

富国宝利增强债券型发起式证券投资基金

二〇二三年中期报告

2023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：2023年08月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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	8
§4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6	中期财务报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	17
6.3	净资产（基金净值）变动表	18
6.4	报表附注	20
§7	投资组合报告	43
7.1	期末基金资产组合情况	43

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	56
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	56
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	56
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	56
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	56
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12	投资组合报告附注.....	57
§8	基金份额持有人信息.....	62
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	62
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况.....	62
§9	开放式基金份额变动.....	63
§10	重大事件揭示.....	64
10.1	基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4	基金投资策略的改变.....	64
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8	其他重大事件.....	68
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	69
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.....	69
§12	备查文件目录.....	70

§ 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
交易代码	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	4,878,639,177.88份
基金合同存续期	不定期

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	021-60637103
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95105686、4008880688	021-60637228
传真		021-20361616	021-60635778
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		裴长江	田国立

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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年01月01日至2023年06月30日)
本期已实现收益	-4,499,048.87
本期利润	119,404,691.14
加权平均基金份额本期利润	0.0204
本期加权平均净值利润率	1.65%
本期基金份额净值增长率	1.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年06月30日)
期末可供分配利润	1,109,451,372.08
期末可供分配基金份额利润	0.2274
期末基金资产净值	6,049,637,364.92
期末基金份额净值	1.2400
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	28.01%

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.65%	0.20%	0.28%	0.09%	0.37%	0.11%
过去三个月	0.15%	0.20%	0.33%	0.08%	-0.18%	0.12%
过去六个月	1.58%	0.20%	1.06%	0.08%	0.52%	0.12%
过去一年	-2.12%	0.24%	-0.23%	0.10%	-1.89%	0.14%
过去三年	12.37%	0.30%	2.35%	0.12%	10.02%	0.18%

自基金合同生效起至今	28.01%	0.28%	9.35%	0.13%	18.66%	0.15%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

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



注：1、截止日期为 2023 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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月，加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省金融资产管理股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

截至 2023 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 304 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	—	10	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；现任富国基金量化投资部定量基金经

					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；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国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，以为投资者减少和分散风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公

平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现 17 次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾今年上半年，随着疫情防控放开所带来的增长动能褪去，而政策端整体趋于保守，国内主要经济增长指标出现了回落，伴随这一过程的是国内风险资产价格的同步回落，宽基指数多数回落到年初附近水平。不过市场结构性机会涌现，在 ChatGPT 这一划时代工具的诞生之下，催生出了人工智能领域巨大的机会，相应板块出了显著的上涨；中特估概念在高股息和估值修复逻辑的带动下也显著走强。债券市场方面，由于央行在上半年采取了较为积极的货币政策态度，运用了降准降息等工具降低社会融资成本，带动市场利率明显回落，债市基本修复了由去年底理财赎回潮所导致的调整幅度。横向来看，债券市场是上半年国内乏善可陈的投资机会当中的一抹亮色。

海外方面，美国经济增长韧性显著强于预期，美联储的加息节奏也强于市场

在年初的计价，市场持续上修对利率的预期路径。美股在基本面和人工智能主题机会等的支撑下也录得较强表现。国内外经济增长力量的变化使得国内汇率走低，美元兑人民币回升到相对高位。

在组合管理方面，权益仓位继续维持指数增强的策略配置，尽管在 TMT 行情的扰动下，超额收益有所波动，但上半年整体还是录得了正向的超额收益；可转债仓位在积极的策略调整之下表现稳健，为组合增厚了一定的收益；而纯债仓位维持流动性管理和趋势性交易。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.24 元；份额累计净值为 1.28 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 1.58%，同期业绩比较基准收益率为 1.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

纵向来看，国内股市已经经历了较长时间的调整，估值水平重新回落到历史低位，对悲观情绪的计价已经非常充分，进一步下探的空间非常有限。随着 7 月份政治局会议上一系列重新定调，市场悲观预期有望得到扭转，政策的后置加码也有望推动经济增长企稳，指数有望从当前底部位置逐步修复。一旦风险偏好回升，债券市场或迎来一定扰动，但经济的修复势必面临波折，仍然需要金融条件的充分宽松，较低的债券利率仍然是修复的必要条件，债券市场也仍然有配置的意义。

于组合层面而言，权益仓位将继续维持指数增强的策略配置，可转债仓位将维持积极参与，以一定程度增加组合的弹性，纯债仓位继续维持流动性管理和趋势性交易。

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国宝利增强债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2023年06月 30日	上年度末 2022年12月31 日
资 产：		
银行存款	57,363,769.95	750,641.10
结算备付金	38,332,714.86	28,121,342.95
存出保证金	380,446.04	296,039.00
交易性金融资产	6,532,413,265.88	7,709,089,679.29
其中：股票投资	1,205,635,993.09	1,437,471,417.06
基金投资	—	—
债券投资	5,326,777,272.79	6,271,618,262.23
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	33,397,268.93	68,794,703.56
应收清算款	51,796,318.92	125,651,422.55
应收股利	—	—
应收申购款	4,310,792.53	15,734,840.56
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	6,717,994,577.11	7,948,438,669.01
负债和净资产	本期末 2023年06月 30日	上年度末 2022年12月31 日
负 债：		
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	559,838,559.56	190,043,561.64
应付清算款	104,172,251.18	16,928,947.52
应付赎回款	16,414.79	385,076,785.81
应付管理人报酬	1,959,411.42	2,633,115.83
应付托管费	489,852.86	658,278.95

应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—
应交税费	112,305.78	122,326.36
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	1,768,416.60	848,645.63
负债合计	668,357,212.19	596,311,661.74
净资产：		
实收基金	4,878,639,177.88	6,022,680,595.05
其他综合收益	—	—
未分配利润	1,170,998,187.04	1,329,446,412.22
净资产合计	6,049,637,364.92	7,352,127,007.27
负债和净资产总计	6,717,994,577.11	7,948,438,669.01

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2400 元，基金份额总额 4,878,639,177.88 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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	145,119,357.09	45,719,830.54
1.利息收入	1,106,344.69	846,767.70
其中：存款利息收入	553,490.00	494,896.34
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	552,854.69	351,871.36
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	19,703,526.75	-37,037,890.75
其中：股票投资收益	-51,653,935.80	-66,098,075.27
基金投资收益	—	—
债券投资收益	56,857,699.81	17,329,537.28
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	14,499,762.74	11,730,647.24
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）	123,903,740.01	81,798,028.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	405,745.64	112,925.05
减：二、营业总支出	25,714,665.95	12,819,306.13
1. 管理人报酬	14,433,048.42	8,311,887.13
2. 托管费	3,608,262.13	2,077,971.80
3. 销售服务费	—	—
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	7,470,844.28	2,280,863.29
其中：卖出回购金融资产支出	7,470,844.28	2,280,863.29
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	84,770.27	42,571.90
8. 其他费用	117,740.85	106,012.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	119,404,691.14	32,900,524.41
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	119,404,691.14	32,900,524.41
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	119,404,691.14	32,900,524.41

6.3 净资产（基金净值）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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2023年01月01日至2023年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	6,022,680,595.05	1,329,446,412.22	7,352,127,007.27
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	6,022,680,595.05	1,329,446,412.22	7,352,127,007.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	—	-158,448,225.18	—
（一）、综合收益总额	1,144,041,417.17	119,404,691.14	1,302,489,642.35
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	—	-277,852,916.32	—
	1,144,041,417.17		1,421,894,333.49

其中：1. 基金申购款	3,159,121,515.82	751,823,304.60	3,910,944,820.42
2. 基金赎回款	-	-	-
	4,303,162,932.99	1,029,676,220.92	5,332,839,153.91
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	4,878,639,177.88	1,170,998,187.04	6,049,637,364.92
项目	上年度可比期间 (2022年01月01日至2022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(基金净值)	1,160,578,047.46	356,277,302.07	1,516,855,349.53
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,160,578,047.46	356,277,302.07	1,516,855,349.53
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,325,662,737.63	840,511,027.71	4,166,173,765.34
(一)、综合收益总额	-	32,900,524.41	32,900,524.41
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	3,325,662,737.63	947,562,565.53	4,273,225,303.16
其中：1.基金申购款	4,683,116,907.79	1,272,101,375.87	5,955,218,283.66
2.基金赎回款	-	-324,538,810.34	-
	1,357,454,170.16		1,681,992,980.50
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-139,952,062.23	-139,952,062.23
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	4,486,240,785.09	1,196,788,329.78	5,683,029,114.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人 基金管理人 基金管理人

基金管理人 基金管理人 基金管理人

基金管理人 基金管理人 基金管理人

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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‰；

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

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

2 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照

相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育费附加。

4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个

人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 (2023年06月30日)
活期存款	57,363,769.95
等于：本金	57,361,273.81
加：应计利息	2,496.14
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	57,363,769.95

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（2023年06月30日）				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,246,887,93 8.58	—	1,205,635,99 3.09	— 41,251,945.4 9	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	2,053,858,78 9.03	17,360,935.5 0	2,071,590,05 8.47	370,333.94
	银行间市场	3,199,502,81 6.13	39,338,214.3 2	3,255,187,21 4.32	16,346,183.8 7
	合计	5,253,361,60 5.16	56,699,149.8 2	5,326,777,27 2.79	16,716,517.8 1
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	

合计	6,500,249,54 3.74	56,699,149.8 2	6,532,413,26 5.88	24,535,427.6 8	-
----	----------------------	-------------------	----------------------	-------------------	---

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（2023年06月30日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	33,397,268.93	—
银行间市场	—	—
合计	33,397,268.93	—

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（2023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	1,616,184.12
其中：交易所市场	1,611,709.12
银行间市场	4,475.00
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	92,232.48
合计	1,768,416.60

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,022,680,595.05	6,022,680,595.05
本期申购	3,159,121,515.82	3,159,121,515.82

本期赎回（以“-”号填列）	-4,303,162,932.99	-4,303,162,932.99
本期末	4,878,639,177.88	4,878,639,177.88

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

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
本期期初	1,372,324,862.79	-42,878,450.57	1,329,446,412.22
本期利润	-4,499,048.87	123,903,740.01	119,404,691.14
本期基金份额交易产生的变动数	-258,374,441.84	-19,478,474.48	-277,852,916.32
其中：基金申购款	718,904,425.94	32,918,878.66	751,823,304.60
基金赎回款	-977,278,867.78	-52,397,353.14	-1,029,676,220.92
本期已分配利润	—	—	—
本期末	1,109,451,372.08	61,546,814.96	1,170,998,187.04

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
活期存款利息收入	123,063.60
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	312,513.52
其他	117,912.88
合计	553,490.00

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
卖出股票成交总额	3,045,738,658.86
减：卖出股票成本总额	3,089,681,747.26
减：交易费用	7,710,847.40
买卖股票差价收入	-51,653,935.80

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（2023年01月01日至2023年06月30日）
债券投资收益——利息收入	64,536,808.57
债券投资收益——买卖债券（债转	-7,679,108.76

股及债券到期兑付) 差价收入	
合计	56,857,699.81

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（2023年01月01日至2023年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,000,345,387.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,933,780,825.83
减：应计利息总额	73,997,799.34
减：交易费用	245,871.34
债券投资收益-差价收入	-7,679,108.76

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（2023年01月01日至2023年06月30日）
股票投资产生的股利收益	14,499,762.74
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	14,499,762.74

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
1. 交易性金融资产	123,903,740.01

股票投资	71,734,779.37
债券投资	52,168,960.64
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	123,903,740.01

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
基金赎回费收入	391,713.40
基金转换费收入	14,032.24
合计	405,745.64

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（2023年01月01日至2023年06月30日）
审计费用	32,232.48
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	6,908.37
债券账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	117,740.85

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构、基金发起人
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东
中国建设银行股份有限公司	基金托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	500,131,882.21	8.58	380,541,295.78	15.78
申万宏源	430,714,992.50	7.39	429,761,498.82	17.82

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（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022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（%）
海通证券	1,089,041,852.73	20.32	605,654,246.43	17.56

申万宏源	343,285,016.77	6.41	427,613,318.24	12.39
------	----------------	------	----------------	-------

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（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
海通证券	8,483,200,000.00	20.14	2,245,900,000.00	17.35
申万宏源	1,000,900,000.00	2.38	1,038,700,000.00	8.02

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（2023年01月01日至2023年06月30日）			
	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	360,750.55	8.58	360,750.55	22.38
申万宏源	310,675.86	7.39	310,675.86	19.28
关联方名称	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）			
	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（%）
申万宏源	393,571.63	17.86	297,238.72	28.04
海通证券	347,586.90	15.77	181,355.84	17.11

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

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（2023年01月01日至2023年06月30日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	14,433,048.42	8,311,887.13
其中：支付销售机构的客户维护费	481,370.66	262,835.94

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（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	3,608,262.13	2,077,971.80

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。

6.4.10.3 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）
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	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	—	—
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金总份额比例	0.20%	0.22%

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

份额单位：份

关联方名称	本期末（2023年06月30日）		上年度末（2022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（%）
申万宏源证券有限公司	40,396,703.56	0.83	—	—

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方上年度末未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）

	月 30 日)		2022 年 06 月 30 日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	57,363,769.95	123,063.60	8,339,887.11	128,281.94

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 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 2023 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 559,838,559.56 元，于 2023 年 7 月 6 日、2023 年 7 月 7 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末（2023年06月30日）	上年度末（2022年12月31日）
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	1,316,854,205.45	1,576,072,669.58
合计	1,316,854,205.45	1,576,072,669.58

注：本表主要列示短期融资券和超短期融资券，债券评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券列示超短期融资券。

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（2023年06月30日）	上年度末（2022年12月31日）
AAA	1,217,558,750.65	998,810,314.57
AAA以下	640,328,982.45	436,636,004.00
未评级	245,988,490.41	40,627,126.03
合计	2,103,876,223.51	1,476,073,444.60

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个工作日内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银行存款、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（2023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							
银行存款	57,363,769.95	—	—	—	—	—	57,363,769.95
结算备付金	38,332,714.86	—	—	—	—	—	38,332,714.86
存出保证金	380,446.04	—	—	—	—	—	380,446.04
交易性金融资产	1,574,139,470.80	316,025,937.41	2,059,755,690.22	713,059,058.19	663,797,116.17	1,205,635,993.09	6,532,413,265.88
买入返售金融资产	33,397,268.93	—	—	—	—	—	33,397,268.93
应收清算款	—	—	—	—	—	51,796,318.92	51,796,318.92
应收申购款	—	—	—	—	—	4,310,792.53	4,310,792.53
资产总计	1,703,613,670.58	316,025,937.41	2,059,755,690.22	713,059,058.19	663,797,116.17	1,261,743,104.54	6,717,994,577.11
负债							
卖出回购金融资产款	559,838,559.56	—	—	—	—	—	559,838,559.56
应付清算款	—	—	—	—	—	104,172,251.18	104,172,251.18
应付赎回款	—	—	—	—	—	16,414.79	16,414.79
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,959,411.42	1,959,411.42
应付托管费	—	—	—	—	—	489,852.86	489,852.86
应交税费	—	—	—	—	—	112,305.78	112,305.78
其他负债	—	—	—	—	—	1,768,416.60	1,768,416.60
负债总计	559,838,559.56	—	—	—	—	108,518,652.63	668,357,212.19
利率敏感度缺口	1,143,775,111.02	316,025,937.41	2,059,755,690.22	713,059,058.19	663,797,116.17	1,153,224,451.91	6,049,637,364.92
上年度末（2022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							
银行存款	750,641.10	—	—	—	—	—	750,641.10
结算备付金	28,121,342.95	—	—	—	—	—	28,121,342.95
存出保证金	296,039.00	—	—	—	—	—	296,039.00
交易性金融资产	1,649,006,946.97	457,679,817.31	3,593,717,260.28	571,214,237.67	—	1,437,471,417.06	7,709,089,679.29
买入返售金融资产	68,794,703.56	—	—	—	—	—	68,794,703.56
应收清算款	—	—	—	—	—	125,651,422.55	125,651,422.55
应收申购款	—	—	—	—	—	15,734,840.56	15,734,840.56
资产总计	1,746,969,673.58	457,679,817.31	3,593,717,260.28	571,214,237.67	—	1,578,857,680.17	7,948,438,669.01
负债							
卖出回购金融资产款	190,043,561.64	—	—	—	—	—	190,043,561.64
应付清算款	—	—	—	—	—	16,928,947.52	16,928,947.52
应付赎回款	—	—	—	—	—	385,076,785.81	385,076,785.81
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,633,115.83	2,633,115.83
应付托管费	—	—	—	—	—	658,278.95	658,278.95
应交税费	—	—	—	—	—	122,326.36	122,326.36
其他负债	—	—	—	—	—	848,645.63	848,645.63
负债总计	190,043,561.64	—	—	—	—	406,268,100.10	596,311,661.74
利率敏感度缺口	1,556,926,111.94	457,679,817.31	3,593,717,260.28	571,214,237.67	—	1,172,589,580.07	7,352,127,007.27

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。		
	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（2023年06月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	1. 基准点利率增加 0.1%	-9,022,378.21	-2,929,789.36
	2. 基准点利率减少 0.1%	9,022,378.21	2,929,789.36

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（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（2023 年 06 月 30 日）		上年度末（2022 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	1,205,635,993.09	19.93	1,437,471,417.06	19.55
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	5,326,777,272.79	88.05	6,271,618,262.23	85.30
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	6,532,413,265.88	107.98	7,709,089,679.29	104.86

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。		
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（2023 年 06 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 市场基准增加 1%	14,028,664.90	17,217,192.64

	2. 市场基准减少 1%	-14, 028, 664. 90	-17, 217, 192. 64
--	--------------	-------------------	-------------------

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 (2023年06月30日)	上年度末 (2022年12月31日)
第一层次	2, 212, 342, 341. 15	2, 317, 975, 523. 11
第二层次	4, 320, 070, 924. 73	5, 391, 114, 156. 18
第三层次	—	—
合计	6, 532, 413, 265. 88	7, 709, 089, 679. 29

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	1,205,635,993.09	17.95
	其中：股票	1,205,635,993.09	17.95
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	5,326,777,272.79	79.29
	其中：债券	5,326,777,272.79	79.29
	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	33,397,268.93	0.50
	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	95,696,484.81	1.42
8	其他各项资产	56,487,557.49	0.84
9	合计	6,717,994,577.11	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	—	—
B	采矿业	39,002,327.76	0.64
C	制造业	740,942,361.88	12.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,305,998.00	0.35
E	建筑业	33,355,691.91	0.55
F	批发和零售业	14,812,562.78	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	32,993,551.25	0.55
H	住宿和餐饮业	713,495.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	75,095,696.28	1.24
J	金融业	221,237,082.69	3.66
K	房地产业	2,529,204.00	0.04
L	租赁和商务服务业	8,406,264.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	878,735.66	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	1,582,941.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	1,027,512.00	0.02
Q	卫生和社会工作	3,472,504.35	0.06
R	文化、体育和娱乐业	8,280,064.53	0.14
S	综合	—	—
	合计	1,205,635,993.09	19.93

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	37,049	62,649,859.00	1.04
2	300750	宁德时代	114,887	26,284,996.73	0.43
3	601318	中国平安	506,335	23,493,944.00	0.39
4	000858	五粮液	141,300	23,112,441.00	0.38
5	000651	格力电器	568,702	20,763,310.02	0.34
6	000725	京东方A	5,067,249	20,725,048.41	0.34
7	000333	美的集团	320,100	18,860,292.00	0.31
8	601766	中国中车	2,571,400	16,714,100.00	0.28
9	600276	恒瑞医药	322,245	15,435,535.50	0.26
10	600690	海尔智家	651,600	15,299,568.00	0.25
11	601012	隆基绿能	533,021	15,281,712.07	0.25
12	000338	潍柴动力	1,196,200	14,904,652.00	0.25
13	603993	洛阳钼业	2,650,524	14,127,292.92	0.23
14	000538	云南白药	265,962	13,957,685.76	0.23
15	601319	中国人保	2,189,800	12,788,432.00	0.21
16	600919	江苏银行	1,716,828	12,618,685.80	0.21
17	600406	国电南瑞	534,300	12,342,330.00	0.20
18	601818	光大银行	3,878,400	11,906,688.00	0.20
19	002736	国信证券	1,304,100	11,384,793.00	0.19
20	600016	民生银行	3,017,600	11,316,000.00	0.19
21	600036	招商银行	334,000	10,941,840.00	0.18
22	601668	中国建筑	1,897,556	10,891,971.44	0.18
23	600104	上汽集团	768,531	10,890,084.27	0.18
24	601600	中国铝业	1,958,600	10,752,714.00	0.18
25	601169	北京银行	2,308,000	10,686,040.00	0.18
26	002600	领益智造	1,529,050	10,565,735.50	0.17
27	300760	迈瑞医疗	35,100	10,522,980.00	0.17
28	601006	大秦铁路	1,412,300	10,493,389.00	0.17
29	601229	上海银行	1,788,760	10,285,370.00	0.17
30	002304	洋河股份	77,900	10,232,165.00	0.17
31	600015	华夏银行	1,813,553	9,811,321.73	0.16
32	600018	上港集团	1,861,891	9,774,927.75	0.16

33	000063	中兴通讯	214,200	9,754,668.00	0.16
34	600885	宏发股份	296,428	9,441,231.80	0.16
35	300124	汇川技术	146,050	9,377,870.50	0.16
36	601607	上海医药	417,600	9,358,416.00	0.15
37	688981	中芯国际	176,784	8,931,127.68	0.15
38	601877	正泰电器	317,700	8,784,405.00	0.15
39	600999	招商证券	621,500	8,433,755.00	0.14
40	002027	分众传媒	1,234,400	8,406,264.00	0.14
41	600031	三一重工	492,100	8,183,623.00	0.14
42	000001	平安银行	722,902	8,118,189.46	0.13
43	688396	华润微	154,614	8,103,319.74	0.13
44	300433	蓝思科技	686,300	8,070,888.00	0.13
45	601328	交通银行	1,384,500	8,030,100.00	0.13
46	600050	中国联通	1,670,900	8,020,320.00	0.13
47	600436	片仔癀	27,419	7,851,704.84	0.13
48	000895	双汇发展	307,600	7,533,124.00	0.12
49	600741	华域汽车	407,037	7,513,903.02	0.12
50	600887	伊利股份	261,001	7,391,548.32	0.12
51	601618	中国中冶	1,846,929	7,332,308.13	0.12
52	002594	比亚迪	28,100	7,257,387.00	0.12
53	601728	中国电信	1,286,100	7,240,743.00	0.12
54	688819	天能股份	193,221	7,118,261.64	0.12
55	601398	工商银行	1,464,500	7,058,890.00	0.12
56	300059	东方财富	476,860	6,771,412.00	0.11
57	600039	四川路桥	683,514	6,705,272.34	0.11
58	002230	科大讯飞	98,600	6,700,856.00	0.11
59	002938	鹏鼎控股	266,100	6,463,569.00	0.11
60	601166	兴业银行	395,300	6,186,445.00	0.10
61	600884	杉杉股份	407,100	6,163,494.00	0.10
62	601088	中国神华	195,500	6,011,625.00	0.10
63	600030	中信证券	294,415	5,823,528.70	0.10
64	601601	中国太保	222,400	5,777,952.00	0.10
65	600941	中国移动	59,600	5,560,680.00	0.09
66	600219	南山铝业	1,796,500	5,425,430.00	0.09
67	600580	卧龙电驱	367,100	5,363,331.00	0.09
68	000596	古井贡酒	21,600	5,343,408.00	0.09
69	600362	江西铜业	272,600	5,173,948.00	0.09
70	603369	今世缘	97,300	5,137,440.00	0.08
71	600438	通威股份	148,300	5,088,173.00	0.08
72	601138	工业富联	201,500	5,077,800.00	0.08
73	688009	中国通号	851,449	4,938,404.20	0.08

74	002202	金风科技	458,100	4,865,022.00	0.08
75	000555	神州信息	393,400	4,838,820.00	0.08
76	300014	亿纬锂能	79,100	4,785,550.00	0.08
77	688126	沪硅产业	223,879	4,679,071.10	0.08
78	601222	林洋能源	559,000	4,578,210.00	0.08
79	002415	海康威视	130,200	4,310,922.00	0.07
80	601998	中信银行	719,000	4,299,620.00	0.07
81	600905	三峡能源	792,300	4,254,651.00	0.07
82	300003	乐普医疗	187,000	4,228,070.00	0.07
83	600875	东方电气	226,400	4,222,360.00	0.07
84	688111	金山办公	8,915	4,209,841.30	0.07
85	600028	中国石化	659,794	4,196,289.84	0.07
86	002128	电投能源	316,700	4,186,774.00	0.07
87	601688	华泰证券	294,300	4,052,511.00	0.07
88	600332	白云山	126,900	4,045,572.00	0.07
89	002085	万丰奥威	558,800	3,872,484.00	0.06
90	600380	健康元	303,800	3,861,298.00	0.06
91	002384	东山精密	148,500	3,846,150.00	0.06
92	688567	孚能科技	176,215	3,804,481.85	0.06
93	600497	驰宏锌锗	753,800	3,784,076.00	0.06
94	600025	华能水电	516,100	3,679,793.00	0.06
95	002203	海亮股份	306,200	3,677,462.00	0.06
96	600570	恒生电子	81,500	3,609,635.00	0.06
97	000938	紫光股份	111,800	3,560,830.00	0.06
98	002273	水晶光电	296,300	3,537,822.00	0.06
99	003816	中国广核	1,134,400	3,527,984.00	0.06
100	000425	徐工机械	514,400	3,482,488.00	0.06
101	300015	爱尔眼科	187,197	3,472,504.35	0.06
102	002180	纳思达	100,800	3,452,400.00	0.06
103	000157	中联重科	511,000	3,449,250.00	0.06
104	600009	上海机场	75,275	3,418,990.50	0.06
105	601336	新华保险	92,800	3,412,256.00	0.06
106	300207	欣旺达	206,300	3,366,816.00	0.06
107	002422	科伦药业	112,300	3,333,064.00	0.06
108	002475	立讯精密	96,907	3,144,632.15	0.05
109	300751	迈为股份	18,204	3,083,393.52	0.05
110	600660	福耀玻璃	83,800	3,004,230.00	0.05
111	600908	无锡银行	549,200	2,943,712.00	0.05
112	002074	国轩高科	105,056	2,901,646.72	0.05
113	600011	华能国际	309,300	2,864,118.00	0.05
114	688599	天合光能	66,855	2,848,691.55	0.05

115	603228	景旺电子	109,448	2,807,341.20	0.05
116	601665	齐鲁银行	713,200	2,795,744.00	0.05
117	300088	长信科技	462,200	2,787,066.00	0.05
118	601801	皖新传媒	296,727	2,786,266.53	0.05
119	601231	环旭电子	183,638	2,747,224.48	0.05
120	600309	万华化学	30,900	2,714,256.00	0.04
121	300450	先导智能	73,700	2,665,729.00	0.04
122	688100	威胜信息	86,906	2,590,667.86	0.04
123	600143	金发科技	295,700	2,581,461.00	0.04
124	600131	国网信通	125,800	2,539,902.00	0.04
125	601901	方正证券	388,000	2,537,520.00	0.04
126	300136	信维通信	125,900	2,528,072.00	0.04
127	601216	君正集团	614,400	2,519,040.00	0.04
128	002410	广联达	77,520	2,518,624.80	0.04
129	000513	丽珠集团	63,900	2,486,349.00	0.04
130	603019	中科曙光	48,600	2,473,740.00	0.04
131	000800	一汽解放	287,400	2,405,538.00	0.04
132	601816	京沪高铁	456,800	2,402,768.00	0.04
133	600893	航发动力	56,800	2,400,368.00	0.04
134	600115	中国东航	500,500	2,382,380.00	0.04
135	603659	璞泰来	62,200	2,377,284.00	0.04
136	603218	日月股份	122,400	2,324,376.00	0.04
137	601098	中南传媒	199,800	2,317,680.00	0.04
138	601360	三六零	184,700	2,316,138.00	0.04
139	002839	张家港行	534,600	2,261,358.00	0.04
140	300142	沃森生物	83,900	2,219,155.00	0.04
141	002555	三七互娱	63,300	2,207,904.00	0.04
142	300763	锦浪科技	21,000	2,186,100.00	0.04
143	600845	宝信软件	42,760	2,172,635.60	0.04
144	603799	华友钴业	46,900	2,153,179.00	0.04
145	000977	浪潮信息	43,400	2,104,900.00	0.03
146	300627	华测导航	62,500	2,029,375.00	0.03
147	300661	圣邦股份	24,700	2,028,611.00	0.03
148	002371	北方华创	6,362	2,020,889.30	0.03
149	688008	澜起科技	34,931	2,005,738.02	0.03
150	000878	云南铜业	179,200	1,980,160.00	0.03
151	002340	格林美	286,500	1,979,715.00	0.03
152	601869	长飞光纤	51,300	1,898,613.00	0.03
153	600600	青岛啤酒	18,300	1,896,429.00	0.03
154	605117	德业股份	12,496	1,868,776.80	0.03
155	002459	晶澳科技	44,800	1,868,160.00	0.03

156	600346	恒力石化	128,600	1,842,838.00	0.03
157	000100	TCL 科技	464,390	1,829,696.60	0.03
158	600926	杭州银行	155,100	1,822,425.00	0.03
159	000997	新大陆	96,000	1,814,400.00	0.03
160	002460	赣锋锂业	29,500	1,798,320.00	0.03
161	601928	凤凰传媒	156,300	1,781,820.00	0.03
162	603639	海利尔	98,200	1,759,744.00	0.03
163	000408	藏格矿业	75,800	1,710,806.00	0.03
164	002244	滨江集团	192,800	1,700,496.00	0.03
165	601868	中国能建	722,900	1,691,586.00	0.03
166	001269	欧晶科技	22,960	1,688,248.80	0.03
167	601899	紫金矿业	148,300	1,686,171.00	0.03
168	601669	中国电建	292,300	1,677,802.00	0.03
169	605499	东鹏饮料	9,600	1,659,840.00	0.03
170	000776	广发证券	111,300	1,637,223.00	0.03
171	002236	大华股份	82,300	1,625,425.00	0.03
172	601390	中国中铁	214,400	1,625,152.00	0.03
173	300122	智飞生物	36,702	1,622,228.40	0.03
174	600583	海油工程	269,040	1,573,884.00	0.03
175	603027	千禾味业	74,300	1,569,216.00	0.03
176	603986	兆易创新	14,600	1,551,250.00	0.03
177	603939	益丰药房	41,720	1,543,640.00	0.03
178	002250	联化科技	147,100	1,538,666.00	0.03
179	600061	国投资本	212,600	1,513,712.00	0.03
180	002966	苏州银行	231,100	1,513,705.00	0.03
181	600995	南网储能	135,300	1,489,653.00	0.02
182	600803	新奥股份	77,200	1,465,256.00	0.02
183	600688	上海石化	470,800	1,464,188.00	0.02
184	002396	星网锐捷	64,200	1,450,278.00	0.02
185	601111	中国国航	175,000	1,442,000.00	0.02
186	300296	利亚德	218,700	1,428,111.00	0.02
187	600023	浙能电力	278,500	1,411,995.00	0.02
188	603688	石英股份	12,400	1,411,616.00	0.02
189	600998	九州通	133,951	1,390,411.38	0.02
190	601021	春秋航空	24,100	1,385,027.00	0.02
191	002152	广电运通	117,900	1,381,788.00	0.02
192	601611	中国核建	163,400	1,380,730.00	0.02
193	603529	爱玛科技	42,700	1,375,794.00	0.02
194	601168	西部矿业	129,500	1,361,045.00	0.02
195	600096	云天化	79,600	1,358,772.00	0.02
196	002797	第一创业	236,900	1,355,068.00	0.02

197	600129	太极集团	22,300	1,326,627.00	0.02
198	603605	珀莱雅	11,661	1,310,696.40	0.02
199	300999	金龙鱼	31,400	1,255,686.00	0.02
200	002215	诺普信	166,100	1,247,411.00	0.02
201	002185	华天科技	134,741	1,239,617.20	0.02
202	601369	陕鼓动力	129,700	1,181,567.00	0.02
203	688390	固德威	6,920	1,154,671.20	0.02
204	688072	拓荆科技	2,700	1,150,119.00	0.02
205	603489	八方股份	16,380	1,148,565.60	0.02
206	603233	大参林	40,640	1,138,326.40	0.02
207	600312	平高电气	90,800	1,125,012.00	0.02
208	300033	同花顺	6,400	1,121,792.00	0.02
209	600183	生益科技	77,600	1,101,920.00	0.02
210	601985	中国核电	153,800	1,084,290.00	0.02
211	300803	指南针	22,300	1,083,557.00	0.02
212	601288	农业银行	302,600	1,068,178.00	0.02
213	000967	盈峰环境	209,300	1,056,965.00	0.02
214	600718	东软集团	96,800	1,031,888.00	0.02
215	603377	东方时尚	127,800	1,027,512.00	0.02
216	688520	神州细胞	17,929	1,017,291.46	0.02
217	688598	金博股份	5,900	1,011,850.00	0.02
218	601187	厦门银行	200,900	1,008,518.00	0.02
219	601077	渝农商行	273,100	980,429.00	0.02
220	600089	特变电工	43,200	962,928.00	0.02
221	002812	恩捷股份	9,900	953,865.00	0.02
222	002603	以岭药业	37,100	953,099.00	0.02
223	600566	济川药业	32,652	948,214.08	0.02
224	600820	隧道股份	153,900	924,939.00	0.02
225	300593	新雷能	39,680	909,068.80	0.02
226	601658	邮储银行	185,200	905,628.00	0.01
227	300532	今天国际	44,000	904,640.00	0.01
228	300850	新强联	24,000	897,120.00	0.01
229	002032	苏泊尔	17,900	895,000.00	0.01
230	603283	赛腾股份	19,800	881,100.00	0.01
231	688561	奇安信-U	16,808	870,822.48	0.01
232	002001	新和成	55,890	860,706.00	0.01
233	601717	郑煤机	68,500	852,825.00	0.01
234	603883	老百姓	28,500	850,725.00	0.01
235	301090	华润材料	67,200	848,064.00	0.01
236	601699	潞安环能	51,500	840,480.00	0.01
237	600728	佳都科技	119,700	829,521.00	0.01

238	688206	概伦电子	29,557	828,778.28	0.01
239	001979	招商蛇口	63,600	828,708.00	0.01
240	601108	财通证券	114,000	825,360.00	0.01
241	002465	海格通信	75,800	783,772.00	0.01
242	600927	永安期货	48,000	780,480.00	0.01
243	000400	许继电气	31,400	723,770.00	0.01
244	300496	中科创达	7,500	722,625.00	0.01
245	002518	科士达	17,500	700,175.00	0.01
246	600968	海油发展	227,800	699,346.00	0.01
247	002461	珠江啤酒	78,200	688,942.00	0.01
248	600699	均胜电子	38,300	675,612.00	0.01
249	603323	苏农银行	157,400	662,654.00	0.01
250	002373	千方科技	48,500	661,540.00	0.01
251	688707	振华新材	21,139	650,869.81	0.01
252	600258	首旅酒店	34,300	649,985.00	0.01
253	600378	昊华科技	17,200	647,408.00	0.01
254	002179	中航光电	14,100	639,435.00	0.01
255	002139	拓邦股份	47,600	621,180.00	0.01
256	600029	南方航空	100,500	606,015.00	0.01
257	002078	太阳纸业	56,300	601,847.00	0.01
258	002568	百润股份	16,300	592,505.00	0.01
259	002241	歌尔股份	32,100	569,775.00	0.01
260	600956	新天绿能	65,100	567,672.00	0.01
261	688002	睿创微纳	12,658	567,078.40	0.01
262	688777	中控技术	8,991	564,454.98	0.01
263	002081	金螳螂	124,700	562,397.00	0.01
264	002056	横店东磁	30,500	555,405.00	0.01
265	301039	中集车辆	41,300	546,399.00	0.01
266	300294	博雅生物	15,000	544,200.00	0.01
267	300699	光威复材	17,620	543,577.00	0.01
268	300009	安科生物	53,900	539,000.00	0.01
269	600547	山东黄金	22,800	535,344.00	0.01
270	688187	时代电气	12,748	533,631.28	0.01
271	600809	山西汾酒	2,800	518,196.00	0.01
272	300274	阳光电源	4,400	513,172.00	0.01
273	688208	道通科技	16,600	503,146.00	0.01
274	300628	亿联网络	14,020	491,681.40	0.01
275	300454	深信服	4,300	486,975.00	0.01
276	603096	新经典	23,400	476,424.00	0.01
277	600481	双良节能	33,500	468,330.00	0.01
278	603466	风语筑	33,200	461,480.00	0.01

279	688116	天奈科技	10,053	459,924.75	0.01
280	605111	新洁能	10,500	456,960.00	0.01
281	600210	紫江企业	80,400	427,728.00	0.01
282	600196	复星医药	13,800	426,420.00	0.01
283	601139	深圳燃气	57,100	416,259.00	0.01
284	600398	海澜之家	59,900	412,112.00	0.01
285	300012	华测检测	21,100	411,450.00	0.01
286	002484	江海股份	19,200	408,768.00	0.01
287	300144	宋城演艺	32,500	403,000.00	0.01
288	688107	安路科技	7,255	401,854.45	0.01
289	600066	宇通客车	26,900	396,506.00	0.01
290	002925	盈趣科技	20,400	395,760.00	0.01
291	002064	华峰化学	56,200	385,532.00	0.01
292	603589	口子窖	7,800	384,930.00	0.01
293	600458	时代新材	32,100	384,879.00	0.01
294	600582	天地科技	66,000	384,780.00	0.01
295	002698	博实股份	22,000	384,780.00	0.01
296	002245	蔚蓝锂芯	35,000	383,250.00	0.01
297	603186	华正新材	11,100	381,840.00	0.01
298	600377	宁沪高速	38,300	376,489.00	0.01
299	601619	嘉泽新能	82,300	374,465.00	0.01
300	688261	东微半导	2,660	372,054.20	0.01
301	002060	粤水电	55,800	367,164.00	0.01
302	002745	木林森	39,600	364,320.00	0.01
303	002049	紫光国微	3,900	363,675.00	0.01
304	600588	用友网络	17,700	362,850.00	0.01
305	600989	宝丰能源	28,500	359,385.00	0.01
306	600548	深高速	40,000	359,200.00	0.01
307	688180	君实生物	9,300	358,422.00	0.01
308	603290	斯达半导	1,652	355,510.40	0.01
309	601311	骆驼股份	38,300	355,424.00	0.01
310	000089	深圳机场	50,700	352,365.00	0.01
311	600549	厦门钨业	18,400	350,152.00	0.01
312	002990	盛视科技	9,500	349,600.00	0.01
313	601528	瑞丰银行	72,060	349,491.00	0.01
314	688779	长远锂科	30,993	349,291.11	0.01
315	603707	健友股份	25,800	348,300.00	0.01
316	603919	金徽酒	14,700	345,156.00	0.01
317	002563	森马服饰	55,400	344,588.00	0.01
318	603568	伟明环保	19,600	343,196.00	0.01
319	603267	鸿远电子	5,200	339,560.00	0.01

320	603515	欧普照明	16,700	339,010.00	0.01
321	002948	青岛银行	106,500	333,345.00	0.01
322	600745	闻泰科技	6,800	332,520.00	0.01
323	600563	法拉电子	2,400	329,520.00	0.01
324	000789	万年青	42,300	327,825.00	0.01
325	605369	拱东医疗	5,700	319,428.00	0.01
326	688267	中触媒	14,925	314,469.75	0.01
327	002233	塔牌集团	40,500	312,660.00	0.01
328	603345	安井食品	2,118	310,922.40	0.01
329	603809	豪能股份	27,400	307,702.00	0.01
330	300226	上海钢联	9,300	301,320.00	0.00
331	688559	海目星	6,401	300,911.01	0.00
332	002391	长青股份	42,800	294,036.00	0.00
333	300408	三环集团	10,000	293,500.00	0.00
334	688105	诺唯赞	9,534	290,691.66	0.00
335	603195	公牛集团	2,960	284,337.60	0.00
336	300767	震安科技	11,200	284,032.00	0.00
337	600019	宝钢股份	50,500	283,810.00	0.00
338	603612	索通发展	16,200	280,746.00	0.00
339	601567	三星医疗	22,200	280,386.00	0.00
340	600299	安迪苏	34,900	278,153.00	0.00
341	600867	通化东宝	25,700	268,308.00	0.00
342	603392	万泰生物	4,000	267,080.00	0.00
343	300357	我武生物	7,700	258,951.00	0.00
344	300130	新国都	9,100	257,803.00	0.00
345	688722	同益中	13,900	257,706.00	0.00
346	000877	天山股份	28,900	235,246.00	0.00
347	601615	明阳智能	13,900	234,632.00	0.00
348	688139	海尔生物	4,200	216,174.00	0.00
349	300832	新产业	3,600	212,400.00	0.00
350	688800	瑞可达	3,320	206,338.00	0.00
351	600170	上海建工	73,000	196,370.00	0.00
352	605300	佳禾食品	9,000	195,660.00	0.00
353	688018	乐鑫科技	1,500	194,730.00	0.00
354	688157	松井股份	3,700	194,620.00	0.00
355	688375	国博电子	2,400	190,080.00	0.00
356	301015	百洋医药	6,800	188,768.00	0.00
357	603306	华懋科技	6,400	185,728.00	0.00
358	002937	兴瑞科技	7,500	184,500.00	0.00
359	603556	海兴电力	7,300	184,252.00	0.00
360	688201	信安世纪	4,300	183,782.00	0.00

361	300855	图南股份	5,200	183,664.00	0.00
362	688551	科威尔	2,800	183,624.00	0.00
363	300590	移为通信	15,000	183,300.00	0.00
364	601827	三峰环境	24,700	182,780.00	0.00
365	002402	和而泰	10,700	181,686.00	0.00
366	300708	聚灿光电	18,400	181,608.00	0.00
367	300951	博硕科技	3,300	180,279.00	0.00
368	600918	中泰证券	26,000	179,660.00	0.00
369	600655	豫园股份	26,100	179,046.00	0.00
370	000060	中金岭南	37,600	178,600.00	0.00
371	688234	天岳先进	2,400	177,456.00	0.00
372	688248	南网科技	4,600	176,594.00	0.00
373	000636	风华高科	11,500	176,410.00	0.00
374	688078	龙软科技	3,400	175,270.00	0.00
375	000860	顺鑫农业	5,200	175,188.00	0.00
376	002807	江阴银行	47,300	174,537.00	0.00
377	603337	杰克股份	9,100	173,264.00	0.00
378	688173	希荻微	7,500	171,600.00	0.00
379	603185	弘元绿能	2,300	171,465.00	0.00
380	688377	迪威尔	6,800	170,340.00	0.00
381	600900	长江电力	7,700	169,862.00	0.00
382	603005	晶方科技	8,400	169,680.00	0.00
383	603501	韦尔股份	1,700	166,668.00	0.00
384	002283	天润工业	25,700	164,994.00	0.00
385	688006	杭可科技	5,400	164,538.00	0.00
386	300308	中际旭创	1,100	162,195.00	0.00
387	002439	启明星辰	5,400	160,704.00	0.00
388	002294	信立泰	5,100	159,069.00	0.00
389	688381	帝奥微	4,800	154,944.00	0.00
390	605136	丽人丽妆	13,400	154,502.00	0.00
391	688020	方邦股份	3,000	149,910.00	0.00
392	688733	壹石通	4,700	145,512.00	0.00
393	300035	中科电气	12,000	144,240.00	0.00
394	002291	遥望科技	10,800	141,480.00	0.00
395	300395	菲利华	2,200	108,240.00	0.00
396	601988	中国银行	27,500	107,525.00	0.00
397	688161	威高骨科	2,200	95,282.00	0.00
398	688188	柏楚电子	500	94,280.00	0.00
399	688168	安博通	2,200	78,320.00	0.00
400	600754	锦江酒店	1,500	63,510.00	0.00
401	601555	东吴证券	7,700	53,438.00	0.00

402	300251	光线传媒	6,600	53,394.00	0.00
403	002929	润建股份	600	26,046.00	0.00
404	600958	东方证券	2,500	24,250.00	0.00
405	600460	士兰微	700	21,189.00	0.00
406	600153	建发股份	800	8,728.00	0.00
407	603378	亚士创能	900	8,199.00	0.00
408	688556	高测股份	132	7,014.48	0.00
409	600929	雪天盐业	500	3,970.00	0.00
410	688099	晶晨股份	37	3,119.84	0.00
411	688106	金宏气体	85	2,312.00	0.00
412	688303	大全能源	15	606.75	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	36,164,856.80	0.49
2	601328	交通银行	35,545,489.00	0.48
3	000725	京东方 A	32,486,334.78	0.44
4	000858	五粮液	30,856,108.00	0.42
5	601288	农业银行	30,470,011.00	0.41
6	002594	比亚迪	29,940,436.00	0.41
7	601766	中国中车	28,567,485.20	0.39
8	600039	四川路桥	27,190,975.50	0.37
9	601169	北京银行	26,121,092.00	0.36
10	600276	恒瑞医药	25,955,194.63	0.35
11	600009	上海机场	25,857,503.28	0.35
12	688981	中芯国际	25,586,480.14	0.35
13	002459	晶澳科技	25,378,214.60	0.35
14	600104	上汽集团	25,276,850.98	0.34
15	000538	云南白药	24,981,121.90	0.34
16	601319	中国人保	24,660,971.00	0.34
17	603290	斯达半导	24,583,477.27	0.33
18	603993	洛阳钼业	24,339,909.63	0.33
19	603369	今世缘	24,132,664.00	0.33
20	000333	美的集团	22,938,717.00	0.31

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	000568	泸州老窖	47,608,722.93	0.65
2	002304	洋河股份	38,323,909.00	0.52
3	601166	兴业银行	37,451,269.72	0.51
4	000001	平安银行	37,395,156.92	0.51
5	601211	国泰君安	37,328,579.10	0.51
6	002371	北方华创	36,689,056.30	0.50
7	600104	上汽集团	35,942,140.35	0.49
8	601658	邮储银行	35,664,898.00	0.49
9	300750	宁德时代	35,404,937.40	0.48
10	600519	贵州茅台	35,096,961.00	0.48
11	601857	中国石油	33,382,340.00	0.45
12	002466	天齐锂业	33,246,706.33	0.45
13	002410	广联达	32,723,217.80	0.45
14	601138	工业富联	32,056,217.00	0.44
15	600584	长电科技	31,822,882.64	0.43
16	600383	金地集团	31,107,598.00	0.42
17	601668	中国建筑	31,086,587.00	0.42
18	601288	农业银行	30,579,753.00	0.42
19	002517	恺英网络	30,566,682.50	0.42
20	601688	华泰证券	30,446,486.00	0.41

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	2,786,111,543.92
卖出股票收入（成交）总额	3,045,738,658.86

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	687,412,620.10	11.36
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,813,774,855.45	29.98
	其中：政策性金融债	1,218,634,223.73	20.14
4	企业债券	224,924,121.10	3.72
5	企业短期融资券	1,316,854,205.45	21.77

6	中期票据	246,118,364.38	4.07
7	可转债（可交换债）	1,037,693,106.31	17.15
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	5,326,777,272.79	88.05

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	230205	23 国开 05	4,500,000	461,642,595.62	7.63
2	190203	19 国开 03	3,000,000	306,168,493.15	5.06
3	019679	22 国债 14	3,000,000	305,393,671.23	5.05
4	019688	22 国债 23	2,778,000	280,909,305.03	4.64
5	102102093	21 汇金 MTN002	2,000,000	204,535,736.99	3.38

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，中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会重庆监管局的处罚。

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

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

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	380,446.04
2	应收清算款	51,796,318.92
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	4,310,792.53
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	56,487,557.49

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	110059	浦发转债	37,832,295.89	0.63
2	128034	江银转债	31,622,499.86	0.52
3	110043	无锡转债	30,384,021.97	0.50
4	127012	招路转债	23,494,601.54	0.39

5	110061	川投转债	22,907,011.82	0.38
6	128048	张行转债	22,373,699.35	0.37
7	113044	大秦转债	22,234,551.32	0.37
8	132026	G 三峡 EB2	21,760,121.48	0.36
9	113063	赛轮转债	21,671,245.90	0.36
10	127058	科伦转债	21,510,689.00	0.36
11	113059	福莱转债	21,318,671.35	0.35
12	127063	贵轮转债	21,236,634.25	0.35
13	110090	爱迪转债	21,023,031.65	0.35
14	113065	齐鲁转债	20,592,144.09	0.34
15	127050	麒麟转债	20,390,529.72	0.34
16	128081	海亮转债	20,058,491.46	0.33
17	113056	重银转债	19,337,076.53	0.32
18	110083	苏租转债	18,935,569.40	0.31
19	113057	中银转债	18,633,871.62	0.31
20	113042	上银转债	18,517,950.05	0.31
21	113050	南银转债	18,373,798.23	0.30
22	113021	中信转债	17,672,398.02	0.29
23	113648	巨星转债	17,471,647.27	0.29
24	127027	能化转债	17,250,950.58	0.29
25	110053	苏银转债	16,175,898.87	0.27
26	110067	华安转债	16,032,936.00	0.27
27	128023	亚太转债	15,851,015.40	0.26
28	123158	宙邦转债	15,427,100.13	0.26
29	127069	小熊转债	14,857,534.28	0.25
30	113048	晶科转债	14,591,325.30	0.24
31	127049	希望转 2	14,508,725.43	0.24
32	128121	宏川转债	14,106,732.61	0.23
33	113060	浙 22 转债	14,030,768.88	0.23
34	127065	瑞鹄转债	13,253,770.55	0.22
35	110047	山鹰转债	13,005,614.49	0.21
36	113651	松霖转债	12,707,312.15	0.21

37	127036	三花转债	12,028,753.97	0.20
38	127070	大中转债	11,779,113.21	0.19
39	118023	广大转债	11,395,720.34	0.19
40	113647	禾丰转债	11,151,731.86	0.18
41	128128	齐翔转 2	10,758,500.86	0.18
42	110073	国投转债	10,629,742.57	0.18
43	118013	道通转债	10,083,397.94	0.17
44	110079	杭银转债	9,957,983.28	0.16
45	118022	锂科转债	9,238,143.32	0.15
46	132018	G 三峡 EB1	9,226,636.77	0.15
47	127043	川恒转债	9,189,788.83	0.15
48	111002	特纸转债	9,023,204.73	0.15
49	110068	龙净转债	8,566,195.15	0.14
50	123150	九强转债	8,411,591.80	0.14
51	113052	兴业转债	8,221,467.33	0.14
52	123156	博汇转债	8,031,940.29	0.13
53	113619	世运转债	7,404,748.68	0.12
54	113534	鼎胜转债	7,365,126.64	0.12
55	113013	国君转债	7,292,917.00	0.12
56	113519	长久转债	7,174,810.96	0.12
57	110062	烽火转债	7,115,273.73	0.12
58	113037	紫银转债	6,726,079.85	0.11
59	127054	双箭转债	6,709,738.08	0.11
60	110075	南航转债	6,704,497.69	0.11
61	123118	惠城转债	6,678,016.68	0.11
62	113061	拓普转债	6,076,093.56	0.10
63	123149	通裕转债	6,065,810.68	0.10
64	113064	东材转债	5,353,170.41	0.09
65	127053	豪美转债	5,334,050.64	0.09
66	113591	胜达转债	5,285,512.80	0.09
67	113516	苏农转债	4,349,524.37	0.07
68	127016	鲁泰转债	4,055,861.13	0.07

69	127074	麦米转 2	4,007,556.88	0.07
70	111005	富春转债	3,945,442.03	0.07
71	113058	友发转债	3,870,836.62	0.06
72	128136	立讯转债	3,467,686.33	0.06
73	127060	湘佳转债	3,326,111.64	0.05
74	127045	牧原转债	3,317,419.76	0.05
75	128141	旺能转债	2,664,043.36	0.04
76	111000	起帆转债	2,553,938.30	0.04
77	128129	青农转债	2,532,339.04	0.04
78	110077	洪城转债	2,486,471.24	0.04
79	123099	普利转债	2,467,159.27	0.04
80	113663	新化转债	2,237,141.92	0.04
81	127020	中金转债	1,774,150.19	0.03
82	111007	永和转债	1,745,548.11	0.03
83	128119	龙大转债	1,608,592.19	0.03
84	110085	通 22 转债	1,600,577.45	0.03
85	113051	节能转债	1,143,846.28	0.02
86	113043	财通转债	976,489.80	0.02
87	110088	淮 22 转债	881,578.14	0.01
88	110063	鹰 19 转债	866,114.14	0.01
89	127052	西子转债	830,727.22	0.01
90	113588	润达转债	729,130.14	0.01
91	123142	申昊转债	671,325.34	0.01
92	127018	本钢转债	362,378.14	0.01
93	113609	永安转债	240,140.00	0.00
94	110091	合力转债	191,889.44	0.00
95	113024	核建转债	151,264.25	0.00
96	123161	强联转债	127,353.86	0.00
97	127035	濮耐转债	92,073.20	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

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 (%)
4,026	1,211,783.20	4,860,321,546.70	99.62	18,317,631.18	0.38

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	250,045.95	0.0051

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	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	0.20	10,000,000.00	0.20	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	40,396,703.56	0.83	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	50,396,703.56	1.03	10,000,000.00	0.20	3年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

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	6,022,680,595.05
本报告期基金总申购份额	3,159,121,515.82
减：本报告期基金总赎回份额	4,303,162,932.99
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	4,878,639,177.88

§ 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未受稽查或处罚。

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 (%)	
安信证券	2	—	—	—	—	—
渤海证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	1	273,582,873.67	4.69	197,338.89	4.69	—
长江证券	3	417,668,880.34	7.16	301,263.04	7.16	—

德邦证券	2	—	—	—	—	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
东财证券	2	892,979,444.17	15.31	644,105.95	15.31	—
方正证券	2	298,346,075.42	5.12	215,197.93	5.12	—
高盛中国	1	—	—	—	—	—
光大证券	2	55,423,885.04	0.95	39,975.68	0.95	—
广发证券	2	—	—	—	—	—
国海证券	2	131,830,757.53	2.26	95,090.63	2.26	—
国盛证券	2	127,175,317.24	2.18	91,730.59	2.18	—
国泰君安	2	510,602,442.32	8.76	368,303.16	8.76	—
国信证券	2	—	—	—	—	—
海通证券	2	500,131,882.21	8.58	360,750.55	8.58	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	149,417,996.78	2.56	107,774.35	2.56	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	430,714,992.50	7.39	310,675.86	7.39	—
太平洋证券	2	35,990,117.80	0.62	25,959.55	0.62	—
天风证券	2	210,353,732.83	3.61	151,728.67	3.61	—
西南证券	2	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	1	472,551,743.57	8.10	340,852.08	8.10	—
招商证券	1	519,554,719.56	8.91	374,756.09	8.91	—
中航证券	2	18,899,979.46	0.32	13,632.44	0.32	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
中泰证券	2	398,992,264.78	6.84	287,792.02	6.84	—
中信建投	1	—	—	—	—	—
中信证券	2	387,051,336.12	6.64	279,179.32	6.64	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

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 (%)
安信证券	18,247,997.06	0.34	31,000,000.00	0.07	—	—
渤海证券	—	—	—	—	—	—
长城证券	61,226,794.39	1.14	640,000,000.00	1.52	—	—
长江证券	203,098,301.60	3.79	1,563,700,000.00	3.71	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	15,311,090.52	0.29	36,000,000.00	0.09	—	—
东财证券	477,377,601.91	8.91	3,151,400,000.00	7.48	—	—
方正证券	197,586,385.84	3.69	1,374,600,000.00	3.26	—	—
高盛中国	151,107,361.17	2.82	50,000,000.00	0.12	—	—
光大证券	200,086,723.08	3.73	3,090,338,000.00	7.34	—	—
广发证券	180,558,927.06	3.37	426,700,000.00	1.01	—	—
国海证券	7,419,268.74	0.14	34,200,000.00	0.08	—	—
国盛证券	316,758,309.97	5.91	4,632,300,000.00	11.00	—	—
国泰君安	76,545,199.89	1.43	1,778,988,000.00	4.22	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	1,089,041,852.73	20.32	8,483,200,000.00	20.14	—	—
华泰证券	25,811,364.72	0.48	166,100,000.00	0.39	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	43,114,286.55	0.80	707,440,000.00	1.68	—	—
上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	343,285,016.77	6.41	1,000,900,000.00	2.38	—	—
太平洋证券	74,393,123.90	1.39	110,900,000.00	0.26	—	—
天风证券	58,636,248.98	1.09	559,900,000.00	1.33	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	331,150,080.15	6.18	2,870,000,000.00	6.82	—	—
招商证券	109,129,206.07	2.04	357,100,000.00	0.85	—	—
中航证券	132,546,443.75	2.47	1,467,300,000.00	3.48	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—

中泰证券	432,092,638.84	8.06	5,239,812,000.00	12.44	—	—
中信建投	42,268,282.34	0.79	402,900,000.00	0.96	—	—
中信证券	772,628,475.55	14.42	3,937,659,000.00	9.35	—	—
中银证券	—	—	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

注：本基金本报告期无需要说明的重大事件。

§ 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	2023-01-03 至 2023-01-05; 2023-01-16 至 2023-01-18; 2023-02-02; 2023-02-07 至 2023-03-09; 2023-03-22 至 2023-03-29; 2023-04-07 至 2023-06-30	1,201,666,106.70	242,384,261.13	242,384,261.13	1,201,666,106.70	24.63%
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>							

§ 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） 公司地址： http://www.fullgoal.com.cn 。