002.00	0.02
210	601456	国联民生	58,100	601,335.00	0.02
211	300373	扬杰科技	11,500	596,850.00	0.02
212	603236	移远通信	6,800	583,440.00	0.02
213	688131	皓元医药	12,033	581,795.55	0.02
214	601669	中国电建	118,300	576,121.00	0.02
215	688123	聚辰股份	6,935	561,665.65	0.02
216	301080	百普赛斯	7,700	550,781.00	0.02
217	601698	中国卫通	26,600	544,502.00	0.02
218	688696	极米科技	4,743	542,409.48	0.02
219	002223	鱼跃医疗	15,200	541,120.00	0.02
220	600057	厦门象屿	76,100	534,983.00	0.02
221	002170	芭田股份	52,100	534,025.00	0.02
222	688766	普冉股份	8,413	531,701.60	0.02
223	002371	北方华创	1,200	530,652.00	0.02
224	300408	三环集团	15,700	524,380.00	0.02
225	601059	信达证券	30,100	514,710.00	0.02
226	601799	星宇股份	4,100	512,500.00	0.02
227	301165	锐捷网络	8,300	510,118.00	0.02
228	002405	四维图新	58,700	501,298.00	0.02
229	688536	思瑞浦	3,575	495,924.00	0.01
230	600186	莲花控股	81,900	491,400.00	0.01
231	002410	广联达	36,600	490,806.00	0.01
232	300738	奥飞数据	22,800	477,204.00	0.01
233	001389	广合科技	8,100	476,037.00	0.01
234	301345	涛涛车业	4,400	475,640.00	0.01

235	601865	福莱特	30,900	469,989.00	0.01
236	300454	深信服	4,900	461,482.00	0.01
237	605080	浙江自然	16,500	458,700.00	0.01
238	603444	吉比特	1,500	452,925.00	0.01
239	688012	中微公司	2,473	450,827.90	0.01
240	300041	回天新材	47,830	450,558.60	0.01
241	300133	华策影视	59,700	448,347.00	0.01
242	600958	东方证券	45,835	443,682.80	0.01
243	002461	珠江啤酒	39,000	440,310.00	0.01
244	301377	鼎泰高科	12,100	435,116.00	0.01
245	300496	中科创达	7,600	434,872.00	0.01
246	601126	四方股份	26,200	426,274.00	0.01
247	002938	鹏鼎控股	13,300	425,999.00	0.01
248	688488	艾迪药业	30,674	424,834.90	0.01
249	688981	中芯国际	4,761	419,777.37	0.01
250	688728	格科微	27,189	418,710.60	0.01
251	002487	大金重工	12,700	417,830.00	0.01
252	603589	口子窖	12,000	417,600.00	0.01
253	688630	芯碁微装	5,255	417,089.35	0.01
254	600602	云赛智联	20,600	415,502.00	0.01
255	002315	焦点科技	9,000	411,210.00	0.01
256	688322	奥比中光	6,962	410,827.62	0.01
257	688636	智明达	12,053	407,270.87	0.01
258	601868	中国能建	181,700	405,191.00	0.01
259	301349	信德新材	10,300	402,421.00	0.01
260	603166	福达股份	26,000	402,220.00	0.01
261	600025	华能水电	41,900	400,145.00	0.01
262	688627	精智达	4,489	395,076.89	0.01
263	603087	甘李药业	7,200	394,416.00	0.01
264	002925	盈趣科技	21,700	390,166.00	0.01
265	003816	中国广核	106,300	386,932.00	0.01
266	688702	盛科通信	6,221	379,978.68	0.01
267	002335	科华数据	8,900	379,852.00	0.01
268	600350	山东高速	35,600	379,496.00	0.01
269	600004	白云机场	41,400	376,740.00	0.01
270	600426	华鲁恒升	17,300	374,891.00	0.01
271	603009	北特科技	8,900	371,130.00	0.01
272	601222	林洋能源	64,500	367,650.00	0.01
273	300054	鼎龙股份	12,800	367,104.00	0.01
274	300986	志特新材	29,100	366,660.00	0.01
275	600435	北方导航	23,300	363,247.00	0.01

276	603198	迎驾贡酒	9,100	358,813.00	0.01
277	601928	凤凰传媒	32,100	358,557.00	0.01
278	002032	苏泊尔	6,800	356,252.00	0.01
279	002967	广电计量	20,200	355,318.00	0.01
280	600879	航天电子	33,300	348,651.00	0.01
281	600486	扬农化工	6,000	348,000.00	0.01
282	300718	长盛轴承	5,000	347,450.00	0.01
283	600406	国电南瑞	15,400	345,114.00	0.01
284	002351	漫步者	26,200	343,744.00	0.01
285	688800	瑞可达	6,982	343,514.40	0.01
286	002080	中材科技	17,500	341,250.00	0.01
287	600418	江淮汽车	8,400	336,756.00	0.01
288	301327	华宝新能	6,420	329,731.20	0.01
289	603927	中科软	17,000	328,780.00	0.01
290	002028	思源电气	4,500	328,095.00	0.01
291	603129	春风动力	1,500	324,750.00	0.01
292	002558	巨人网络	13,600	320,280.00	0.01
293	600233	圆通速递	24,700	318,383.00	0.01
294	600817	宇通重工	26,800	317,312.00	0.01
295	002281	光迅科技	6,400	315,648.00	0.01
296	600570	恒生电子	9,400	315,276.00	0.01
297	300627	华测导航	8,980	314,300.00	0.01
298	688200	华峰测控	2,165	312,193.00	0.01
299	002865	钧达股份	7,980	311,220.00	0.01
300	688362	甬矽电子	10,430	310,605.40	0.01
301	603730	岱美股份	54,200	308,398.00	0.01
302	688076	ST 诺泰	8,253	307,176.66	0.01
303	301550	斯菱股份	3,400	303,586.00	0.01
304	605296	神农集团	9,800	301,252.00	0.01
305	688326	经纬恒润	3,364	300,203.36	0.01
306	301498	乖宝宠物	2,700	295,299.00	0.01
307	688668	鼎通科技	4,701	293,624.46	0.01
308	301188	力诺药包	13,300	287,679.00	0.01
309	300628	亿联网络	8,200	285,032.00	0.01
310	300866	安克创新	2,500	284,000.00	0.01
311	601916	浙商银行	83,700	283,743.00	0.01
312	601330	绿色动力	36,800	281,152.00	0.01
313	600885	宏发股份	12,540	279,767.40	0.01
314	603297	永新光学	3,200	279,520.00	0.01
315	603281	江瀚新材	11,000	275,660.00	0.01
316	300019	硅宝科技	13,800	272,412.00	0.01

317	688563	航材股份	4,791	271,314.33	0.01
318	002327	富安娜	36,400	270,088.00	0.01
319	301035	润丰股份	4,500	267,030.00	0.01
320	600882	妙可蓝多	8,700	265,611.00	0.01
321	603277	银都股份	16,595	265,520.00	0.01
322	000729	燕京啤酒	20,000	258,600.00	0.01
323	301328	维峰电子	6,100	257,115.00	0.01
324	600918	中泰证券	39,800	255,914.00	0.01
325	600916	中国黄金	31,300	255,721.00	0.01
326	603501	豪威集团	2,000	255,300.00	0.01
327	601702	华峰铝业	16,000	254,240.00	0.01
328	001203	大中矿业	26,600	251,370.00	0.01
329	001308	康冠科技	10,900	246,558.00	0.01
330	601577	长沙银行	24,700	245,518.00	0.01
331	002920	德赛西威	2,400	245,112.00	0.01
332	688019	安集科技	1,563	237,263.40	0.01
333	688332	中科蓝讯	2,299	236,980.92	0.01
334	600655	豫园股份	42,200	234,210.00	0.01
335	002831	裕同科技	10,000	234,200.00	0.01
336	688428	诺诚健华	9,565	233,672.95	0.01
337	002507	涪陵榨菜	18,000	230,220.00	0.01
338	688023	安恒信息	4,041	229,286.34	0.01
339	688469	芯联集成	47,924	228,597.48	0.01
340	605099	共创草坪	6,800	228,412.00	0.01
341	688017	绿的谐波	1,765	220,430.85	0.01
342	601717	中创智领	13,100	217,722.00	0.01
343	600968	海油发展	52,400	213,792.00	0.01
344	688141	杰华特	6,496	211,639.68	0.01
345	688222	成都先导	13,140	211,291.20	0.01
346	601077	渝农商行	29,300	209,202.00	0.01
347	600710	苏美达	21,600	207,576.00	0.01
348	688052	纳芯微	1,185	206,770.65	0.01
349	600938	中国海油	7,800	203,658.00	0.01
350	300100	双林股份	4,300	202,444.00	0.01
351	688036	传音控股	2,530	201,641.00	0.01
352	688252	天德钰	8,224	200,501.12	0.01
353	603187	海容冷链	16,800	197,568.00	0.01
354	002563	森马服饰	37,100	195,146.00	0.01
355	002180	纳思达	8,500	194,990.00	0.01
356	002044	美年健康	37,500	192,750.00	0.01
357	688099	晶晨股份	2,698	191,584.98	0.01

358	603019	中科曙光	2,700	190,080.00	0.01
359	600845	宝信软件	7,900	186,598.00	0.01
360	002913	奥士康	6,300	185,283.00	0.01
361	600415	小商品城	8,900	184,052.00	0.01
362	002215	诺普信	17,800	183,874.00	0.01
363	002970	锐明技术	3,700	182,780.00	0.01
364	603486	科沃斯	3,100	180,513.00	0.01
365	600547	山东黄金	5,600	178,808.00	0.01
366	002609	捷顺科技	15,300	178,704.00	0.01
367	688508	芯朋微	3,192	178,177.44	0.01
368	300761	立华股份	9,400	176,626.00	0.01
369	002739	万达电影	15,400	176,022.00	0.01
370	001301	尚太科技	3,600	175,536.00	0.01
371	688303	大全能源	8,232	175,506.24	0.01
372	300662	科锐国际	5,900	175,289.00	0.01
373	688331	荣昌生物	2,847	172,243.50	0.01
374	688018	乐鑫科技	1,177	171,959.70	0.01
375	688188	柏楚电子	1,306	171,947.96	0.01
376	600597	光明乳业	20,100	169,041.00	0.01
377	000157	中联重科	23,000	166,290.00	0.00
378	002484	江海股份	7,500	153,675.00	0.00
379	002179	中航光电	3,800	153,368.00	0.00
380	600372	中航机载	12,600	151,956.00	0.00
381	688819	天能股份	5,458	151,514.08	0.00
382	001322	箭牌家居	17,900	151,255.00	0.00
383	000893	亚钾国际	5,000	150,700.00	0.00
384	600348	华阳股份	22,600	150,516.00	0.00
385	003031	中瓷电子	2,800	148,988.00	0.00
386	603601	再升科技	35,600	144,536.00	0.00
387	601128	常熟银行	19,440	143,272.80	0.00
388	601801	皖新传媒	20,100	137,283.00	0.00
389	600826	兰生股份	16,700	136,940.00	0.00
390	002756	永兴材料	4,300	136,525.00	0.00
391	601882	海天精工	7,000	133,700.00	0.00
392	601878	浙商证券	12,200	133,102.00	0.00
393	002790	瑞尔特	18,300	133,041.00	0.00
394	000657	中钨高新	11,200	132,832.00	0.00
395	002010	传化智联	23,800	132,804.00	0.00
396	605598	上海港湾	6,200	132,494.00	0.00
397	603848	好太太	8,600	132,440.00	0.00
398	301039	中集车辆	16,200	131,706.00	0.00

399	000685	中山公用	14,900	130,822.00	0.00
400	300012	华测检测	11,100	129,759.00	0.00
401	601098	中南传媒	9,500	124,640.00	0.00
402	000895	双汇发展	5,070	123,758.70	0.00
403	605090	九丰能源	4,700	121,307.00	0.00
404	601127	赛力斯	900	120,888.00	0.00
405	002601	龙佰集团	7,400	119,954.00	0.00
406	600499	科达制造	12,200	119,560.00	0.00
407	300832	新产业	2,100	119,112.00	0.00
408	688327	云从科技	8,617	118,828.43	0.00
409	600316	洪都航空	3,100	116,870.00	0.00
410	002120	韵达股份	17,200	115,240.00	0.00
411	301338	凯格精机	2,400	114,504.00	0.00
412	600166	福田汽车	42,200	114,362.00	0.00
413	601117	中国化学	14,700	112,749.00	0.00
414	300037	新宙邦	3,200	112,640.00	0.00
415	601311	骆驼股份	11,900	107,457.00	0.00
416	002138	顺络电子	3,800	106,856.00	0.00
417	002129	TCL 中环	13,400	102,912.00	0.00
418	688676	金盘科技	3,010	100,684.50	0.00
419	601231	环旭电子	6,600	96,558.00	0.00
420	002493	荣盛石化	11,400	94,392.00	0.00
421	601985	中国核电	10,100	94,132.00	0.00
422	002517	恺英网络	4,800	92,688.00	0.00
423	002690	美亚光电	5,400	91,098.00	0.00
424	603919	金徽酒	4,900	88,690.00	0.00
425	300590	移为通信	6,700	87,167.00	0.00
426	600380	健康元	7,900	87,137.00	0.00
427	688108	赛诺医疗	7,423	83,286.06	0.00
428	002294	信立泰	1,700	80,461.00	0.00
429	000800	一汽解放	10,400	71,344.00	0.00
430	002460	赣锋锂业	2,100	70,917.00	0.00
431	600438	通威股份	4,200	70,350.00	0.00
432	603661	恒林股份	2,400	68,640.00	0.00
433	600850	电科数字	2,800	67,732.00	0.00
434	688484	南芯科技	1,695	67,037.25	0.00
435	300058	蓝色光标	10,200	66,912.00	0.00
436	300768	迪普科技	3,900	66,885.00	0.00
437	605183	确成股份	3,800	66,500.00	0.00
438	603303	得邦照明	5,500	66,385.00	0.00
439	688156	路德环境	3,901	65,965.91	0.00

440	601628	中国人寿	1, 600	65, 904. 00	0. 00
441	002832	比音勒芬	4, 100	65, 805. 00	0. 00
442	000969	安泰科技	5, 100	65, 688. 00	0. 00
443	601186	中国铁建	8, 200	65, 682. 00	0. 00
444	002518	科士达	2, 900	65, 511. 00	0. 00
445	603868	飞科电器	1, 800	64, 566. 00	0. 00
446	002738	中矿资源	2, 000	64, 320. 00	0. 00
447	688025	杰普特	887	63, 420. 50	0. 00
448	688516	奥特维	1, 898	63, 089. 52	0. 00
449	600489	中金黄金	4, 300	62, 909. 00	0. 00
450	688102	斯瑞新材	4, 581	61, 751. 88	0. 00
451	688208	道通科技	2, 007	61, 414. 20	0. 00
452	603881	数据港	2, 400	61, 320. 00	0. 00
453	603035	常熟汽饰	4, 600	61, 180. 00	0. 00
454	300811	铂科新材	1, 300	60, 333. 00	0. 00
455	002284	亚太股份	5, 400	59, 670. 00	0. 00
456	600012	皖通高速	3, 500	59, 430. 00	0. 00
457	300652	雷迪克	1, 000	58, 890. 00	0. 00
458	300308	中际旭创	395	57, 614. 70	0. 00
459	605089	味知香	2, 300	57, 132. 00	0. 00
460	000848	承德露露	6, 100	55, 693. 00	0. 00
461	688408	中信博	1, 163	54, 288. 84	0. 00
462	002270	华明装备	3, 200	53, 568. 00	0. 00
463	600809	山西汾酒	300	52, 917. 00	0. 00
464	603309	维力医疗	4, 100	52, 152. 00	0. 00
465	002139	拓邦股份	3, 600	49, 716. 00	0. 00
466	688698	伟创电气	1, 051	49, 607. 20	0. 00
467	600820	隧道股份	8, 100	49, 410. 00	0. 00
468	688281	华秦科技	792	47, 923. 92	0. 00
469	600584	长电科技	1, 400	47, 166. 00	0. 00
470	688677	海泰新光	1, 205	47, 007. 05	0. 00
471	600085	同仁堂	1, 300	46, 878. 00	0. 00
472	600167	联美控股	8, 200	46, 084. 00	0. 00
473	002841	视源股份	1, 300	44, 980. 00	0. 00
474	689009	九号公司	716	42, 365. 72	0. 00
475	688009	中国通号	8, 066	41, 459. 24	0. 00
476	300014	亿纬锂能	900	41, 229. 00	0. 00
477	600436	片仔癀	200	40, 002. 00	0. 00
478	603298	杭叉集团	1, 800	37, 710. 00	0. 00
479	301368	丰立智能	600	37, 098. 00	0. 00
480	300413	芒果超媒	1, 700	37, 094. 00	0. 00

481	000726	鲁泰 A	5,700	36,138.00	0.00
482	002668	TCL 智家	3,500	34,195.00	0.00
483	688050	爱博医疗	451	31,051.35	0.00
484	603270	金帝股份	1,200	30,828.00	0.00
485	600060	海信视像	1,300	29,926.00	0.00
486	000738	航发控制	1,400	29,050.00	0.00
487	000928	中钢国际	4,500	28,260.00	0.00
488	601398	工商银行	3,700	28,083.00	0.00
489	000630	铜陵有色	8,400	28,056.00	0.00
490	000962	东方钽业	1,700	27,897.00	0.00
491	601377	兴业证券	4,500	27,855.00	0.00
492	300285	国瓷材料	1,600	27,760.00	0.00
493	002659	凯文教育	4,700	23,688.00	0.00
494	300919	中伟股份	700	23,016.00	0.00
495	300223	北京君正	300	20,760.00	0.00
496	600183	生益科技	600	18,090.00	0.00
497	002416	爱施德	1,400	16,828.00	0.00
498	600961	株冶集团	1,500	16,770.00	0.00
499	605198	安德利	400	16,124.00	0.00
500	001339	智微智能	300	14,499.00	0.00
501	600515	海南机场	4,000	14,160.00	0.00
502	600256	广汇能源	2,300	13,846.00	0.00
503	300115	长盈精密	500	10,700.00	0.00
504	600763	通策医疗	200	8,256.00	0.00
505	600998	九州通	1,500	7,710.00	0.00
506	600600	青岛啤酒	100	6,946.00	0.00
507	600029	南方航空	700	4,130.00	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	600519	贵州茅台	39,917,441.00	1.25
2	300750	宁德时代	39,286,364.00	1.23
3	600900	长江电力	33,134,964.00	1.04
4	600036	招商银行	28,432,752.00	0.89
5	601318	中国平安	26,705,420.96	0.83
6	002594	比亚迪	25,942,911.13	0.81
7	000333	美的集团	24,840,260.06	0.78
8	601899	紫金矿业	23,860,560.00	0.75

9	000651	格力电器	23,849,157.89	0.75
10	600276	恒瑞医药	22,974,991.40	0.72
11	603259	药明康德	21,865,671.00	0.68
12	002230	科大讯飞	21,436,886.00	0.67
13	000725	京东方A	21,285,173.00	0.66
14	601166	兴业银行	20,401,052.00	0.64
15	600941	中国移动	19,497,102.00	0.61
16	300502	新易盛	18,398,614.74	0.57
17	000776	广发证券	18,210,685.00	0.57
18	600919	江苏银行	17,434,958.00	0.54
19	002352	顺丰控股	16,967,295.79	0.53
20	600887	伊利股份	16,884,735.00	0.53

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	300750	宁德时代	40,963,620.00	1.28
2	600519	贵州茅台	37,857,491.00	1.18
3	600036	招商银行	32,502,760.00	1.02
4	002594	比亚迪	32,049,170.00	1.00
5	600900	长江电力	30,550,658.52	0.95
6	000651	格力电器	28,040,323.00	0.88
7	000333	美的集团	25,260,414.49	0.79
8	601318	中国平安	23,969,533.00	0.75
9	600276	恒瑞医药	23,844,920.00	0.74
10	600887	伊利股份	21,427,546.00	0.67
11	600941	中国移动	20,540,223.00	0.64
12	601899	紫金矿业	20,505,811.00	0.64
13	000725	京东方A	20,045,860.00	0.63
14	601728	中国电信	19,744,494.00	0.62
15	601169	北京银行	18,765,563.02	0.59
16	002475	立讯精密	18,525,330.00	0.58
17	000858	五粮液	18,409,376.00	0.58
18	601166	兴业银行	17,107,034.00	0.53
19	600015	华夏银行	16,706,284.80	0.52
20	603259	药明康德	16,515,675.00	0.52

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	3,045,680,088.34
卖出股票收入（成交）总额	2,978,256,070.34

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	566,550,109.50	16.99
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,099,583,123.00	32.98
	其中：政策性金融债	404,543,810.97	12.13
4	企业债券	492,365,704.13	14.77
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	688,708,565.53	20.66
8	同业存单	—	—
9	其他	30,789,606.56	0.92
10	合计	2,877,997,108.72	86.33

### 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	2500002	25 超长特别国债 02	1,900,000	191,470,890.71	5.74
2	282480011	24 平安人寿永续债 01	1,700,000	172,475,684.38	5.17
3	200219	20 国开 19	1,300,000	133,907,728.77	4.02
4	250002	25 附息国债 02	1,200,000	121,122,895.03	3.63
5	019766	25 国债 01	1,050,000	105,462,776.72	3.16

### 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，江西省交通投资集团有限责任公司在报告编制日前一年内曾受到泰和县自然资源局的处罚。

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	395,350.44
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	709.24
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	396,059.68

### 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	113641	华友转债	18,621,724.32	0.56
2	113632	鹤 21 转债	18,548,569.07	0.56
3	127020	中金转债	18,485,406.64	0.55
4	127049	希望转 2	18,452,904.92	0.55
5	113058	友发转债	18,295,184.22	0.55
6	113062	常银转债	18,089,112.33	0.54

7	110093	神马转债	18, 073, 693. 76	0.54
8	113056	重银转债	17, 907, 941. 06	0.54
9	110081	闻泰转债	17, 334, 289. 79	0.52
10	113042	上银转债	17, 148, 078. 77	0.51
11	123247	万凯转债	17, 097, 086. 64	0.51
12	113052	兴业转债	16, 920, 885. 61	0.51
13	127040	国泰转债	16, 758, 398. 91	0.50
14	123119	康泰转 2	16, 635, 887. 83	0.50
15	113647	禾丰转债	16, 300, 950. 64	0.49
16	113605	大参转债	15, 620, 075. 76	0.47
17	111010	立昂转债	15, 550, 986. 73	0.47
18	127103	东南转债	15, 038, 645. 13	0.45
19	118031	天 23 转债	14, 758, 096. 56	0.44
20	127086	恒邦转债	14, 640, 595. 33	0.44
21	110082	宏发转债	14, 168, 750. 74	0.42
22	113054	绿动转债	14, 071, 202. 93	0.42
23	110086	精工转债	13, 373, 178. 94	0.40
24	118038	金宏转债	13, 215, 695. 77	0.40
25	111018	华康转债	12, 615, 483. 76	0.38
26	123212	立中转债	12, 079, 262. 88	0.36
27	127022	恒逸转债	11, 243, 204. 88	0.34
28	123120	隆华转债	10, 952, 126. 83	0.33
29	113631	皖天转债	10, 548, 505. 59	0.32
30	123161	强联转债	10, 416, 502. 78	0.31
31	111007	永和转债	10, 053, 708. 62	0.30
32	118013	道通转债	9, 734, 050. 42	0.29
33	113661	福 22 转债	9, 291, 479. 74	0.28
34	113065	齐鲁转债	8, 970, 578. 60	0.27
35	113606	荣泰转债	8, 850, 172. 01	0.27
36	123113	仙乐转债	8, 441, 323. 80	0.25
37	113627	太平转债	8, 434, 016. 91	0.25
38	127052	西子转债	8, 302, 953. 56	0.25

39	127105	龙星转债	7,939,349.02	0.24
40	118041	星球转债	7,746,195.03	0.23
41	123178	花园转债	7,527,435.39	0.23
42	128132	交建转债	7,421,599.58	0.22
43	127041	弘亚转债	7,358,345.75	0.22
44	127082	亚科转债	7,267,069.57	0.22
45	128141	旺能转债	7,087,232.55	0.21
46	113068	金铜转债	7,063,212.56	0.21
47	113667	春23转债	6,966,908.29	0.21
48	123236	家联转债	6,816,848.93	0.20
49	127018	本钢转债	6,793,773.50	0.20
50	113037	紫银转债	6,751,465.18	0.20
51	123063	大禹转债	6,457,559.02	0.19
52	113663	新化转债	6,352,777.94	0.19
53	113625	江山转债	6,340,652.86	0.19
54	127024	盈峰转债	5,812,223.14	0.17
55	123249	英搏转债	5,077,868.87	0.15
56	123149	通裕转债	5,039,418.20	0.15
57	127067	恒逸转2	5,036,865.69	0.15
58	111017	蓝天转债	3,915,630.36	0.12
59	123145	药石转债	3,482,119.92	0.10
60	111014	李子转债	3,072,320.50	0.09
61	128105	长集转债	2,851,565.59	0.09
62	113584	家悦转债	2,809,024.93	0.08
63	127089	晶澳转债	2,097,078.17	0.06
64	123107	温氏转债	2,021,889.75	0.06
65	113656	嘉诚转债	1,814,938.61	0.05
66	123186	志特转债	1,747,297.38	0.05
67	128095	恩捷转债	1,665,084.58	0.05
68	127054	双箭转债	244,000.55	0.01
69	128131	崇达转2	196,968.66	0.01
70	110060	天路转债	141,520.48	0.00

---

71	123215	铭利转债	125,023.84	0.00
72	127026	超声转债	88,195.32	0.00
73	127045	牧原转债	70,382.43	0.00
74	127030	盛虹转债	67,799.83	0.00
75	111005	富春转债	65,855.84	0.00
76	127064	杭氧转债	61,144.60	0.00
77	113658	密卫转债	56,617.37	0.00
78	113563	柳药转债	49,300.95	0.00
79	113648	巨星转债	20,197.75	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 (%)
富国宝利增强债券 A	2,069	711,033.07	1,462,067, 555.80	99.38	9,059,871 .00	0.62
富国宝利增强债券 E	83	12,281,626. 85	1,019,268, 861.09	99.99	106,167.2 5	0.01
合计	2,152	1,157,296.6 8	2,481,336, 416.89	99.63	9,166,038 .25	0.37

### 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	富国宝利增强债券 A	110,349.59	0.0075
	富国宝利增强债券 E	0.75	0.0000
	合计	110,350.34	0.0044

### 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	富国宝利增强债券 A	0
	富国宝利增强债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理 持有本开放式基 金	富国宝利增强债券 A	10~50
	富国宝利增强债券 E	0
	合计	10~50

### 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	10,000,000.00	0.40	10,000,000.00	0.40	3 年
基金管理人高级管理人	—	—	—	—	—

---

员					
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,000,000.00	0.40	10,000,000.00	0.40	3 年

注：截至 2021 年 2 月 8 日，本基金的基金合同生效届满 3 年。

---

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国宝利增强债券 A	富国宝利增强债券 E
基金合同生效日(2018 年 02 月 08 日) 基金份额总额	73,996,883.34	—
报告期期初基金份额总额	1,431,540,361.73	995,661,736.68
本报告期基金总申购份额	1,152,730,512.67	2,596,661,029.26
减：本报告期基金总赎回份额	1,113,143,447.60	2,572,947,737.60
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,471,127,426.80	1,019,375,028.34

---

## § 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。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

### 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 (%)	
渤海证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	3	—	—	—	—	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
东财证券	2	—	—	—	—	—
方正证券	2	52,734,504.00	0.88	21,405.03	0.88	—
高盛中国	1	—	—	—	—	—
光大证券	2	40,548,470.81	0.67	16,459.45	0.67	—
广发证券	2	—	—	—	—	—
国海证券	2	1,245,891,216 .92	20.68	505,709.27	20.68	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通	4	674,164,743.3 0	11.19	273,643.72	11.19	—
国泰君安	2	374,428,064.3 8	6.22	151,981.11	6.22	—
国投证券	2	162,979,263.5 3	2.71	66,156.17	2.71	—
国信证券	2	115,439,763.1 2	1.92	46,856.41	1.92	—
海通证券	2	343,868,716.1 7	5.71	139,577.45	5.71	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—
华源证券	2	350,470,804.5 4	5.82	142,257.28	5.82	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	331,748,076.8 6	5.51	134,658.58	5.51	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	1,047,266,706 .45	17.39	425,086.76	17.39	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	740,056,274.2 8	12.29	300,390.27	12.29	—

西南证券	2	—	—	—	—	—
湘财证券	2	—	—	—	—	—
信达证券	2	13,814,251.67	0.23	5,607.30	0.23	—
兴业证券	1	371,320,493.95	6.16	150,716.38	6.16	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
中航证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
中泰证券	2	159,204,808.70	2.64	64,621.27	2.64	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中信证券	3	—	—	—	—	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

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：华源证券（019189、63156）。

2、国泰海通证券有限公司（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（%）
渤海证券	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东财证券	67,835,423.60	1.41	314,600,000.00	0.79	—	—
方正证券	4,540,116.00	0.09	25,000,000.00	0.06	—	—
高盛中国	—	—	—	—	—	—

光大证券	5,236,885.44	0.11	110,000,000.00	0.28	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	970,243,705.38	20.21	7,994,600,000.00	20.07	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰海通	566,481,333.25	11.80	7,109,274,000.00	17.84	—	—
国泰君安	269,710,299.29	5.62	1,699,500,000.00	4.27	—	—
国投证券	77,279,113.52	1.61	668,300,000.00	1.68	—	—
国信证券	106,003,418.60	2.21	811,300,000.00	2.04	—	—
海通证券	479,801,574.15	10.00	1,196,600,000.00	3.00	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
华源证券	289,840,105.69	6.04	2,233,500,000.00	5.61	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	85,938,909.34	1.79	421,900,000.00	1.06	—	—
上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	655,829,051.55	13.66	6,358,900,000.00	15.96	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	679,255,987.65	14.15	5,666,210,000.00	14.22	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	9,846,794.34	0.21	150,000,000.00	0.38	—	—
兴业证券	290,276,397.22	6.05	4,374,250,000.00	10.98	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中航证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中泰证券	241,791,094.47	5.04	705,600,000.00	1.77	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—

---

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

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

### 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宝利增强债券型发起式证券投资基金的文件 2、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金合同 3、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	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> 。