

富国宝利增强债券型发起式证券投资基金

二〇二六年中期报告

2026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：2026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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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 2026 年 1 月 1 日起至 2026 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	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
§ 4	管理人报告	11
4.1	基金管理人及基金经理情况	11
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
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	半年度财务报告（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	42
7.1	期末基金资产组合情况	42

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	58
§ 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	64
§ 10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	65
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	66
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
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	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	
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	12,049,858,821.64 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国宝利增强债券 A	富国宝利增强债券 E
下属分级基金的交易代码	005078	022175
报告期末下属分级基金的份额总额	6,482,165,762.35 份	5,567,693,059.29 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。本基金在债券投资过程中突出主动性的投资管理，在对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势进行客观判断的基础上，通过合理配置收益率相对较高的企业债、公司债、资产支持证券，以及风险收益特征优异的可转换公司债券、可分离交易可转债、中小企业私募债券、可交换债券等债券品种，加以对国家债券、金融债券、中央银行票据以及质押及买断式回购等高流动性品种的投资，灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略，在保证基金流动性的前提下，积极把握固定收益证券市场中投资机会，获取各类债券的超额投资收益。当本基金管理人判断市场出现明显的趋势性投资机会时，本基金可以直接参与股票市场投资，努力获取超额收益。在股票市场投资过程中，本基金主要采取自下而上的投资策略，利用数量化投资技术与基本面研究相结合的研究方法进行投资。本基金的资产证券化产品投资策略、存托凭证投资策略、权证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	王小飞
	联系电话	021-20361818	021-6063 7103
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	95105686、4008880688	021-60637228
传真	021-20361616	021-60635778
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	陈戈	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告置备地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国保利增强债券 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	159,006,270.86
本期利润	243,098,610.30
加权平均基金份额本期利润	0.0531
本期加权平均净值利润率	3.67%
本期基金份额净值增长率	3.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	2,379,134,919.98
期末可供分配基金份额利润	0.3670
期末基金资产净值	9,535,930,008.44
期末基金份额净值	1.4711
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	51.86%

(2) 富国保利增强债券 E

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	175,860,206.29
本期利润	251,178,025.47
加权平均基金份额本期利润	0.0520
本期加权平均净值利润率	3.60%
本期基金份额净值增长率	3.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	2,040,337,259.19
期末可供分配基金份额利润	0.3665
期末基金资产净值	8,187,558,827.88
期末基金份额净值	1.4705
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	20.00%

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，开放式基金的申购费

回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国保利增强债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.08%	0.28%	1.74%	0.14%	1.34%	0.14%
过去六个月	3.86%	0.27%	1.62%	0.12%	2.24%	0.15%
过去一年	9.88%	0.25%	1.98%	0.11%	7.90%	0.14%
过去三年	18.64%	0.35%	7.80%	0.11%	10.84%	0.24%
过去五年	19.90%	0.32%	7.84%	0.11%	12.06%	0.21%
过去七年	39.20%	0.31%	13.34%	0.12%	25.86%	0.19%
自基金合同生效起至今	51.86%	0.31%	17.88%	0.12%	33.98%	0.19%

(2) 富国保利增强债券 E

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.07%	0.28%	1.74%	0.14%	1.33%	0.14%
过去六个月	3.86%	0.27%	1.62%	0.12%	2.24%	0.15%
过去一年	9.87%	0.25%	1.98%	0.11%	7.89%	0.14%
自基金分级生效日起至今	20.00%	0.39%	4.84%	0.12%	15.16%	0.27%

注：本基金业绩比较基准根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

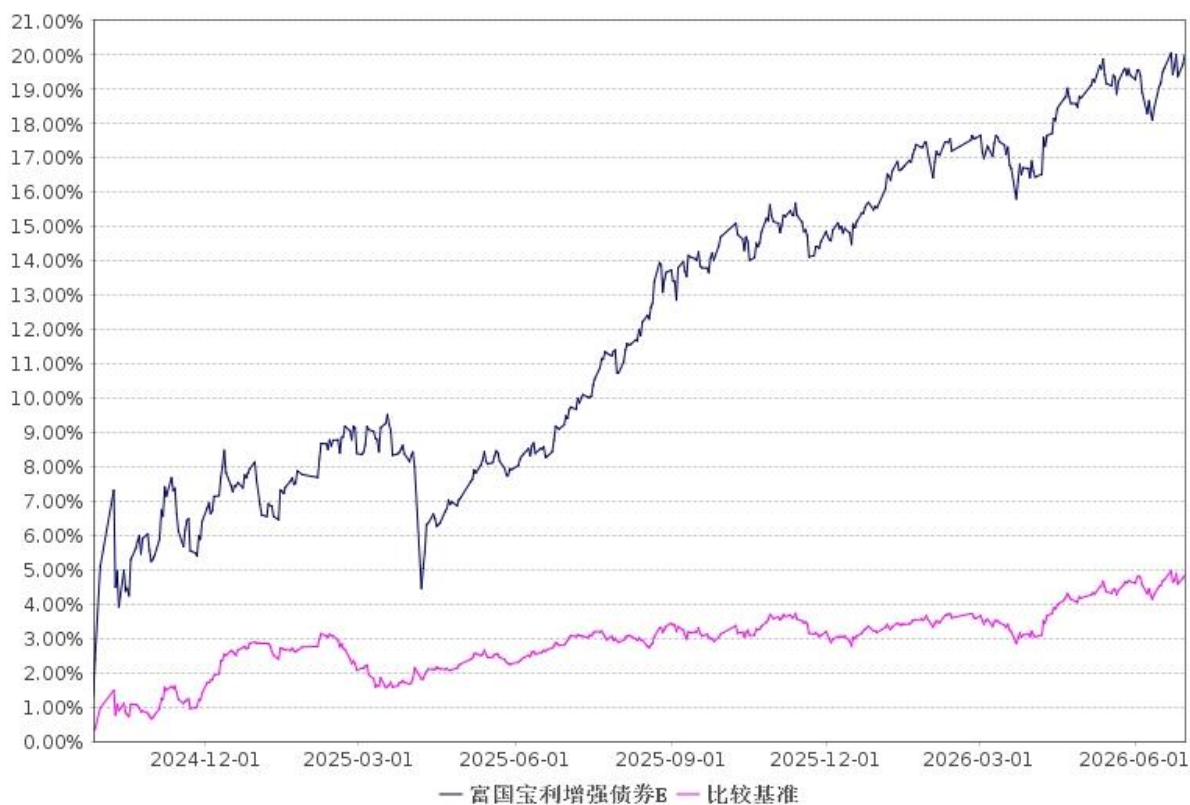
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(1) 富国保利增强债券 A



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

(2) 富国宝利增强债券 E



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2024 年 9 月 25 日起增加 E 类份额，相关数据按实际存续期计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至 2026 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 464 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	—	13	硕士，曾任交银施罗德基金管理有限公司研究员、投资经理；自 2016 年 10 月加入富国基金管理有限公司，历任定量投资经理、定量基金经理、量化投资部债券投资总监助理；现任富国基金量化投资部债券投资总监助理兼量化多资产投资部总经理，兼任富国基金定量基

					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；自 2026 年 06 月起任富国裕丰回报混合型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

本报告期，公司严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规和内部管理办法的要求，通过自动化系统、人工审核等方式在各投资业务环节加强管控，确保公平对待旗下管理的所有投资组合。管理人对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析评估。在同向交易价差分析方面，采集连续四个季度不同时间窗口（1 日内、3 日内、5 日内）的同向交易样本，对同向交易价差进行假设检验并对检验结果进行分析。分析结果表明在同向交易价差方面，本投资组合与公司管理的其他投资组合未出现可能导致不公平交易、利益输送的交易事项。本报告期内公司旗下基金严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间，出现 76 次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况，为投资组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平对待投资组合或利益输送等情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，市场在国内经济结构性修复、海外央行政策再定价、地缘冲突反复和政策呵护之间剧烈波动。年初春季躁动带动权益、可转债和大宗商品快速上行，贵金属及高估值转债表现突出，但随后宽基 ETF 持续流出、监管降温及获利了结使市场于 1 月下旬开始调整。2 月至 3 月，美伊冲突及霍尔木兹海峡风险推升油价和通胀预期，全球风险资产承压，A 股主要指数冲高回落，能源、煤炭、公用事业等防御及资源方向相对占优，科技和小盘风格波动明显放大；债券市场则在避险需求和通胀约束之间反复，短端利率及信用债受益于宽松资金面，超长端表现相对受压。

二季度，随着停火预期、政治局会议及一季报陆续落地，市场围绕政策和业绩线索阶段性修复，通信、电子、军工、电力设备等成长方向多次领涨。指数在中美关系缓和带动下创出阶段性新高，但随后科技抱团加剧、市场宽度收窄，月底又受到海外通胀和地缘扰动冲击，指增选股难度上升；债市在宽松资金面和偏弱增长预期下延续走强。二季度末，市场风险偏好在美伊局势、海外央行鹰派信号和国内科创政策之间快速切换，科技成长方向多次强势反弹，但板块内部分化加剧，指增选股难度进一步加大。纯债部分组合适度拉长久期、参与了利率下行机会；而可转债方面，由于市场估值水平仍居高位，整体维持低敞口以降低波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金份额净值富国宝利增强债券 A 为 1.4711 元，富国宝利增强债券 E 为 1.4705 元；份额累计净值富国宝利增强债券 A 为 1.5111 元，富国宝利增强债券 E 为 1.4705 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国宝利增强债券 A 为 3.86%，富国宝利增强债券 E 为 3.86%；同期业绩比较基准收益率情况：富国宝利增强债券 A 为 1.62%，富国宝利增强债券 E 为 1.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济仍处于温和修复阶段，6月制造业PMI守在荣枯线上方，政策仍具支持空间，但内需弹性和企业盈利修复仍需观察。海外方面，美联储鹰派表态、通胀黏性及地缘风险仍可能阶段性扰动全球流动性和风险偏好。权益市场方面，AI和硬科技或仍是中长期重要方向，但短期拥挤度和交易集中度偏高，后续更需要关注业绩兑现、产业趋势扩散以及市场宽度修复。债券方面，利率已处于偏低位置，进一步下行需要基本面或政策催化，组合将保持灵活久期管理。可转债估值性价比仍不突出，战略性机会尚需等待。整体上，组合将继续力求以控制回撤和提高风险收益比为核心，在权益、纯债和转债的策略配置上进行动态调整。

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合规守信情况声明

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合规守信、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 半年度财务报告（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：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	449,500,739.06	32,780,937.11
结算备付金	112,045,448.83	72,173,663.64
存出保证金	1,036,504.09	570,037.65
交易性金融资产	17,908,677,130.25	9,296,527,293.15
其中：股票投资	3,488,170,613.86	1,814,979,078.34
基金投资	—	—
债券投资	14,420,506,516.39	7,481,548,214.81
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	22,800,000.00	480,192,560.98
应收清算款	60,388,302.18	437,412,057.77
应收股利	—	—
应收申购款	94,897,021.91	140,238,583.10
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	18,649,345,146.32	10,459,895,133.40
负债和净资产	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 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	400,000,000.00	739,931,062.50
应付清算款	504,088,098.81	469,939,250.27
应付赎回款	8,028,269.43	129,946.99
应付管理人报酬	4,996,072.74	2,897,145.81
应付托管费	1,249,018.18	724,286.47
应付销售服务费	59,555.32	39,684.09
应付投资顾问费	—	—
应交税费	282,135.78	99,506.40

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	7,153,159.74	4,618,947.64
负债合计	925,856,310.00	1,218,379,830.17
净资产：		
实收基金	12,049,858,821.64	6,525,795,233.35
未分配利润	5,673,630,014.68	2,715,720,069.88
净资产合计	17,723,488,836.32	9,241,515,303.23
负债和净资产总计	18,649,345,146.32	10,459,895,133.40

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4708 元，基金份额总额 12,049,858,821.64 份。其中：富国宝利增强债券 A 份额净值 1.4711 元，份额总额 6,482,165,762.35 份；富国宝利增强债券 E 份额净值 1.4705 元，份额总额 5,567,693,059.29 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：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	533,472,647.71	46,115,940.39
1. 利息收入	1,760,368.91	675,817.80
其中：存款利息收入	1,036,787.27	302,378.00
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	723,581.64	373,439.80
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	371,025,912.28	53,941,995.48
其中：股票投资收益	200,729,102.32	-31,133,637.15
基金投资收益	—	—
债券投资收益	143,943,785.83	75,911,566.75
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	26,353,024.13	9,164,065.88
其他投资收益	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	159,410,158.62	-8,573,697.07
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,276,207.90	71,824.18
减：二、营业总支出	39,196,011.94	12,849,304.80
1. 管理人报酬	27,046,096.82	7,972,412.75

2. 托管费	6,761,524.24	1,993,103.23
3. 销售服务费	347,275.84	136,981.44
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	4,766,089.78	2,584,129.90
其中：卖出回购金融资产支出	4,766,089.78	2,584,129.90
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	128,679.75	37,628.31
8. 其他费用	146,345.51	125,049.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	494,276,635.77	33,266,635.59
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	494,276,635.77	33,266,635.59
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	494,276,635.77	33,266,635.59

6.3 净资产变动表

会计主体：富国宝利增强债券型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2026 年 01 月 01 日至 2026 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	6,525,795,233.35	2,715,720,069.88	9,241,515,303.23
二、本期期初净资产	6,525,795,233.35	2,715,720,069.88	9,241,515,303.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,524,063,588.29	2,957,909,944.80	8,481,973,533.09
（一）、综合收益总额	—	494,276,635.77	494,276,635.77
（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）	5,524,063,588.29	2,463,633,309.03	7,987,696,897.32
其中：1. 基金申购款	15,114,166,840.55	6,732,127,073.79	21,846,293,914.34
2. 基金赎回款	—	—	—
	9,590,103,252.26	4,268,493,764.76	13,858,597,017.02
（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、本期期末净资产	12,049,858,821.64	5,673,630,014.68	17,723,488,836.32
项目	上年度可比期间 (2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,427,202,098.41	774,025,265.22	3,201,227,363.63
二、本期期初净资产	2,427,202,098.41	774,025,265.22	3,201,227,363.63

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	63,300,356.73	69,379,526.51	132,679,883.24
（一）、综合收益总额	—	33,266,635.59	33,266,635.59
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	63,300,356.73	36,112,890.92	99,413,247.65
其中：1. 基金申购款	3,749,391,541.93	1,217,624,980.73	4,967,016,522.66
2. 基金赎回款	—	—	—
	3,686,091,185.20	1,181,512,089.81	4,867,603,275.01
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—
四、本期期末净资产	2,490,502,455.14	843,404,791.73	3,333,907,246.87

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

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国宝利增强债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1252号《关于准予富国宝利增强债券型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2018年2月8日生效，首次设立募集规模为73,996,883.34份基金份额。根据基金管理人于2024年09月23日发布的《富国基金管理有限公司关于富国宝利增强债券型发起式证券投资基金增加E类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自2024年09月25日起，本基金增加E类份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会发布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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发布的其他相关规定。

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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

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

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

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

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

2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3% 的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》

及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末（2026 年 06 月 30 日）
活期存款	449,500,739.06
等于：本金	449,461,245.35

加：应计利息	39,493.71
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	449,500,739.06

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（2026 年 06 月 30 日）			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,324,940,314.89	—	3,488,170,613.86	163,230,298.97
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	2,589,654,492.56	21,649,373.52	2,596,134,826.89	-15,169,039.19
	银行间市场	11,671,095,526.90	117,601,089.50	11,824,371,689.50	35,675,073.10
	合计	14,260,750,019.46	139,250,463.02	14,420,506,516.39	20,506,033.91
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		17,585,690,334.35	139,250,463.02	17,908,677,130.25	183,736,332.88

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（2026年06月30日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	22,800,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	22,800,000.00	—

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（2026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	7,005,447.56
其中：交易所市场	6,949,335.06
银行间市场	56,112.50
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	87,712.18
合计	7,153,159.74

6.4.7.7 实收基金

富国宝利增强债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,856,103,581.57	2,856,103,581.57
本期申购	6,664,275,757.94	6,664,275,757.94
本期赎回（以“-”号填列）	-3,038,213,577.16	-3,038,213,577.16
本期末	6,482,165,762.35	6,482,165,762.35

富国宝利增强债券 E

金额单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,669,691,651.78	3,669,691,651.78
本期申购	8,449,891,082.61	8,449,891,082.61
本期赎回（以“-”号填列）	-6,551,889,675.10	-6,551,889,675.10
本期末	5,567,693,059.29	5,567,693,059.29

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

富国宝利增强债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	939,095,706.38	250,241,955.46	1,189,337,661.84
本期期初	939,095,706.38	250,241,955.46	1,189,337,661.84
本期利润	159,006,270.86	84,092,339.44	243,098,610.30
本期基金份额交易产生的变动数	1,281,032,942.74	340,295,031.21	1,621,327,973.95
其中：基金申购款	2,355,086,440.56	622,424,018.58	2,977,510,459.14
基金赎回款	-1,074,053,497.82	-282,128,987.37	-1,356,182,485.19
本期已分配利润	—	—	—
本期末	2,379,134,919.98	674,629,326.11	3,053,764,246.09

富国宝利增强债券 E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,204,840,059.67	321,542,348.37	1,526,382,408.04
本期期初	1,204,840,059.67	321,542,348.37	1,526,382,408.04
本期利润	175,860,206.29	75,317,819.18	251,178,025.47
本期基金份额交易产生的变动数	659,636,993.23	182,668,341.85	842,305,335.08
其中：基金申购款	2,969,793,722.32	784,822,892.33	3,754,616,614.65
基金赎回款	-2,310,156,729.09	-602,154,550.48	-2,912,311,279.57
本期已分配利润	—	—	—
本期末	2,040,337,259.19	579,528,509.40	2,619,865,768.59

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
活期存款利息收入	530,598.00
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	150,367.50
其他	355,821.77
合计	1,036,787.27

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
卖出股票成交总额	14,078,011,891.74
减：卖出股票成本总额	13,856,389,492.11
减：交易费用	20,893,297.31
买卖股票差价收入	200,729,102.32

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（2026年01月01日至2026年06月30日）
债券投资收益——利息收入	121,165,233.54
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	22,778,552.29
合计	143,943,785.83

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（2026年01月01日至2026年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,235,765,546.09
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,152,593,374.27
减：应计利息总额	60,122,551.13
减：交易费用	271,068.40
买卖债券差价收入	22,778,552.29

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（2026年01月01日至2026年06月30日）
股票投资产生的股利收益	26,353,024.13
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	26,353,024.13

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
1. 交易性金融资产	159,410,158.62
股票投资	131,217,556.98
债券投资	28,192,601.64
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	159,410,158.62

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
基金赎回费收入	1,274,079.91
基金转换费收入	2,127.99
合计	1,276,207.90

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（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
审计费用	34,712.18
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	32,513.31
债券账户维护费	18,000.00
其他	1,120.02
合计	146,345.51

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、关联关系

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（2025 年 3 月 14 日前）
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	基金管理人的股东、基金代销机构（自 2025 年 3 月 14 日起）
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人
富国鑫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
富国鑫汇养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金

注：（1）关联方国泰海通证券股份有限公司（简称“国泰海通”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原关联方海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

(2) 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（2026年01月01日至2026年06月30日）		上年度可比期间（2025年01月01日至2025年06月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国泰海通	8,516,855,416.28	28.89	674,164,743.30	11.19
海通证券	—	—	343,868,716.17	5.71
申万宏源	6,435,447,813.23	21.83	1,047,266,706.45	17.39

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）		上年度可比期间（2025年01月01日至2025年06月30日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
国泰海通	1,542,263,951.09	31.40	566,481,333.25	11.80
海通证券	—	—	479,801,574.15	10.00
申万宏源	1,012,325,830.38	20.61	655,829,051.55	13.66

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）		上年度可比期间（2025年01月01日至2025年06月30日）	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
国泰海通	19,797,500,000.00	24.87	7,109,274,000.00	17.84
海通证券	—	—	1,196,600,000.00	3.00

申万宏源	11,821,848,000.00	14.85	6,358,900,000.00	15.96
------	-------------------	-------	------------------	-------

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国泰海通	3,457,041.47	28.89	1,991,454.60	28.66
申万宏源	2,612,221.23	21.83	1,764,034.06	25.38
关联方名称	上年度可比期间（2025年01月01日至2025年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国泰海通	273,643.72	11.19	273,643.72	22.52
海通证券	139,577.45	5.71	—	—
申万宏源	425,086.76	17.39	258,670.96	21.29

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）	上年度可比期间（2025年01月01日至2025年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	27,046,096.82	7,972,412.75
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,160,912.55	422,715.96
应支付基金管理人的净管理费	24,885,184.27	7,549,696.79

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（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	6,761,524.24	1,993,103.23

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国宝利增强债券 A	富国宝利增强债券 E	合计
富国基金管理有限公司	—	211,610.49	211,610.49
合计	—	211,610.49	211,610.49

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国宝利增强债券 A	富国宝利增强债券 E	合计
富国基金管理有限公司	—	102,063.96	102,063.96
合计	—	102,063.96	102,063.96

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

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

H 为 E 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 E 类基金份额前一日的基金资产净值

E 类基金份额的销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）

交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	
	富国宝利增强债券 A	富国宝利增强债券 E	富国宝利增强债券 A	富国宝利增强债券 E
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	—	10,000,000.00	816.06
报告期间申购/买入总份额	—	—	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—	—	816.06
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	—	10,000,000.00	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.15%	—	0.68%	—

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

富国宝利增强债券 A：

份额单位：份

关联方名称	本期末（2026 年 06 月 30 日）		上年度末（2025 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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的

		比例(%)		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）	3,229,974.16	0.05	3,229,974.16	0.11
申万宏源证券有限公司	61,863,109.65	0.95	61,863,109.65	2.17

富国宝利增强债券 E：

份额单位：份

关联方名称	本期末（2026 年 06 月 30 日）		上年度末（2025 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(%)
富国鑫汇养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	10,810,061.43	0.19	—	—

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（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2025 年 01 月 01 日至 2025 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	449,500,739.06	530,598.00	94,094,572.07	111,135.28

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（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118071	华峰转债	2026-06-23	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.00	80	8,000.00	8,000.14	—
118072	鼎通转债	2026-06-24	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.00	260	26,000.00	26,000.80	—

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 06 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 07 月 13 日	890.99	17,947.00	13,217,436.68	14,931,904.00	—

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 2026 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 2026 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 400,000,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
AAA	5,312,673,350.73	4,578,541,765.86
AAA 以下	315,135,628.58	645,764,724.79
未评级	991,265,757.29	725,940,506.31
合计	6,619,074,736.60	5,950,246,996.96

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

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的

风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末及上年度末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末（2026 年 06 月 30 日）	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	449,500,739.06	—	—	—	449,500,739.06
结算备付金	112,045,448.83	—	—	—	112,045,448.83
存出保证金	1,036,504.09	—	—	—	1,036,504.09
交易性金融资产	4,643,819,902.44	4,790,151,607.86	4,986,535,006.09	3,488,170,613.86	17,908,677,130.25
买入返售金融资产	22,800,000.00	—	—	—	22,800,000.00
应收清算款	—	—	—	60,388,302.18	60,388,302.18
应收申购款	—	—	—	94,897,021.91	94,897,021.91
资产总计	5,229,202,594.42	4,790,151,607.86	4,986,535,006.09	3,643,455,937.95	18,649,345,146.32
负债					
卖出回购金融资产款	400,000,000.00	—	—	—	400,000,000.00
应付清算款	—	—	—	504,088,098.81	504,088,098.81
应付赎回款	—	—	—	8,028,269.43	8,028,269.43
应付管理人报酬	—	—	—	4,996,072.74	4,996,072.74
应付托管费	—	—	—	1,249,018.18	1,249,018.18
应付销售服务费	—	—	—	59,555.32	59,555.32
应交税费	—	—	—	282,135.78	282,135.78
其他负债	—	—	—	7,153,159.74	7,153,159.74
负债总计	400,000,000.00	—	—	525,856,310.00	925,856,310.00
利率敏感度缺口	4,829,202,594.42	4,790,151,607.86	4,986,535,006.09	3,117,599,627.95	17,723,488,836.32
上年度末（2025 年 12 月 31 日）	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	32,780,937.11	—	—	—	32,780,937.11
结算备付金	72,173,663.64	—	—	—	72,173,663.64
存出保证金	570,037.65	—	—	—	570,037.65
交易性金融资产	3,048,554,525.13	3,973,069,787.45	459,923,902.23	1,814,979,078.34	9,296,527,293.15
买入返售金融资产	480,192,560.98	—	—	—	480,192,560.98
应收清算款	—	—	—	437,412,057.77	437,412,057.77
应收申购款	—	—	—	140,238,583.10	140,238,583.10

资产总计	3,634,271,724.51	3,973,069,787.45	459,923,902.23	2,392,629,719.21	10,459,895,133.40
负债					
卖出回购金融资产款	739,931,062.50	—	—	—	739,931,062.50
应付清算款	—	—	—	469,939,250.27	469,939,250.27
应付赎回款	—	—	—	129,946.99	129,946.99
应付管理人报酬	—	—	—	2,897,145.81	2,897,145.81
应付托管费	—	—	—	724,286.47	724,286.47
应付销售服务费	—	—	—	39,684.09	39,684.09
应交税费	—	—	—	99,506.40	99,506.40
其他负债	—	—	—	4,618,947.64	4,618,947.64
负债总计	739,931,062.50	—	—	478,448,767.67	1,218,379,830.17
利率敏感度缺口	2,894,340,662.01	3,973,069,787.45	459,923,902.23	1,914,180,951.54	9,241,515,303.23

注：上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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026年06月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-59,199,260.94	-15,828,960.84
	2. 基准点利率减少0.1%	59,199,260.94	15,828,960.84

注：上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。

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

金额单位：人民币元

项目	本期末（2026 年 06 月 30 日）		上年度末（2025 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	3,488,170,613.86	19.68	1,814,979,078.34	19.64
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	14,420,506,516.39	81.36	7,481,548,214.81	80.96
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	17,908,677,130.25	101.04	9,296,527,293.15	100.60

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 市场基准增加 1%	39,780,089.53	28,701,089.95
	2. 市场基准减少 1%	-39,780,089.53	-28,701,089.95

注：本基金管理人运用资本资产定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为

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。

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（2026年06月30日）	上年度末（2025年12月31日）
第一层次	3,916,106,342.88	2,716,844,091.29
第二层次	13,992,570,787.37	6,579,683,201.86
第三层次	—	—
合计	17,908,677,130.25	9,296,527,293.15

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	3,488,170,613.86	18.70
	其中：股票	3,488,170,613.86	18.70
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	14,420,506,516.39	77.32
	其中：债券	14,420,506,516.39	77.32
	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	22,800,000.00	0.12
	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	561,546,187.89	3.01
8	其他各项资产	156,321,828.18	0.84
9	合计	18,649,345,146.32	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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	139,427,310.32	0.79
C	制造业	2,243,613,155.70	12.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	87,509,845.36	0.49
E	建筑业	21,911,195.50	0.12
F	批发和零售业	39,768,839.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	117,104,965.41	0.66
H	住宿和餐饮业	5,825,162.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	222,023,951.25	1.25
J	金融业	458,863,697.63	2.59
K	房地产业	20,731,220.00	0.12
L	租赁和商务服务业	14,943,957.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	95,048,055.24	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	13,234,828.45	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	3,573,774.00	0.02

Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	4,590,657.00	0.03
S	综合	—	—
	合计	3,488,170,613.86	19.68

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	300308	中际旭创	132,300	168,021,000.00	0.95
2	300750	宁德时代	233,266	91,675,870.66	0.52
3	300502	新易盛	142,924	86,754,868.00	0.49
4	603259	药明康德	566,320	70,512,503.20	0.40
5	688256	寒武纪	39,752	63,426,303.60	0.36
6	000333	美的集团	759,283	57,348,644.99	0.32
7	603986	兆易创新	70,300	57,294,500.00	0.32
8	600030	中信证券	1,915,000	55,017,950.00	0.31
9	002384	东山精密	187,500	49,190,625.00	0.28
10	301308	江波龙	68,500	48,210,300.00	0.27
11	688498	源杰科技	25,476	48,047,736.00	0.27
12	600919	江苏银行	4,406,000	47,496,680.00	0.27
13	688525	佰维存储	88,245	43,657,448.85	0.25
14	600999	招商证券	2,048,400	43,221,240.00	0.24
15	002371	北方华创	46,400	41,043,584.00	0.23
16	600900	长江电力	1,436,920	38,035,272.40	0.21
17	002142	宁波银行	1,179,054	35,006,113.26	0.20
18	601985	中国核电	3,801,800	34,330,254.00	0.19
19	002049	紫光国微	386,040	34,261,050.00	0.19
20	600036	招商银行	952,000	33,796,000.00	0.19
21	002466	天齐锂业	549,400	33,689,208.00	0.19
22	600519	贵州茅台	27,269	32,327,126.81	0.18
23	601009	南京银行	3,099,700	30,656,033.00	0.17
24	002709	天赐材料	580,400	29,849,972.00	0.17
25	600875	东方电气	1,025,900	29,515,143.00	0.17
26	601988	中国银行	5,138,400	29,391,648.00	0.17
27	688008	澜起科技	94,762	29,366,743.80	0.17
28	601995	中金公司	799,500	28,901,925.00	0.16
29	002379	宏桥控股	1,899,400	28,054,138.00	0.16
30	600150	中国船舶	820,720	27,732,128.80	0.16
31	601127	赛力斯	441,800	27,060,250.00	0.15
32	300661	圣邦股份	187,424	26,891,595.52	0.15
33	002653	海思科	403,630	26,776,814.20	0.15

34	000776	广发证券	1,117,800	26,156,520.00	0.15
35	688521	芯原股份	69,738	25,882,561.32	0.15
36	600547	山东黄金	1,098,690	25,368,752.10	0.14
37	600809	山西汾酒	225,700	24,684,809.00	0.14
38	688012	中微公司	50,618	23,714,533.00	0.13
39	688519	南亚新材	61,367	23,321,914.68	0.13
40	601398	工商银行	3,274,800	23,152,836.00	0.13
41	002463	沪电股份	151,000	23,072,800.00	0.13
42	001965	招商公路	2,489,500	22,803,820.00	0.13
43	600938	中国海油	797,200	21,643,980.00	0.12
44	600887	伊利股份	889,800	21,319,608.00	0.12
45	688536	思瑞浦	57,841	21,059,329.69	0.12
46	688368	晶丰明源	96,105	20,808,654.60	0.12
47	000651	格力电器	543,820	20,393,250.00	0.12
48	001389	广合科技	82,900	19,668,025.00	0.11
49	300033	同花顺	79,920	19,260,720.00	0.11
50	000338	潍柴动力	705,800	19,233,050.00	0.11
51	601899	紫金矿业	749,673	18,846,779.22	0.11
52	000975	山金国际	1,072,787	18,237,379.00	0.10
53	688578	艾力斯	163,692	17,875,166.40	0.10
54	300476	胜宏科技	51,300	17,771,859.00	0.10
55	688409	富创精密	57,284	17,543,225.00	0.10
56	300124	汇川技术	264,100	17,517,753.00	0.10
57	600989	宝丰能源	860,751	17,499,067.83	0.10
58	688472	阿特斯	1,590,668	17,211,027.76	0.10
59	300972	万辰集团	97,600	16,924,816.00	0.10
60	688002	睿创微纳	106,848	16,528,317.12	0.09
61	600233	圆通速递	1,047,800	16,502,850.00	0.09
62	603799	华友钴业	340,700	16,442,182.00	0.09
63	300223	君正股份	65,596	16,326,844.40	0.09
64	600741	华域汽车	1,022,550	15,869,976.00	0.09
65	601838	成都银行	888,200	15,721,140.00	0.09
66	002493	荣盛石化	1,454,750	15,638,562.50	0.09
67	600019	宝钢股份	2,861,700	15,539,031.00	0.09
68	600176	中国巨石	212,700	15,501,576.00	0.09
69	688041	海光信息	41,390	15,326,717.00	0.09
70	601138	工业富联	208,800	15,064,920.00	0.08
71	688072	拓荆科技	17,947	14,931,904.00	0.08
72	002916	深南电路	32,300	14,790,170.00	0.08
73	000792	盐湖股份	488,600	14,750,834.00	0.08
74	002415	海康威视	430,700	14,729,940.00	0.08

75	688337	普源精电	196,364	14,713,554.52	0.08
76	600460	士兰微	267,403	14,616,247.98	0.08
77	600018	上港集团	3,007,700	14,196,344.00	0.08
78	600418	江淮汽车	527,200	13,617,576.00	0.08
79	600489	中金黄金	741,300	13,380,465.00	0.08
80	688428	诺诚健华	469,225	13,358,835.75	0.08
81	002600	领益智造	755,900	13,107,306.00	0.07
82	600885	宏发股份	378,400	13,051,016.00	0.07
83	600026	中远海能	707,600	12,694,344.00	0.07
84	603127	昭衍新药	330,200	12,620,244.00	0.07
85	300857	协创数据	36,700	12,474,330.00	0.07
86	601318	中国平安	256,135	12,227,884.90	0.07
87	002027	分众传媒	2,504,100	12,119,844.00	0.07
88	600893	航发动力	310,673	11,911,202.82	0.07
89	600183	生益科技	66,700	11,565,780.00	0.07
90	000596	古井贡酒	138,200	11,028,360.00	0.06
91	601117	中国化学	1,455,700	10,699,395.00	0.06
92	000807	云铝股份	480,800	10,644,912.00	0.06
93	688111	金山办公	49,009	10,441,367.45	0.06
94	300413	芒果超媒	673,300	9,850,379.00	0.06
95	002938	鹏鼎控股	92,400	9,737,112.00	0.05
96	605117	德业股份	91,120	9,675,121.60	0.05
97	301536	星辰科技	72,900	9,382,959.00	0.05
98	300724	捷佳伟创	132,500	9,354,500.00	0.05
99	601872	招商轮船	531,900	9,345,483.00	0.05
100	002558	巨人网络	337,300	9,295,988.00	0.05
101	688390	固德威	85,187	9,243,641.37	0.05
102	301607	富特科技	176,340	9,213,765.00	0.05
103	002179	中航光电	198,008	9,147,969.60	0.05
104	603993	洛阳钼业	517,000	9,073,350.00	0.05
105	603057	紫燕食品	405,100	9,033,730.00	0.05
106	601512	中新集团	1,139,400	8,887,320.00	0.05
107	002532	天山铝业	823,700	8,838,301.00	0.05
108	002475	立讯精密	123,300	8,680,320.00	0.05
109	600926	杭州银行	591,896	8,552,897.20	0.05
110	688235	百济神州	33,371	8,496,590.31	0.05
111	688627	精智达	11,838	8,464,170.00	0.05
112	601601	中国太保	295,240	8,420,244.80	0.05
113	002266	浙富控股	1,649,500	8,346,470.00	0.05
114	688045	必易微	97,302	7,860,055.56	0.04
115	301606	绿联科技	128,400	7,834,968.00	0.04

116	600350	山东高速	685,201	7,626,287.13	0.04
117	605599	菜百股份	555,400	7,608,980.00	0.04
118	688981	中芯国际	47,449	7,535,850.18	0.04
119	300014	亿纬锂能	114,900	7,471,947.00	0.04
120	600219	南山铝业	1,869,900	7,460,901.00	0.04
121	688503	聚和材料	56,164	7,452,962.80	0.04
122	600988	赤峰黄金	280,900	7,393,288.00	0.04
123	601998	中信银行	1,065,400	7,383,222.00	0.04
124	600438	通威股份	608,100	7,364,091.00	0.04
125	600570	恒生电子	340,200	7,208,838.00	0.04
126	600015	华夏银行	1,106,000	7,067,340.00	0.04
127	001914	招商积余	856,000	6,984,960.00	0.04
128	000301	东方盛虹	599,700	6,866,565.00	0.04
129	300953	震裕科技	51,340	6,864,158.00	0.04
130	000603	盛达资源	293,600	6,782,160.00	0.04
131	603345	安井食品	83,900	6,727,941.00	0.04
132	600299	安迪苏	847,800	6,655,230.00	0.04
133	301086	鸿富瀚	31,220	6,533,721.60	0.04
134	002436	兴森科技	128,100	6,526,695.00	0.04
135	605499	东鹏饮料	52,800	6,517,104.00	0.04
136	601869	长飞光纤	11,900	6,496,210.00	0.04
137	000429	粤高速A	474,100	6,471,465.00	0.04
138	001339	智微智能	62,640	6,406,819.20	0.04
139	000988	华工科技	34,700	6,405,967.00	0.04
140	600089	特变电工	276,500	6,221,250.00	0.04
141	002841	视源股份	177,800	6,139,434.00	0.03
142	601567	三星电气	404,500	6,043,230.00	0.03
143	300438	鹏辉能源	72,400	5,998,340.00	0.03
144	688095	福昕软件	98,019	5,825,269.17	0.03
145	600754	锦江酒店	323,800	5,825,162.00	0.03
146	601919	中远海控	423,500	5,615,610.00	0.03
147	300432	富临精工	271,800	5,460,462.00	0.03
148	600566	济川药业	244,700	5,429,893.00	0.03
149	002402	和而泰	209,400	5,408,802.00	0.03
150	600584	长电科技	52,200	5,405,310.00	0.03
151	000933	神火股份	253,800	5,380,560.00	0.03
152	603619	中曼石油	286,400	5,358,544.00	0.03
153	002345	潮宏基	561,200	5,146,204.00	0.03
154	600502	安徽建工	1,168,400	5,082,540.00	0.03
155	600426	华鲁恒升	211,200	5,051,904.00	0.03
156	601018	宁波港	1,586,400	4,997,160.00	0.03

157	688127	蓝特光学	50,440	4,922,944.00	0.03
158	300442	润泽科技	59,200	4,917,744.00	0.03
159	002028	思源电气	28,400	4,913,200.00	0.03
160	300017	网宿科技	372,500	4,846,225.00	0.03
161	300628	亿联网络	141,100	4,772,002.00	0.03
162	688372	伟测科技	25,608	4,763,088.00	0.03
163	688025	杰普特	10,004	4,701,880.00	0.03
164	300277	汽轮科技	302,500	4,549,600.00	0.03
165	002460	赣锋锂业	68,000	4,447,200.00	0.03
166	300677	英科医疗	113,500	4,445,795.00	0.03
167	002803	吉宏股份	170,800	4,413,472.00	0.02
168	688097	博众精工	69,349	4,372,454.45	0.02
169	301358	湖南裕能	57,400	4,354,938.00	0.02
170	000534	万泽股份	156,000	4,268,160.00	0.02
171	600039	四川路桥	544,800	4,260,336.00	0.02
172	603162	海通发展	473,524	4,247,510.28	0.02
173	300129	泰胜风能	496,200	4,242,510.00	0.02
174	688258	卓易信息	35,697	4,231,522.38	0.02
175	688349	三一重能	269,753	4,094,850.54	0.02
176	603893	瑞芯微	21,400	4,030,904.00	0.02
177	601607	上海医药	258,300	3,977,820.00	0.02
178	600023	浙能电力	755,400	3,973,404.00	0.02
179	688516	奥特维	68,554	3,934,314.06	0.02
180	301371	敷尔佳	148,981	3,873,506.00	0.02
181	688700	东威科技	43,097	3,852,871.80	0.02
182	600941	中国移动	44,400	3,824,172.00	0.02
183	002468	申通快递	258,200	3,759,392.00	0.02
184	600655	豫园股份	913,800	3,755,718.00	0.02
185	601059	信达证券	231,300	3,744,747.00	0.02
186	002080	中材科技	41,000	3,690,000.00	0.02
187	688717	艾罗能源	44,423	3,668,007.11	0.02
188	000625	长安汽车	508,020	3,642,503.40	0.02
189	600027	华电国际	807,212	3,592,093.40	0.02
190	300492	华图山鼎	104,040	3,573,774.00	0.02
191	002865	钧达股份	59,700	3,562,896.00	0.02
192	000001	平安银行	353,200	3,549,660.00	0.02
193	601699	潞安环能	247,200	3,530,016.00	0.02
194	601288	农业银行	570,200	3,461,114.00	0.02
195	300394	天孚通信	11,380	3,444,498.40	0.02
196	601456	国联民生	388,400	3,433,456.00	0.02
197	301093	华兰股份	24,900	3,377,187.00	0.02

198	300416	苏试试验	162,800	3,317,864.00	0.02
199	600025	华能水电	366,500	3,258,185.00	0.02
200	300251	光线传媒	293,300	3,252,697.00	0.02
201	600801	华新建材	207,900	3,243,240.00	0.02
202	600391	航发科技	94,600	3,164,370.00	0.02
203	600515	海南机场	1,126,100	3,085,514.00	0.02
204	301061	匠心家居	87,728	3,076,620.96	0.02
205	600323	瀚蓝环境	111,100	3,050,806.00	0.02
206	688046	药康生物	124,790	3,019,918.00	0.02
207	688326	经纬恒润	42,463	3,009,777.44	0.02
208	000977	浪潮信息	42,928	3,004,960.00	0.02
209	688052	纳芯微	10,333	2,979,107.23	0.02
210	300850	新强联	109,800	2,942,640.00	0.02
211	600487	亨通光电	26,900	2,941,246.00	0.02
212	603290	斯达半导	19,000	2,905,860.00	0.02
213	300037	新宙邦	30,900	2,869,065.00	0.02
214	000426	兴业银锡	85,700	2,824,672.00	0.02
215	601339	百隆东方	416,700	2,821,059.00	0.02
216	688063	派能科技	52,855	2,815,585.85	0.02
217	601825	沪农商行	375,700	2,813,993.00	0.02
218	300803	指南针	30,341	2,781,359.47	0.02
219	003010	若羽臣	113,900	2,767,770.00	0.02
220	601083	锦江航运	278,100	2,764,314.00	0.02
221	600750	华润江中	124,300	2,743,301.00	0.02
222	603019	中科曙光	25,500	2,734,365.00	0.02
223	603198	迎驾贡酒	92,100	2,726,160.00	0.02
224	003816	中国广核	690,800	2,701,028.00	0.02
225	300740	水羊股份	142,000	2,614,220.00	0.01
226	002156	通富微电	33,900	2,571,993.00	0.01
227	601336	新华保险	41,900	2,499,754.00	0.01
228	600362	江西铜业	57,300	2,481,090.00	0.01
229	688396	华润微	25,195	2,457,772.25	0.01
230	000657	中钨高新	25,400	2,431,288.00	0.01
231	301200	大族数控	6,700	2,416,355.00	0.01
232	301345	涛涛车业	10,400	2,402,400.00	0.01
233	603737	三棵树	99,320	2,393,612.00	0.01
234	688196	卓越新能	64,530	2,316,627.00	0.01
235	002236	大华股份	140,254	2,312,788.46	0.01
236	300001	特锐德	61,100	2,311,413.00	0.01
237	000408	藏格矿业	33,186	2,300,453.52	0.01
238	601100	恒立液压	21,300	2,291,028.00	0.01

239	300049	福瑞医科	58,900	2,290,032.00	0.01
240	603556	海兴电力	103,630	2,279,860.00	0.01
241	002534	西子洁能	120,300	2,231,565.00	0.01
242	002837	英维克	28,000	2,227,680.00	0.01
243	002947	恒铭达	28,700	2,182,635.00	0.01
244	688301	奕瑞科技	17,448	2,163,552.00	0.01
245	603699	纽威股份	42,894	2,157,568.20	0.01
246	000630	铜陵有色	335,800	2,135,688.00	0.01
247	301165	锐捷网络	25,900	2,083,655.00	0.01
248	002557	洽洽食品	113,900	2,045,644.00	0.01
249	605111	新洁能	20,600	2,042,284.00	0.01
250	301291	明阳电气	55,500	1,997,445.00	0.01
251	002154	报喜鸟	551,900	1,964,764.00	0.01
252	603806	福斯特	114,100	1,915,739.00	0.01
253	002768	国恩股份	36,648	1,907,894.88	0.01
254	600845	宝信软件	114,587	1,905,581.81	0.01
255	688266	泽璟制药	16,108	1,879,159.28	0.01
256	688180	君实生物	53,684	1,815,592.88	0.01
257	688378	奥来德	29,196	1,810,152.00	0.01
258	688778	厦钨新能	33,245	1,808,528.00	0.01
259	301338	凯格精机	11,020	1,795,047.80	0.01
260	688580	伟思医疗	33,542	1,786,782.34	0.01
261	688200	华峰测控	3,381	1,775,363.10	0.01
262	301177	迪阿股份	64,200	1,769,994.00	0.01
263	002838	道恩股份	56,800	1,739,216.00	0.01
264	603288	海天味业	52,286	1,733,803.76	0.01
265	600590	泰豪科技	171,200	1,729,120.00	0.01
266	002281	光迅科技	6,700	1,721,498.00	0.01
267	300201	海伦哲	81,600	1,719,312.00	0.01
268	002531	天顺风能	200,900	1,693,587.00	0.01
269	002422	科伦药业	43,957	1,693,223.64	0.01
270	002738	中矿资源	28,700	1,693,013.00	0.01
271	601000	唐山港	403,500	1,674,525.00	0.01
272	300408	三环集团	10,020	1,672,338.00	0.01
273	688336	三生国健	31,164	1,654,808.40	0.01
274	300896	爱美客	18,900	1,648,080.00	0.01
275	603308	应流股份	26,900	1,624,760.00	0.01
276	002851	麦格米特	9,600	1,604,928.00	0.01
277	688480	赛恩斯	17,555	1,537,642.45	0.01
278	603392	万泰生物	56,800	1,531,896.00	0.01
279	300122	智飞生物	130,500	1,525,545.00	0.01

280	601882	海天精工	75,400	1,525,342.00	0.01
281	688279	峰昭科技	6,725	1,509,359.00	0.01
282	603565	中谷物流	151,700	1,488,177.00	0.01
283	003022	联泓新科	57,300	1,484,070.00	0.01
284	002429	兆驰股份	142,400	1,479,536.00	0.01
285	300806	斯迪克	13,200	1,478,400.00	0.01
286	688668	鼎通科技	3,815	1,424,139.50	0.01
287	600660	福耀玻璃	28,232	1,424,022.08	0.01
288	688599	天合光能	100,830	1,423,719.60	0.01
289	002270	华明装备	74,400	1,402,440.00	0.01
290	300596	利安隆	26,500	1,390,720.00	0.01
291	600498	烽火通信	18,800	1,383,680.00	0.01
292	600549	厦门钨业	16,100	1,371,720.00	0.01
293	002001	新 和 成	48,100	1,367,002.00	0.01
294	603901	永创智能	125,100	1,359,837.00	0.01
295	601886	江河集团	169,150	1,358,274.50	0.01
296	601595	上海电影	80,600	1,337,960.00	0.01
297	688531	日联科技	7,304	1,298,943.36	0.01
298	300454	深信服	13,300	1,279,460.00	0.01
299	300870	欧陆通	3,700	1,279,053.00	0.01
300	300002	神州泰岳	163,700	1,278,497.00	0.01
301	688510	航亚科技	53,275	1,272,207.00	0.01
302	000568	泸州老窖	16,300	1,263,576.00	0.01
303	601360	三六零	143,100	1,243,539.00	0.01
304	300782	卓胜微	11,300	1,238,254.00	0.01
305	601600	中国铝业	149,700	1,230,534.00	0.01
306	688167	炬光科技	3,469	1,228,754.49	0.01
307	300274	阳光电源	7,600	1,208,552.00	0.01
308	601077	渝农商行	197,500	1,206,725.00	0.01
309	603920	世运电路	24,900	1,196,196.00	0.01
310	002299	圣农发展	77,000	1,167,320.00	0.01
311	000415	渤海租赁	286,100	1,164,427.00	0.01
312	300703	创源股份	91,100	1,163,347.00	0.01
313	300568	星源材质	61,500	1,151,280.00	0.01
314	600901	江苏金租	198,900	1,143,675.00	0.01
315	605056	咸亨国际	71,100	1,137,600.00	0.01
316	300693	盛弘股份	23,000	1,121,250.00	0.01
317	300418	昆仑万维	27,300	1,101,828.00	0.01
318	002850	科达利	5,800	1,097,940.00	0.01
319	301031	中熔电气	9,100	1,086,995.00	0.01
320	603889	新澳股份	211,840	1,082,502.40	0.01

321	002518	科士达	20,000	1,071,800.00	0.01
322	002202	金风科技	44,700	1,068,330.00	0.01
323	300487	蓝晓科技	18,100	1,065,185.00	0.01
324	300984	金沃股份	19,800	1,063,854.00	0.01
325	601168	西部矿业	38,700	1,050,318.00	0.01
326	000598	兴蓉环境	163,100	1,047,102.00	0.01
327	002155	湖南黄金	43,600	1,040,732.00	0.01
328	002170	芭田股份	95,400	1,036,044.00	0.01
329	002203	海亮股份	45,200	1,032,820.00	0.01
330	601688	华泰证券	50,000	1,031,000.00	0.01
331	002126	银轮股份	20,700	1,030,860.00	0.01
332	600166	福田汽车	350,200	1,019,082.00	0.01
333	601665	齐鲁银行	173,600	1,001,672.00	0.01
334	603507	振江股份	30,300	996,567.00	0.01
335	002484	江海股份	9,400	987,000.00	0.01
336	601816	京沪高铁	215,700	977,121.00	0.01
337	601208	东材科技	13,800	976,902.00	0.01
338	301011	华立科技	68,600	970,004.00	0.01
339	002353	杰瑞股份	6,300	960,750.00	0.01
340	688629	华丰科技	5,119	959,863.69	0.01
341	601877	正泰电器	38,100	955,167.00	0.01
342	300395	菲利华	7,100	949,483.00	0.01
343	600482	中国动力	28,900	947,920.00	0.01
344	300833	浩洋股份	31,400	947,652.00	0.01
345	600177	雅戈尔	125,100	942,003.00	0.01
346	603228	景旺电子	12,900	934,089.00	0.01
347	603268	松发股份	6,700	933,176.00	0.01
348	002064	华峰化学	97,900	929,071.00	0.01
349	002563	森马服饰	184,000	927,360.00	0.01
350	688692	达梦数据	3,636	888,238.44	0.01
351	603505	金石资源	43,800	882,570.00	0.00
352	688313	仕佳光子	4,679	863,977.35	0.00
353	603317	天味食品	64,240	835,762.40	0.00
354	688222	成都先导	25,364	814,438.04	0.00
355	601857	中国石油	92,000	798,560.00	0.00
356	600007	中国国贸	42,000	797,160.00	0.00
357	688307	中润光学	9,812	784,469.40	0.00
358	601698	中国卫通	25,900	783,475.00	0.00
359	688475	萤石网络	28,537	780,486.95	0.00
360	605333	沪光股份	45,400	774,070.00	0.00
361	688305	科德数控	11,604	757,393.08	0.00

362	000672	上峰材料	31,700	750,656.00	0.00
363	601888	中国中免	13,900	746,569.00	0.00
364	601107	四川成渝	151,300	738,344.00	0.00
365	600309	万华化学	10,500	718,305.00	0.00
366	600188	兖矿能源	40,200	714,354.00	0.00
367	000848	承德露露	94,900	702,260.00	0.00
368	603239	浙江仙通	46,700	691,627.00	0.00
369	600325	华发股份	295,000	681,450.00	0.00
370	300207	欣旺达	35,300	670,347.00	0.00
371	605166	聚合顺	69,900	670,341.00	0.00
372	300682	朗新科技	66,500	658,350.00	0.00
373	301550	斯菱智驱	7,100	649,153.00	0.00
374	002683	广东宏大	21,700	635,593.00	0.00
375	001301	尚太科技	6,700	626,517.00	0.00
376	002643	万润股份	29,500	618,025.00	0.00
377	300811	铂科新材	6,400	607,296.00	0.00
378	601225	陕西煤业	28,640	582,824.00	0.00
379	002997	瑞鹄模具	20,100	553,956.00	0.00
380	688698	伟创电气	10,368	543,801.60	0.00
381	301272	英华特	16,300	536,922.00	0.00
382	603267	鸿远电子	6,900	534,612.00	0.00
383	002946	新乳业	36,900	519,552.00	0.00
384	300113	顺网科技	28,500	518,985.00	0.00
385	002130	沃尔核材	27,300	517,608.00	0.00
386	600201	生物股份	44,400	517,260.00	0.00
387	002290	禾盛新材	5,500	505,285.00	0.00
388	688059	华锐精密	2,525	504,267.75	0.00
389	605319	无锡振华	22,200	503,718.00	0.00
390	601156	东航物流	30,900	498,108.00	0.00
391	001222	源飞宠物	37,500	498,000.00	0.00
392	002674	兴业科技	16,600	473,598.00	0.00
393	600010	宝钢股份	212,200	473,206.00	0.00
394	603296	华勤技术	6,320	469,386.40	0.00
395	002595	豪迈科技	10,000	466,000.00	0.00
396	603596	伯特利	18,100	449,604.00	0.00
397	600588	用友网络	46,600	427,788.00	0.00
398	603091	众鑫股份	8,760	427,225.20	0.00
399	600415	小商品城	41,300	419,608.00	0.00
400	600461	洪城环境	46,176	418,354.56	0.00
401	600111	北方稀土	8,500	408,425.00	0.00
402	600012	皖通高速	25,400	400,304.00	0.00

403	600153	建发股份	50,100	397,293.00	0.00
404	600985	淮北矿业	28,200	396,210.00	0.00
405	000425	徐工机械	48,600	393,174.00	0.00
406	688136	科兴制药	18,345	379,924.95	0.00
407	300604	长川科技	1,100	375,562.00	0.00
408	601611	中国核建	33,600	374,640.00	0.00
409	301033	迈普医学	7,100	367,709.00	0.00
410	002074	国轩高科	13,300	365,883.00	0.00
411	300866	安克创新	3,500	365,750.00	0.00
412	002812	恩捷股份	5,400	361,314.00	0.00
413	601958	金钼股份	12,800	359,808.00	0.00
414	003000	劲仔食品	36,400	358,904.00	0.00
415	002891	中宠股份	13,200	352,704.00	0.00
416	002572	索菲亚	45,900	335,070.00	0.00
417	300776	帝尔激光	1,500	322,440.00	0.00
418	002138	顺络电子	4,400	321,640.00	0.00
419	300673	佩蒂股份	23,800	320,110.00	0.00
420	300121	阳谷华泰	25,300	318,780.00	0.00
421	002625	光启技术	10,000	303,200.00	0.00
422	603979	金诚信	5,100	301,053.00	0.00
423	603568	伟明环保	19,500	299,910.00	0.00
424	601126	四方股份	4,700	297,040.00	0.00
425	601231	环旭电子	9,100	294,840.00	0.00
426	000002	万 科 A	99,600	294,816.00	0.00
427	002970	锐明技术	5,500	293,865.00	0.00
428	688122	西部超导	4,676	293,699.56	0.00
429	300679	电连技术	4,800	287,952.00	0.00
430	601229	上海银行	32,300	280,364.00	0.00
431	002648	卫星化学	11,600	272,484.00	0.00
432	601865	福莱特	25,600	269,056.00	0.00
433	688267	中触媒	13,522	266,383.40	0.00
434	603833	欧派家居	8,500	255,935.00	0.00
435	002301	齐心集团	34,500	249,435.00	0.00
436	002928	华夏航空	33,600	234,864.00	0.00
437	601012	隆基绿能	17,600	230,912.00	0.00
438	603181	皇马科技	13,500	218,970.00	0.00
439	601238	广汽集团	40,300	204,724.00	0.00
440	600378	昊华科技	2,700	203,526.00	0.00
441	301029	怡合达	7,300	197,173.00	0.00
442	002624	完美世界	15,000	186,300.00	0.00
443	688049	炬芯科技	3,954	185,482.14	0.00

444	300316	晶盛机电	3,000	181,200.00	0.00
445	603214	爱婴室	14,900	180,439.00	0.00
446	300990	同飞股份	1,700	178,619.00	0.00
447	688348	昱能科技	5,107	177,621.46	0.00
448	002734	利民股份	10,300	176,851.00	0.00
449	600862	中航高科	9,800	176,694.00	0.00
450	688388	嘉元科技	4,005	176,220.00	0.00
451	688690	纳微科技	3,975	175,297.50	0.00
452	300680	隆盛科技	7,700	174,944.00	0.00
453	300792	壹网壹创	6,700	173,798.00	0.00
454	300952	恒辉安防	9,900	172,260.00	0.00
455	001203	大中矿业	5,700	170,715.00	0.00
456	002791	坚朗五金	13,000	170,300.00	0.00
457	688677	海泰新光	1,650	166,864.50	0.00
458	603355	莱克电气	6,200	163,556.00	0.00
459	300729	乐歌股份	16,800	161,616.00	0.00
460	601166	兴业银行	9,600	158,976.00	0.00
461	002832	比音勒芬	7,600	156,864.00	0.00
462	603393	新天然气	7,200	154,152.00	0.00
463	000683	博源化工	26,200	150,912.00	0.00
464	000039	中集集团	18,400	149,224.00	0.00
465	601963	重庆银行	13,900	140,112.00	0.00
466	603929	亚翔集成	500	136,010.00	0.00
467	002273	水晶光电	3,700	131,276.00	0.00
468	603659	璞泰来	3,900	112,827.00	0.00
469	688800	瑞可达	1,098	105,375.06	0.00
470	601788	光大证券	7,200	103,896.00	0.00
471	002615	哈尔斯	14,200	97,980.00	0.00
472	002048	宁波华翔	4,200	96,600.00	0.00
473	605168	三人行	1,900	96,216.00	0.00
474	002706	良信股份	8,000	87,280.00	0.00
475	301332	德尔玛	11,400	87,210.00	0.00
476	603612	索通发展	4,800	87,024.00	0.00
477	300035	中科电气	6,000	86,520.00	0.00
478	301187	欧圣电气	6,000	85,860.00	0.00
479	002488	金固股份	9,600	85,536.00	0.00
480	688050	爱博医疗	2,344	85,438.80	0.00
481	688552	航天南湖	3,031	85,262.03	0.00
482	002765	蓝黛科技	12,200	84,912.00	0.00
483	601901	方正证券	11,500	82,800.00	0.00
484	300926	博俊科技	4,300	76,325.00	0.00

485	603885	吉祥航空	6,700	68,943.00	0.00
486	688150	莱特光电	824	56,542.88	0.00
487	600301	华锡有色	900	55,188.00	0.00
488	300769	德方纳米	800	53,200.00	0.00
489	301590	优优绿能	400	52,580.00	0.00
490	301525	儒竞科技	1,100	51,931.00	0.00
491	603638	艾迪精密	2,200	51,590.00	0.00
492	600535	天士力	3,800	50,274.00	0.00
493	300286	安科瑞	2,000	48,300.00	0.00
494	600436	片仔癀	300	32,784.00	0.00
495	002993	奥海科技	400	28,644.00	0.00
496	688386	泛亚微透	115	10,331.60	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	300308	中际旭创	196,463,622.07	2.13
2	300750	宁德时代	166,353,215.40	1.80
3	300274	阳光电源	135,988,700.08	1.47
4	601138	工业富联	132,278,517.76	1.43
5	002475	立讯精密	130,711,185.83	1.41
6	600519	贵州茅台	124,988,832.30	1.35
7	300502	新易盛	124,285,389.48	1.34
8	002463	沪电股份	121,787,880.67	1.32
9	603259	药明康德	120,239,333.32	1.30
10	000333	美的集团	117,075,399.38	1.27
11	300476	胜宏科技	116,814,639.33	1.26
12	600150	中国船舶	110,630,170.39	1.20
13	600030	中信证券	101,045,842.85	1.09
14	600660	福耀玻璃	100,796,228.36	1.09
15	000975	山金国际	99,867,097.61	1.08
16	600066	宇通客车	96,572,943.40	1.04
17	002028	思源电气	92,412,592.00	1.00
18	688256	寒武纪	89,497,273.30	0.97
19	600919	江苏银行	87,445,835.00	0.95
20	002415	海康威视	85,327,450.11	0.92

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	300274	阳光电源	148,118,990.46	1.60
2	002475	立讯精密	139,075,375.58	1.50
3	300308	中际旭创	138,656,899.76	1.50
4	601138	工业富联	135,945,805.00	1.47
5	300750	宁德时代	130,813,817.12	1.42
6	002463	沪电股份	129,595,143.00	1.40
7	600519	贵州茅台	124,499,104.80	1.35
8	600066	宇通客车	113,177,977.40	1.22
9	300476	胜宏科技	112,252,290.99	1.21
10	600660	福耀玻璃	108,426,630.04	1.17
11	002028	思源电气	101,909,201.00	1.10
12	300502	新易盛	94,945,170.24	1.03
13	000333	美的集团	88,684,761.48	0.96
14	000975	山金国际	87,406,544.40	0.95
15	601899	紫金矿业	86,933,255.96	0.94
16	600150	中国船舶	85,525,587.68	0.93
17	601088	中国神华	82,535,484.58	0.89
18	000977	浪潮信息	81,854,822.00	0.89
19	603993	洛阳钼业	81,555,194.05	0.88
20	601058	赛轮轮胎	80,888,588.20	0.88

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	15,398,363,470.65
卖出股票收入（成交）总额	14,078,011,891.74

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	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	515,707,478.42	2.91
2	央行票据	—	—
3	金融债券	12,116,657,900.96	68.36
	其中：政策性金融债	7,285,724,301.37	41.11
4	企业债券	1,345,239,503.05	7.59

5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	442,901,633.96	2.50
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	14,420,506,516.39	81.36

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	260401	26 农发 01	15,500,000	1,562,760,958.90	8.82
2	250220	25 国开 20	13,000,000	1,328,884,219.18	7.50
3	250430	25 农发 30	12,500,000	1,273,818,835.62	7.19
4	260205	26 国开 05	11,000,000	1,120,409,972.60	6.32
5	250215	25 国开 15	9,000,000	891,438,904.11	5.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

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

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

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

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约定的备选股票库

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	1,036,504.09
2	应收清算款	60,388,302.18
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	94,897,021.91

6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	156,321,828.18

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	127040	国泰转债	13,715,827.31	0.08
2	118024	冠宇转债	13,610,871.63	0.08
3	113661	福 22 转债	13,553,610.28	0.08
4	127030	盛虹转债	13,503,512.24	0.08
5	118031	天 23 转债	13,461,973.86	0.08
6	113052	兴业转债	13,459,499.95	0.08
7	127110	广核转债	13,303,979.74	0.08
8	113056	重银转债	13,174,305.89	0.07
9	113042	上银转债	12,904,303.16	0.07
10	110099	福能转债	11,785,820.81	0.07
11	110087	天业转债	11,333,201.65	0.06
12	123107	温氏转债	11,020,049.16	0.06
13	113616	韦尔转债	10,294,835.11	0.06
14	113051	节能转债	10,074,670.33	0.06
15	113043	财通转债	10,059,188.54	0.06
16	113054	绿动转债	10,047,884.63	0.06
17	113062	常银转债	9,547,029.84	0.05
18	127067	恒逸转 2	8,123,948.66	0.05
19	118034	晶能转债	7,884,018.88	0.04
20	113046	金田转债	7,844,238.92	0.04
21	110076	华海转债	7,778,646.64	0.04
22	128136	立讯转债	7,519,639.58	0.04
23	113652	伟 22 转债	7,424,841.97	0.04
24	127045	牧原转债	6,673,019.50	0.04
25	110075	南航转债	6,555,892.92	0.04
26	128134	鸿路转债	6,304,119.29	0.04

27	113067	燃 23 转债	6,059,090.08	0.03
28	113605	大参转债	6,025,780.87	0.03
29	113659	莱克转债	5,975,433.83	0.03
30	127046	百润转债	5,281,370.70	0.03
31	127084	柳工转 2	5,211,462.86	0.03
32	113636	甬金转债	5,155,030.90	0.03
33	113053	隆 22 转债	5,148,291.49	0.03
34	127050	麒麟转债	5,059,940.21	0.03
35	113658	密卫转债	4,813,200.25	0.03
36	123104	卫宁转债	4,800,611.52	0.03
37	123165	回天转债	4,760,259.09	0.03
38	113066	平煤转债	4,575,221.92	0.03
39	123114	三角转债	4,552,066.66	0.03
40	113048	晶科转债	4,514,189.15	0.03
41	113655	欧 22 转债	4,484,508.47	0.03
42	127108	太能转债	4,431,248.51	0.03
43	123150	九强转债	4,410,731.74	0.02
44	110097	天润转债	4,322,862.00	0.02
45	118042	奥维转债	4,116,120.49	0.02
46	113688	国检转债	3,933,433.84	0.02
47	113650	博 22 转债	3,669,665.70	0.02
48	123257	安克转债	3,599,127.19	0.02
49	123188	水羊转债	3,493,042.68	0.02
50	123215	铭利转债	3,371,488.90	0.02
51	123119	康泰转 2	3,218,650.23	0.02
52	128142	新乳转债	3,185,025.97	0.02
53	113058	友发转债	3,177,065.51	0.02
54	123194	百洋转债	3,079,998.45	0.02
55	127031	洋丰转债	2,959,427.16	0.02
56	111017	蓝天转债	2,614,163.93	0.01
57	111002	特纸转债	2,528,306.62	0.01
58	123213	天源转债	2,462,634.56	0.01

59	113631	皖天转债	2,438,173.81	0.01
60	127099	盛航转债	2,337,785.50	0.01
61	127095	广泰转债	2,293,191.30	0.01
62	123076	强力转债	2,234,759.20	0.01
63	123091	长海转债	2,199,479.43	0.01
64	113627	太平转债	2,096,652.21	0.01
65	111004	明新转债	1,985,049.26	0.01
66	113625	江山转债	1,939,316.73	0.01
67	123113	仙乐转债	1,506,208.64	0.01
68	123117	健帆转债	1,480,442.61	0.01
69	127078	优彩转债	1,358,568.29	0.01
70	123192	科思转债	1,025,552.40	0.01
71	118035	国力转债	1,019,496.32	0.01
72	111020	合顺转债	901,217.34	0.01
73	123133	佩蒂转债	837,759.63	0.00
74	118044	赛特转债	802,195.20	0.00
75	110086	精工转债	770,514.95	0.00
76	113643	风语转债	722,246.56	0.00
77	127089	晶澳转债	678,418.10	0.00
78	123263	鼎捷转债	638,285.75	0.00
79	127064	杭氧转债	569,563.27	0.00
80	113699	金 25 转债	477,242.71	0.00
81	123178	花园转债	1,325.96	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
富国宝利增强债券 A	5,691	1,139,020.52	6,445,795,838.67	99.44	36,369,923.68	0.56
富国宝利增强债券 E	615	9,053,159.45	5,563,486,344.90	99.92	4,206,714.39	0.08
合计	6,306	1,910,856.14	12,009,282,183.57	99.66	40,576,638.07	0.34

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有 从业人员持有本 基金	富国宝利增强债券 A	148,357.20	0.0023
	富国宝利增强债券 E	41,183.41	0.0007
	合计	189,540.61	0.0016

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情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有 本开放式基金	富国宝利增强债券 A	0
	富国宝利增强债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持 有本开放式基金	富国宝利增强债券 A	10~50
	富国宝利增强债券 E	0
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数 (份)	持有份额占 基金总份额 比例 (%)	发起份额总数 (份)	发起份额占基 金总份额比例 (%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.08	10,000,000.00	0.08	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—

基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,000,000.00	0.08	10,000,000.00	0.08	3 年

注：截至 2021 年 2 月 8 日，本基金的基金合同生效届满 3 年。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国保利增强债券 A	富国保利增强债券 E
基金合同生效日（2018 年 02 月 08 日）基金份额总额	73,996,883.34	—
本报告期期初基金份额总额	2,856,103,581.57	3,669,691,651.78
本报告期基金总申购份额	6,664,275,757.94	8,449,891,082.61
减：本报告期基金总赎回份额	3,038,213,577.16	6,551,889,675.10
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	6,482,165,762.35	5,567,693,059.29

§ 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，本基金基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布公告，王苏龙先生自 2026 年 6 月 26 日起担任公司董事长，同日起裴长江先生不再担任公司董事长。

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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	—	—	—	—	—
长江证券	3	—	—	—	—	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
东财证券	2	788,073,168.72	2.67	319,882.12	2.67	—
方正证券	2	—	—	—	—	—
高盛中国	1	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—
广发证券	2	—	—	—	—	—
国海证券	2	3,041,505,506.86	10.32	1,234,663.17	10.32	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通	3	8,516,855,416.28	28.89	3,457,041.47	28.89	—
国投证券	2	—	—	—	—	—
国信证券	2	1,804,219,104.30	6.12	732,380.66	6.12	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—
华源证券	2	481,775,236.55	1.63	195,549.57	1.63	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	6,435,447,813.23	21.83	2,612,221.23	21.83	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—

天风证券	2	2,387,709,039.25	8.10	969,178.97	8.10	—
西南证券	2	—	—	—	—	—
湘财证券	2	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	1	5,349,049,636.11	18.15	2,171,224.22	18.15	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
中航证券	2	671,740,441.09	2.28	272,666.00	2.28	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
中泰证券	2	—	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中信证券	3	—	—	—	—	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

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。本报告期本基金退租券商交易单元：国泰海通（274902）。

10.7.2 基金租用或者通过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	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东财证券	147,437,815.55	3.00	3,175,600,000.00	3.99	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
高盛中国	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	480,631,407.10	9.79	6,756,000,000.00	8.49	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰海通	1,542,263,951.09	31.40	19,797,500,000.00	24.87	—	—

国投证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	340,231,475.62	6.93	6,320,000,000.00	7.94	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
华源证券	113,314,101.62	2.31	1,981,900,000.00	2.49	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—
上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	1,012,325,830.38	20.61	11,821,848,000.00	14.85	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	335,036,849.30	6.82	4,457,300,000.00	5.60	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	815,992,016.73	16.61	22,376,279,000.00	28.11	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中航证券	73,166,455.07	1.49	1,700,000,000.00	2.14	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中泰证券	51,048,359.98	1.04	1,210,000,000.00	1.52	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
中银证券	—	—	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定披露媒介	2026年06月27日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，经基金管理人董事会第七届十四次会议审议通过，王苏龙先生自 2026 年 6 月 26 日起担任公司董事长，同日起裴长江先生不再担任公司董事长。具体可参见基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布的《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

§ 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国宝利增强债券型发起式证券投资基金的文件 2、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金合同 3、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址： http://www.fullgoal.com.cn 。