

富国兴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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	41
7.1	期末基金资产组合情况	41

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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.....	59
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	59
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	62
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.....	63
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国兴利增强债券型发起式证券投资基金	
基金简称	富国兴利增强债券	
基金主代码	005121	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 09 月 20 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	14,299,226,234.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国兴利增强债券 A	富国兴利增强债券 E
下属分级基金的交易代码	005121	022229
报告期末下属分级基金的份额总额	5,006,765,306.71 份	9,292,460,928.11 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。此外，本基金的存托凭证投资策略、权证投资策略等详见基金合同。
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	郭明
	联系电话	021-20361818	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95588

传真	021-20361616	010—66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	陈戈	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 55 号

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国兴利增强债券 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	233,647,829.19
本期利润	599,756,379.52
加权平均基金份额本期利润	0.1524
本期加权平均净值利润率	8.28%
本期基金份额净值增长率	9.09%
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	2,283,974,721.85
期末可供分配基金份额利润	0.4562
期末基金资产净值	9,675,974,973.46
期末基金份额净值	1.9326
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	93.26%

(2) 富国兴利增强债券 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	500,812,768.68
本期利润	1,097,431,328.30
加权平均基金份额本期利润	0.1380
本期加权平均净值利润率	7.50%
本期基金份额净值增长率	9.08%
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	4,232,157,923.21
期末可供分配基金份额利润	0.4554
期末基金资产净值	17,950,416,867.73
期末基金份额净值	1.9317
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	39.57%

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) 富国兴利增强债券 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	8.70%	0.51%	1.74%	0.14%	6.96%	0.37%
过去六个月	9.09%	0.49%	1.62%	0.12%	7.47%	0.37%
过去一年	22.06%	0.53%	1.98%	0.11%	20.08%	0.42%
过去三年	33.78%	0.66%	7.80%	0.11%	25.98%	0.55%
过去五年	31.27%	0.58%	7.84%	0.11%	23.43%	0.47%
过去七年	83.60%	0.59%	13.34%	0.12%	70.26%	0.47%
自基金合同生效起至今	93.26%	0.53%	17.73%	0.12%	75.53%	0.41%

(2) 富国兴利增强债券 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	8.70%	0.51%	1.74%	0.14%	6.96%	0.37%
过去六个月	9.08%	0.49%	1.62%	0.12%	7.46%	0.37%
过去一年	22.04%	0.53%	1.98%	0.11%	20.06%	0.42%
自基金分级生效日起至今	39.57%	0.75%	4.47%	0.12%	35.10%	0.63%

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。

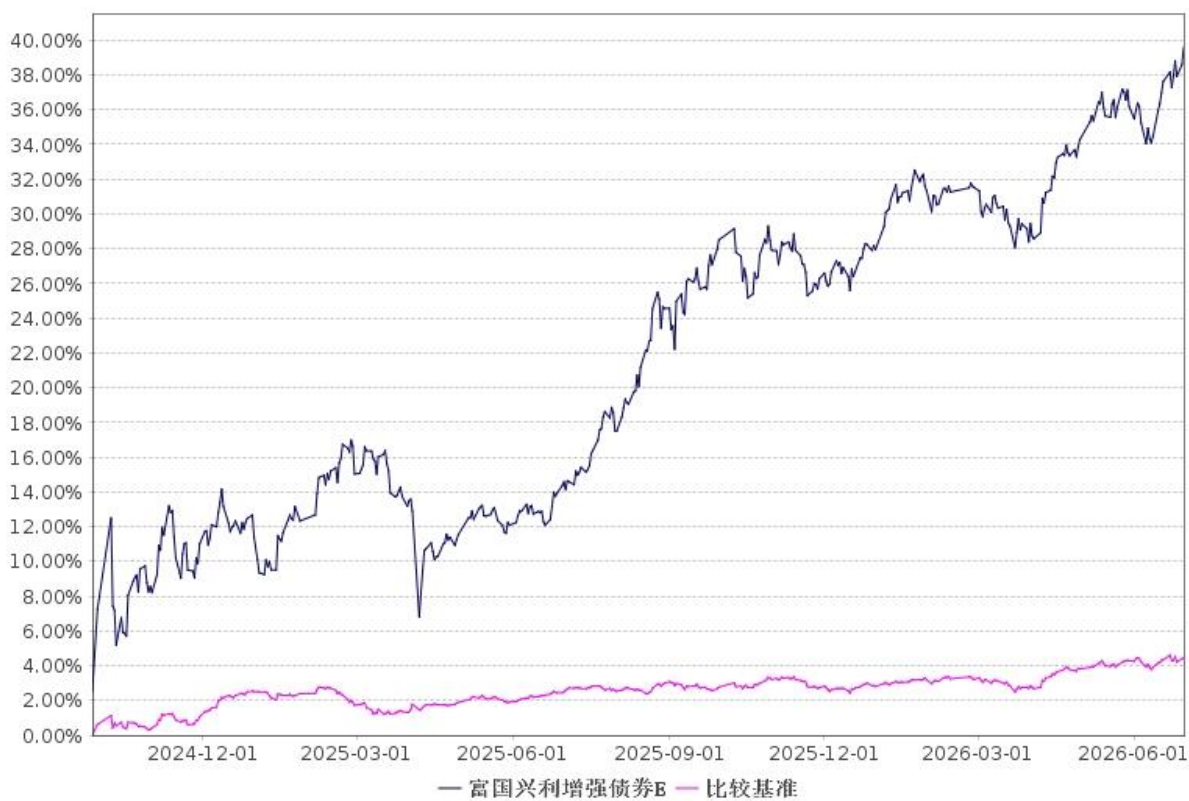
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(1) 富国兴利增强债券 A



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

(2) 富国兴利增强债券 E



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2024 年 9 月 26 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	2018-04-02	—	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兴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》、《富国兴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 56 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兴利增强债券 A 为 1.9326 元，富国兴利增强债券 E 为 1.9317 元；份额累计净值富国兴利增强债券 A 为 1.9326 元，富国兴利增强债券 E 为 1.9317 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国兴利增强债券 A 为 9.09%，富国兴利增强债券 E 为 9.08%；同期业绩比较基准收益率情况：富国兴利增强债券 A 为 1.62%，富国兴利增强债券 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国兴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	546,314,452.17	253,322,672.49
结算备付金	186,042,756.28	114,893,283.65
存出保证金	2,393,478.90	1,173,758.55
交易性金融资产	28,355,146,892.11	11,939,795,393.60
其中：股票投资	5,656,958,346.87	2,279,231,040.28
基金投资	—	—
债券投资	22,698,188,545.24	9,660,564,353.32
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	260,000,000.00	27,576,755.67
应收清算款	258,982,140.67	90,415,718.92
应收股利	—	—
应收申购款	142,648,522.04	121,413,910.87
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	29,751,528,242.17	12,548,591,493.75
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	1,000,000,000.00	473,622,227.87
应付清算款	107,859,360.32	167,095,685.77
应付赎回款	998,626,847.84	290,054,528.12
应付管理人报酬	8,236,595.88	3,614,630.21
应付托管费	2,059,148.99	903,657.57
应付销售服务费	136,088.72	61,806.81
应付投资顾问费	—	—
应交税费	446,425.54	173,076.05

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	7,771,933.69	4,656,949.43
负债合计	2,125,136,400.98	940,182,561.83
净资产：		
实收基金	14,299,226,234.82	6,554,341,437.31
未分配利润	13,327,165,606.37	5,054,067,494.61
净资产合计	27,626,391,841.19	11,608,408,931.92
负债和净资产总计	29,751,528,242.17	12,548,591,493.75

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.9320 元，基金份额总额 14,299,226,234.82 份。其中：富国兴利增强债券 A 份额净值 1.9326 元，份额总额 5,006,765,306.71 份；富国兴利增强债券 E 份额净值 1.9317 元，份额总额 9,292,460,928.11 份。

6.2 利润表

会计主体：富国兴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	1,759,580,222.97	24,993,919.65
1. 利息收入	3,137,242.45	749,239.77
其中：存款利息收入	2,025,491.26	296,675.25
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	1,111,751.19	452,564.52
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	790,845,069.63	25,184,671.50
其中：股票投资收益	451,099,252.11	-42,449,114.34
基金投资收益	—	—
债券投资收益	322,098,824.89	64,184,084.16
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	17,646,992.63	3,449,701.68
其他投资收益	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	962,727,109.95	-1,546,261.33
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,870,800.94	606,269.71
减：二、营业总支出	62,392,515.15	11,455,636.56
1. 管理人报酬	43,390,737.81	6,147,254.44

2. 托管费	10,847,684.48	1,536,813.62
3. 销售服务费	725,565.08	109,373.83
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	7,055,218.26	3,522,016.38
其中：卖出回购金融资产支出	7,055,218.26	3,522,016.38
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	223,601.73	29,116.77
8. 其他费用	149,707.79	111,061.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,697,187,707.82	13,538,283.09
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,697,187,707.82	13,538,283.09
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	1,697,187,707.82	13,538,283.09

6.3 净资产变动表

会计主体：富国兴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	6,554,341,437.31	5,054,067,494.61	11,608,408,931.92
二、本期期初净资产	6,554,341,437.31	5,054,067,494.61	11,608,408,931.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,744,884,797.51	8,273,098,111.76	16,017,982,909.27
（一）、综合收益总额	—	1,697,187,707.82	1,697,187,707.82
（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）	7,744,884,797.51	6,575,910,403.94	14,320,795,201.45
其中：1. 基金申购款	24,991,320,900.96	21,075,615,555.44	46,066,936,456.40
2. 基金赎回款	—	—	—
	17,246,436,103.45	14,499,705,151.50	31,746,141,254.95
（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	14,299,226,234.82	13,327,165,606.37	27,626,391,841.19
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	1,627,535,408.47	881,794,118.58	2,509,329,527.05
二、本期期初净资产	1,627,535,408.47	881,794,118.58	2,509,329,527.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-140,889,666.47	-14,991,800.08	-155,881,466.55
（一）、综合收益总额	—	13,538,283.09	13,538,283.09
（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）	-140,889,666.47	-28,530,083.17	-169,419,749.64
其中：1. 基金申购款	3,049,507,679.83	1,777,329,201.94	4,826,836,881.77
2. 基金赎回款	—	—	—
	3,190,397,346.30	1,805,859,285.11	4,996,256,631.41
（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	1,486,645,742.00	866,802,318.50	2,353,448,060.50

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

富国兴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] 1483 号《关于准予富国兴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 2017 年 9 月 20 日生效，首次设立募集规模为 99,995,250.23 份基金份额。根据基金管理人于 2024 年 09 月 24 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国兴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 26 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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、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、存托凭证及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	546,314,452.17
等于：本金	546,244,872.89
加：应计利息	69,579.28
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	546,314,452.17

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末（2026年06月30日）			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		4,463,133,780.87	—	5,656,958,346.87	1,193,824,566.00
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	6,767,863,637.18	45,860,371.48	6,667,014,974.17	-146,709,034.49
	银行间市场	15,801,628,601.65	167,879,971.07	16,031,173,571.07	61,664,998.35
	合计	22,569,492,238.83	213,740,342.55	22,698,188,545.24	-85,044,036.14
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		27,032,626,019.70	213,740,342.55	28,355,146,892.11	1,108,780,529.86

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	260,000,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	260,000,000.00	—

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（2026年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	52.87
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	7,620,201.12
其中：交易所市场	7,525,689.12
银行间市场	94,512.00
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	91,679.70
合计	7,771,933.69

6.4.7.7 实收基金

富国兴利增强债券 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	2,022,782,871.64	2,022,782,871.64
本期申购	7,224,963,340.90	7,224,963,340.90
本期赎回（以“-”号填列）	-4,240,980,905.83	-4,240,980,905.83
本期末	5,006,765,306.71	5,006,765,306.71

富国兴利增强债券 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	4,531,558,565.67	4,531,558,565.67
本期申购	17,766,357,560.06	17,766,357,560.06
本期赎回（以“-”号填列）	-13,005,455,197.62	-13,005,455,197.62
本期末	9,292,460,928.11	9,292,460,928.11

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

富国兴利增强债券 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	802,890,401.88	757,876,409.60	1,560,766,811.48
本期期初	802,890,401.88	757,876,409.60	1,560,766,811.48
本期利润	233,647,829.19	366,108,550.33	599,756,379.52
本期基金份额交易产生的变动数	1,247,436,490.78	1,261,249,984.97	2,508,686,475.75
其中：基金申购款	3,077,613,692.40	3,009,376,391.20	6,086,990,083.60
基金赎回款	-1,830,177,201.62	-1,748,126,406.23	-3,578,303,607.85
本期已分配利润	—	—	—
本期末	2,283,974,721.85	2,385,234,944.90	4,669,209,666.75

富国兴利增强债券 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	1,795,816,559.78	1,697,484,123.35	3,493,300,683.13
本期期初	1,795,816,559.78	1,697,484,123.35	3,493,300,683.13
本期利润	500,812,768.68	596,618,559.62	1,097,431,328.30
本期基金份额交易产生的变动数	1,935,528,594.75	2,131,695,333.44	4,067,223,928.19
其中：基金申购款	7,531,373,250.44	7,457,252,221.40	14,988,625,471.84
基金赎回款	-5,595,844,655.69	-5,325,556,887.96	-10,921,401,543.65
本期已分配利润	—	—	—
本期末	4,232,157,923.21	4,425,798,016.41	8,657,955,939.62

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	959,085.14
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	225,294.44
其他	841,111.68

合计	2,025,491.26
----	--------------

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	15,904,982,806.81
减：卖出股票成本总额	15,430,142,824.19
减：交易费用	23,740,730.51
买卖股票差价收入	451,099,252.11

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	164,932,932.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	157,165,892.10
合计	322,098,824.89

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	20,046,916,655.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	19,779,346,223.05
减：应计利息总额	109,441,361.80
减：交易费用	963,178.55
买卖债券差价收入	157,165,892.10

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	17,646,992.63
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	17,646,992.63

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	962,727,109.95
股票投资	1,115,305,847.64
债券投资	-152,578,737.69
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	962,727,109.95

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	2,754,243.60
基金转换费收入	116,557.34
合计	2,870,800.94

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	38,679.70
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	29,195.24
债券账户维护费	18,000.00
其他	3,832.85
合计	149,707.79

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构

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	3,249,703,362.62	9.67	192,586,653.77	4.57
申万宏源	2,709,344,679.03	8.07	158,453,711.53	3.76

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	3,148,329,986.84	14.68	754,501,938.50	9.60
海通证券	—	—	344,926,943.15	4.39
申万宏源	1,332,060,120.63	6.21	418,656,380.63	5.33

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	6,163,800,000.00	4.95	5,683,800,000.00	11.21
海通证券	—	—	309,300,000.00	0.61
申万宏源	6,642,000,000.00	5.33	3,243,900,000.00	6.40

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	1,319,093.02	9.67	810,333.82	10.77
申万宏源	1,099,837.06	8.07	972,960.31	12.93
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	78,190.13	4.57	53,696.84	8.35
申万宏源	64,325.43	3.76	18,687.49	2.90

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	43,390,737.81	6,147,254.44
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,758,045.50	392,695.35
应支付基金管理人的净管理费	39,632,692.31	5,754,559.09

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（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	10,847,684.48	1,536,813.62

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

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期（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		
	富国兴利增强债券 A	富国兴利增强债券 E	合计
富国基金管理有限公司	—	450,438.85	450,438.85
合计	—	450,438.85	450,438.85

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		
	富国兴利增强债券 A	富国兴利增强债券 E	合计
富国基金管理有限公司	—	74,567.86	74,567.86
合计	—	74,567.86	74,567.86

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）	
	富国兴利增强债券A	富国兴利增强债券E	富国兴利增强债券A	富国兴利增强债券E
报告期初持有的基金份额	10,002,250.23	—	10,002,250.23	722.54
报告期内申购/买入总份额	—	—	—	—
报告期内因拆分变动份额	—	—	—	—
减：报告期内赎回/卖出总份额	—	—	—	722.54
报告期末持有的基金份额	10,002,250.23	—	10,002,250.23	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.20%	—	1.21%	—

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

富国兴利增强债券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(%)
国泰海通证券股份	10,459,156.99	0.11	—	—

有限公司				
------	--	--	--	--

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
中国工商银行股份有 限公司	546,314,452.17	959,085.14	51,564,828.43	88,936.68

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

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

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	150,815.0 0	83,158,22 1.39	125,478,0 80.00	—

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 1,000,000,000.00 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	8,357,176,826.89	4,686,459,262.41
AAA 以下	2,061,826,976.88	3,000,021,804.09
未评级	1,453,510,660.53	596,750,875.91
合计	11,872,514,464.30	8,283,231,942.41

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

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	546,314,452.17	—	—	—	546,314,452.17
结算备付金	186,042,756.28	—	—	—	186,042,756.28
存出保证金	2,393,478.90	—	—	—	2,393,478.90
交易性金融资产	7,841,076,182.10	8,320,971,163.01	6,536,141,200.13	5,656,958,346.87	28,355,146,892.11
买入返售金融资产	260,000,000.00	—	—	—	260,000,000.00
应收清算款	—	—	—	258,982,140.67	258,982,140.67
应收申购款	—	—	—	142,648,522.04	142,648,522.04
资产总计	8,835,826,869.45	8,320,971,163.01	6,536,141,200.13	6,058,589,009.58	29,751,528,242.17
负债					
卖出回购金融资产款	1,000,000,000.00	—	—	—	1,000,000,000.00
应付清算款	—	—	—	107,859,360.32	107,859,360.32

				2	
应付赎回款	—	—	—	998,626,847.84	998,626,847.84
应付管理人报酬	—	—	—	8,236,595.88	8,236,595.88
应付托管费	—	—	—	2,059,148.99	2,059,148.99
应付销售服务费	—	—	—	136,088.72	136,088.72
应交税费	—	—	—	446,425.54	446,425.54
其他负债	—	—	—	7,771,933.69	7,771,933.69
负债总计	1,000,000,000.00	—	—	1,125,136,400.98	2,125,136,400.98
利率敏感度缺口	7,835,826,869.45	8,320,971,163.01	6,536,141,200.13	4,933,452,608.60	27,626,391,841.19
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	253,322,672.49	—	—	—	253,322,672.49
结算备付金	114,893,283.65	—	—	—	114,893,283.65
存出保证金	1,173,758.55	—	—	—	1,173,758.55
交易性金融资产	6,034,842,081.43	3,354,883,346.04	270,838,925.85	2,279,231,040.28	11,939,795,393.60
买入返售金融资产	27,576,755.67	—	—	—	27,576,755.67
应收清算款	—	—	—	90,415,718.92	90,415,718.92
应收申购款	—	—	—	121,413,910.87	121,413,910.87
资产总计	6,431,808,551.79	3,354,883,346.04	270,838,925.85	2,491,060,670.07	12,548,591,493.75
负债					
卖出回购金融资产款	473,622,227.87	—	—	—	473,622,227.87
应付清算款	—	—	—	167,095,685.77	167,095,685.77
应付赎回款	—	—	—	290,054,528.12	290,054,528.12
应付管理人报酬	—	—	—	3,614,630.21	3,614,630.21
应付托管费	—	—	—	903,657.57	903,657.57
应付销售服务费	—	—	—	61,806.81	61,806.81
应交税费	—	—	—	173,076.05	173,076.05
其他负债	—	—	—	4,656,949.43	4,656,949.43
负债总计	473,622,227.87	—	—	466,560,333.96	940,182,561.83
利率敏感度缺口	5,958,186,323.9	3,354,883,346	270,838,925.85	2,024,500,336	11,608,408,931.9

	2	.04		.11	2
--	---	-----	--	-----	---

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%	-80,570,465.18	-14,046,224.76
	2. 基准点利率减少 0.1%	80,570,465.18	14,046,224.76

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，所面临的最大的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	5,656,958,346.87	20.48	2,279,231,040.28	19.63
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—

交易性金融资产—债券投资	22,698,188,545.24	82.16	9,660,564,353.32	83.22
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	28,355,146,892.11	102.64	11,939,795,393.60	102.85

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%	103,473,978.89	69,957,904.67
	2. 市场基准减少1%	-103,473,978.89	-69,957,904.67

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	8,429,457,153.93	6,503,409,288.97
第二层次	19,925,689,738.18	5,436,386,104.63
第三层次	—	—
合计	28,355,146,892.11	11,939,795,393.60

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	5,656,958,346.87	19.01
	其中：股票	5,656,958,346.87	19.01
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	22,698,188,545.24	76.29
	其中：债券	22,698,188,545.24	76.29
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	260,000,000.00	0.87
	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	732,357,208.45	2.46
8	其他各项资产	404,024,141.61	1.36
9	合计	29,751,528,242.17	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	10,391,242.40	0.04
B	采矿业	20,061,760.00	0.07
C	制造业	4,585,892,070.26	16.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,924,579.00	0.01
E	建筑业	5,318,035.00	0.02
F	批发和零售业	72,405,446.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	10,088,397.40	0.04
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	734,462,323.97	2.66
J	金融业	127,355,032.06	0.46
K	房地产业	20,898,638.60	0.08
L	租赁和商务服务业	21,922,809.68	0.08
M	科学研究和技术服务业	23,843,012.50	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	7,082,583.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	1,534,158.00	0.01

Q	卫生和社会工作	5,312,832.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	7,465,427.00	0.03
S	综合	—	—
	合计	5,656,958,346.87	20.48

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	324,602	412,244,540.00	1.49
2	300750	宁德时代	945,204	371,474,624.04	1.34
3	688256	寒武纪	180,030	287,246,866.50	1.04
4	300502	新易盛	469,633	285,067,231.00	1.03
5	688008	澜起科技	786,661	243,786,243.90	0.88
6	688012	中微公司	496,886	232,791,091.00	0.84
7	688041	海光信息	617,851	228,790,225.30	0.83
8	688981	中芯国际	1,255,180	199,347,687.60	0.72
9	688525	佰维存储	340,590	168,500,090.70	0.61
10	688498	源杰科技	79,614	150,152,004.00	0.54
11	688521	芯原股份	371,252	137,786,467.28	0.50
12	688072	拓荆科技	150,815	125,478,080.00	0.45
13	688347	华虹宏力	271,456	91,290,652.80	0.33
14	300476	胜宏科技	254,529	88,176,481.47	0.32
15	688120	华海清科	252,964	81,499,941.52	0.30
16	300059	东方财富	3,824,411	77,941,496.18	0.28
17	301308	江波龙	108,100	76,080,780.00	0.28
18	300274	阳光电源	432,307	68,745,459.14	0.25
19	300408	三环集团	358,156	59,776,236.40	0.22
20	300394	天孚通信	197,366	59,738,740.88	0.22
21	688361	中科飞测	133,240	57,293,200.00	0.21
22	300475	香农芯创	180,000	54,000,000.00	0.20
23	300604	长川科技	155,800	53,193,236.00	0.19
24	300223	君正股份	197,700	49,207,530.00	0.18
25	300857	协创数据	141,508	48,098,569.20	0.17
26	300124	汇川技术	723,455	47,986,770.15	0.17
27	688469	芯联集成	4,279,775	45,408,412.75	0.16
28	688777	中控技术	355,524	41,774,070.00	0.15
29	688578	艾力斯	380,183	41,515,983.60	0.15
30	688702	盛科通信	103,352	40,306,246.48	0.15
31	688111	金山办公	166,232	35,415,727.60	0.13
32	688220	翱捷科技	279,152	34,704,176.64	0.13
33	688249	晶合集成	562,651	33,213,288.53	0.12

34	688183	生益电子	240,302	31,815,984.80	0.12
35	688396	华润微	325,849	31,786,569.95	0.12
36	688126	沪硅产业	771,886	30,790,532.54	0.11
37	688213	思特威	287,432	30,775,344.24	0.11
38	688082	盛美上海	71,209	30,762,288.00	0.11
39	300033	同花顺	124,827	30,083,307.00	0.11
40	688271	联影医疗	290,227	29,379,679.21	0.11
41	300014	亿纬锂能	422,893	27,500,731.79	0.10
42	603986	兆易创新	32,500	26,487,500.00	0.10
43	300661	圣邦股份	183,158	26,279,509.84	0.10
44	301536	星辰科技	199,903	25,729,515.13	0.09
45	689009	九号公司	569,781	21,737,145.15	0.08
46	300433	蓝思科技	387,500	20,793,250.00	0.08
47	300136	信维通信	162,600	19,390,050.00	0.07
48	301526	国际复材	406,500	18,971,355.00	0.07
49	688099	晶晨股份	180,550	18,578,595.00	0.07
50	688568	中科星图	423,625	17,567,728.75	0.06
51	300760	迈瑞医疗	119,002	16,164,041.66	0.06
52	300450	先导智能	394,370	16,058,746.40	0.06
53	001389	广合科技	63,084	14,966,679.00	0.05
54	600663	陆家嘴	2,368,700	14,875,436.00	0.05
55	688036	传音控股	247,749	14,604,803.55	0.05
56	002414	高德红外	1,099,631	14,581,107.06	0.05
57	300346	南大光电	157,200	14,564,580.00	0.05
58	688266	泽璟制药	121,181	14,136,975.46	0.05
59	688047	龙芯中科	88,601	13,703,916.67	0.05
60	300724	捷佳伟创	193,400	13,654,040.00	0.05
61	301358	湖南裕能	179,719	13,635,280.53	0.05
62	300677	英科医疗	347,500	13,611,575.00	0.05
63	688027	国盾量子	26,954	13,585,085.54	0.05
64	300054	鼎龙股份	127,100	13,468,787.00	0.05
65	688002	睿创微纳	85,306	13,195,985.14	0.05
66	300548	长芯博创	47,300	13,149,400.00	0.05
67	688122	西部超导	206,601	12,976,608.81	0.05
68	300285	国瓷材料	125,300	12,928,454.00	0.05
69	300001	特锐德	341,094	12,903,586.02	0.05
70	300972	万辰集团	72,400	12,554,884.00	0.05
71	300442	润泽科技	150,200	12,477,114.00	0.05
72	300803	指南针	135,964	12,463,819.88	0.05
73	300458	全志科技	313,436	12,368,184.56	0.04
74	300395	菲利华	86,300	11,540,899.00	0.04

75	300666	江丰电子	31,000	11,426,600.00	0.04
76	300757	罗博特科	18,300	11,327,700.00	0.04
77	300390	天华新能	117,800	11,015,478.00	0.04
78	002284	亚太股份	1,158,400	10,993,216.00	0.04
79	300373	扬杰科技	69,500	10,927,485.00	0.04
80	301377	鼎泰高科	19,600	10,797,640.00	0.04
81	300498	温氏股份	843,445	10,391,242.40	0.04
82	300432	富临精工	515,500	10,356,395.00	0.04
83	688045	必易微	125,378	10,128,034.84	0.04
84	300672	国科微	33,700	9,941,500.00	0.04
85	688188	柏楚电子	92,763	9,897,812.10	0.04
86	300017	网宿科技	759,900	9,886,299.00	0.04
87	002558	巨人网络	353,700	9,747,972.00	0.04
88	300628	亿联网络	288,100	9,743,542.00	0.04
89	688506	百利天恒	32,326	9,504,813.78	0.03
90	002384	东山精密	36,000	9,444,600.00	0.03
91	300438	鹏辉能源	113,400	9,395,190.00	0.03
92	300567	精测电子	29,200	9,273,920.00	0.03
93	000415	渤海租赁	2,273,424	9,252,835.68	0.03
94	688795	摩尔线程	12,895	9,239,138.55	0.03
95	002049	紫光国微	102,900	9,132,375.00	0.03
96	300953	震裕科技	67,960	9,086,252.00	0.03
97	002466	天齐锂业	146,400	8,977,248.00	0.03
98	688375	国博电子	82,819	8,638,021.70	0.03
99	688728	格科微	407,172	8,566,898.88	0.03
100	300620	光库科技	22,300	8,433,860.00	0.03
101	300496	中科创达	133,400	8,242,786.00	0.03
102	688169	石头科技	85,233	8,094,578.01	0.03
103	002738	中矿资源	136,700	8,063,933.00	0.03
104	688599	天合光能	569,893	8,046,889.16	0.03
105	688608	恒玄科技	47,971	8,020,271.49	0.03
106	300102	乾照光电	305,300	7,950,012.00	0.03
107	600363	联创光电	220,700	7,896,646.00	0.03
108	300759	康龙化成	267,250	7,731,542.50	0.03
109	601360	三六零	888,100	7,717,589.00	0.03
110	688223	晶科能源	1,609,177	7,643,590.75	0.03
111	688331	荣昌生物	58,106	7,568,887.56	0.03
112	300413	芒果超媒	496,300	7,260,869.00	0.03
113	300418	昆仑万维	178,737	7,213,825.32	0.03
114	600875	东方电气	250,500	7,206,885.00	0.03
115	300058	蓝色光标	518,800	7,138,688.00	0.03

116	688617	惠泰医疗	39,269	7,129,679.64	0.03
117	300782	卓胜微	64,900	7,111,742.00	0.03
118	688187	时代电气	102,157	7,014,099.62	0.03
119	300002	神州泰岳	897,500	7,009,475.00	0.03
120	002460	赣锋锂业	106,800	6,984,720.00	0.03
121	002266	浙富控股	1,348,400	6,822,904.00	0.02
122	688065	凯赛生物	141,167	6,754,840.95	0.02
123	300037	新宙邦	69,900	6,490,215.00	0.02
124	688802	沐曦股份	7,832	6,487,245.60	0.02
125	300751	迈为股份	22,500	6,355,350.00	0.02
126	688472	阿特斯	571,085	6,179,139.70	0.02
127	300251	光线传媒	552,200	6,123,898.00	0.02
128	688235	百济神州	23,218	5,911,534.98	0.02
129	688538	和辉光电	2,263,126	5,884,127.60	0.02
130	601512	中新集团	735,617	5,737,812.60	0.02
131	301217	铜冠铜箔	34,200	5,645,394.00	0.02
132	600026	中远海能	309,200	5,547,048.00	0.02
133	688297	中无人机	132,231	5,494,198.05	0.02
134	300316	晶盛机电	88,100	5,321,240.00	0.02
135	300015	爱尔眼科	643,200	5,312,832.00	0.02
136	301200	大族数控	14,700	5,301,555.00	0.02
137	688428	诺诚健华	182,106	5,184,557.82	0.02
138	688390	固德威	47,401	5,143,482.51	0.02
139	300012	华测检测	363,800	5,042,268.00	0.02
140	300207	欣旺达	256,800	4,876,632.00	0.02
141	688009	中国通号	1,011,869	4,816,496.44	0.02
142	002716	湖南白银	567,700	4,592,693.00	0.02
143	300255	常山药业	195,700	4,583,294.00	0.02
144	300699	光威复材	158,200	4,532,430.00	0.02
145	002371	北方华创	5,000	4,422,800.00	0.02
146	600547	山东黄金	191,000	4,410,190.00	0.02
147	688303	大全能源	252,101	4,394,120.43	0.02
148	600885	宏发股份	126,800	4,373,332.00	0.02
149	002497	雅化集团	214,200	4,363,254.00	0.02
150	603290	斯达半导	28,200	4,312,908.00	0.02
151	002131	利欧股份	901,800	4,283,550.00	0.02
152	300339	润和软件	110,300	4,247,653.00	0.02
153	000426	兴业银锡	125,400	4,133,184.00	0.01
154	300896	爱美客	46,200	4,028,640.00	0.01
155	600502	安徽建工	925,300	4,025,055.00	0.01
156	603259	药明康德	31,800	3,959,418.00	0.01

157	301611	珂玛科技	21,500	3,871,505.00	0.01
158	300454	深信服	40,147	3,862,141.40	0.01
159	300866	安克创新	36,900	3,856,050.00	0.01
160	301236	软通动力	90,500	3,841,725.00	0.01
161	300115	长盈精密	136,200	3,805,428.00	0.01
162	600999	招商证券	176,700	3,728,370.00	0.01
163	300347	泰格医药	75,900	3,643,200.00	0.01
164	300919	中伟新材	81,900	3,583,125.00	0.01
165	301269	华大九天	29,600	3,534,832.00	0.01
166	002195	岩山科技	527,800	3,451,812.00	0.01
167	002600	领益智造	198,900	3,448,926.00	0.01
168	601212	白银有色	645,116	3,277,189.28	0.01
169	300474	景嘉微	53,600	3,241,728.00	0.01
170	300122	智飞生物	270,300	3,159,807.00	0.01
171	603538	美诺华	95,900	3,121,545.00	0.01
172	300775	三角防务	139,400	3,072,376.00	0.01
173	300073	当升科技	63,200	3,036,128.00	0.01
174	300416	苏试试验	148,300	3,022,354.00	0.01
175	300748	金力永磁	97,800	3,017,130.00	0.01
176	301606	绿联科技	49,400	3,014,388.00	0.01
177	002803	吉宏股份	116,600	3,012,944.00	0.01
178	600601	方正科技	213,500	2,954,840.00	0.01
179	002841	视源股份	85,218	2,942,577.54	0.01
180	002104	恒宝股份	282,600	2,913,606.00	0.01
181	000603	盛达资源	124,900	2,885,190.00	0.01
182	300763	锦浪科技	31,900	2,882,165.00	0.01
183	301165	锐捷网络	35,640	2,867,238.00	0.01
184	600460	士兰微	50,200	2,743,932.00	0.01
185	002534	西子洁能	147,400	2,734,270.00	0.01
186	601339	百隆东方	400,100	2,708,677.00	0.01
187	002415	海康威视	79,200	2,708,640.00	0.01
188	300487	蓝晓科技	45,600	2,683,560.00	0.01
189	002938	鹏鼎控股	25,400	2,676,652.00	0.01
190	300277	汽轮科技	175,200	2,635,008.00	0.01
191	300383	光环新网	206,400	2,567,616.00	0.01
192	601985	中国核电	280,300	2,531,109.00	0.01
193	002379	宏桥控股	168,800	2,493,176.00	0.01
194	688516	奥特维	42,559	2,442,461.01	0.01
195	002436	兴森科技	47,400	2,415,030.00	0.01
196	002455	百川股份	326,000	2,347,200.00	0.01
197	302132	中航成飞	40,000	2,332,800.00	0.01

198	002345	潮宏基	243,900	2,236,563.00	0.01
199	000534	万泽股份	81,200	2,221,632.00	0.01
200	002402	和而泰	85,800	2,216,214.00	0.01
201	002969	嘉美包装	156,400	2,202,112.00	0.01
202	002506	协鑫集成	686,700	2,183,706.00	0.01
203	300832	新产业	51,500	2,163,000.00	0.01
204	688173	希荻微	112,538	2,153,977.32	0.01
205	002493	荣盛石化	199,500	2,144,625.00	0.01
206	001965	招商公路	233,400	2,137,944.00	0.01
207	601127	赛力斯	34,600	2,119,250.00	0.01
208	688536	思瑞浦	5,775	2,102,619.75	0.01
209	601567	三星电气	140,500	2,099,070.00	0.01
210	601988	中国银行	363,900	2,081,508.00	0.01
211	300627	华测导航	72,747	2,066,014.80	0.01
212	301371	敷尔佳	77,960	2,026,960.00	0.01
213	300003	乐普医疗	170,600	2,021,610.00	0.01
214	301550	斯菱智驱	21,500	1,965,745.00	0.01
215	603063	禾望电气	37,100	1,962,219.00	0.01
216	000975	山金国际	115,400	1,961,800.00	0.01
217	600566	济川药业	86,400	1,917,216.00	0.01
218	300999	金龙鱼	81,000	1,884,060.00	0.01
219	600988	赤峰黄金	71,000	1,868,720.00	0.01
220	000592	平潭发展	274,800	1,838,412.00	0.01
221	002080	中材科技	19,494	1,754,460.00	0.01
222	002342	巨力索具	166,400	1,748,864.00	0.01
223	000060	中金岭南	228,900	1,732,773.00	0.01
224	300253	卫宁健康	254,300	1,711,439.00	0.01
225	300139	晓程科技	46,300	1,692,265.00	0.01
226	601872	招商轮船	95,900	1,684,963.00	0.01
227	300623	捷捷微电	37,400	1,682,626.00	0.01
228	300979	华利集团	53,500	1,591,625.00	0.01
229	300990	同飞股份	14,400	1,513,008.00	0.01
230	300129	泰胜风能	172,600	1,475,730.00	0.01
231	600299	安迪苏	187,900	1,475,015.00	0.01
232	688776	国光电气	24,037	1,474,429.58	0.01
233	300765	石药创新	53,066	1,444,987.18	0.01
234	688209	英集芯	49,143	1,429,078.44	0.01
235	603156	养元饮品	28,800	1,413,216.00	0.01
236	605599	菜百股份	99,300	1,360,410.00	0.00
237	300144	宋城演艺	230,900	1,341,529.00	0.00
238	688068	热景生物	15,250	1,320,650.00	0.00

239	601869	长飞光纤	2,400	1,310,160.00	0.00
240	300492	华图山鼎	37,200	1,277,820.00	0.00
241	002865	钧达股份	20,900	1,247,312.00	0.00
242	688653	康希通信	68,222	1,185,698.36	0.00
243	002532	天山铝业	110,100	1,181,373.00	0.00
244	300718	长盛轴承	19,300	1,176,721.00	0.00
245	000338	潍柴动力	41,800	1,139,050.00	0.00
246	600418	江淮汽车	43,400	1,121,022.00	0.00
247	603619	中曼石油	59,100	1,105,761.00	0.00
248	300342	天银机电	23,500	1,104,500.00	0.00
249	002163	海南发展	122,000	1,017,480.00	0.00
250	002595	豪迈科技	21,400	997,240.00	0.00
251	600707	彩虹股份	59,000	996,510.00	0.00
252	000807	云铝股份	41,500	918,810.00	0.00
253	605117	德业股份	8,400	891,912.00	0.00
254	688052	纳芯微	3,075	886,553.25	0.00
255	600331	宏达股份	79,000	868,210.00	0.00
256	002079	苏州固锝	56,500	849,195.00	0.00
257	000733	振华科技	14,900	843,936.00	0.00
258	300111	向日葵	290,500	836,640.00	0.00
259	002792	通宇通讯	23,500	835,895.00	0.00
260	000533	顺钠股份	87,200	829,272.00	0.00
261	601106	中国一重	247,700	817,410.00	0.00
262	300951	博硕科技	15,500	782,750.00	0.00
263	600750	华润江中	34,900	770,243.00	0.00
264	600391	航发科技	22,400	749,280.00	0.00
265	688326	经纬恒润	10,459	741,333.92	0.00
266	000933	神火股份	34,800	737,760.00	0.00
267	002155	湖南黄金	30,700	732,809.00	0.00
268	301301	川宁生物	92,100	731,274.00	0.00
269	300888	稳健医疗	25,800	722,142.00	0.00
270	688629	华丰科技	3,831	718,350.81	0.00
271	600113	浙江东日	20,900	693,462.00	0.00
272	002156	通富微电	8,600	652,482.00	0.00
273	601995	中金公司	17,900	647,085.00	0.00
274	000429	粤高速A	46,916	640,403.40	0.00
275	002837	英维克	7,900	628,524.00	0.00
276	300663	科蓝软件	94,100	626,706.00	0.00
277	301061	匠心家居	17,630	618,284.10	0.00
278	603122	合富中国	56,000	613,760.00	0.00
279	600118	中国卫星	7,400	607,170.00	0.00

280	002913	奥士康	9,400	601,036.00	0.00
281	300909	汇创达	9,900	576,378.00	0.00
282	002602	世纪华通	40,500	571,050.00	0.00
283	001337	四川黄金	15,400	564,564.00	0.00
284	002955	鸿合科技	15,700	561,275.00	0.00
285	300681	英搏尔	19,600	560,952.00	0.00
286	688262	国芯科技	12,938	559,309.74	0.00
287	002654	万润科技	24,900	554,274.00	0.00
288	301117	ST 佳缘	23,380	545,923.00	0.00
289	301498	乖宝宠物	13,400	543,906.00	0.00
290	300602	飞荣达	10,500	537,600.00	0.00
291	000039	中集集团	64,700	524,717.00	0.00
292	001287	中电港	16,800	523,320.00	0.00
293	002544	普天科技	28,700	522,914.00	0.00
294	688109	品茗科技	6,480	490,536.00	0.00
295	300689	澄天伟业	6,900	484,242.00	0.00
296	603920	世运电路	9,800	470,792.00	0.00
297	002643	万润股份	21,900	458,805.00	0.00
298	002916	深南电路	1,000	457,900.00	0.00
299	300740	水羊股份	23,800	438,158.00	0.00
300	300590	移为通信	30,400	436,240.00	0.00
301	002222	福晶科技	4,700	433,716.00	0.00
302	002487	大金重工	7,400	428,978.00	0.00
303	688531	日联科技	2,404	427,527.36	0.00
304	600809	山西汾酒	3,800	415,606.00	0.00
305	300991	创益通	11,700	411,957.00	0.00
306	601009	南京银行	41,400	409,446.00	0.00
307	300613	富瀚微	5,100	408,408.00	0.00
308	688301	奕瑞科技	3,286	407,464.00	0.00
309	002240	盛新锂能	8,900	398,987.00	0.00
310	600989	宝丰能源	19,200	390,336.00	0.00
311	688717	艾罗能源	4,630	382,299.10	0.00
312	688025	杰普特	807	379,290.00	0.00
313	301280	珠城科技	7,500	379,275.00	0.00
314	301251	威尔高	7,000	372,960.00	0.00
315	688779	五矿新能	45,824	371,632.64	0.00
316	300461	田中精机	10,000	370,400.00	0.00
317	601778	晶科科技	86,100	370,230.00	0.00
318	300986	志特新材	20,600	353,290.00	0.00
319	688311	盟升电子	12,911	338,139.09	0.00
320	301096	百诚医药	5,600	320,264.00	0.00

321	688110	东芯股份	1,554	316,549.80	0.00
322	301328	维峰电子	4,400	313,280.00	0.00
323	600550	保变电气	26,600	312,018.00	0.00
324	301093	华兰股份	2,300	311,949.00	0.00
325	300870	欧陆通	900	311,121.00	0.00
326	002709	天赐材料	6,000	308,580.00	0.00
327	300545	联得装备	6,500	300,300.00	0.00
328	605299	舒华体育	22,000	293,700.00	0.00
329	600489	中金黄金	16,100	290,605.00	0.00
330	600563	法拉电子	1,500	286,200.00	0.00
331	688277	天智航	16,670	285,057.00	0.00
332	300596	利安隆	5,400	283,392.00	0.00
333	300219	鸿利智汇	27,100	282,653.00	0.00
334	603267	鸿远电子	3,600	278,928.00	0.00
335	605289	罗曼股份	1,900	275,500.00	0.00
336	600237	铜峰电子	19,700	274,815.00	0.00
337	002639	雪人集团	19,700	274,027.00	0.00
338	002077	大港股份	14,100	271,989.00	0.00
339	002796	世嘉科技	6,600	269,148.00	0.00
340	600105	永鼎股份	3,900	263,172.00	0.00
341	301282	金禄电子	8,900	262,461.00	0.00
342	002463	沪电股份	1,700	259,760.00	0.00
343	688182	灿勤科技	6,006	258,678.42	0.00
344	688660	电气风电	29,956	258,220.72	0.00
345	000526	学大教育	10,100	256,338.00	0.00
346	002845	同兴达	15,300	250,920.00	0.00
347	000070	特发信息	12,000	250,080.00	0.00
348	300576	容大感光	4,800	245,856.00	0.00
349	600219	南山铝业	60,900	242,991.00	0.00
350	603799	华友钴业	5,000	241,300.00	0.00
351	300409	道氏技术	11,900	237,167.00	0.00
352	000878	云南铜业	14,700	233,436.00	0.00
353	688228	开普云	3,017	233,334.78	0.00
354	300551	古鳌科技	23,500	231,240.00	0.00
355	300427	红相股份	33,900	227,469.00	0.00
356	001208	华菱线缆	16,000	227,040.00	0.00
357	600773	西藏城投	16,600	213,642.00	0.00
358	002270	华明装备	11,100	209,235.00	0.00
359	603025	大豪科技	14,600	199,144.00	0.00
360	300776	帝尔激光	900	193,464.00	0.00
361	601061	中信金属	17,600	189,552.00	0.00

362	605111	新洁能	1,900	188,366.00	0.00
363	603737	三棵树	7,600	183,160.00	0.00
364	601699	潞安环能	12,400	177,072.00	0.00
365	002745	木林森	13,800	173,190.00	0.00
366	688689	银河微电	2,640	170,860.80	0.00
367	001359	平安电工	1,300	162,825.00	0.00
368	688593	新相微	3,983	155,018.36	0.00
369	300774	倍杰特	13,700	147,275.00	0.00
370	688061	灿瑞科技	2,778	137,983.26	0.00
371	603556	海兴电力	6,200	136,400.00	0.00
372	688758	赛分科技	6,184	136,109.84	0.00
373	300850	新强联	4,900	131,320.00	0.00
374	300940	南极光	8,600	129,688.00	0.00
375	002130	沃尔核材	6,800	128,928.00	0.00
376	300164	通源石油	15,900	127,200.00	0.00
377	688778	厦钨新能	2,320	126,208.00	0.00
378	300153	科泰电源	5,500	124,410.00	0.00
379	003035	南网能源	21,300	123,966.00	0.00
380	605056	咸亨国际	7,500	120,000.00	0.00
381	688378	奥来德	1,918	118,916.00	0.00
382	300049	福瑞医科	3,000	116,640.00	0.00
383	000727	冠捷科技	42,000	114,660.00	0.00
384	603686	福龙马	8,700	112,404.00	0.00
385	600985	淮北矿业	8,000	112,400.00	0.00
386	605258	协和电子	3,300	111,804.00	0.00
387	688475	萤石网络	4,048	110,712.80	0.00
388	300959	线上线下	700	103,467.00	0.00
389	003040	楚天龙	9,500	100,890.00	0.00
390	000333	美的集团	1,300	98,189.00	0.00
391	301636	泽润新能	2,300	96,853.00	0.00
392	301631	壹连科技	1,220	87,669.20	0.00
393	605196	华通线缆	3,300	86,130.00	0.00
394	688559	海目星	1,003	84,171.76	0.00
395	688486	龙迅股份	1,250	79,475.00	0.00
396	603162	海通发展	8,700	78,039.00	0.00
397	600641	先导基电	1,800	71,748.00	0.00
398	688261	东微半导	662	69,463.66	0.00
399	002851	麦格米特	400	66,872.00	0.00
400	301486	致尚科技	300	62,496.00	0.00
401	688196	卓越新能	1,361	48,859.90	0.00
402	600693	东百集团	3,900	30,576.00	0.00

403	600722	金牛化工	3,300	26,796.00	0.00
404	600903	贵州燃气	3,500	23,240.00	0.00
405	603779	威龙股份	2,800	21,028.00	0.00
406	600497	驰宏锌锗	1,400	16,954.00	0.00
407	300840	酷特智能	200	4,126.00	0.00
408	688050	爱博医疗	90	3,280.50	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	300750	宁德时代	431,630,219.54	3.72
2	300308	中际旭创	307,782,518.96	2.65
3	688981	中芯国际	289,353,533.45	2.49
4	688256	寒武纪	283,643,185.02	2.44
5	688008	澜起科技	261,337,631.83	2.25
6	688041	海光信息	222,119,325.04	1.91
7	688012	中微公司	222,042,508.78	1.91
8	300502	新易盛	212,026,758.70	1.83
9	688525	佰维存储	173,707,725.57	1.50
10	300274	阳光电源	161,125,934.30	1.39
11	688072	拓荆科技	159,606,632.45	1.37
12	688498	源杰科技	152,588,683.68	1.31
13	300059	东方财富	149,918,727.68	1.29
14	688521	芯原股份	148,981,409.09	1.28
15	300476	胜宏科技	127,133,336.23	1.10
16	300124	汇川技术	116,024,504.71	1.00
17	300408	三环集团	113,110,511.53	0.97
18	688347	华虹宏力	104,698,778.29	0.90
19	688120	华海清科	102,287,321.47	0.88
20	688777	中控技术	101,415,359.62	0.87

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	300750	宁德时代	296,668,562.00	2.56
2	688256	寒武纪	240,030,384.39	2.07
3	300308	中际旭创	226,444,820.32	1.95
4	688981	中芯国际	208,856,394.06	1.80

5	688008	澜起科技	201,932,457.82	1.74
6	688041	海光信息	180,374,868.86	1.55
7	300502	新易盛	158,870,528.64	1.37
8	688012	中微公司	141,363,455.44	1.22
9	300274	阳光电源	137,159,104.27	1.18
10	688521	芯原股份	125,287,484.97	1.08
11	688072	拓荆科技	117,823,209.15	1.01
12	300408	三环集团	111,671,368.98	0.96
13	300059	东方财富	106,352,897.24	0.92
14	688525	佰维存储	104,278,631.59	0.90
15	300476	胜宏科技	86,014,223.04	0.74
16	688777	中控技术	85,798,212.10	0.74
17	300604	长川科技	82,442,852.00	0.71
18	688271	联影医疗	80,946,813.21	0.70
19	688183	生益电子	79,106,412.22	0.68
20	300418	昆仑万维	77,540,821.00	0.67

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	17,692,564,283.14
卖出股票收入（成交）总额	15,904,982,806.81

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	865,522,311.08	3.13
2	央行票据	—	—
3	金融债券	17,192,573,446.01	62.23
	其中：政策性金融债	9,960,151,769.86	36.05
4	企业债券	1,742,115,901.09	6.31
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	2,897,976,887.06	10.49
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	22,698,188,545.24	82.16

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	18,000,000	1,814,819,178.08	6.57
2	250430	25 农发 30	17,500,000	1,783,346,369.86	6.46
3	250220	25 国开 20	14,700,000	1,502,661,386.30	5.44
4	260205	26 国开 05	14,000,000	1,425,976,328.77	5.16
5	250215	25 国开 15	13,500,000	1,337,158,356.16	4.84

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	2,393,478.90
2	应收清算款	258,982,140.67
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	142,648,522.04
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	404,024,141.61

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	89,501,348.86	0.32
2	118024	冠宇转债	88,822,077.33	0.32
3	113661	福22转债	88,447,483.86	0.32

4	127030	盛虹转债	88,117,949.72	0.32
5	118031	天 23 转债	87,848,024.48	0.32
6	113052	兴业转债	87,833,738.90	0.32
7	127110	广核转债	86,818,279.18	0.31
8	113056	重银转债	85,974,304.43	0.31
9	113042	上银转债	84,206,065.66	0.30
10	110099	福能转债	80,531,995.44	0.29
11	110087	天业转债	73,959,095.76	0.27
12	123107	温氏转债	71,912,426.57	0.26
13	113616	韦尔转债	67,181,434.89	0.24
14	113051	节能转债	65,747,477.82	0.24
15	113043	财通转债	65,649,646.58	0.24
16	113054	绿动转债	65,567,991.19	0.24
17	113062	常银转债	64,662,138.37	0.23
18	127067	恒逸转 2	62,975,057.52	0.23
19	113046	金田转债	51,188,294.03	0.19
20	110076	华海转债	50,763,511.63	0.18
21	128136	立讯转债	49,075,765.17	0.18
22	113652	伟 22 转债	48,450,501.49	0.18
23	118034	晶能转债	45,179,642.75	0.16
24	127045	牧原转债	43,548,552.43	0.16
25	110075	南航转债	42,786,058.39	0.15
26	128134	鸿路转债	41,144,172.89	0.15
27	113605	大参转债	39,910,272.51	0.14
28	113067	燃 23 转债	39,544,631.78	0.14
29	113659	莱克转债	38,997,768.64	0.14
30	127046	百润转债	34,469,153.03	0.12
31	127084	柳工转 2	34,011,326.70	0.12
32	113636	甬金转债	33,645,782.06	0.12
33	113053	隆 22 转债	33,599,062.67	0.12
34	127050	麒麟转债	33,025,529.32	0.12
35	113658	密卫转债	31,409,650.03	0.11

36	123104	卫宁转债	31,331,309.73	0.11
37	123165	回天转债	31,065,225.14	0.11
38	113655	欧 22 转债	31,011,813.27	0.11
39	113066	平煤转债	29,855,549.13	0.11
40	123114	三角转债	29,711,277.07	0.11
41	113048	晶科转债	29,457,896.89	0.11
42	123150	九强转债	29,034,392.43	0.11
43	127108	太能转债	28,917,884.15	0.10
44	110097	天润转债	28,212,431.79	0.10
45	118042	奥维转债	26,864,755.89	0.10
46	113688	国检转债	25,671,961.09	0.09
47	123215	铭利转债	24,477,820.33	0.09
48	113650	博 22 转债	24,195,388.50	0.09
49	123257	安克转债	23,494,220.89	0.09
50	123188	水羊转债	22,793,985.23	0.08
51	123119	康泰转 2	21,009,518.32	0.08
52	128142	新乳转债	20,789,224.55	0.08
53	113058	友发转债	20,738,432.41	0.08
54	123194	百洋转债	20,104,024.52	0.07
55	127031	洋丰转债	19,318,210.93	0.07
56	111017	蓝天转债	17,064,448.58	0.06
57	111002	特纸转债	16,500,456.02	0.06
58	123213	天源转债	16,078,102.82	0.06
59	113631	皖天转债	15,915,126.99	0.06
60	127099	盛航转债	15,257,383.50	0.06
61	127095	广泰转债	14,965,371.81	0.05
62	123076	强力转债	14,585,993.04	0.05
63	123091	长海转债	14,364,342.19	0.05
64	113627	太平转债	13,685,151.75	0.05
65	111004	明新转债	12,957,288.01	0.05
66	113625	江山转债	12,658,220.21	0.05
67	123113	仙乐转债	9,829,892.16	0.04

68	123117	健帆转债	9,663,191.56	0.03
69	127078	优彩转债	8,874,496.22	0.03
70	123192	科思转债	6,698,648.78	0.02
71	111020	合顺转债	5,890,148.03	0.02
72	123133	佩蒂转债	5,468,297.18	0.02
73	118044	赛特转债	5,240,780.60	0.02
74	110086	精工转债	5,028,996.53	0.02
75	113643	风语转债	4,718,412.94	0.02
76	123263	鼎捷转债	4,167,319.01	0.02
77	127064	杭氧转债	3,725,004.69	0.01
78	113699	金 25 转债	3,122,577.74	0.01
79	118035	国力转债	2,405,518.52	0.01
80	127089	晶澳转债	1,436,147.67	0.01
81	127049	希望转 2	651.57	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 (%)
富国兴利增强债券 A	5,987	836,272.81	4,942,234,881.03	98.71	64,530,425.68	1.29
富国兴利增强债券 E	16,679	557,135.38	9,205,657,964.44	99.07	86,802,963.67	0.93
合计	22,666	630,866.77	14,147,892,845.47	98.94	151,333,389.35	1.06

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	富国兴利增强债券 A	827,122.70	0.0165
	富国兴利增强债券 E	55,017.61	0.0006
	合计	882,140.31	0.0062

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	富国兴利增强债券 A	0
	富国兴利增强债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持 有本开放式基金	富国兴利增强债券 A	10~50
	富国兴利增强债券 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	10,002,250.23	0.07	10,002,250.23	0.07	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	10,002,250.23	0.07	10,002,250.23	0.07	3 年

注：截至 2020 年 9 月 20 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	富国兴利增强债券 A	富国兴利增强债券 E
基金合同生效日（2017 年 09 月 20 日）基金份额总额	99,995,250.23	—
本报告期期初基金份额总额	2,022,782,871.64	4,531,558,565.67
本报告期基金总申购份额	7,224,963,340.90	17,766,357,560.06
减：本报告期基金总赎回份额	4,240,980,905.83	13,005,455,197.62
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	5,006,765,306.71	9,292,460,928.11

§ 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、基金财产的诉讼。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

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：本报告期内托管人无重大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：本报告期内托管人相关从业人员无重大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 (%)	
长江证券	3	6,383,625,060.12	19.00	2,591,584.37	19.01	—
德邦证券	1	—	—	—	—	—
东方证券	2	3,131,041,001.90	9.32	1,271,032.51	9.32	—
东吴证券	1	—	—	—	—	—
国泰海通	2	3,249,703,362.62	9.67	1,319,093.02	9.67	—
华源证券	2	9,932,545,552.12	29.57	4,031,843.23	29.57	—
申万宏源	2	2,709,344,679.03	8.07	1,099,837.06	8.07	—
野村证券	2	—	—	—	—	—
浙商证券	2	8,185,027,497.31	24.37	3,322,776.10	24.37	—

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（018519、60243）。

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 (%)
长江证券	3,340,110,184.58	15.58	25,323,909,000.00	20.32	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	2,060,419,316.86	9.61	12,919,600,000.00	10.37	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—
国泰海通	3,148,329,986.84	14.68	6,163,800,000.00	4.95	—	—
华源证券	5,441,647,358.08	25.38	27,378,900,000.00	21.97	—	—
申万宏源	1,332,060,120.63	6.21	6,642,000,000.00	5.33	—	—
野村证券	—	—	—	—	—	—
浙商证券	6,121,986,439.19	28.55	46,197,400,000.00	37.07	—	—

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兴利增强债券型发起式证券投资基金的文件 2、富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金合同 3、富国兴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、富国兴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 。