

富国丰利增强债券型发起式证券投资基金

二〇二四年中期报告

2024年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2024年08月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	6
2.1	基金基本情况	6
2.2	基金产品说明	6
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	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	14
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	净资产变动表	18
6.4	报表附注	19
§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.....	53
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	55
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.....	55
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.....	55
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	55
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12	投资组合报告附注.....	55
§8	基金份额持有人信息.....	61
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况.....	61
§9	开放式基金份额变动.....	62
§10	重大事件揭示.....	63
10.1	基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4	基金投资策略的改变.....	63
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
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.....	66
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	67
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	67
§12	备查文件目录.....	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国丰利增强债券型发起式证券投资基金
基金简称	富国丰利增强债券
基金主代码	004902
交易代码	004902
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年09月05日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	886,648,550.66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。本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*80%+中证500指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	方圆

	联系电话	021-20361818	95559
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95559
传真		021-20361616	021-62701216
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	中国(上海)长宁区仙霞路18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		裴长江	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 交通银行股份有限公司 中国(上海)长宁区仙霞路18号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	富国基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年01月01日至2024年06月30日)
本期已实现收益	-24,528,619.92
本期利润	-1,226,300.97
加权平均基金份额本期利润	-0.0007
本期加权平均净值利润率	-0.06%
本期基金份额净值增长率	0.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)
期末可供分配利润	160,583,974.18
期末可供分配基金份额利润	0.1811
期末基金资产净值	1,053,883,805.59
期末基金份额净值	1.1886
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	24.65%

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

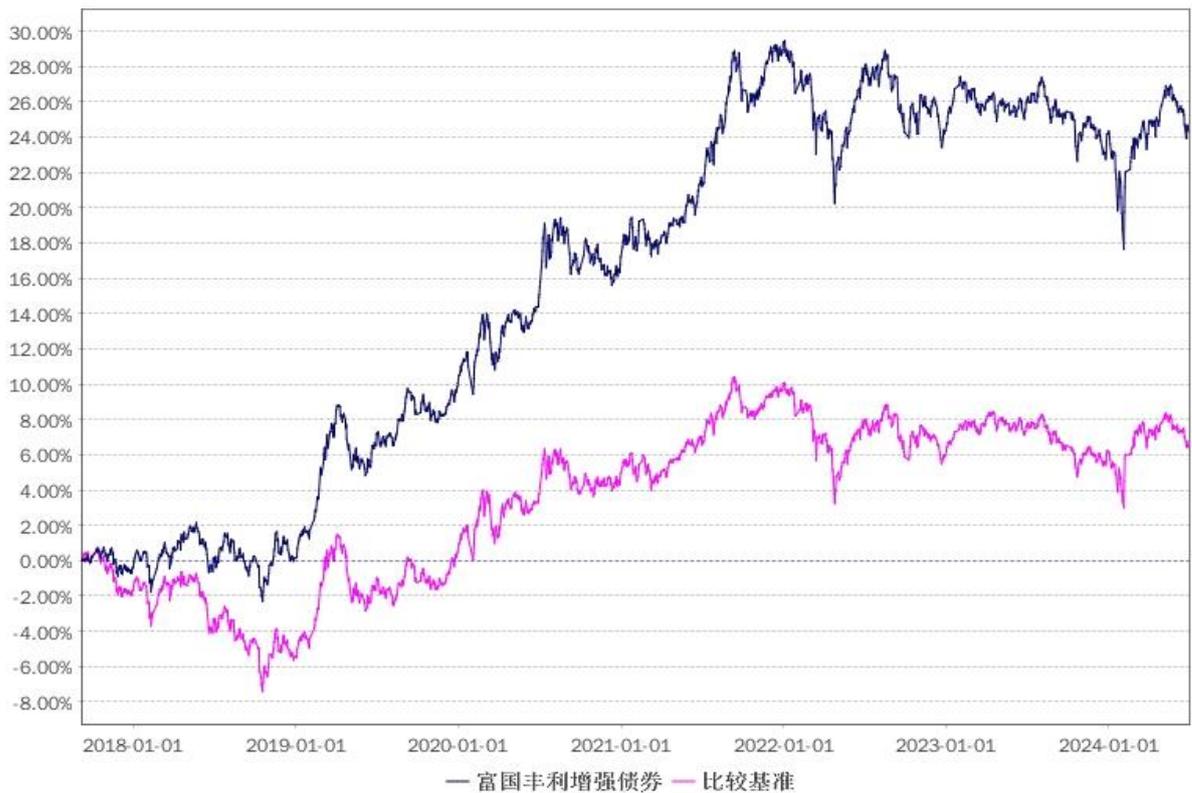
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.17%	0.27%	-0.89%	0.19%	-0.28%	0.08%
过去三个月	0.38%	0.28%	-0.43%	0.21%	0.81%	0.07%
过去六个月	0.36%	0.41%	0.28%	0.31%	0.08%	0.10%
过去一年	-1.02%	0.33%	-0.97%	0.25%	-0.05%	0.08%
过去三年	2.41%	0.32%	-0.46%	0.24%	2.87%	0.08%

自基金合同生效起至今	24.65%	0.30%	6.53%	0.26%	18.12%	0.04%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

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2024年6月30日。

2、本基金于2017年9月5日成立，建仓期6个月，从2017年9月5日起至2018年3月4日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 350 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈斯扬	本基金现任基金经理	2018-03-19	—	11	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；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丰利增强债券型发起式证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国丰利增强债券型发起式证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，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9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

上半年国内资本市场无疑充满了波折，一季度曾经出现了雪球敲入、股票融资杠杆平仓、微盘股调整等一系列冲击；二季度市场围绕政策端反复博弈，在对地产和财政政策的期待与落空之间，市场预期经历了由热渐冷的转变，摇摇欲坠的权益市场在其中徘徊。整个上半年来看，大盘和红利资产相对强势，小微盘股的调整幅度较大，其中固然有盈利和避险情绪的线索，但市场结构因素和政策导向也起到了重要作用，最终使得这种风格的转变是较为极致和彻底的。

这种风格因素还深深影响到了可转债市场。上半年国内可转债市场经历了近年来最严重的一轮信用冲击，大量转债跌穿理论债底，负纯债溢价率的转债占比将近三分之一。过去由于可转债拥有转股条款和下修条款，哪怕资质较弱的发行

人，通常只要有一轮小的行情，就可以实现顺利转股，因此兑付风险通常被认为要小于同等级的信用债。但今年当大量的发行公司或是市值沦为小微、或是股价破净、或是接近低价退市，那么传统下修配合转股的模式就受到了很大挑战，实质违约的信用风险就被摆到了台面上。加之机构赎回的冲击和流动性的匮乏，导致转债市场进入了负反馈的循环，大量原本被视为低信用风险的转债也连带出现了跌穿债底的状况。尽管我们认为这种市场状况是不理性的、最终大概率会出现修复，但在摇摆的负债端之下，修复的进程或许比以往都要漫长。

上半年表现最佳的无疑是债券。由于国内经济增长放缓、通胀低迷、政府债券发行进度放缓、低风险偏好资金配置需求强劲等因素，债券市场经历了超预期的牛市，长端利率创下历史低点。尽管出于维护汇率的需求，央行多次提醒长端利率过快下行的风险，但供需的失衡仍然在推动利率震荡下行。

组合方面，上半年股票指数增强仓位的超额收益稳健，对冲了一部分市场贝塔的下行。尽管超额收益在 1 月份受到一定冲击，但随后得到了较快的修复，组合在配置上相较指数整体偏向价值和红利风格，这一选择为组合贡献了大部分的超额收益来源。组合在可转债仓位配置上，相较转债等权指数更偏向大盘和价值风格，并增加部分高信用等级偏债型转债来作为信用债的替代，但受到市场因素的影响，转债市场整体受到的冲击显著，弱化了其在当前位置上本应具备的防御能力。在纯债仓位上，组合仍以高等级高流动性品种为主，辅以利率债的交易性配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.1886 元；份额累计净值为 1.2466 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 0.36%，同期业绩比较基准收益率为 0.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前权益市场对于经济增长和政策的预期已经较低，估值也处在长期具有吸引力的位置。但资金流向的逆转仍然需要更强的触发契机，一切还有待经济增长出现更为积极的信号、或者财政政策给出更加积极的态度，以扭转当前风险偏好的下降。由于权益市场已经经历了较为漫长的调整，赚钱效应的消失也使得供需格局持续走弱，相较过去，或许需要更长时间来构建起新的信心。但因为多数悲

观预期已经被当前的价格所反映，待权益类资产的供需企稳，市场的修复显然是可以期待的。

可转债市场已经经历了显著的超调，在机构资金赎回和降仓等流动性冲击下，转债的静态到期收益率已经达到了近年来的新高水平。考虑到绝大部分发行人仍然可以有效利用转债条款来最终促进转股，当前市场对可转债的广泛的信用风险担忧，显然是过虑的。我们相应市场最终会回到更加理性的轨道上来。但在此之前，或许仍需要等待一段时间，以期看到市场供需面的平衡，以缓解转债赎回压力下的流动性冲击。

纯债方面，就当前经济增长的强度而言，国内利率水平所面临的风险仍然很有限，如果政府债券仍然保持较为缓慢的发行节奏，或许利率仍有继续下行的空间。但目前各等级利差都已经压缩到相对较为极致的水平，债市所蕴含的风险也在积累。保持积极的参与，但同时留三分清醒，或许是当前较为合理的策略。

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

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

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

本报告期内，富国基金管理有限公司在富国丰利增强债券型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 中期财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国丰利增强债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2024年06月 30日	上年度末 2023年12月31 日
资产：		
货币资金	20,728,683.55	4,962,699.34
结算备付金	26,062,968.74	30,594,024.74
存出保证金	323,631.07	402,877.66
交易性金融资产	1,230,109,866.65	3,666,776,025.93
其中：股票投资	203,521,832.00	673,946,928.14
基金投资	—	—
债券投资	1,026,588,034.65	2,992,829,097.79
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	9,000,000.00	14,797,262.32
应收清算款	98,575,444.43	130,623,345.57
应收股利	—	—
应收申购款	49.96	49.96
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	1,384,800,644.40	3,848,156,285.52
负债和净资产	本期末 2024年06月 30日	上年度末 2023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	230,110,677.01	459,384,611.51
应付清算款	—	9,970,461.51
应付赎回款	98,887,194.39	709,050.25
应付管理人报酬	404,016.71	1,380,047.04
应付托管费	101,004.17	345,011.78

应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—
应交税费	37,445.41	48,617.32
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	1,376,501.12	2,293,106.93
负债合计	330,916,838.81	474,130,906.34
净资产：		
实收基金	886,648,550.66	2,849,042,081.39
其他综合收益	—	—
未分配利润	167,235,254.93	524,983,297.79
净资产合计	1,053,883,805.59	3,374,025,379.18
负债和净资产总计	1,384,800,644.40	3,848,156,285.52

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1886 元，基金份额总额 886,648,550.66 份。

6.2 利润表

会计主体：富国丰利增强债券型发起式证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	8,209,388.73	108,866,057.15
1.利息收入	758,359.20	1,129,823.94
其中：存款利息收入	391,621.36	560,081.82
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	366,737.84	569,742.12
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	-15,866,439.18	42,558,015.11
其中：股票投资收益	-19,605,929.30	-16,586,860.47
基金投资收益	—	—
债券投资收益	-696,277.26	45,396,191.15
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	4,435,767.38	13,748,684.43
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）	23,302,318.95	64,939,933.32
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	15,149.76	238,284.78
减：二、营业总支出	9,435,689.70	19,900,880.16
1. 管理人报酬	4,222,144.07	11,624,319.50
2. 托管费	1,055,535.96	2,906,079.94
3. 销售服务费	—	—
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	4,015,659.21	5,177,160.33
其中：卖出回购金融资产支出	4,015,659.21	5,177,160.33
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	25,670.01	70,239.81
8. 其他费用	116,680.45	123,080.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,226,300.97	88,965,176.99
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,226,300.97	88,965,176.99
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	-1,226,300.97	88,965,176.99

6.3 净资产变动表

会计主体：富国丰利增强债券型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2024年01月01日至2024年06月30日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、上期期末净资产	2,849,042,081.39	524,983,297.79	3,374,025,379.18
二、本期期初净资产	2,849,042,081.39	524,983,297.79	3,374,025,379.18
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	— 1,962,393,530.73	-357,748,042.86	— 2,320,141,573.59
(一)、综合收益总额	—	-1,226,300.97	-1,226,300.97
(二)、本期基金份额交 易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号 填列)	— 1,962,393,530.73	-356,521,741.89	— 2,318,915,272.62
其中：1. 基金申购款	236,718,246.54	43,153,616.60	279,871,863.14
2. 基金赎回款	— 2,199,111,777.27	-399,675,358.49	— 2,598,787,135.76
(三)、本期向基金份额 持有人分配利润产生的	—	—	—

净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
（四）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	886,648,550.66	167,235,254.93	1,053,883,805.59
项目	上年度可比期间 (2023年01月01日至2023年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,579,447,608.80	1,037,170,323.84	6,616,617,932.64
二、本期期初净资产	5,579,447,608.80	1,037,170,323.84	6,616,617,932.64
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	— 1,457,962,352.82	-209,517,127.31	— 1,667,479,480.13
（一）、综合收益总额	—	88,965,176.99	88,965,176.99
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	— 1,457,962,352.82	-298,482,304.30	— 1,756,444,657.12
其中：1.基金申购款	1,624,031,456.79	324,827,965.35	1,948,859,422.14
2.基金赎回款	— 3,081,993,809.61	-623,310,269.65	— 3,705,304,079.26
（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	4,121,485,255.98	827,653,196.53	4,949,138,452.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人
基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国丰利增强债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]769号《关于准予富国丰利增强债券型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2017年9月5日生效，

首次设立募集规模为 150,004,400.62 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票、存托凭证、权证等资产的比例不超过基金资产的 20%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*80%+中证 500 指数收益率*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

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

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

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

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

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

2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融

商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

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

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的

企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5 个人所得税

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2024年06月30日)
活期存款	20,728,683.55
等于：本金	20,727,321.96
加：应计利息	1,361.59
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	20,728,683.55

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	209,631,913.06	—	203,521,832.00	6,110,081.06	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	747,148,325.18	10,172,228.24	755,648,150.10	1,672,403.32
	银行间市场	264,103,581.03	4,742,384.55	270,939,884.55	2,093,918.97
	合计	1,011,251,906.21	14,914,612.79	1,026,588,034.65	421,515.65
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	1,220,883,819.27	14,914,612.79	1,230,109,866.65	5,688,565.41	

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（2024年06月30日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	9,000,000.00	—
银行间市场	—	—

合计	9,000,000.00	—
----	--------------	---

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	1,102,659.58
其中：交易所市场	1,097,884.58
银行间市场	4,775.00
应付利息	—
预提信息披露费	180,000.00
预提审计费	93,841.54
合计	1,376,501.12

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,849,042,081.39	2,849,042,081.39
本期申购	236,718,246.54	236,718,246.54
本期赎回（以“-”号填列）	-2,199,111,777.27	-2,199,111,777.27
本期末	886,648,550.66	886,648,550.66

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
上年度末	536,849,306.33	—	524,983,297.79
本期期初	536,849,306.33	11,866,008.54	524,983,297.79
本期利润	-24,528,619.92	23,302,318.95	-1,226,300.97
本期基金份额交易产生的变动数	—	-4,785,029.66	—
其中：基金申购款	351,736,712.23	1,010,030.77	356,521,741.89
基金赎回款	42,143,585.83	-5,795,060.43	43,153,616.60
	—	—	—

	393,880,298.06		399,675,358.49
本期已分配利润	—	—	—
本期末	160,583,974.18	6,651,280.75	167,235,254.93

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
活期存款利息收入	96,965.06
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	279,657.20
其他	14,999.10
合计	391,621.36

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出股票成交总额	2,175,964,048.35
减：卖出股票成本总额	2,191,374,261.38
减：交易费用	4,195,716.27
买卖股票差价收入	-19,605,929.30

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
债券投资收益——利息收入	26,096,643.56
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-26,792,920.82
合计	-696,277.26

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,599,888,217.07
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,590,131,149.93
减：应计利息总额	36,417,356.74
减：交易费用	132,631.22
买卖债券差价收入	-26,792,920.82

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（2024年01月01日至2024年06月30日）
股票投资产生的股利收益	4,435,767.38
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	4,435,767.38

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
1. 交易性金融资产	23,302,318.95
股票投资	8,707,175.22
债券投资	14,595,143.73
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	23,302,318.95

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
基金赎回费收入	15,149.76
合计	15,149.76

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
审计费用	28,841.54
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	9,230.04
债券账户维护费	18,000.00
其他	608.87
合计	116,680.45

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
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	387,556,358.57	9.98	1,448,893,753.18	11.22
申万宏源	194,022,083.85	4.99	1,435,951,175.04	11.12

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
海通证券	282,212,384.99	8.79	363,936,669.26	7.38
申万宏源	212,560,095.57	6.62	1,200,591,994.86	24.36

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
海通证券	1,068,000,000.00	3.22	1,552,300,000.00	4.39
申万宏源	2,500,000,000.00	7.55	5,860,701,000.00	16.57

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	285,205.26	9.98	8,301.32	0.76
申万宏源	142,771.29	4.99	13,038.00	1.19
关联方名称	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	1,045,092.00	11.22	297,226.79	8.84
申万宏源	1,035,752.85	11.12	157,782.72	4.69

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	4,222,144.07	11,624,319.50
其中：支付销售机构的客户维护费	200,304.40	363,348.79
应支付基金管理人的净管理费	4,021,839.67	11,260,970.71

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.4%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	1,055,535.96	2,906,079.94

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

$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 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（2024年01月01日至2024年06月30日）	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）
基金合同生效日（2017年09月05日）持有的基金份额	10,006,200.62	10,006,200.62
期初持有的基金份额	10,006,200.62	10,006,200.62
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	10,006,200.62	10,006,200.62
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.13%	0.24%

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（2024年06月30日）		上年度末（2023年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	858,985.10	0.10	858,985.10	0.03

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	20,728,683.55	96,965.06	47,930,564.92	163,936.11

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证

券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，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 230,110,677.01 元，于 2024 年 7 月 1 日、2024 年 7 月 10 日、2024 年 10 月 11 日、2024 年 10 月 17 日、2024 年 10 月 18 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（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
AAA	551,154,080.31	1,874,809,085.27
AAA 以下	170,862,534.79	612,936,676.51
未评级	162,388,996.44	160,636,589.32
合计	884,405,611.54	2,648,382,351.10

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

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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

单位：人民币元

本期末（2024年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	20,728,683.55	—	—	—	—	—	20,728,683.55
结算备付金	26,062,968.74	—	—	—	—	—	26,062,968.74
存出保证金	323,631.07	—	—	—	—	—	323,631.07
交易性金融资产	74,564,568.17	330,781,806.52	402,683,958.79	141,539,464.36	77,018,236.81	203,521,832.00	1,230,109,866.65
买入返售金融资产	9,000,000.00	—	—	—	—	—	9,000,000.00
应收清算款	—	—	—	—	—	98,575,444.43	98,575,444.43
应收申购款	—	—	—	—	—	49.96	49.96
资产总计	130,679,851.53	330,781,806.52	402,683,958.79	141,539,464.36	77,018,236.81	302,097,326.39	1,384,800,644.40
负债							
卖出回购金融资产款	210,028,560.60	—	20,082,116.41	—	—	—	230,110,677.01
应付赎回款	—	—	—	—	—	98,887,194.39	98,887,194.39
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	404,016.71	404,016.71
应付托管费	—	—	—	—	—	101,004.17	101,004.17
应交税费	—	—	—	—	—	37,445.41	37,445.41
其他负债	—	—	—	—	—	1,376,501.12	1,376,501.12
负债总计	210,028,560.60	—	20,082,116.41	—	—	100,806,161.80	330,916,838.81
利率敏感度缺口	-79,348,709.07	330,781,806.52	382,601,842.38	141,539,464.36	77,018,236.81	201,291,164.59	1,053,883,805.59
上年度末（2023年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

货币资金	4,962,699.34	—	—	—	—	—	4,962,699.34
结算备付金	30,594,024.74	—	—	—	—	—	30,594,024.74
存出保证金	402,877.66	—	—	—	—	—	402,877.66
交易性金融资产	159,208,371.81	574,028,664.53	1,902,695,141.81	356,896,919.64	—	673,946,928.14	3,666,776,025.93
买入返售金融资产	14,797,262.32	—	—	—	—	—	14,797,262.32
应收清算款	—	—	—	—	—	130,623,345.57	130,623,345.57
应收申购款	—	—	—	—	—	49.96	49.96
资产总计	209,965,235.87	574,028,664.53	1,902,695,141.81	356,896,919.64	—	804,570,323.67	3,848,156,285.52
负债							
卖出回购金融资产款	453,668,323.34	5,716,288.17	—	—	—	—	459,384,611.51
应付清算款	—	—	—	—	—	9,970,461.51	9,970,461.51
应付赎回款	—	—	—	—	—	709,050.25	709,050.25
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,380,047.04	1,380,047.04
应付托管费	—	—	—	—	—	345,011.78	345,011.78
应交税费	—	—	—	—	—	48,617.32	48,617.32
其他负债	—	—	—	—	—	2,293,106.93	2,293,106.93
负债总计	453,668,323.34	5,716,288.17	—	—	—	14,746,294.83	474,130,906.34
利率敏感度缺口	-243,703,087.47	568,312,376.36	1,902,695,141.81	356,896,919.64	—	789,824,028.84	3,374,025,379.18

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（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
分析	1. 基准点利率增加 0.1%	-1,873,664.72	-4,000,333.69
	2. 基准点利率减少 0.1%	1,873,664.72	4,000,333.69

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须

符合中国证监会相关规定)。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；投资于股票、存托凭证、权证等资产的比例不超过基金资产的20%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）		上年度末（2023年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	203,521,832.00	19.31	673,946,928.14	19.97
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,026,588,034.65	97.41	2,992,829,097.79	88.70
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,230,109,866.65	116.72	3,666,776,025.93	108.68

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）

1. 业绩比较基准增加 1%	13,222,279.57	42,109,070.45
2. 业绩比较基准减少 1%	-13,222,279.57	-42,109,070.45

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 (2024年06月30日)	上年度末 (2023年12月31日)
第一层次	442,589,180.14	1,487,955,672.45
第二层次	787,520,686.51	2,178,820,353.48
第三层次	—	—
合计	1,230,109,866.65	3,666,776,025.93

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行业务等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	203,521,832.00	14.70
	其中：股票	203,521,832.00	14.70
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,026,588,034.65	74.13
	其中：债券	1,026,588,034.65	74.13
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	9,000,000.00	0.65
	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	46,791,652.29	3.38
8	其他各项资产	98,899,125.46	7.14
9	合计	1,384,800,644.40	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	1,313,767.00	0.12
B	采矿业	8,202,626.00	0.78
C	制造业	110,689,190.66	10.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,522,171.00	1.47
E	建筑业	4,350,120.00	0.41
F	批发和零售业	3,074,292.96	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	9,698,916.00	0.92
H	住宿和餐饮业	198,380.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,538,705.48	1.28
J	金融业	28,776,773.00	2.73
K	房地产业	1,866,537.00	0.18
L	租赁和商务服务业	728,654.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	1,393,061.90	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	1,939,043.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	525,481.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	1,595,697.00	0.15
S	综合	108,416.00	0.01
	合计	203,521,832.00	19.31

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	601077	渝农商行	691,200	3,469,824.00	0.33
2	600863	内蒙华电	675,000	3,132,000.00	0.30
3	600901	江苏金租	605,100	3,055,755.00	0.29
4	600380	健康元	258,600	2,888,562.00	0.27
5	002563	森马服饰	464,800	2,700,488.00	0.26
6	600873	梅花生物	247,300	2,477,946.00	0.24
7	600161	天坛生物	101,480	2,476,112.00	0.23
8	601216	君正集团	595,300	2,196,657.00	0.21
9	002078	太阳纸业	157,100	2,191,545.00	0.21
10	603606	东方电缆	43,900	2,142,759.00	0.20
11	600050	中国联通	450,800	2,118,760.00	0.20
12	000725	京东方A	513,900	2,101,851.00	0.20
13	002831	裕同科技	81,900	2,095,821.00	0.20
14	000598	兴蓉环境	275,800	2,074,016.00	0.20
15	600582	天地科技	299,600	2,064,244.00	0.20
16	300088	长信科技	432,800	2,034,160.00	0.19
17	000830	鲁西化工	173,600	2,012,024.00	0.19
18	600521	华海药业	116,700	1,989,735.00	0.19
19	002138	顺络电子	71,800	1,971,628.00	0.19
20	600941	中国移动	18,300	1,967,250.00	0.19
21	600348	华阳股份	190,600	1,898,376.00	0.18
22	600663	陆家嘴	207,100	1,826,622.00	0.17
23	601997	贵阳银行	342,000	1,802,340.00	0.17
24	000728	国元证券	295,900	1,793,154.00	0.17
25	601990	南京证券	225,100	1,728,768.00	0.16
26	600879	航天电子	218,000	1,693,860.00	0.16
27	000513	丽珠集团	44,400	1,652,124.00	0.16
28	601816	京沪高铁	304,300	1,634,091.00	0.16
29	600820	隧道股份	249,300	1,627,929.00	0.15
30	600019	宝钢股份	244,700	1,627,255.00	0.15
31	601058	赛轮轮胎	114,500	1,603,000.00	0.15
32	000563	陕国投A	573,500	1,577,125.00	0.15

33	600919	江苏银行	207,000	1,538,010.00	0.15
34	600177	雅戈尔	215,960	1,537,635.20	0.15
35	601000	唐山港	327,100	1,537,370.00	0.15
36	002065	东华软件	338,100	1,528,212.00	0.15
37	002487	大金重工	66,700	1,526,096.00	0.14
38	002415	海康威视	49,100	1,517,681.00	0.14
39	002128	电投能源	69,200	1,460,120.00	0.14
40	601728	中国电信	232,300	1,428,645.00	0.14
41	002465	海格通信	136,700	1,416,212.00	0.13
42	600398	海澜之家	151,900	1,403,556.00	0.13
43	002240	盛新锂能	104,100	1,397,022.00	0.13
44	300383	光环新网	162,700	1,374,815.00	0.13
45	000887	中鼎股份	110,200	1,348,848.00	0.13
46	002152	广电运通	128,800	1,347,248.00	0.13
47	600143	金发科技	202,100	1,335,881.00	0.13
48	002385	大北农	327,500	1,260,875.00	0.12
49	300601	康泰生物	79,200	1,236,312.00	0.12
50	600925	苏能股份	243,900	1,231,695.00	0.12
51	300390	天华新能	71,000	1,219,780.00	0.12
52	600096	云天化	60,100	1,167,142.00	0.11
53	300296	利亚德	255,000	1,147,500.00	0.11
54	300212	易华录	67,500	1,136,025.00	0.11
55	002371	北方华创	3,500	1,119,615.00	0.11
56	600642	申能股份	126,400	1,116,112.00	0.11
57	002273	水晶光电	64,900	1,102,002.00	0.10
58	002765	蓝黛科技	231,900	1,089,930.00	0.10
59	600481	双良节能	232,800	1,087,176.00	0.10
60	603228	景旺电子	33,800	1,074,840.00	0.10
61	002500	山西证券	226,380	1,063,986.00	0.10
62	600219	南山铝业	275,800	1,050,798.00	0.10
63	600517	国网英大	234,200	1,014,086.00	0.10
64	600704	物产中大	230,094	998,607.96	0.09
65	601717	郑煤机	66,600	985,680.00	0.09
66	002008	大族激光	46,800	973,440.00	0.09
67	002100	天康生物	140,300	972,279.00	0.09
68	002252	上海莱士	122,300	956,386.00	0.09
69	000683	远兴能源	137,400	949,434.00	0.09
70	002466	天齐锂业	30,900	924,219.00	0.09
71	603688	石英股份	31,200	923,832.00	0.09
72	000027	深圳能源	118,800	867,240.00	0.08
73	002531	天顺风能	96,400	861,816.00	0.08

74	600350	山东高速	93,900	831,015.00	0.08
75	002697	红旗连锁	175,500	812,565.00	0.08
76	600887	伊利股份	31,300	808,792.00	0.08
77	002139	拓邦股份	76,100	808,182.00	0.08
78	600299	安迪苏	79,200	768,240.00	0.07
79	688114	华大智造	15,925	755,004.25	0.07
80	000723	美锦能源	158,100	752,556.00	0.07
81	002550	千红制药	136,100	733,579.00	0.07
82	600008	首创环保	273,400	732,712.00	0.07
83	603096	新经典	43,300	731,770.00	0.07
84	002241	歌尔股份	37,300	727,723.00	0.07
85	002446	盛路通信	128,800	727,720.00	0.07
86	300438	鹏辉能源	38,400	704,256.00	0.07
87	001286	陕西能源	60,800	701,024.00	0.07
88	601857	中国石油	66,600	687,312.00	0.07
89	600497	驰宏锌锗	128,600	686,724.00	0.07
90	002429	兆驰股份	142,500	685,425.00	0.07
91	003816	中国广核	146,900	680,147.00	0.06
92	002961	瑞达期货	61,500	673,425.00	0.06
93	601009	南京银行	64,700	672,233.00	0.06
94	600886	国投电力	36,400	663,936.00	0.06
95	600795	国电电力	110,600	662,494.00	0.06
96	601169	北京银行	113,100	660,504.00	0.06
97	600323	瀚蓝环境	31,600	660,440.00	0.06
98	601229	上海银行	90,900	659,934.00	0.06
99	601827	三峰环境	77,700	659,673.00	0.06
100	601398	工商银行	115,600	658,920.00	0.06
101	600900	长江电力	22,600	653,592.00	0.06
102	601939	建设银行	88,300	653,420.00	0.06
103	600028	中国石化	103,200	652,224.00	0.06
104	600018	上港集团	112,800	651,984.00	0.06
105	601669	中国电建	116,600	651,794.00	0.06
106	600025	华能水电	60,400	651,112.00	0.06
107	601668	中国建筑	122,600	651,006.00	0.06
108	002839	张家港行	160,500	645,210.00	0.06
109	601006	大秦铁路	90,100	645,116.00	0.06
110	600000	浦发银行	78,300	644,409.00	0.06
111	002267	陕天然气	84,700	640,332.00	0.06
112	600967	内蒙一机	88,900	640,080.00	0.06
113	600015	华夏银行	99,800	638,720.00	0.06
114	601117	中国化学	77,500	638,600.00	0.06

115	600377	宁沪高速	50,600	637,560.00	0.06
116	600717	天津港	149,200	637,084.00	0.06
117	603323	苏农银行	132,100	635,401.00	0.06
118	002807	江阴银行	168,300	634,491.00	0.06
119	603299	苏盐井神	66,600	632,700.00	0.06
120	002601	龙佰集团	33,900	629,523.00	0.06
121	600104	上汽集团	45,300	627,858.00	0.06
122	601231	环旭电子	39,000	625,950.00	0.06
123	600332	白云山	21,200	621,796.00	0.06
124	600039	四川路桥	78,700	620,943.00	0.06
125	301109	军信股份	41,400	618,930.00	0.06
126	601916	浙商银行	224,000	618,240.00	0.06
127	300498	温氏股份	30,900	612,438.00	0.06
128	600926	杭州银行	46,900	612,045.00	0.06
129	300760	迈瑞医疗	2,100	610,911.00	0.06
130	600548	深高速	57,100	606,973.00	0.06
131	002048	宁波华翔	46,600	603,004.00	0.06
132	300384	三联虹普	45,900	602,208.00	0.06
133	600598	北大荒	48,200	602,018.00	0.06
134	000848	承德露露	76,500	601,290.00	0.06
135	002249	大洋电机	127,100	601,183.00	0.06
136	002153	石基信息	104,800	600,504.00	0.06
137	601608	中信重工	157,000	598,170.00	0.06
138	600033	福建高速	175,600	588,260.00	0.06
139	002034	旺能环境	45,000	585,450.00	0.06
140	301391	卡莱特	13,200	577,896.00	0.05
141	601158	重庆水务	118,200	567,360.00	0.05
142	002498	汉缆股份	171,900	565,551.00	0.05
143	600618	氯碱化工	63,700	559,286.00	0.05
144	301011	华立科技	36,000	554,760.00	0.05
145	600909	华安证券	127,700	537,617.00	0.05
146	001206	依依股份	41,000	533,820.00	0.05
147	600256	广汇能源	79,300	531,310.00	0.05
148	688177	百奥泰	24,797	523,712.64	0.05
149	002195	岩山科技	206,100	517,311.00	0.05
150	002064	华峰化学	71,800	514,806.00	0.05
151	002223	鱼跃医疗	13,500	507,600.00	0.05
152	600874	创业环保	88,800	496,392.00	0.05
153	002028	思源电气	7,400	495,060.00	0.05
154	000825	太钢不锈	143,400	484,692.00	0.05
155	601198	东兴证券	59,200	471,232.00	0.04

156	603408	建霖家居	35,700	470,883.00	0.04
157	300378	鼎捷软件	28,800	468,576.00	0.04
158	000429	粤高速A	44,800	466,368.00	0.04
159	300595	欧普康视	28,900	453,152.00	0.04
160	001203	大中矿业	47,000	451,670.00	0.04
161	601139	深圳燃气	67,500	450,900.00	0.04
162	000837	秦川机床	59,800	440,128.00	0.04
163	601766	中国中车	58,300	437,833.00	0.04
164	600755	厦门国贸	60,900	436,653.00	0.04
165	603305	旭升集团	39,800	420,288.00	0.04
166	600522	中天科技	26,500	420,025.00	0.04
167	002948	青岛银行	123,600	416,532.00	0.04
168	300887	谱尼测试	55,900	413,660.00	0.04
169	601607	上海医药	21,600	412,776.00	0.04
170	688276	百克生物	14,504	411,478.48	0.04
171	002738	中矿资源	15,300	410,040.00	0.04
172	300529	健帆生物	15,000	408,150.00	0.04
173	300122	智飞生物	14,400	403,632.00	0.04
174	600674	川投能源	21,500	403,125.00	0.04
175	001213	中铁特货	101,300	400,135.00	0.04
176	603883	老百姓	21,400	392,904.00	0.04
177	000100	TCL 科技	88,800	383,616.00	0.04
178	600507	方大特钢	101,500	379,610.00	0.04
179	600183	生益科技	17,600	370,656.00	0.04
180	000009	中国宝安	43,000	369,800.00	0.04
181	600845	宝信软件	11,200	357,616.00	0.03
182	000932	华菱钢铁	76,940	340,844.20	0.03
183	688510	航亚科技	18,328	337,418.48	0.03
184	603882	金域医学	12,100	328,999.00	0.03
185	000958	电投产融	88,900	325,374.00	0.03
186	301260	格力博	23,400	318,708.00	0.03
187	600125	铁龙物流	52,900	315,813.00	0.03
188	002004	华邦健康	82,700	314,260.00	0.03
189	601311	骆驼股份	39,100	313,582.00	0.03
190	688533	上声电子	12,028	311,164.36	0.03
191	300364	中文在线	14,400	310,752.00	0.03
192	601636	旗滨集团	47,800	308,310.00	0.03
193	688105	诺唯赞	15,034	300,830.34	0.03
194	000999	华润三九	6,800	289,544.00	0.03
195	300559	佳发教育	29,400	281,358.00	0.03
196	301029	怡合达	14,200	279,172.00	0.03

197	002001	新和成	14,200	272,640.00	0.03
198	002683	广东宏大	13,500	271,755.00	0.03
199	002475	立讯精密	6,900	271,239.00	0.03
200	000937	冀中能源	39,600	265,320.00	0.03
201	688779	五矿新能	57,194	264,808.22	0.03
202	688313	仕佳光子	27,743	264,113.36	0.03
203	688551	科威尔	8,274	260,631.00	0.02
204	603939	益丰药房	10,600	260,230.00	0.02
205	600566	济川药业	8,200	260,022.00	0.02
206	300133	华策影视	40,900	251,126.00	0.02
207	300997	欢乐家	21,200	250,584.00	0.02
208	002068	黑猫股份	34,700	246,370.00	0.02
209	000987	越秀资本	48,900	242,544.00	0.02
210	000559	万向钱潮	53,500	238,610.00	0.02
211	605186	健麾信息	10,400	233,584.00	0.02
212	688567	孚能科技	24,010	230,496.00	0.02
213	002966	苏州银行	30,600	229,500.00	0.02
214	301291	明阳电气	7,600	228,380.00	0.02
215	688169	石头科技	581	228,100.60	0.02
216	002056	横店东磁	18,200	226,954.00	0.02
217	002865	钧达股份	5,700	218,766.00	0.02
218	002020	京新药业	20,300	212,541.00	0.02
219	688023	安恒信息	5,280	211,252.80	0.02
220	300674	宇信科技	18,700	207,196.00	0.02
221	002334	英威腾	34,600	206,908.00	0.02
222	601598	中国外运	36,500	205,495.00	0.02
223	002126	银轮股份	11,500	200,215.00	0.02
224	301073	君亭酒店	10,900	198,380.00	0.02
225	002544	普天科技	10,200	190,638.00	0.02
226	601019	山东出版	16,100	190,302.00	0.02
227	002120	韵达股份	24,500	189,630.00	0.02
228	688707	振华新材	19,258	187,572.92	0.02
229	688095	福昕软件	4,077	186,767.37	0.02
230	688639	华恒生物	2,444	186,697.16	0.02
231	688516	奥特维	4,444	185,803.64	0.02
232	605007	五洲特纸	14,600	184,398.00	0.02
233	000538	云南白药	3,600	184,140.00	0.02
234	600062	华润双鹤	9,400	184,052.00	0.02
235	000403	派林生物	6,900	183,954.00	0.02
236	688028	沃尔德	11,177	183,638.11	0.02
237	300001	特锐德	9,100	183,092.00	0.02

238	605016	百龙创园	8,870	180,681.90	0.02
239	000050	深天马A	24,800	180,544.00	0.02
240	002340	格林美	28,300	180,271.00	0.02
241	300371	汇中股份	21,500	179,955.00	0.02
242	603501	韦尔股份	1,800	178,866.00	0.02
243	688598	金博股份	6,272	177,497.60	0.02
244	688772	珠海冠宇	11,790	175,671.00	0.02
245	688556	高测股份	14,148	168,219.72	0.02
246	002044	美年健康	43,400	164,052.00	0.02
247	600929	雪天盐业	30,600	162,180.00	0.02
248	601868	中国能建	75,400	159,848.00	0.02
249	601577	长沙银行	19,500	159,510.00	0.02
250	002019	亿帆医药	12,900	159,444.00	0.02
251	600908	无锡银行	29,400	156,408.00	0.01
252	688375	国博电子	2,190	154,701.60	0.01
253	603119	浙江荣泰	8,140	144,240.80	0.01
254	688036	传音控股	1,881	143,971.74	0.01
255	000541	佛山照明	29,100	141,717.00	0.01
256	002558	巨人网络	15,000	141,600.00	0.01
257	002797	第一创业	27,000	137,430.00	0.01
258	001328	登康口腔	5,300	134,090.00	0.01
259	601298	青岛港	14,000	133,840.00	0.01
260	603258	电魂网络	8,100	130,815.00	0.01
261	002414	高德红外	21,400	126,046.00	0.01
262	000039	中集集团	13,200	122,232.00	0.01
263	688188	柏楚电子	656	121,064.80	0.01
264	688425	铁建重工	32,253	118,691.04	0.01
265	000785	居然之家	47,900	116,397.00	0.01
266	300502	新易盛	1,100	116,105.00	0.01
267	688690	纳微科技	6,625	115,076.25	0.01
268	603569	长久物流	16,600	113,876.00	0.01
269	600399	抚顺特钢	19,400	109,222.00	0.01
270	600673	东阳光	15,400	108,416.00	0.01
271	002587	奥拓电子	19,800	106,524.00	0.01
272	002472	双环传动	4,800	105,696.00	0.01
273	688031	星环科技	2,849	104,586.79	0.01
274	688563	航材股份	1,965	103,909.20	0.01
275	300969	恒帅股份	1,500	103,695.00	0.01
276	000810	创维数字	11,800	101,244.00	0.01
277	000423	东阿阿胶	1,600	100,160.00	0.01
278	300972	万辰集团	4,700	99,311.00	0.01

279	688009	中国通号	16,392	98,352.00	0.01
280	601665	齐鲁银行	19,600	96,236.00	0.01
281	002745	木林森	11,700	94,302.00	0.01
282	603214	爱婴室	8,200	92,578.00	0.01
283	000750	国海证券	31,300	91,083.00	0.01
284	002818	富森美	7,100	87,046.00	0.01
285	688180	君实生物	2,969	86,249.45	0.01
286	300003	乐普医疗	5,800	86,072.00	0.01
287	300114	中航电测	1,900	85,975.00	0.01
288	002739	万达电影	6,700	81,003.00	0.01
289	002777	久远银海	5,400	80,946.00	0.01
290	603816	顾家家居	2,500	80,725.00	0.01
291	600483	福能股份	6,900	80,454.00	0.01
292	300893	松原股份	2,800	79,996.00	0.01
293	688089	嘉必优	5,968	79,016.32	0.01
294	300207	欣旺达	5,200	78,884.00	0.01
295	601555	东吴证券	13,300	78,470.00	0.01
296	603328	依顿电子	9,900	77,814.00	0.01
297	300017	网宿科技	9,800	77,420.00	0.01
298	688315	诺禾致源	6,993	76,363.56	0.01
299	688369	致远互联	4,849	76,274.77	0.01
300	603233	大参林	5,300	75,790.00	0.01
301	600269	赣粤高速	14,500	74,965.00	0.01
302	600095	湘财股份	12,400	73,904.00	0.01
303	601658	邮储银行	14,500	73,515.00	0.01
304	000630	铜陵有色	20,300	73,283.00	0.01
305	300005	探路者	14,300	71,643.00	0.01
306	001311	多利科技	2,900	70,122.00	0.01
307	000967	盈峰环境	16,500	69,795.00	0.01
308	688680	海优新材	2,406	69,148.44	0.01
309	002262	恩华药业	2,700	64,098.00	0.01
310	600741	华域汽车	3,900	63,882.00	0.01
311	603181	皇马科技	7,100	63,829.00	0.01
312	600282	南钢股份	12,200	60,756.00	0.01
313	002035	华帝股份	9,700	60,431.00	0.01
314	603728	鸣志电器	1,500	60,345.00	0.01
315	300170	汉得信息	9,700	59,558.00	0.01
316	600089	特变电工	4,100	56,867.00	0.01
317	300687	赛意信息	3,300	45,936.00	0.00
318	601155	新城控股	4,500	39,915.00	0.00
319	000712	锦龙股份	5,200	39,000.00	0.00

320	002791	坚朗五金	1,500	38,805.00	0.00
321	603786	科博达	600	38,490.00	0.00
322	600956	新天绿能	4,700	38,399.00	0.00
323	603185	弘元绿能	2,200	37,598.00	0.00
324	002225	濮耐股份	8,700	35,583.00	0.00
325	000012	南玻A	7,000	35,280.00	0.00
326	600988	赤峰黄金	2,100	34,314.00	0.00
327	000738	航发控制	1,700	34,119.00	0.00
328	601963	重庆银行	4,400	34,100.00	0.00
329	600699	均胜电子	2,300	34,086.00	0.00
330	002268	电科网安	2,300	32,729.00	0.00
331	600763	通策医疗	600	32,430.00	0.00
332	300058	蓝色光标	5,900	32,096.00	0.00
333	688116	天奈科技	1,389	32,058.12	0.00
334	600420	国药现代	3,000	32,040.00	0.00
335	600985	淮北矿业	1,900	31,806.00	0.00
336	603039	泛微网络	1,000	31,760.00	0.00
337	605166	聚合顺	3,000	31,470.00	0.00
338	601399	国机重装	12,100	31,218.00	0.00
339	002945	华林证券	3,100	30,938.00	0.00
340	603466	风语筑	3,600	30,744.00	0.00
341	301102	兆讯传媒	2,600	30,654.00	0.00
342	600369	西南证券	8,500	30,430.00	0.00
343	300303	聚飞光电	6,200	30,132.00	0.00
344	601162	天风证券	13,800	30,084.00	0.00
345	300258	精锻科技	3,700	30,081.00	0.00
346	600372	中航机载	2,500	29,925.00	0.00
347	002790	瑞尔特	3,300	29,799.00	0.00
348	600787	中储股份	6,100	29,341.00	0.00
349	301187	欧圣电气	1,200	29,100.00	0.00
350	301078	孩子王	5,700	28,842.00	0.00
351	301296	新巨丰	4,000	28,840.00	0.00
352	001236	弘业期货	4,000	28,440.00	0.00
353	300379	东方通	3,500	28,280.00	0.00
354	300769	德方纳米	1,000	28,200.00	0.00
355	300662	科锐国际	1,600	25,808.00	0.00
356	300253	卫宁健康	3,800	22,420.00	0.00
357	688475	萤石网络	648	22,103.28	0.00
358	603596	伯特利	400	15,560.00	0.00
359	688252	天德钰	715	10,388.95	0.00
360	688236	春立医疗	531	7,529.58	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	600820	隧道股份	15,529,032.00	0.46
2	601058	赛轮轮胎	13,661,450.00	0.40
3	002064	华峰化学	12,155,718.00	0.36
4	600582	天地科技	11,418,170.00	0.34
5	600497	驰宏锌锗	10,818,889.00	0.32
6	600406	国电南瑞	10,613,027.00	0.31
7	600529	山东药玻	10,508,699.00	0.31
8	600887	伊利股份	10,444,868.00	0.31
9	002465	海格通信	9,770,854.50	0.29
10	002385	大北农	9,224,138.00	0.27
11	600398	海澜之家	9,026,349.00	0.27
12	600879	航天电子	8,974,981.00	0.27
13	000651	格力电器	8,900,629.00	0.26
14	603000	人民网	8,846,643.04	0.26
15	000725	京东方 A	8,649,026.00	0.26
16	002152	广电运通	8,534,808.00	0.25
17	300136	信维通信	8,455,846.00	0.25
18	000878	云南铜业	8,438,352.00	0.25
19	601077	渝农商行	8,388,308.00	0.25
20	002429	兆驰股份	8,168,888.00	0.24

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	600497	驰宏锌锗	19,968,740.00	0.59
2	600704	物产中大	16,418,637.80	0.49
3	600873	梅花生物	16,013,209.00	0.47
4	600879	航天电子	15,630,749.21	0.46
5	002252	上海莱士	14,565,335.00	0.43
6	000725	京东方 A	14,430,847.00	0.43
7	600582	天地科技	14,339,071.00	0.42
8	000630	铜陵有色	13,964,933.00	0.41
9	600820	隧道股份	13,923,057.00	0.41
10	002078	太阳纸业	13,862,662.00	0.41

11	000100	TCL 科技	13,194,474.00	0.39
12	002600	领益智造	13,060,429.00	0.39
13	000039	中集集团	12,970,172.40	0.38
14	601162	天风证券	12,859,371.00	0.38
15	601058	赛轮轮胎	12,750,688.00	0.38
16	000723	美锦能源	12,111,378.00	0.36
17	002064	华峰化学	12,074,483.00	0.36
18	000937	冀中能源	12,070,710.18	0.36
19	600637	东方明珠	11,688,914.00	0.35
20	600998	九州通	11,449,173.40	0.34

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,712,241,990.02
卖出股票收入（成交）总额	2,175,964,048.35

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	142,182,423.11	13.49
2	央行票据	—	—
3	金融债券	304,360,217.77	28.88
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	335,929,239.19	31.88
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	244,116,154.58	23.16
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,026,588,034.65	97.41

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	188630	21 中车 G1	890,000	90,989,771.78	8.63

2	1928032	19 建设银行永续 债	700,000	72,423,614.21	6.87
3	019727	23 国债 24	640,000	65,164,186.30	6.18
4	230023	23 附息国债 23	500,000	56,345,573.77	5.35
5	2028032	20 农业银行永续 债 02	500,000	53,309,426.23	5.06

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，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

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	323,631.07
2	应收清算款	98,575,444.43
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	49.96
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	98,899,125.46

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	113053	隆 22 转债	12,249,725.38	1.16
2	118034	晶能转债	5,866,173.48	0.56
3	113056	重银转债	5,347,037.48	0.51
4	113052	兴业转债	5,302,665.89	0.50
5	110079	杭银转债	5,223,182.82	0.50
6	123107	温氏转债	5,061,843.54	0.48
7	132026	G 三峡 EB2	5,048,806.44	0.48
8	118024	冠宇转债	4,911,401.43	0.47
9	113045	环旭转债	4,883,418.61	0.46
10	111010	立昂转债	4,825,253.81	0.46

11	113065	齐鲁转债	4,779,920.06	0.45
12	128109	楚江转债	4,770,195.10	0.45
13	110059	浦发转债	4,741,840.90	0.45
14	113632	鹤21转债	4,709,593.22	0.45
15	113050	南银转债	4,702,953.08	0.45
16	113602	景20转债	4,578,428.24	0.43
17	118031	天23转债	4,456,859.18	0.42
18	127032	苏行转债	4,431,031.23	0.42
19	113623	风21转债	4,297,461.90	0.41
20	127049	希望转2	4,233,255.33	0.40
21	127052	西子转债	4,180,396.98	0.40
22	113651	松霖转债	4,146,967.95	0.39
23	113669	景23转债	4,141,817.52	0.39
24	123119	康泰转2	4,124,837.64	0.39
25	113619	世运转债	4,084,493.36	0.39
26	113042	上银转债	4,067,238.08	0.39
27	127015	希望转债	4,027,624.13	0.38
28	123170	南电转债	3,595,576.18	0.34
29	113652	伟22转债	3,573,195.10	0.34
30	113068	金铜转债	3,370,454.61	0.32
31	113658	密卫转债	3,340,458.40	0.32
32	127022	恒逸转债	3,340,176.24	0.32
33	127045	牧原转债	3,313,781.59	0.31
34	123145	药石转债	3,260,096.88	0.31
35	113673	岱美转债	3,153,082.97	0.30
36	128136	立讯转债	3,151,893.53	0.30
37	111002	特纸转债	2,905,306.34	0.28
38	113672	福蓉转债	2,686,739.82	0.25
39	113616	韦尔转债	2,678,719.71	0.25
40	128141	旺能转债	2,667,272.89	0.25
41	123208	孩王转债	2,547,655.61	0.24
42	127095	广泰转债	2,482,159.95	0.24

43	123035	利德转债	2,442,673.32	0.23
44	118030	睿创转债	2,435,632.05	0.23
45	123133	佩蒂转债	2,203,473.29	0.21
46	123184	天阳转债	2,100,716.74	0.20
47	123213	天源转债	2,086,268.59	0.20
48	127098	欧晶转债	2,081,622.90	0.20
49	127016	鲁泰转债	2,061,285.63	0.20
50	123228	震裕转债	2,052,865.69	0.19
51	113627	太平转债	2,011,133.45	0.19
52	113639	华正转债	1,998,106.42	0.19
53	123115	捷捷转债	1,965,557.19	0.19
54	113021	中信转债	1,879,818.81	0.18
55	113638	台21转债	1,873,078.84	0.18
56	127031	洋丰转债	1,849,086.02	0.18
57	118033	华特转债	1,836,410.36	0.17
58	123191	智尚转债	1,820,878.36	0.17
59	123188	水羊转债	1,802,521.82	0.17
60	123113	仙乐转债	1,789,700.00	0.17
61	123233	凯盛转债	1,760,315.45	0.17
62	123224	宇邦转债	1,748,025.68	0.17
63	110074	精达转债	1,584,819.02	0.15
64	127067	恒逸转2	1,567,519.21	0.15
65	113024	核建转债	1,563,775.97	0.15
66	123101	拓斯转债	1,459,879.05	0.14
67	110076	华海转债	1,420,518.46	0.13
68	118004	博瑞转债	1,357,232.65	0.13
69	118037	上声转债	1,291,983.39	0.12
70	128087	孚日转债	1,254,093.91	0.12
71	123117	健帆转债	1,173,148.20	0.11
72	118041	星球转债	1,053,996.04	0.10
73	123120	隆华转债	1,034,222.61	0.10
74	123235	亿田转债	976,422.95	0.09

75	111007	永和转债	917,254.93	0.09
76	123050	聚飞转债	880,921.53	0.08
77	127040	国泰转债	857,508.44	0.08
78	123225	翔丰转债	749,171.40	0.07
79	113656	嘉诚转债	685,197.25	0.07
80	123090	三诺转债	676,394.94	0.06
81	128131	崇达转 2	443,305.75	0.04
82	113582	火炬转债	424,423.38	0.04
83	110093	神马转债	405,548.98	0.04
84	128071	合兴转债	343,179.51	0.03
85	113676	荣 23 转债	328,780.86	0.03
86	123178	花园转债	321,999.17	0.03
87	123108	乐普转 2	318,737.26	0.03
88	127082	亚科转债	243,755.11	0.02
89	127077	华宏转债	232,654.99	0.02
90	127043	川恒转债	228,397.20	0.02
91	127039	北港转债	180,301.52	0.02
92	127070	大中转债	154,093.33	0.01
93	113046	金田转债	143,702.24	0.01
94	127086	恒邦转债	127,788.07	0.01
95	123064	万孚转债	125,304.43	0.01
96	118044	赛特转债	117,414.54	0.01
97	113662	豪能转债	115,323.03	0.01
98	123169	正海转债	88,644.36	0.01
99	127017	万青转债	67,534.77	0.01
100	113644	艾迪转债	45,216.68	0.00
101	113647	禾丰转债	20,848.68	0.00
102	113051	节能转债	20,301.89	0.00
103	110062	烽火转债	7,050.15	0.00
104	111005	富春转债	6,413.25	0.00
105	110077	洪城转债	6,323.13	0.00
106	111008	沿浦转债	4,764.28	0.00

107	113641	华友转债	2,029.34	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(%)
2,239	396,002.03	883,966,129.68	99.70	2,682,420.98	0.30

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	9,966.76	0.0011

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
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数(份)	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数(份)	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,006,200.62	1.13	10,006,200.62	1.13	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	858,985.10	0.10	—	—	—
合计	10,865,185.72	1.23	10,006,200.62	1.13	3年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年09月05日)基金份额总额	150,004,400.62
报告期期初基金份额总额	2,849,042,081.39
本报告期基金总申购份额	236,718,246.54
减：本报告期基金总赎回份额	2,199,111,777.27
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	886,648,550.66

§ 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。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长城证券	1	86,905,101.73	2.24	63,954.52	2.24	—
方正证券	2	360,071,665.15	9.27	264,977.56	9.27	—
国盛证券	1	—	—	—	—	—
国泰君安	2	719,914,322.65	18.53	529,786.82	18.53	—
海通证券	1	387,556,358.57	9.98	285,205.26	9.98	—
华泰证券	1	799,935,055.91	20.59	588,669.30	20.59	—
平安证券	2	335,722,132.74	8.64	247,054.84	8.64	—
申万宏源	2	194,022,083.85	4.99	142,771.29	4.99	—
银河证券	2	117,798,744.46	3.03	86,688.33	3.03	—
招商证券	1	178,851,149.27	4.60	131,613.63	4.60	—
浙商证券	2	—	—	—	—	—
中金财富	2	—	—	—	—	—
中金公司	1	145,909,035.85	3.76	107,378.19	3.76	—
中泰证券	1	64,503,506.94	1.66	47,466.17	1.66	—
中信证券	1	493,288,488.66	12.70	363,031.64	12.70	—

注：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 (%)
长城证券	64,524,709.03	2.01	199,493,000.00	0.60	—	—

方正证券	360,899,793.62	11.24	1,002,500,000.00	3.03	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	519,110,406.07	16.16	2,980,200,000.00	9.00	—	—
海通证券	282,212,384.99	8.79	1,068,000,000.00	3.22	—	—
华泰证券	679,085,575.94	21.15	10,637,100,000.00	32.11	—	—
平安证券	271,522,505.81	8.45	1,912,700,000.00	5.77	—	—
申万宏源	212,560,095.57	6.62	2,500,000,000.00	7.55	—	—
银河证券	120,504,233.18	3.75	1,853,300,000.00	5.59	—	—
招商证券	128,250,200.29	3.99	2,232,775,000.00	6.74	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中金财富	—	—	—	—	—	—
中金公司	91,061,027.02	2.84	1,276,000,000.00	3.85	—	—
中泰证券	6,442,834.30	0.20	440,000,000.00	1.33	—	—
中信证券	475,276,156.77	14.80	7,028,000,000.00	21.21	—	—

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	2024-01-01 至 2024-03-11; 2024-03-19; 2024-03-25 至 2024-05-16	750,745,452.08	—	750,745,452.08	—	—
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丰利增强债券型发起式证券投资基金的文件 2、富国丰利增强债券型发起式证券投资基金基金合同 3、富国丰利增强债券型发起式证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国丰利增强债券型发起式证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	中国(上海)自由贸易试验区 世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费） 公司地址： http://www.fullgoal.com.cn 。