

富国盛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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	12
4.1	基金管理人及基金经理情况	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6	半年度财务报告（未经审计）	17
6.1	资产负债表	17
6.2	利润表	18
6.3	净资产变动表	19
6.4	报表附注	20
§ 7	投资组合报告	44
7.1	期末基金资产组合情况	44

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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.....	69
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.....	69
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.....	69
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.....	69
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.12 本报告期投资基金情况	70
7.13 投资组合报告附注	70
§ 8 基金份额持有人信息	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
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.....	73
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	73
§ 9 开放式基金份额变动	75
§ 10 重大事件揭示	76
10.1 基金份额持有人大会决议	76
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.....	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
10.4 基金投资策略的改变	76
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	76
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	76
10.8 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.....	77
10.9 其他重大事件	78
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	79
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	79
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	79
§ 12 备查文件目录	80

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国盛利增强债券型发起式证券投资基金		
基金简称	富国盛利增强债券发起式		
基金主代码	020811		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2024 年 03 月 18 日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	9,390,486,140.36 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	富国盛利增强债券发起式 A	富国盛利增强债券发起式 C	富国盛利增强债券发起式 E
下属分级基金的交易代码	020811	020812	022357
报告期末下属分级基金的份额总额	3,889,113,650.62 份	1,535,390,765.18 份	3,965,981,724.56 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在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，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采取稳健灵活的投资策略，力求在有效控制风险的基础上，获得基金资产的稳定增值；同时根据对权益类市场的趋势研判适度参与股票资产投资，力求提高基金总体收益率。在资产配置方面，本基金采取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。在债券等固定收益类资产投资策略方面，本基金主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略。在股票投资方面，本基金将精选基本面良好、有长期投资价值的优质企业。在基金投资方面，本基金投资于全市场的股票型 ETF 及基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金。本基金的动态收益增强策略、存托凭证投资策略、国债期货投资策略、信用衍生品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×80%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×2%+中证全指指数收益率×18%
风险收益特征	本基金为债券型基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	任航

	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		陈戈	谷澍

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 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

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) 富国盛利增强债券发起式 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	37,264,476.89
本期利润	50,972,255.95
加权平均基金份额本期利润	0.0242
本期加权平均净值利润率	2.16%
本期基金份额净值增长率	3.29%
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	470,491,138.73
期末可供分配基金份额利润	0.1210
期末基金资产净值	4,403,867,740.03
期末基金份额净值	1.1324
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	13.24%

(2) 富国盛利增强债券发起式 C

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	6,623,845.01
本期利润	8,910,162.10
加权平均基金份额本期利润	0.0165
本期加权平均净值利润率	1.48%
本期基金份额净值增长率	3.15%
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	173,990,917.92
期末可供分配基金份额利润	0.1133
期末基金资产净值	1,725,498,395.06
期末基金份额净值	1.1238
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	12.38%

(3) 富国盛利增强债券发起式 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	43,621,333.56
本期利润	58,486,337.93
加权平均基金份额本期利润	0.0238
本期加权平均净值利润率	2.12%
本期基金份额净值增长率	3.29%
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	478,181,887.80
期末可供分配基金份额利润	0.1206
期末基金资产净值	4,489,055,632.64
期末基金份额净值	1.1319
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	11.59%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国盛利增强债券发起式 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	2.29%	0.26%	2.49%	0.27%	-0.20%	-0.01%
过去六个月	3.29%	0.24%	2.44%	0.26%	0.85%	-0.02%
过去一年	7.72%	0.20%	4.76%	0.22%	2.96%	-0.02%
自基金合同生效起至今	13.24%	0.19%	11.71%	0.25%	1.53%	-0.06%
(2) 富国盛利增强债券发起式 C						
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	2.20%	0.26%	2.49%	0.27%	-0.29%	-0.01%
过去六个月	3.15%	0.24%	2.44%	0.26%	0.71%	-0.02%

过去一年	7.32%	0.20%	4.76%	0.22%	2.56%	-0.02%
自基金合同生效起至今	12.38%	0.19%	11.71%	0.25%	0.67%	-0.06%

(3) 富国盛利增强债券发起式 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	2.28%	0.26%	2.49%	0.27%	-0.21%	-0.01%
过去六个月	3.29%	0.24%	2.44%	0.26%	0.85%	-0.02%
过去一年	7.71%	0.20%	4.76%	0.22%	2.95%	-0.02%
自基金分级生效日起至今	11.59%	0.18%	8.05%	0.23%	3.54%	-0.05%

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) 富国盛利增强债券发起式 A



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

(2) 富国盛利增强债券发起式 C



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

(3) 富国盛利增强债券发起式 E



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2024 年 10 月 18 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	2024-03-18	—	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盛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》、《富国盛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 72 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盛利增强债券发起式 A 为 1.1324 元，富国盛利增强债券发起式 C 为 1.1238 元，富国盛利增强债券发起式 E 为 1.1319 元；份额累计净值富国盛利增强债券发起式 A 为 1.1324 元，富国盛利增强债券发起式 C 为 1.1238 元，富国盛利增强债券发起式 E 为 1.1319 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国盛利增强债券发起式 A 为 3.29%，富国盛利增强债券发起式 C 为 3.15%，富国盛利增强债券发起式 E 为 3.29%；同期业绩比较基准收益率情况：富国盛利增强债券发起式 A 为 2.44%，富国盛利增强债券发起

式 C 为 2.44%，富国盛利增强债券发起式 E 为 2.44%。

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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关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的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、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：富国盛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	482,492,551.60	30,735,262.48
结算备付金	61,354,224.19	8,451,799.25
存出保证金	1,203,742.57	154,845.41
交易性金融资产	10,205,892,212.58	1,043,767,985.76
其中：股票投资	1,460,475,962.87	175,147,786.05
基金投资	—	—
债券投资	8,745,416,249.71	868,620,199.71
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	320,000,000.00	2,698,288.11
应收清算款	—	5,730,935.23
应收股利	—	—
应收申购款	98,867,652.85	39,695,411.41
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	11,169,810,383.79	1,131,234,527.65
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	—	28,184,082.82
应付清算款	427,321,069.40	34,304,705.30
应付赎回款	112,291,018.84	2,897,287.35
应付管理人报酬	3,437,290.92	322,467.44
应付托管费	859,322.71	80,616.84
应付销售服务费	446,132.34	43,547.59
应付投资顾问费	—	—
应交税费	165,858.47	12,458.21

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	6,867,923.38	709,014.88
负债合计	551,388,616.06	66,554,180.43
净资产：		
实收基金	9,390,486,140.36	972,095,471.28
未分配利润	1,227,935,627.37	92,584,875.94
净资产合计	10,618,421,767.73	1,064,680,347.22
负债和净资产总计	11,169,810,383.79	1,131,234,527.65

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1308 元，基金份额总额 9,390,486,140.36 份。其中：富国盛利增强债券发起式 A 份额净值 1.1324 元，份额总额 3,889,113,650.62 份；富国盛利增强债券发起式 C 份额净值 1.1238 元，份额总额 1,535,390,765.18 份；富国盛利增强债券发起式 E 份额净值 1.1319 元，份额总额 3,965,981,724.56 份。

6.2 利润表

会计主体：富国盛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	134,893,694.04	1,098,475.09
1. 利息收入	931,234.09	13,831.53
其中：存款利息收入	554,924.39	2,259.02
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	376,309.70	11,572.51
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	102,943,547.81	1,822,306.87
其中：股票投资收益	43,363,804.22	497,708.45
基金投资收益	—	—
债券投资收益	52,466,588.47	1,229,988.32
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	7,113,155.12	94,610.10
其他投资收益	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	30,859,100.52	-737,671.59
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	159,811.62	8.28

减：二、营业总支出	16,524,938.06	241,076.30
1. 管理人报酬	11,158,609.66	97,041.73
2. 托管费	2,789,652.38	24,260.45
3. 销售服务费	998,425.98	22,050.75
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	1,399,369.59	46,213.10
其中：卖出回购金融资产支出	1,399,369.59	46,213.10
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	55,644.28	354.50
8. 其他费用	123,236.17	51,155.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	118,368,755.98	857,398.79
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	118,368,755.98	857,398.79
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	118,368,755.98	857,398.79

6.3 净资产变动表

会计主体：富国盛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	972,095,471.28	92,584,875.94	1,064,680,347.22
二、本期期初净资产	972,095,471.28	92,584,875.94	1,064,680,347.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	8,418,390,669.08	1,135,350,751.43	9,553,741,420.51
（一）、综合收益总额	—	118,368,755.98	118,368,755.98
（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）	8,418,390,669.08	1,016,981,995.45	9,435,372,664.53
其中：1. 基金申购款	13,093,588,752.63	1,579,998,757.58	14,673,587,510.21
2. 基金赎回款	—	-563,016,762.13	—
	4,675,198,083.55		5,238,214,845.68
（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	9,390,486,140.36	1,227,935,627.37	10,618,421,767.73
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	80,117,445.02	2,223,065.37	82,340,510.39
二、本期期初净资产	80,117,445.02	2,223,065.37	82,340,510.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-37,859,241.66	-118,155.39	-37,977,397.05
（一）、综合收益总额	—	857,398.79	857,398.79
（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）	-37,859,241.66	-975,554.18	-38,834,795.84
其中：1. 基金申购款	16,167,148.76	696,616.06	16,863,764.82
2. 基金赎回款	-54,026,390.42	-1,672,170.24	-55,698,560.66
（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	42,258,203.36	2,104,909.98	44,363,113.34

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

富国盛利增强债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）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[2024] 215 号文《关于准予富国盛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自 2024 年 3 月 1 日至 2024 年 3 月 14 日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具德师报(验)字(24)第 00038 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2024 年 3 月 18 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。富国盛利增强债券发起式收到的净有效认购金额为人民币 2,615,340,376.61 元，其中归属于 A 类基金份额为人民币 1,508,035,293.17 元，归属于 C 类基金份额为人民币 1,107,305,083.44 元。经基金注册登记机构计算并确认的认购资金利息计人民币 1,199,595.27 元，其中归属于 A 类基金份额为 727,621.10 元，归属于 C 类基金份额为 471,974.17 元。合计为人民币 2,616,539,971.88 元，折算基金份额计 2,616,539,971.88 份。根据基金管理人于 2024 年 10 月 16 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国盛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 10 月 18 日起，本基金增加 E 类份额。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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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股票（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、政府支持债券、政府支持机构债券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、现金等货币市场工具、信用衍生品、国债期货、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（仅限于全市场的股票型 ETF 及基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金，不包括 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资公募基金的非基金中基金、货币市场基金、非本基金管理人管理的基金（全市场的股票型 ETF 除外））等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，本基金对股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产及可转换债券、分离交易可转债、可交换债券资产的合计投资比例不超过基金资产的 20%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；本基金持有其他基金，其市值不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的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。其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：

- 1、基金合同约定股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金；
- 2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票及存托凭证资产占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金。

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。

本基金业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率 $\times$ 80%+恒生指数收益率（使用估值 汇

率折算) × 2% + 中证全指指数收益率 × 18%。

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 第 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 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	482,492,551.60
等于：本金	482,461,804.47
加：应计利息	30,747.13
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	482,492,551.60

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		1,452,913,370.35	—	1,460,475,962.87	7,562,592.52
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	1,193,271,286.04	9,816,494.04	1,205,522,338.92	2,434,558.84
	银行间市场	7,443,129,513.13	74,367,510.79	7,539,893,910.79	22,396,886.87
	合计	8,636,400,799.17	84,184,004.83	8,745,416,249.71	24,831,445.71
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		10,089,314,169.52	84,184,004.83	10,205,892,212.58	32,394,038.23

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	320,000,000.00	—
银行间市场	—	—

合计	320,000,000.00	—
----	----------------	---

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	1,614.70
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	6,768,472.89
其中：交易所市场	6,704,110.39
银行间市场	64,362.50
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	37,835.79
合计	6,867,923.38

6.4.7.7 实收基金

富国盛利增强债券发起式 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	268,118,613.33	268,118,613.33
本期申购	4,552,122,441.64	4,552,122,441.64
本期赎回（以“-”号填列）	-931,127,404.35	-931,127,404.35
本期末	3,889,113,650.62	3,889,113,650.62

富国盛利增强债券发起式 C

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	112,635,790.84	112,635,790.84
本期申购	2,028,325,340.79	2,028,325,340.79
本期赎回（以“-”号填列）	-605,570,366.45	-605,570,366.45
本期末	1,535,390,765.18	1,535,390,765.18

富国盛利增强债券发起式 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	591,341,067.11	591,341,067.11
本期申购	6,513,140,970.20	6,513,140,970.20
本期赎回（以“-”号填列）	-3,138,500,312.75	-3,138,500,312.75
本期末	3,965,981,724.56	3,965,981,724.56

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

富国盛利增强债券发起式 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	25,815,971.43	4,569.06	25,820,540.49
本期期初	25,815,971.43	4,569.06	25,820,540.49
本期利润	37,264,476.89	13,707,779.06	50,972,255.95
本期基金份额交易产生的变动数	407,410,690.41	30,550,602.56	437,961,292.97
其中：基金申购款	515,538,252.50	37,772,729.81	553,310,982.31
基金赎回款	-108,127,562.09	-7,222,127.25	-115,349,689.34
本期已分配利润	—	—	—
本期末	470,491,138.73	44,262,950.68	514,754,089.41

富国盛利增强债券发起式 C

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	10,176,227.02	-90,602.68	10,085,624.34
本期期初	10,176,227.02	-90,602.68	10,085,624.34
本期利润	6,623,845.01	2,286,317.09	8,910,162.10
本期基金份额交易产生的变动数	157,190,845.89	13,920,997.55	171,111,843.44
其中：基金申购款	222,630,658.70	18,540,592.96	241,171,251.66
基金赎回款	-65,439,812.81	-4,619,595.41	-70,059,408.22
本期已分配利润	—	—	—
本期末	173,990,917.92	16,116,711.96	190,107,629.88

富国盛利增强债券发起式 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	56,708,053.98	-29,342.87	56,678,711.11
本期期初	56,708,053.98	-29,342.87	56,678,711.11
本期利润	43,621,333.56	14,865,004.37	58,486,337.93
本期基金份额交易产生的变动数	377,852,500.26	30,056,358.78	407,908,859.04
其中：基金申购款	734,864,010.99	50,652,512.62	785,516,523.61
基金赎回款	-357,011,510.73	-20,596,153.84	-377,607,664.57
本期已分配利润	—	—	—
本期末	478,181,887.80	44,892,020.28	523,073,908.08

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	310,096.17
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	55,063.45
其他	189,764.77
合计	554,924.39

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	11,349,674,660.43
减：卖出股票成本总额	11,289,393,654.66
减：交易费用	16,917,201.55
买卖股票差价收入	43,363,804.22

6.4.7.11 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 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	47,383,962.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,082,626.25
合计	52,466,588.47

6.4.7.12.2 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	3,940,989,092.27
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,913,632,199.98
减：应计利息总额	22,153,280.11

减：交易费用	120,985.93
买卖债券差价收入	5,082,626.25

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.16 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	7,113,155.12
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	7,113,155.12

6.4.7.17 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	30,859,100.52
股票投资	5,559,968.91
债券投资	25,299,131.61
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	30,859,100.52

6.4.7.18 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	145,988.63
基金转换费收入	13,822.99
合计	159,811.62

6.4.7.19 持有基金产生的费用

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 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	19,835.79
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	24,478.87
债券账户维护费	18,000.00
其他	921.51
合计	123,236.17

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	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	3,163,860,937.64	13.23	37,199,802.80	32.63

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	33,704,162.87	3.14	34,297,223.73	26.58

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	1,693,700,000.00	6.36	245,490,000.00	35.99

6.4.10.1.4 基金交易

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基金交易。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 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	1,284,246.17	13.23	1,210,761.16	18.06
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	15,099.61	32.63	13,077.51	51.51

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	11,158,609.66	97,041.73

其中：应支付销售机构的客户维护费	1,519,752.60	35,241.91
应支付基金管理人的净管理费	9,638,857.06	61,799.82

注：本基金对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日除基金管理人管理的基金外的基金资产净值的 0.40%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

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减去持有基金管理人管理基金的基金资产净值

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	2,789,652.38	24,260.45

注：本基金对基金财产中持有的本基金托管人自身托管的基金部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日除基金托管人托管的基金外的基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

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减去持有基金托管人托管基金的基金资产净值

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			
	富国盛利增强债券发起式 A	富国盛利增强债券发起式 C	富国盛利增强债券发起式 E	合计
富国基金管理有限公司	—	—	70,968.59	70,968.59
国泰海通证券股份有限公司	—	1,820.70	—	1,820.70

中国农业银行股份有限公司	—	144,230.88	—	144,230.88
合计	—	146,051.58	70,968.59	217,020.17

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			
	富国盛利增强债券发起式 A	富国盛利增强债券发起式 C	富国盛利增强债券发起式 E	合计
富国基金管理有限公司	—	6.36	1.73	8.09
国泰海通证券股份有限公司	—	44.25	—	44.25
海通证券股份有限公司	—	7.32	—	7.32
中国农业银行股份有限公司	—	13,749.10	—	13,749.10
合计	—	13,807.03	1.73	13,808.76

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日该类基金份额资产净值的 0.3% 年费率计提，E 类基金份额的销售服务费按前一日该类基金份额资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{该类基金份额销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

C 类、E 类基金份额的销售服务费自基金合同生效日次日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

率从事证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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）		
	富国盛利增强债券发起式 A	富国盛利增强债券发起式 C	富国盛利增强债券发起式 E	富国盛利增强债券发起式 A	富国盛利增强债券发起式 C	富国盛利增强债券发起式 E
报告期初持有的基金份额	10,001,350.14	—	985.90	10,001,350.14	—	985.90
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	—	—	—	—	—	—
报告期末持有的基金份额	10,001,350.14	—	985.90	10,001,350.14	—	985.90
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.26%	—	0.00%	45.57%	—	0.02%

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（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
中国农业银行股份有限公司	482,492,551.60	310,096.17	125,180.42	786.40

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。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未因交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生费用。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

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
113706	金帝转债	2026-06-15	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.01	1,090	109,000.00	109,007.64	—
118071	华峰转债	2026-06-23	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.07	—

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	5,227.00	3,257,132.36	4,348,864.00	—

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，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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	4,094,247,555.20	497,163,175.11
AAA 以下	8,856,883.94	8,681,521.73
未评级	612,661,305.70	123,410,236.01
合计	4,715,765,744.84	629,254,932.85

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	482,492,551.60	—	—	—	482,492,551.60
结算备付金	61,354,224.19	—	—	—	61,354,224.19
存出保证金	1,203,742.57	—	—	—	1,203,742.57
交易性金融资产	1,584,063,192.05	4,735,352,851.42	2,426,000,206.24	1,460,475,962.87	10,205,892,212.58
买入返售金融资产	320,000,000.00	—	—	—	320,000,000.00
应收申购款	—	—	—	98,867,652.85	98,867,652.85
资产总计	2,449,113,710.41	4,735,352,851.42	2,426,000,206.24	1,559,343,615.72	11,169,810,383.79
负债					
应付清算款	—	—	—	427,321,069.40	427,321,069.40
应付赎回款	—	—	—	112,291,018.84	112,291,018.84
应付管理人报酬	—	—	—	3,437,290.92	3,437,290.92
应付托管费	—	—	—	859,322.71	859,322.71
应付销售服务费	—	—	—	446,132.34	446,132.34
应交税费	—	—	—	165,858.47	165,858.47

其他负债	—	—	—	6,867,923.38	6,867,923.38
负债总计	—	—	—	551,388,616.06	551,388,616.06
利率敏感度缺口	2,449,113,710.41	4,735,352,851.42	2,426,000,206.24	1,007,954,999.66	10,618,421,767.73
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	30,735,262.48	—	—	—	30,735,262.48
结算备付金	8,451,799.25	—	—	—	8,451,799.25
存出保证金	154,845.41	—	—	—	154,845.41
交易性金融资产	189,859,271.53	660,324,686.42	18,436,241.76	175,147,786.05	1,043,767,985.76
买入返售金融资产	2,698,288.11	—	—	—	2,698,288.11
应收清算款	—	—	—	5,730,935.23	5,730,935.23
应收申购款	—	—	—	39,695,411.41	39,695,411.41
资产总计	231,899,466.78	660,324,686.42	18,436,241.76	220,574,132.69	1,131,234,527.65
负债					
卖出回购金融资产款	28,184,082.82	—	—	—	28,184,082.82
应付清算款	—	—	—	34,304,705.30	34,304,705.30
应付赎回款	—	—	—	2,897,287.35	2,897,287.35
应付管理人报酬	—	—	—	322,467.44	322,467.44
应付托管费	—	—	—	80,616.84	80,616.84
应付销售服务费	—	—	—	43,547.59	43,547.59
应交税费	—	—	—	12,458.21	12,458.21
其他负债	—	—	—	709,014.88	709,014.88
负债总计	28,184,082.82	—	—	38,370,097.61	66,554,180.43
利率敏感度缺口	203,715,383.96	660,324,686.42	18,436,241.76	182,204,035.08	1,064,680,347.22

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）

			日)
	1. 基准点利率增加 0.1%	-35,811,158.69	-1,970,534.82
	2. 基准点利率减少 0.1%	35,811,158.69	1,970,534.82

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

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

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	1,460,475,962.87	13.75	175,147,786.05	16.45
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	8,745,416,249.71	82.36	868,620,199.71	81.59
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	10,205,892,212.58	96.11	1,043,767,985.76	98.04

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，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026年06月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	95,293,978.91	6,919,742.82
	2. 业绩比较基准减少 1%	-95,293,978.91	-6,919,742.82

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，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

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	1,464,870,975.10	186,931,274.58

第二层次	8,741,021,237.48	856,836,711.18
第三层次	—	—
合计	10,205,892,212.58	1,043,767,985.76

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,460,475,962.87	13.08
	其中：股票	1,460,475,962.87	13.08
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	8,745,416,249.71	78.30
	其中：债券	8,745,416,249.71	78.30
	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	320,000,000.00	2.86
	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	543,846,775.79	4.87
8	其他各项资产	100,071,395.42	0.90
9	合计	11,169,810,383.79	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	2,176,892.00	0.02
B	采矿业	61,798,492.00	0.58
C	制造业	1,069,087,953.33	10.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,031,525.00	0.14
E	建筑业	16,754,362.00	0.16
F	批发和零售业	34,742,028.00	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	21,159,974.25	0.20
H	住宿和餐饮业	2,471,203.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	136,743,886.85	1.29
J	金融业	20,875,960.00	0.20
K	房地产业	17,072,972.00	0.16
L	租赁和商务服务业	17,006,195.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	21,831,563.64	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	13,092,919.80	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	5,736,313.00	0.05

Q	卫生和社会工作	604,394.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	4,289,329.00	0.04
S	综合	—	—
	合计	1,460,475,962.87	13.75

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	688525	佰维存储	35,344	17,485,737.12	0.16
2	688766	普冉股份	22,762	17,449,349.20	0.16
3	688498	源杰科技	8,591	16,202,626.00	0.15
4	301308	江波龙	20,900	14,709,420.00	0.14
5	001309	德明利	14,600	13,766,340.00	0.13
6	002709	天赐材料	264,400	13,598,092.00	0.13
7	002466	天齐锂业	220,900	13,545,588.00	0.13
8	300308	中际旭创	9,500	12,065,000.00	0.11
9	688536	思瑞浦	32,397	11,795,423.73	0.11
10	002653	海思科	166,300	11,032,342.00	0.10
11	688519	南亚新材	24,969	9,489,218.76	0.09
12	688002	睿创微纳	60,874	9,416,599.06	0.09
13	688390	固德威	78,257	8,491,667.07	0.08
14	688368	晶丰明源	39,103	8,466,581.56	0.08
15	002738	中矿资源	137,100	8,087,529.00	0.08
16	688428	诺诚健华	274,417	7,812,651.99	0.07
17	600363	联创光电	217,900	7,796,462.00	0.07
18	300661	圣邦股份	54,100	7,762,268.00	0.07
19	603538	美诺华	234,100	7,619,955.00	0.07
20	002384	东山精密	28,600	7,503,210.00	0.07
21	688045	必易微	92,194	7,447,431.32	0.07
22	600875	东方电气	253,800	7,301,826.00	0.07
23	603986	兆易创新	8,800	7,172,000.00	0.07
24	688409	富创精密	23,383	7,161,043.75	0.07
25	688472	阿特斯	660,296	7,144,402.72	0.07
26	688503	聚和材料	53,025	7,036,417.50	0.07
27	300953	震裕科技	51,880	6,936,356.00	0.07
28	688025	杰普特	14,758	6,936,260.00	0.07
29	000975	山金国际	405,400	6,891,800.00	0.06
30	300502	新易盛	11,320	6,871,240.00	0.06
31	002865	钧达股份	113,600	6,779,648.00	0.06
32	002414	高德红外	481,500	6,384,690.00	0.06
33	002716	湖南白银	788,900	6,382,201.00	0.06

34	300775	三角防务	284,700	6,274,788.00	0.06
35	688195	腾景科技	31,450	6,056,641.00	0.06
36	300017	网宿科技	465,400	6,054,854.00	0.06
37	600331	宏达股份	550,600	6,051,094.00	0.06
38	688337	普源精电	79,896	5,986,607.28	0.06
39	603799	华友钴业	122,100	5,892,546.00	0.06
40	002455	百川股份	816,400	5,878,080.00	0.06
41	300986	志特新材	342,600	5,875,590.00	0.06
42	300139	晓程科技	159,500	5,829,725.00	0.05
43	688111	金山办公	27,296	5,815,412.80	0.05
44	000592	平潭发展	858,900	5,746,041.00	0.05
45	600773	西藏城投	438,300	5,640,921.00	0.05
46	300681	英搏尔	196,800	5,632,416.00	0.05
47	300724	捷佳伟创	76,400	5,393,840.00	0.05
48	600988	赤峰黄金	201,300	5,298,216.00	0.05
49	300164	通源石油	661,400	5,291,200.00	0.05
50	600418	江淮汽车	203,800	5,264,154.00	0.05
51	000533	顺钠股份	552,400	5,253,324.00	0.05
52	603290	斯达半导	34,000	5,199,960.00	0.05
53	002916	深南电路	11,300	5,174,270.00	0.05
54	603127	昭衍新药	134,700	5,148,234.00	0.05
55	000603	盛达资源	221,900	5,125,890.00	0.05
56	688372	伟测科技	27,488	5,112,768.00	0.05
57	002379	宏桥控股	344,200	5,083,834.00	0.05
58	600885	宏发股份	147,400	5,083,826.00	0.05
59	300476	胜宏科技	14,596	5,056,492.28	0.05
60	002131	利欧股份	1,054,100	5,006,975.00	0.05
61	300277	汽轮科技	328,452	4,939,918.08	0.05
62	600489	中金黄金	273,300	4,933,065.00	0.05
63	688717	艾罗能源	59,549	4,916,960.93	0.05
64	001316	润贝航科	145,300	4,791,994.00	0.05
65	002049	紫光国微	53,200	4,721,500.00	0.04
66	001337	四川黄金	127,700	4,681,482.00	0.04
67	002342	巨力索具	445,400	4,681,154.00	0.04
68	000923	河钢资源	374,500	4,647,545.00	0.04
69	605289	罗曼股份	31,600	4,582,000.00	0.04
70	600601	方正科技	322,200	4,459,248.00	0.04
71	002506	协鑫集成	1,388,000	4,413,840.00	0.04
72	688072	拓荆科技	5,227	4,348,864.00	0.04
73	300620	光库科技	11,200	4,235,840.00	0.04
74	300740	水羊股份	224,800	4,138,568.00	0.04

75	688173	希荻微	214,724	4,109,817.36	0.04
76	688095	福昕软件	68,720	4,084,029.60	0.04
77	600547	山东黄金	176,300	4,070,767.00	0.04
78	600391	航发科技	121,100	4,050,795.00	0.04
79	688008	澜起科技	13,029	4,037,687.10	0.04
80	002497	雅化集团	198,200	4,037,334.00	0.04
81	002266	浙富控股	791,700	4,006,002.00	0.04
82	688311	盟升电子	150,969	3,953,878.11	0.04
83	002544	普天科技	216,300	3,940,986.00	0.04
84	300972	万辰集团	22,600	3,919,066.00	0.04
85	688256	寒武纪	2,439	3,891,546.45	0.04
86	301086	鸿富瀚	18,560	3,884,236.80	0.04
87	301316	慧博云通	97,770	3,850,182.60	0.04
88	002345	潮宏基	419,400	3,845,898.00	0.04
89	688279	峰昭科技	17,099	3,837,699.56	0.04
90	603259	药明康德	30,700	3,822,457.00	0.04
91	000733	振华科技	67,100	3,800,544.00	0.04
92	600570	恒生电子	177,900	3,769,701.00	0.04
93	301536	星宸科技	29,200	3,758,332.00	0.04
94	301607	富特科技	71,800	3,751,550.00	0.04
95	300475	香农芯创	12,400	3,720,000.00	0.04
96	600230	沧州大化	284,300	3,701,586.00	0.03
97	688052	纳芯微	12,819	3,695,845.89	0.03
98	603057	紫燕食品	164,800	3,675,040.00	0.03
99	300049	福瑞医科	93,900	3,650,832.00	0.03
100	688048	长光华芯	7,237	3,632,974.00	0.03
101	688378	奥来德	58,502	3,627,124.00	0.03
102	002810	山东赫达	145,000	3,581,500.00	0.03
103	688220	翱捷科技	28,426	3,533,920.32	0.03
104	002757	南兴股份	193,600	3,494,480.00	0.03
105	301392	汇成真空	12,100	3,492,544.00	0.03
106	001389	广合科技	14,700	3,487,575.00	0.03
107	300590	移为通信	242,300	3,477,005.00	0.03
108	688521	芯原股份	9,333	3,463,849.62	0.03
109	688301	奕瑞科技	27,853	3,453,772.00	0.03
110	688627	精智达	4,816	3,443,440.00	0.03
111	301117	ST 佳缘	146,940	3,431,049.00	0.03
112	002803	吉宏股份	132,300	3,418,632.00	0.03
113	688012	中微公司	7,239	3,391,471.50	0.03
114	601212	白银有色	667,000	3,388,360.00	0.03
115	300693	盛弘股份	69,500	3,388,125.00	0.03

116	300223	君正股份	13,500	3,360,150.00	0.03
117	000969	安泰科技	135,800	3,332,532.00	0.03
118	002222	福晶科技	35,500	3,275,940.00	0.03
119	002471	中超控股	542,500	3,271,275.00	0.03
120	605117	德业股份	30,780	3,268,220.40	0.03
121	600545	卓郎智能	405,500	3,264,275.00	0.03
122	688599	天合光能	229,977	3,247,275.24	0.03
123	300602	飞荣达	63,400	3,246,080.00	0.03
124	688262	国芯科技	75,058	3,244,757.34	0.03
125	688603	天承科技	15,533	3,230,087.35	0.03
126	000807	云铝股份	145,700	3,225,798.00	0.03
127	300903	科翔股份	31,800	3,221,658.00	0.03
128	300774	倍杰特	296,500	3,187,375.00	0.03
129	002077	大港股份	163,000	3,144,270.00	0.03
130	300984	金沃股份	58,300	3,132,459.00	0.03
131	300121	阳谷华泰	248,300	3,128,580.00	0.03
132	600590	泰豪科技	309,700	3,127,970.00	0.03
133	300551	古鳌科技	317,700	3,126,168.00	0.03
134	603933	睿能科技	138,200	3,116,410.00	0.03
135	002674	兴业科技	109,100	3,112,623.00	0.03
136	000534	万泽股份	113,400	3,102,624.00	0.03
137	002129	TCL 中环	257,300	3,092,746.00	0.03
138	603619	中曼石油	164,200	3,072,182.00	0.03
139	600176	中国巨石	41,900	3,053,672.00	0.03
140	002195	岩山科技	466,800	3,052,872.00	0.03
141	002112	三变科技	185,300	3,037,067.00	0.03
142	688099	晶晨股份	29,511	3,036,681.90	0.03
143	000426	兴业银锡	92,100	3,035,616.00	0.03
144	300619	金银河	97,500	3,033,225.00	0.03
145	300857	协创数据	8,900	3,025,110.00	0.03
146	688568	中科星图	72,508	3,006,906.76	0.03
147	300418	昆仑万维	74,300	2,998,748.00	0.03
148	300438	鹏辉能源	35,900	2,974,315.00	0.03
149	600989	宝丰能源	146,000	2,968,180.00	0.03
150	001339	智微智能	29,000	2,966,120.00	0.03
151	002922	伊戈尔	89,900	2,948,720.00	0.03
152	002969	嘉美包装	209,300	2,946,944.00	0.03
153	002947	恒铭达	38,700	2,943,135.00	0.03
154	600577	精达股份	300,700	2,940,846.00	0.03
155	300153	科泰电源	129,800	2,936,076.00	0.03
156	689009	九号公司	76,738	2,927,554.70	0.03

157	603601	再升科技	238,300	2,926,324.00	0.03
158	688518	联赢激光	94,680	2,925,612.00	0.03
159	301510	固高科技	91,600	2,924,788.00	0.03
160	300129	泰胜风能	341,500	2,919,825.00	0.03
161	688209	英集芯	100,351	2,918,207.08	0.03
162	603063	禾望电气	55,100	2,914,239.00	0.03
163	002780	三夫户外	238,200	2,891,748.00	0.03
164	300672	国科微	9,800	2,891,000.00	0.03
165	688531	日联科技	16,226	2,885,631.84	0.03
166	300151	昌红科技	115,200	2,874,240.00	0.03
167	002163	海南发展	344,500	2,873,130.00	0.03
168	600999	招商证券	135,200	2,852,720.00	0.03
169	603686	福龙马	220,300	2,846,276.00	0.03
170	002468	申通快递	195,000	2,839,200.00	0.03
171	688266	泽璟制药	24,290	2,833,671.40	0.03
172	300490	华自科技	213,700	2,827,251.00	0.03
173	300789	唐源电气	158,300	2,812,991.00	0.03
174	688700	东威科技	31,388	2,806,087.20	0.03
175	002493	荣盛石化	259,700	2,791,775.00	0.03
176	603206	嘉环科技	174,900	2,786,157.00	0.03
177	300757	罗博特科	4,500	2,785,500.00	0.03
178	601678	滨化股份	422,600	2,784,934.00	0.03
179	300492	华图山鼎	80,900	2,778,915.00	0.03
180	603306	华懋科技	26,800	2,778,892.00	0.03
181	002429	兆驰股份	266,800	2,772,052.00	0.03
182	002565	顺灏股份	215,000	2,724,050.00	0.03
183	600299	安迪苏	346,700	2,721,595.00	0.03
184	002353	杰瑞股份	17,700	2,699,250.00	0.03
185	000906	浙商中拓	530,900	2,675,736.00	0.03
186	300424	航新科技	169,300	2,664,782.00	0.03
187	600325	华发股份	1,152,900	2,663,199.00	0.03
188	000792	盐湖股份	88,200	2,662,758.00	0.03
189	300416	苏试试验	129,700	2,643,286.00	0.02
190	688678	福立旺	109,158	2,638,348.86	0.02
191	300504	天邑股份	163,500	2,637,255.00	0.02
192	300432	富临精工	130,900	2,629,781.00	0.02
193	300945	曼卡龙	241,900	2,619,777.00	0.02
194	688059	华锐精密	13,094	2,615,002.74	0.02
195	300427	红相股份	389,200	2,611,532.00	0.02
196	300843	胜蓝股份	16,700	2,609,375.00	0.02
197	688155	先惠技术	32,174	2,602,554.86	0.02

198	002273	水晶光电	72,900	2,586,492.00	0.02
199	601778	晶科科技	601,500	2,586,450.00	0.02
200	002171	楚江新材	187,400	2,543,018.00	0.02
201	600821	金开新能	406,700	2,541,875.00	0.02
202	600233	圆通速递	161,300	2,540,475.00	0.02
203	002792	通宇通讯	71,400	2,539,698.00	0.02
204	301067	显盈科技	67,100	2,537,722.00	0.02
205	300803	指南针	27,500	2,520,925.00	0.02
206	300913	兆龙互连	52,500	2,515,275.00	0.02
207	600487	亨通光电	23,000	2,514,820.00	0.02
208	002179	中航光电	54,300	2,508,660.00	0.02
209	600183	生益科技	14,400	2,496,960.00	0.02
210	603390	通达电气	239,100	2,496,204.00	0.02
211	002838	道恩股份	80,800	2,474,096.00	0.02
212	688578	艾力斯	22,601	2,468,029.20	0.02
213	300183	东软载波	236,100	2,467,245.00	0.02
214	300063	天龙集团	282,800	2,454,704.00	0.02
215	300102	乾照光电	94,100	2,450,364.00	0.02
216	688331	荣昌生物	18,697	2,435,471.22	0.02
217	301280	珠城科技	48,000	2,427,360.00	0.02
218	300677	英科医疗	61,700	2,416,789.00	0.02
219	600754	锦江酒店	131,700	2,369,283.00	0.02
220	600026	中远海能	131,500	2,359,110.00	0.02
221	601869	长飞光纤	4,300	2,347,370.00	0.02
222	605060	联德股份	41,300	2,343,362.00	0.02
223	002768	国恩股份	44,844	2,334,578.64	0.02
224	300634	彩讯股份	118,600	2,321,002.00	0.02
225	688235	百济神州	9,102	2,317,460.22	0.02
226	605208	永茂泰	143,200	2,284,040.00	0.02
227	601995	中金公司	63,000	2,277,450.00	0.02
228	001965	招商公路	248,100	2,272,596.00	0.02
229	301326	捷邦科技	16,300	2,271,731.00	0.02
230	002886	沃特股份	80,100	2,250,009.00	0.02
231	001301	尚太科技	23,900	2,234,889.00	0.02
232	603826	坤彩科技	87,300	2,231,388.00	0.02
233	000776	广发证券	94,500	2,211,300.00	0.02
234	002402	和而泰	85,500	2,208,465.00	0.02
235	002284	亚太股份	232,500	2,206,425.00	0.02
236	002487	大金重工	38,000	2,202,860.00	0.02
237	002517	恺英网络	135,400	2,200,250.00	0.02
238	601127	赛力斯	35,800	2,192,750.00	0.02

239	688556	高测股份	164,117	2,179,473.76	0.02
240	002602	世纪华通	154,500	2,178,450.00	0.02
241	002460	赣锋锂业	33,300	2,177,820.00	0.02
242	600499	科达制造	157,800	2,177,640.00	0.02
243	002989	中天精装	63,920	2,173,280.00	0.02
244	601567	三星电气	145,300	2,170,782.00	0.02
245	601360	三六零	249,100	2,164,679.00	0.02
246	300750	宁德时代	5,500	2,161,555.00	0.02
247	002946	新乳业	152,800	2,151,424.00	0.02
248	603162	海通发展	239,625	2,149,436.25	0.02
249	002240	盛新锂能	47,800	2,142,874.00	0.02
250	000719	中原传媒	187,400	2,141,982.00	0.02
251	301371	敷尔佳	82,244	2,138,344.00	0.02
252	300921	南凌科技	105,120	2,134,987.20	0.02
253	601512	中新集团	272,600	2,126,280.00	0.02
254	600663	陆家嘴	338,500	2,125,780.00	0.02
255	603345	安井食品	26,500	2,125,035.00	0.02
256	002558	巨人网络	77,000	2,122,120.00	0.02
257	601231	环旭电子	65,400	2,118,960.00	0.02
258	601899	紫金矿业	84,200	2,116,788.00	0.02
259	601083	锦江航运	212,100	2,108,274.00	0.02
260	600502	安徽建工	483,300	2,102,355.00	0.02
261	300033	同花顺	8,700	2,096,700.00	0.02
262	000933	神火股份	98,700	2,092,440.00	0.02
263	605599	菜百股份	152,300	2,086,510.00	0.02
264	300926	博俊科技	117,400	2,083,850.00	0.02
265	002519	银河电子	354,800	2,075,580.00	0.02
266	600064	南京高科	291,000	2,074,830.00	0.02
267	301358	湖南裕能	27,300	2,071,251.00	0.02
268	000429	粤高速 A	151,600	2,069,340.00	0.02
269	000415	渤海租赁	507,800	2,066,746.00	0.02
270	601117	中国化学	280,900	2,064,615.00	0.02
271	601339	百隆东方	304,800	2,063,496.00	0.02
272	002532	天山铝业	190,700	2,046,211.00	0.02
273	001266	宏英智能	41,500	2,037,650.00	0.02
274	601872	招商轮船	115,300	2,025,821.00	0.02
275	688127	蓝特光学	20,523	2,003,044.80	0.02
276	300219	鸿利智汇	190,100	1,982,743.00	0.02
277	688196	卓越新能	55,196	1,981,536.40	0.02
278	000526	学大教育	77,900	1,977,102.00	0.02
279	001208	华菱线缆	137,800	1,955,382.00	0.02

280	603615	茶花股份	120,500	1,946,075.00	0.02
281	300213	佳讯飞鸿	317,900	1,926,474.00	0.02
282	002463	沪电股份	12,600	1,925,280.00	0.02
283	300112	万讯自控	310,100	1,919,519.00	0.02
284	002943	宇晶股份	43,383	1,918,830.09	0.02
285	002080	中材科技	21,100	1,899,000.00	0.02
286	600741	华域汽车	121,500	1,885,680.00	0.02
287	688516	奥特维	32,489	1,864,543.71	0.02
288	002079	苏州固锔	122,800	1,845,684.00	0.02
289	301093	华兰股份	13,600	1,844,568.00	0.02
290	601118	海南橡胶	371,600	1,828,272.00	0.02
291	002104	恒宝股份	176,700	1,821,777.00	0.02
292	601058	赛轮轮胎	156,700	1,806,751.00	0.02
293	002368	太极股份	128,600	1,799,114.00	0.02
294	688223	晶科能源	376,205	1,786,973.75	0.02
295	688097	博众精工	28,217	1,779,081.85	0.02
296	300662	科锐国际	104,600	1,776,108.00	0.02
297	603122	合富中国	161,600	1,771,136.00	0.02
298	002643	万润股份	84,400	1,768,180.00	0.02
299	300257	开山股份	61,600	1,766,688.00	0.02
300	002293	罗莱生活	176,590	1,746,475.10	0.02
301	301136	招标股份	158,200	1,737,036.00	0.02
302	688258	卓易信息	14,578	1,728,076.12	0.02
303	605299	舒华体育	129,200	1,724,820.00	0.02
304	002039	黔源电力	91,500	1,722,030.00	0.02
305	002154	报喜鸟	483,000	1,719,480.00	0.02
306	688226	威腾电气	39,886	1,708,317.38	0.02
307	603889	新澳股份	333,890	1,706,177.90	0.02
308	001914	招商积余	208,900	1,704,624.00	0.02
309	002155	湖南黄金	71,300	1,701,931.00	0.02
310	688388	嘉元科技	38,440	1,691,360.00	0.02
311	000990	诚志股份	206,600	1,689,988.00	0.02
312	600809	山西汾酒	15,300	1,673,361.00	0.02
313	603256	宏和科技	6,300	1,671,579.00	0.02
314	688349	三一重能	109,757	1,666,111.26	0.02
315	300870	欧陆通	4,800	1,659,312.00	0.02
316	603214	爱婴室	136,500	1,653,015.00	0.02
317	688595	芯海科技	37,632	1,650,539.52	0.02
318	300696	爱乐达	62,700	1,632,081.00	0.02
319	603283	赛腾股份	20,064	1,624,782.72	0.02
320	603806	福斯特	96,000	1,611,840.00	0.02

321	301529	福赛科技	16,600	1,599,576.00	0.02
322	688277	天智航	93,377	1,596,746.70	0.02
323	301061	匠心家居	45,514	1,596,175.98	0.02
324	002371	北方华创	1,800	1,592,208.00	0.01
325	600113	浙江东日	47,900	1,589,322.00	0.01
326	688326	经纬恒润	22,389	1,586,932.32	0.01
327	002498	汉缆股份	232,100	1,582,922.00	0.01
328	002043	兔宝宝	142,600	1,580,008.00	0.01
329	601233	桐昆股份	72,700	1,573,955.00	0.01
330	600460	士兰微	28,500	1,557,810.00	0.01
331	300850	新强联	58,100	1,557,080.00	0.01
332	600722	金牛化工	189,000	1,534,680.00	0.01
333	300890	翔丰华	46,100	1,529,137.00	0.01
334	600655	豫园股份	371,800	1,528,098.00	0.01
335	601238	广汽集团	300,700	1,527,556.00	0.01
336	000338	潍柴动力	56,000	1,526,000.00	0.01
337	002840	华统股份	208,700	1,521,423.00	0.01
338	000151	中成股份	141,700	1,516,190.00	0.01
339	601600	中国铝业	183,900	1,511,658.00	0.01
340	688308	欧科亿	8,283	1,505,932.23	0.01
341	603125	常青科技	45,590	1,492,616.60	0.01
342	603006	联明股份	104,600	1,490,550.00	0.01
343	688480	赛恩斯	16,920	1,482,022.80	0.01
344	600566	济川药业	65,600	1,455,664.00	0.01
345	601009	南京银行	144,400	1,428,116.00	0.01
346	600919	江苏银行	131,900	1,421,882.00	0.01
347	605196	华通线缆	54,400	1,419,840.00	0.01
348	002841	视源股份	41,100	1,419,183.00	0.01
349	002812	恩捷股份	21,100	1,411,801.00	0.01
350	002436	兴森科技	27,700	1,411,315.00	0.01
351	300613	富瀚微	17,600	1,409,408.00	0.01
352	002851	麦格米特	8,400	1,404,312.00	0.01
353	300055	万邦达	218,200	1,403,026.00	0.01
354	688063	派能科技	26,332	1,402,705.64	0.01
355	300991	创益通	39,700	1,397,837.00	0.01
356	688418	震有科技	29,059	1,397,156.72	0.01
357	600808	马钢股份	558,200	1,395,500.00	0.01
358	688253	英诺特	23,085	1,391,563.80	0.01
359	301338	凯格精机	8,540	1,391,080.60	0.01
360	601985	中国核电	153,500	1,386,105.00	0.01
361	002911	佛燃能源	145,100	1,376,999.00	0.01

362	000060	中金岭南	181,700	1,375,469.00	0.01
363	688068	热景生物	15,873	1,374,601.80	0.01
364	000333	美的集团	17,500	1,321,775.00	0.01
365	600801	华新建材	84,600	1,319,760.00	0.01
366	002034	旺能环境	87,100	1,319,565.00	0.01
367	002938	鹏鼎控股	12,500	1,317,250.00	0.01
368	601988	中国银行	230,200	1,316,744.00	0.01
369	300988	津荣天宇	83,840	1,310,419.20	0.01
370	300697	电工合金	85,800	1,299,870.00	0.01
371	600350	山东高速	116,200	1,293,306.00	0.01
372	300461	田中精机	34,500	1,277,880.00	0.01
373	601939	建设银行	132,500	1,275,975.00	0.01
374	002142	宁波银行	42,900	1,273,701.00	0.01
375	300785	值得买	34,400	1,261,448.00	0.01
376	300713	英可瑞	97,800	1,245,972.00	0.01
377	300409	道氏技术	62,200	1,239,646.00	0.01
378	603703	盛洋科技	111,500	1,237,650.00	0.01
379	603013	亚普股份	78,100	1,233,199.00	0.01
380	603600	永艺股份	138,750	1,230,712.50	0.01
381	300769	德方纳米	18,400	1,223,600.00	0.01
382	300777	中简科技	46,500	1,222,020.00	0.01
383	001330	博纳影业	216,500	1,216,730.00	0.01
384	002478	常宝股份	196,800	1,216,224.00	0.01
385	605189	富春染织	100,700	1,213,435.00	0.01
386	600550	保变电气	102,700	1,204,671.00	0.01
387	300037	新宙邦	12,600	1,169,910.00	0.01
388	003035	南网能源	201,000	1,169,820.00	0.01
389	300434	金石亚药	103,700	1,164,551.00	0.01
390	300450	先导智能	28,500	1,160,520.00	0.01
391	300458	全志科技	29,400	1,160,124.00	0.01
392	301329	信音电子	47,600	1,156,204.00	0.01
393	688660	电气风电	131,401	1,132,676.62	0.01
394	000301	东方盛虹	98,900	1,132,405.00	0.01
395	300541	先进数通	117,200	1,130,980.00	0.01
396	300963	中洲特材	84,000	1,128,120.00	0.01
397	300680	隆盛科技	49,400	1,122,368.00	0.01
398	002111	威海广泰	123,100	1,107,900.00	0.01
399	688191	智洋创新	31,002	1,106,771.40	0.01
400	688776	国光电气	17,878	1,096,636.52	0.01
401	600030	中信证券	38,100	1,094,613.00	0.01
402	300111	向日葵	379,800	1,093,824.00	0.01

403	002976	瑞玛精密	42,860	1,080,072.00	0.01
404	603699	纽威股份	21,400	1,076,420.00	0.01
405	002324	普利特	89,000	1,074,230.00	0.01
406	688653	康希通信	61,366	1,066,541.08	0.01
407	002534	西子洁能	57,200	1,061,060.00	0.01
408	603100	川仪股份	58,200	1,050,510.00	0.01
409	002218	拓日新能	271,400	1,042,176.00	0.01
410	603737	三棵树	43,200	1,041,120.00	0.01
411	300745	欣锐科技	24,600	1,038,612.00	0.01
412	300951	博硕科技	20,400	1,030,200.00	0.01
413	300909	汇创达	17,600	1,024,672.00	0.01
414	000404	长虹华意	130,200	1,023,372.00	0.01
415	688208	道通科技	40,302	1,015,207.38	0.01
416	603267	鸿远电子	13,100	1,014,988.00	0.01
417	002956	西麦食品	48,300	1,002,708.00	0.01
418	301193	家联科技	53,800	997,452.00	0.01
419	001203	大中矿业	33,100	991,345.00	0.01
420	688728	格科微	46,997	988,816.88	0.01
421	300342	天银机电	21,000	987,000.00	0.01
422	600903	贵州燃气	148,500	986,040.00	0.01
423	605098	行动教育	18,100	980,296.00	0.01
424	002927	泰永长征	49,800	968,610.00	0.01
425	605366	宏柏新材	74,300	968,129.00	0.01
426	301377	鼎泰高科	1,700	936,530.00	0.01
427	600738	丽尚国潮	259,800	935,280.00	0.01
428	002270	华明装备	49,300	929,305.00	0.01
429	002850	科达利	4,900	927,570.00	0.01
430	603150	万朗磁塑	13,100	927,480.00	0.01
431	300604	长川科技	2,700	921,834.00	0.01
432	301608	博实结	18,257	917,596.82	0.01
433	300684	中石科技	15,000	915,000.00	0.01
434	002913	奥士康	14,300	914,342.00	0.01
435	600346	恒力石化	51,500	912,065.00	0.01
436	688383	新益昌	4,835	909,173.40	0.01
437	301487	盟固利	47,300	905,795.00	0.01
438	603032	德新科技	33,000	887,700.00	0.01
439	002955	鸿合科技	24,700	883,025.00	0.01
440	603909	建发合诚	102,900	877,737.00	0.01
441	002752	昇兴股份	158,500	874,920.00	0.01
442	300127	银河磁体	30,900	863,655.00	0.01
443	600595	中孚实业	153,600	863,232.00	0.01

444	000962	东方钨业	9,500	860,700.00	0.01
445	603308	应流股份	14,200	857,680.00	0.01
446	002843	泰嘉股份	39,900	856,653.00	0.01
447	002568	百润股份	50,300	851,076.00	0.01
448	002281	光迅科技	3,300	847,902.00	0.01
449	603650	彤程新材	8,600	842,628.00	0.01
450	688023	安恒信息	22,934	842,136.48	0.01
451	688299	长阳科技	50,362	841,549.02	0.01
452	605499	东鹏饮料	6,800	839,324.00	0.01
453	600900	长江电力	31,500	833,805.00	0.01
454	002557	洽洽食品	46,300	831,548.00	0.01
455	600711	盛屯矿业	75,500	828,235.00	0.01
456	605111	新洁能	8,300	822,862.00	0.01
457	603016	新宏泰	24,300	820,368.00	0.01
458	003816	中国广核	209,800	820,318.00	0.01
459	601138	工业富联	11,300	815,295.00	0.01
460	002339	积成电子	116,814	809,521.02	0.01
461	601069	西部黄金	36,700	807,400.00	0.01
462	300715	凯伦股份	47,900	788,434.00	0.01
463	600893	航发动力	20,500	785,970.00	0.01
464	300596	利安隆	14,800	776,704.00	0.01
465	301328	维峰电子	10,900	776,080.00	0.01
466	600578	京能电力	120,100	774,645.00	0.01
467	603708	家家悦	90,000	772,200.00	0.01
468	688244	永信至诚	53,895	768,542.70	0.01
469	300286	安科瑞	31,800	767,970.00	0.01
470	301603	乔锋智能	5,300	762,140.00	0.01
471	603929	亚翔集成	2,800	761,656.00	0.01
472	688677	海泰新光	7,506	759,081.78	0.01
473	603993	洛阳钼业	42,900	752,895.00	0.01
474	688787	海天瑞声	5,599	752,785.55	0.01
475	301195	北路智控	27,500	745,250.00	0.01
476	002337	赛象科技	167,800	743,354.00	0.01
477	688180	君实生物	21,843	738,730.26	0.01
478	002796	世嘉科技	18,000	734,040.00	0.01
479	688543	国科军工	18,599	733,730.55	0.01
480	300576	容大感光	14,300	732,446.00	0.01
481	605358	立昂微	9,400	729,440.00	0.01
482	688580	伟思医疗	13,647	726,975.69	0.01
483	000059	华锦股份	193,300	724,875.00	0.01
484	002648	卫星化学	30,700	721,143.00	0.01

485	688200	华峰测控	1,337	702,058.70	0.01
486	600750	华润江中	31,800	701,826.00	0.01
487	301177	迪阿股份	25,400	700,278.00	0.01
488	688620	安凯微	42,791	693,214.20	0.01
489	688202	美迪西	8,559	690,796.89	0.01
490	603897	长城科技	21,000	681,660.00	0.01
491	688336	三生国健	12,680	673,308.00	0.01
492	603556	海兴电力	30,000	660,000.00	0.01
493	300663	科蓝软件	97,300	648,018.00	0.01
494	301191	菲菱科思	5,700	647,235.00	0.01
495	600330	天通股份	20,900	644,556.00	0.01
496	002151	北斗星通	20,200	641,350.00	0.01
497	688257	新锐股份	6,142	625,869.80	0.01
498	301169	零点有数	8,800	621,808.00	0.01
499	601139	深圳燃气	108,100	611,846.00	0.01
500	688018	乐鑫科技	4,766	609,666.72	0.01
501	300700	岱勒新材	28,500	606,480.00	0.01
502	300400	劲拓股份	16,100	606,165.00	0.01
503	300806	斯迪克	5,400	604,800.00	0.01
504	603085	天成自控	55,400	602,198.00	0.01
505	688778	厦钨新能	11,034	600,249.60	0.01
506	301282	金禄电子	20,200	595,698.00	0.01
507	603025	大豪科技	43,400	591,976.00	0.01
508	300244	迪安诊断	31,500	590,310.00	0.01
509	001287	中电港	18,800	585,620.00	0.01
510	603588	高能环境	30,200	579,840.00	0.01
511	002248	华东数控	63,700	573,300.00	0.01
512	688182	灿勤科技	13,302	572,917.14	0.01
513	600438	通威股份	47,300	572,803.00	0.01
514	002531	天顺风能	67,500	569,025.00	0.01
515	603198	迎驾贡酒	19,100	565,360.00	0.01
516	603083	剑桥科技	2,200	560,714.00	0.01
517	688559	海目星	6,618	555,382.56	0.01
518	603901	永创智能	50,900	553,283.00	0.01
519	002805	丰元股份	19,200	548,928.00	0.01
520	603409	汇通控股	29,871	548,132.85	0.01
521	002394	联发股份	61,400	547,688.00	0.01
522	301291	明阳电气	15,100	543,449.00	0.01
523	301631	壹连科技	7,500	538,950.00	0.01
524	600707	彩虹股份	31,800	537,102.00	0.01
525	002560	通达股份	72,100	536,424.00	0.01

526	301568	思泰克	4,800	535,680.00	0.01
527	600429	三元股份	131,700	532,068.00	0.01
528	301268	铭利达	38,000	531,240.00	0.01
529	603163	圣晖集成	3,600	527,400.00	0.00
530	002328	新朋股份	71,600	525,544.00	0.00
531	601838	成都银行	29,500	522,150.00	0.00
532	300454	深信服	5,400	519,480.00	0.00
533	001311	多利科技	31,770	512,450.10	0.00
534	688692	达梦数据	2,094	511,543.26	0.00
535	002606	大连电瓷	38,000	509,580.00	0.00
536	301526	国际复材	10,900	508,703.00	0.00
537	003025	思进智能	35,700	502,656.00	0.00
538	688046	药康生物	20,436	494,551.20	0.00
539	002637	赞宇科技	46,700	491,751.00	0.00
540	002912	中新赛克	26,600	490,504.00	0.00
541	688167	炬光科技	1,375	487,038.75	0.00
542	603095	越剑智能	33,900	485,448.00	0.00
543	605056	咸亨国际	29,800	476,800.00	0.00
544	301052	果麦文化	21,400	475,508.00	0.00
545	002299	圣农发展	31,300	474,508.00	0.00
546	002449	国星光电	61,100	473,525.00	0.00
547	300782	卓胜微	4,300	471,194.00	0.00
548	002361	神剑股份	31,200	469,560.00	0.00
549	300001	特锐德	12,400	469,092.00	0.00
550	688510	航亚科技	19,580	467,570.40	0.00
551	600985	淮北矿业	33,200	466,460.00	0.00
552	301226	祥明智能	14,000	464,660.00	0.00
553	000737	北方铜业	34,600	457,412.00	0.00
554	688112	鼎阳科技	6,221	456,994.66	0.00
555	600497	驰宏锌锗	37,100	449,281.00	0.00
556	002563	森马服饰	86,900	437,976.00	0.00
557	603568	伟明环保	28,400	436,792.00	0.00
558	300053	航宇微	26,400	434,280.00	0.00
559	301606	绿联科技	7,100	433,242.00	0.00
560	001221	悍高集团	10,700	430,354.00	0.00
561	002745	木林森	33,800	424,190.00	0.00
562	000596	古井贡酒	5,300	422,940.00	0.00
563	601699	潞安环能	29,600	422,688.00	0.00
564	002170	芭田股份	38,800	421,368.00	0.00
565	688515	裕太微	1,680	417,916.80	0.00
566	300922	天秦装备	27,500	416,625.00	0.00

567	301535	浙江华远	30,900	414,678.00	0.00
568	603893	瑞芯微	2,200	414,392.00	0.00
569	002135	东南网架	60,900	413,511.00	0.00
570	002511	中顺洁柔	62,000	412,300.00	0.00
571	002824	和胜股份	11,900	411,502.00	0.00
572	000762	西藏矿业	15,400	411,180.00	0.00
573	601882	海天精工	20,300	410,669.00	0.00
574	688228	开普云	5,275	407,968.50	0.00
575	301636	泽润新能	9,500	400,045.00	0.00
576	688073	毕得医药	7,407	398,644.74	0.00
577	300731	科创新源	6,820	398,015.20	0.00
578	002995	天地在线	22,400	396,032.00	0.00
579	300689	澄天伟业	5,600	393,008.00	0.00
580	300250	初灵信息	26,900	392,202.00	0.00
581	600714	金瑞矿业	19,100	392,123.00	0.00
582	688353	华盛锂电	3,180	369,102.60	0.00
583	000001	平安银行	36,500	366,825.00	0.00
584	301026	浩通科技	17,700	357,894.00	0.00
585	603383	顶点软件	13,300	353,248.00	0.00
586	300773	拉卡拉	22,800	348,840.00	0.00
587	002320	海峡股份	54,900	344,223.00	0.00
588	002277	友阿股份	58,200	342,798.00	0.00
589	603155	新亚强	11,900	340,102.00	0.00
590	600498	烽火通信	4,600	338,560.00	0.00
591	002202	金风科技	14,100	336,990.00	0.00
592	688222	成都先导	10,320	331,375.20	0.00
593	688697	纽威数控	24,241	329,435.19	0.00
594	688593	新相微	8,395	326,733.40	0.00
595	605166	聚合顺	34,000	326,060.00	0.00
596	002821	凯莱英	2,000	324,000.00	0.00
597	600887	伊利股份	13,500	323,460.00	0.00
598	688307	中润光学	3,992	319,160.40	0.00
599	002297	博云新材	11,000	318,890.00	0.00
600	600075	新疆天业	78,500	317,140.00	0.00
601	301272	英华特	9,600	316,224.00	0.00
602	600641	先导基电	7,900	314,894.00	0.00
603	603112	华翔股份	18,600	311,178.00	0.00
604	000892	欢瑞世纪	93,300	310,689.00	0.00
605	688107	安路科技	6,769	308,666.40	0.00
606	688153	唯捷创芯	9,537	306,328.44	0.00
607	301165	锐捷网络	3,800	305,710.00	0.00

608	603629	利通电子	1,700	303,977.00	0.00
609	603920	世运电路	6,300	302,652.00	0.00
610	300222	科大智能	21,800	301,930.00	0.00
611	002845	同兴达	18,400	301,760.00	0.00
612	300469	信息发展	5,700	299,877.00	0.00
613	601012	隆基绿能	22,800	299,136.00	0.00
614	300042	朗科科技	3,900	297,063.00	0.00
615	300570	太辰光	1,200	296,052.00	0.00
616	301219	腾远钴业	5,400	295,920.00	0.00
617	688197	首药控股	8,834	295,143.94	0.00
618	300916	朗特智能	12,600	294,462.00	0.00
619	300189	神农种业	68,000	293,760.00	0.00
620	301152	天力锂能	12,400	293,508.00	0.00
621	688686	奥普特	1,737	292,493.43	0.00
622	688779	五矿新能	35,476	287,710.36	0.00
623	688499	利元亨	5,468	287,343.40	0.00
624	301041	金百泽	8,500	286,875.00	0.00
625	603960	克来机电	16,400	285,524.00	0.00
626	688090	瑞松科技	2,667	283,902.15	0.00
627	001288	运机集团	11,900	283,101.00	0.00
628	300930	屹通新材	9,900	282,150.00	0.00
629	605588	冠石科技	4,200	282,114.00	0.00
630	601061	中信金属	26,100	281,097.00	0.00
631	688360	德马科技	15,678	280,636.20	0.00
632	600029	南方航空	53,400	276,612.00	0.00
633	300709	精研科技	4,900	275,625.00	0.00
634	301456	盘古智能	12,200	275,476.00	0.00
635	603228	景旺电子	3,800	275,158.00	0.00
636	603020	爱普股份	19,500	274,950.00	0.00
637	688109	品茗科技	3,623	274,261.10	0.00
638	002823	凯中精密	19,100	271,984.00	0.00
639	688793	倍轻松	16,814	270,873.54	0.00
640	300733	西菱动力	22,600	270,070.00	0.00
641	600962	国投中鲁	8,900	268,513.00	0.00
642	688529	豪森智能	16,970	266,938.10	0.00
643	002682	龙洲股份	62,100	263,304.00	0.00
644	688651	盛邦安全	8,167	263,140.74	0.00
645	000973	佛塑科技	18,300	262,605.00	0.00
646	002064	华峰化学	27,500	260,975.00	0.00
647	600693	东百集团	33,200	260,288.00	0.00
648	300124	汇川技术	3,900	258,687.00	0.00

649	300249	依米康	16,700	257,180.00	0.00
650	301302	华如科技	9,500	255,740.00	0.00
651	002985	北摩高科	9,200	254,840.00	0.00
652	002829	星网宇达	14,500	254,620.00	0.00
653	688176	亚虹医药	25,655	254,497.60	0.00
654	300548	长芯博创	900	250,200.00	0.00
655	603507	振江股份	7,600	249,964.00	0.00
656	600403	大有能源	47,200	249,688.00	0.00
657	603051	鹿山新材	12,940	249,483.20	0.00
658	688348	昱能科技	7,090	246,590.20	0.00
659	688577	浙海德曼	5,380	246,565.40	0.00
660	688148	芳源股份	28,548	244,941.84	0.00
661	688456	有研粉材	1,748	244,020.80	0.00
662	688141	杰华特	1,560	239,460.00	0.00
663	603948	建业股份	9,900	238,590.00	0.00
664	300863	卡倍亿	3,100	237,553.00	0.00
665	688648	中邮科技	6,487	237,099.85	0.00
666	002615	哈尔斯	34,300	236,670.00	0.00
667	600490	鹏欣资源	40,300	234,546.00	0.00
668	600755	厦门国贸	43,200	234,144.00	0.00
669	688275	万润新能	1,827	233,033.85	0.00
670	603416	信捷电气	4,400	232,628.00	0.00
671	603967	中创物流	22,300	230,805.00	0.00
672	002093	国脉科技	36,500	229,950.00	0.00
673	301517	陕西华达	4,600	228,298.00	0.00
674	600115	中国东航	59,200	225,552.00	0.00
675	300413	芒果超媒	14,900	217,987.00	0.00
676	688609	九联科技	19,788	217,865.88	0.00
677	300940	南极光	14,400	217,152.00	0.00
678	603070	万控智造	17,100	215,118.00	0.00
679	002130	沃尔核材	11,200	212,352.00	0.00
680	688690	纳微科技	4,792	211,327.20	0.00
681	600433	冠豪高新	65,700	210,897.00	0.00
682	601126	四方股份	3,300	208,560.00	0.00
683	300959	线上线下	1,400	206,934.00	0.00
684	603124	江南新材	1,100	205,678.00	0.00
685	301305	朗坤科技	7,200	205,344.00	0.00
686	603579	荣泰健康	12,100	205,337.00	0.00
687	688020	方邦股份	811	202,425.60	0.00
688	002348	高乐股份	19,000	200,260.00	0.00
689	002261	拓维信息	7,100	198,871.00	0.00

690	301285	鸿日达	1,800	198,594.00	0.00
691	688396	华润微	2,026	197,636.30	0.00
692	300867	圣元环保	10,900	197,508.00	0.00
693	601187	厦门银行	28,500	194,655.00	0.00
694	003001	中岩大地	14,700	190,365.00	0.00
695	300008	天海防务	31,100	188,466.00	0.00
696	301307	美利信	2,500	188,225.00	0.00
697	002081	金螳螂	42,900	185,757.00	0.00
698	000570	苏常柴A	39,772	185,735.24	0.00
699	601828	美凯龙	90,500	184,620.00	0.00
700	300283	温州宏丰	8,900	182,895.00	0.00
701	002110	三钢闽光	63,500	182,880.00	0.00
702	300786	国林科技	7,200	180,504.00	0.00
703	688261	东微半导	1,719	180,374.67	0.00
704	600746	江苏索普	33,600	175,728.00	0.00
705	301292	海科新源	2,200	175,406.00	0.00
706	600177	雅戈尔	22,900	172,437.00	0.00
707	001359	平安电工	1,360	170,340.00	0.00
708	300429	强力新材	9,600	170,112.00	0.00
709	688629	华丰科技	902	169,134.02	0.00
710	300791	仙乐健康	10,424	166,992.48	0.00
711	300444	双杰电气	13,600	166,056.00	0.00
712	301011	华立科技	11,600	164,024.00	0.00
713	605305	中际联合	3,900	163,488.00	0.00
714	600237	铜峰电子	11,700	163,215.00	0.00
715	002930	宏川智慧	17,600	161,920.00	0.00
716	601886	江河集团	20,100	161,403.00	0.00
717	688293	奥浦迈	3,869	161,298.61	0.00
718	688049	炬芯科技	3,339	156,632.49	0.00
719	688305	科德数控	2,349	153,319.23	0.00
720	000657	中钨高新	1,600	153,152.00	0.00
721	603026	石大胜华	1,700	151,929.00	0.00
722	603200	上海洗霸	3,500	151,760.00	0.00
723	300513	恒实科技	20,800	150,592.00	0.00
724	301196	唯科科技	1,200	150,504.00	0.00
725	300014	亿纬锂能	2,300	149,569.00	0.00
726	300919	中伟新材	3,400	148,750.00	0.00
727	601611	中国核建	13,300	148,295.00	0.00
728	603516	淳中科技	1,100	148,071.00	0.00
729	002271	东方雨虹	12,400	147,188.00	0.00
730	688116	天奈科技	3,786	144,625.20	0.00

731	601595	上海电影	8,700	144,420.00	0.00
732	002132	恒星科技	26,500	143,365.00	0.00
733	603779	威龙股份	19,000	142,690.00	0.00
734	300644	南京聚隆	6,100	142,618.00	0.00
735	301567	贝隆精密	4,100	141,901.00	0.00
736	002997	瑞鹄模具	5,100	140,556.00	0.00
737	301172	君逸数码	5,400	140,130.00	0.00
738	000922	佳电股份	10,000	139,600.00	0.00
739	688443	智翔金泰	5,957	138,500.25	0.00
740	300880	迦南智能	6,500	138,125.00	0.00
741	301252	同星科技	3,400	137,802.00	0.00
742	603270	金帝股份	4,100	137,391.00	0.00
743	003022	联泓新科	5,300	137,270.00	0.00
744	603355	莱克电气	5,200	137,176.00	0.00
745	300960	通业科技	8,800	136,840.00	0.00
746	300584	海辰药业	3,700	134,051.00	0.00
747	300581	晨曦航空	11,900	133,756.00	0.00
748	000039	中集集团	16,400	133,004.00	0.00
749	301261	恒工精密	1,700	132,770.00	0.00
750	605258	协和电子	3,900	132,132.00	0.00
751	603325	博隆技术	2,600	131,612.00	0.00
752	301391	卡莱特	2,300	131,330.00	0.00
753	002285	世联行	63,900	130,995.00	0.00
754	301201	诚达药业	3,600	130,896.00	0.00
755	002774	快意电梯	9,200	130,732.00	0.00
756	003040	楚天龙	12,300	130,626.00	0.00
757	600123	兰花科创	24,400	130,296.00	0.00
758	000878	云南铜业	8,200	130,216.00	0.00
759	000815	美利云	8,900	129,495.00	0.00
760	002968	新大正	15,300	129,438.00	0.00
761	600785	新华百货	13,000	127,400.00	0.00
762	603867	新化股份	3,800	127,262.00	0.00
763	300054	鼎龙股份	1,200	127,164.00	0.00
764	301012	扬电科技	5,400	126,846.00	0.00
765	300378	鼎捷数智	3,500	126,350.00	0.00
766	603610	麒盛科技	7,000	125,720.00	0.00
767	603808	歌力思	16,600	125,662.00	0.00
768	300842	帝科股份	1,400	124,838.00	0.00
769	002442	龙星科技	25,300	124,729.00	0.00
770	300440	运达科技	5,700	121,581.00	0.00
771	300928	华安鑫创	4,200	121,296.00	0.00

772	301360	荣旗科技	1,770	121,227.30	0.00
773	300154	瑞凌股份	16,100	121,072.00	0.00
774	600426	华鲁恒升	5,000	119,600.00	0.00
775	600530	ST 交昂	24,000	118,320.00	0.00
776	300933	中辰股份	19,300	117,344.00	0.00
777	300592	华凯易佰	6,600	116,820.00	0.00
778	000651	格力电器	3,000	112,500.00	0.00
779	300997	欢乐家	8,200	111,110.00	0.00
780	603626	科森科技	6,000	111,000.00	0.00
781	002300	太阳电缆	16,400	110,864.00	0.00
782	600501	航天晨光	7,000	110,110.00	0.00
783	600963	岳阳林纸	35,900	109,136.00	0.00
784	688122	西部超导	1,709	107,342.29	0.00
785	688089	ST 嘉必优	9,932	105,378.52	0.00
786	301246	宏源药业	3,900	104,910.00	0.00
787	300623	捷捷微电	2,300	103,477.00	0.00
788	301073	君亭酒店	5,600	101,920.00	0.00
789	300407	凯发电气	9,000	97,200.00	0.00
790	601777	千里科技	11,800	96,288.00	0.00
791	688433	华曙高科	1,105	94,588.00	0.00
792	002611	东方精工	5,300	93,598.00	0.00
793	300201	海伦哲	4,300	90,601.00	0.00
794	300801	泰和科技	2,800	90,440.00	0.00
795	002867	周大生	8,100	90,315.00	0.00
796	000419	通程控股	20,000	90,200.00	0.00
797	301299	卓创资讯	2,000	88,120.00	0.00
798	688484	南芯科技	1,499	84,678.51	0.00
799	300132	诺斯贝尔	14,600	82,928.00	0.00
800	603038	华立股份	5,300	82,680.00	0.00
801	002734	利民股份	4,800	82,416.00	0.00
802	002134	天津普林	2,600	79,092.00	0.00
803	688186	广大特材	5,213	78,976.95	0.00
804	300002	神州泰岳	10,000	78,100.00	0.00
805	002860	星帅尔	5,300	77,327.00	0.00
806	688070	纵横股份	2,055	76,713.15	0.00
807	002156	通富微电	1,000	75,870.00	0.00
808	688668	鼎通科技	200	74,660.00	0.00
809	301251	威尔高	1,400	74,592.00	0.00
810	605333	沪光股份	4,300	73,315.00	0.00
811	002935	天奥电子	3,300	72,402.00	0.00
812	002094	青岛金王	16,500	72,270.00	0.00

813	301200	大族数控	200	72,130.00	0.00
814	300943	春晖智控	1,600	71,920.00	0.00
815	300703	创源股份	5,600	71,512.00	0.00
816	300632	光莆股份	2,500	71,375.00	0.00
817	301662	宏工科技	700	70,924.00	0.00
818	301238	瑞泰新材	2,900	70,760.00	0.00
819	002278	神开股份	9,300	70,122.00	0.00
820	000766	通化金马	3,600	69,840.00	0.00
821	605068	明新旭腾	4,100	68,798.00	0.00
822	688313	仕佳光子	363	67,027.95	0.00
823	688680	海优新材	1,592	66,864.00	0.00
824	688615	合合信息	588	66,502.80	0.00
825	002545	东方铁塔	4,100	66,502.00	0.00
826	600515	海南机场	23,800	65,212.00	0.00
827	603980	吉华集团	9,700	64,408.00	0.00
828	001222	源飞宠物	4,500	59,760.00	0.00
829	300712	永福股份	2,700	57,807.00	0.00
830	603393	新天然气	2,700	57,807.00	0.00
831	603876	鼎胜新材	2,200	57,222.00	0.00
832	603861	白云电器	4,400	56,804.00	0.00
833	300025	华星创业	13,300	55,860.00	0.00
834	601700	风范股份	12,600	54,936.00	0.00
835	002982	湘佳股份	5,200	54,860.00	0.00
836	000042	中洲控股	6,900	52,785.00	0.00
837	002600	领益智造	3,000	52,020.00	0.00
838	605018	长华集团	3,200	47,712.00	0.00
839	301111	粤万年青	1,800	46,584.00	0.00
840	301210	金杨精密	1,500	45,000.00	0.00
841	301083	百胜智能	3,400	44,778.00	0.00
842	600510	黑牡丹	5,900	44,014.00	0.00
843	600189	泉阳泉	5,800	43,674.00	0.00
844	002666	德联集团	10,800	42,660.00	0.00
845	300985	致远新能	1,100	42,350.00	0.00
846	688435	英方软件	1,305	41,760.00	0.00
847	002771	真视通	3,400	41,752.00	0.00
848	300327	中颖电子	1,300	41,665.00	0.00
849	688199	久日新材	1,203	41,539.59	0.00
850	002732	燕塘乳业	3,300	40,920.00	0.00
851	603239	浙江仙通	2,500	37,025.00	0.00
852	300879	大叶股份	2,300	36,064.00	0.00
853	002882	金龙羽	1,900	35,891.00	0.00

854	688084	晶品特装	713	35,849.64	0.00
855	605286	同力天启	1,400	35,686.00	0.00
856	300682	朗新科技	3,600	35,640.00	0.00
857	603121	华培动力	3,000	35,250.00	0.00
858	002941	新疆交建	3,700	34,928.00	0.00
859	301312	智立方	300	34,803.00	0.00
860	002462	嘉事堂	3,100	33,263.00	0.00
861	600367	红星发展	500	31,465.00	0.00
862	603928	兴业股份	2,100	31,080.00	0.00
863	603990	麦迪科技	1,400	29,806.00	0.00
864	601918	新集能源	3,400	29,206.00	0.00
865	002398	垒知集团	7,600	28,500.00	0.00
866	300829	金丹科技	1,900	26,087.00	0.00
867	301021	英诺激光	200	24,380.00	0.00
868	002863	今飞凯达	5,700	24,168.00	0.00
869	000825	太钢不锈	6,700	22,847.00	0.00
870	600816	建元信托	9,100	22,204.00	0.00
871	600419	天润乳业	2,700	20,439.00	0.00
872	603687	大胜达	800	16,232.00	0.00
873	002888	惠威科技	700	15,386.00	0.00
874	603333	福华尚纬	1,900	15,314.00	0.00
875	301522	上大股份	577	15,100.09	0.00
876	300711	广哈通信	900	14,760.00	0.00
877	603158	腾龙股份	1,200	14,676.00	0.00
878	603677	奇精机械	1,100	14,135.00	0.00
879	002044	美年健康	2,800	14,084.00	0.00
880	603138	海量数据	1,000	14,050.00	0.00
881	000601	韶能股份	2,400	14,040.00	0.00
882	002021	中捷资源	5,500	13,860.00	0.00
883	688159	有方科技	310	13,760.90	0.00
884	601789	宁波建工	3,400	13,634.00	0.00
885	300937	药易购	700	13,503.00	0.00
886	000506	招金黄金	1,100	12,892.00	0.00
887	688598	金博股份	258	12,758.10	0.00
888	603660	苏州科达	500	6,125.00	0.00
889	688162	巨一科技	209	4,940.76	0.00
890	688077	大地熊	106	2,807.94	0.00
891	600792	云煤能源	800	2,536.00	0.00
892	688136	科兴制药	45	931.95	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	69,541,828.00	6.53
2	002463	沪电股份	46,389,110.46	4.36
3	300476	胜宏科技	46,351,814.01	4.35
4	000975	山金国际	44,039,813.00	4.14
5	002028	思源电气	42,384,044.00	3.98
6	300502	新易盛	40,710,753.48	3.82
7	300274	阳光电源	36,875,282.00	3.46
8	600660	福耀玻璃	36,754,656.00	3.45
9	601138	工业富联	35,026,931.00	3.29
10	001309	德明利	34,100,807.84	3.20
11	600066	宇通客车	32,454,566.00	3.05
12	002466	天齐锂业	32,442,791.00	3.05
13	688498	源杰科技	32,172,269.11	3.02
14	688525	佰维存储	30,142,608.31	2.83
15	601058	赛轮轮胎	30,101,211.00	2.83
16	603993	洛阳钼业	30,068,192.00	2.82
17	688766	普冉股份	29,927,477.45	2.81
18	688002	睿创微纳	29,731,407.11	2.79
19	300750	宁德时代	29,178,987.00	2.74
20	002475	立讯精密	27,550,740.00	2.59
21	002709	天赐材料	27,065,408.06	2.54
22	301308	江波龙	26,965,688.00	2.53
23	603986	兆易创新	26,227,185.00	2.46
24	002384	东山精密	25,537,803.00	2.40
25	601899	紫金矿业	25,373,145.00	2.38
26	002131	利欧股份	25,316,767.00	2.38
27	002402	和而泰	24,673,797.00	2.32
28	688472	阿特斯	24,364,305.94	2.29
29	601212	白银有色	23,829,305.00	2.24
30	300681	英搏尔	23,119,021.00	2.17
31	300724	捷佳伟创	22,648,117.00	2.13
32	600482	中国动力	22,211,009.81	2.09
33	002455	百川股份	21,546,395.00	2.02
34	688536	思瑞浦	21,354,388.84	2.01
35	002716	湖南白银	21,348,601.00	2.01

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	300308	中际旭创	65,367,891.76	6.14
2	002463	沪电股份	49,564,938.88	4.66
3	300476	胜宏科技	41,953,155.00	3.94
4	002028	思源电气	41,057,986.00	3.86
5	300502	新易盛	38,154,246.04	3.58
6	600660	福耀玻璃	37,333,833.00	3.51
7	300274	阳光电源	36,528,075.00	3.43
8	601138	工业富联	35,512,832.93	3.34
9	600066	宇通客车	33,384,813.00	3.14
10	000975	山金国际	33,210,609.34	3.12
11	603993	洛阳钼业	29,944,075.00	2.81
12	002475	立讯精密	28,662,565.00	2.69
13	300750	宁德时代	28,229,050.00	2.65
14	601058	赛轮轮胎	27,794,644.20	2.61
15	001309	德明利	25,866,103.78	2.43
16	603986	兆易创新	24,775,774.00	2.33
17	601899	紫金矿业	23,389,034.00	2.20
18	600482	中国动力	22,205,773.63	2.09
19	002402	和而泰	21,193,196.00	1.99
20	688002	睿创微纳	20,796,800.38	1.95

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	12,569,161,862.57
卖出股票收入（成交）总额	11,349,674,660.43

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	367,941,896.66	3.47
2	央行票据	—	—
3	金融债券	7,657,721,608.34	72.12
	其中：政策性金融债	3,661,708,608.21	34.48
4	企业债券	608,564,419.67	5.73

5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	102,331,441.10	0.96
7	可转债（可交换债）	8,856,883.94	0.08
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	8,745,416,249.71	82.36

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	260411	26 农发 11	9,500,000	954,614,657.53	8.99
2	260205	26 国开 05	8,000,000	814,843,616.44	7.67
3	250430	25 农发 30	7,000,000	713,338,547.95	6.72
4	250215	25 国开 15	4,300,000	425,909,698.63	4.01
5	242380033	23 招行永续债 01	3,200,000	339,502,343.01	3.20

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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

针对基金投资，本基金投资于全市场的股票型 ETF 及基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金。其中，计入权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：

1) 基金合同约定股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金；

2) 根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票及存托凭证资产占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金。

本基金采用定量分析和定性分析相结合的方式，一方面通过严格的量化规则筛选有潜在投资价值的标的纳入研究范围，另一方面结合所选基金的基金管理人的基本情况和投研文化等定性因素进行二次研判，双重维度力求筛选出中长期业绩稳定的优秀基金。

本基金基于权益类基金投资目标的不同，将标的基金分为主动和被动两大类。其中，针对主动管理类基金，本基金从基金风格、业绩表现、稳定性、规模变化等多角度进行分析，主要参考基金规模、历史业绩、风险调整后的收益、风险控制指标等一系列量化指标对基金进行分析，选取出预期能够获得良好业绩的基金；针对被动管理类基金，本基金从标的指数表现、跟踪误差、超额收益、规模变化等多角度进行分析，选取出表现稳定，符合未来市场发展方向的基金。同时，本基金还将通过分析标的基金基金管理人的资产管理规模、投研文化、风险控制能力等因素，对标的基金的业绩稳定性、风险控制能力等方面进行筛选。

本基金还将定期对投资组合进行回顾和动态调整，剔除不再符合筛选标准的标的基金，增加符合筛选标准的基金，以实现基金投资组合的优化。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，符合基金合同约定的投资政策，投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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，兴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。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商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、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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	1,203,742.57
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	98,867,652.85
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	100,071,395.42

7.13.4 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	118050	航宇转债	463,623.28	0.00
2	118060	瑞可转债	455,256.69	0.00
3	123255	鼎龙转债	452,254.51	0.00
4	113697	应流转债	445,120.14	0.00
5	118056	路维转债	444,119.36	0.00
6	123195	蓝晓转 02	439,773.08	0.00
7	118042	奥维转债	438,581.54	0.00
8	123241	欧通转债	438,199.08	0.00
9	123259	锦浪转 02	435,716.19	0.00
10	123263	鼎捷转债	432,202.46	0.00
11	113658	密卫转债	429,247.39	0.00
12	123250	嘉益转债	428,423.62	0.00
13	123257	安克转债	420,143.01	0.00
14	118051	皓元转债	418,415.85	0.00
15	113699	金 25 转债	416,562.37	0.00
16	113692	保隆转债	211,756.63	0.00
17	113696	伯 25 转债	137,800.00	0.00
18	118035	国力转债	90,861.45	0.00

7.13.5 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。

7.13.6 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 (%)
富国盛利增强债券发起式 A	14,573	266,871.18	3,642,430,716.08	93.66	246,682,934.54	6.34
富国盛利增强债券发起式 C	7,550	203,363.02	1,475,944.97	0.10	1,533,914,820.21	99.90
富国盛利增强债券发起式 E	1,269	3,125,281.11	3,951,655,809.25	99.64	14,325,915.31	0.36
合计	23,392	401,440.07	7,595,562,470.30	80.89	1,794,923,670.06	19.11

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	富国盛利增强债券发起式 A	2,130,940.45	0.0548
	富国盛利增强债券发起式 C	101,680.98	0.0066
	富国盛利增强债券发起式 E	134,447.26	0.0034
	合计	2,367,068.69	0.0252

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	富国盛利增强债券发起式 A	0~10
	富国盛利增强债券发起式 C	0
	富国盛利增强债券发起式 E	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	富国盛利增强债券发起式 A	10~50
	富国盛利增强债券发起式 C	0
	富国盛利增强债券发起式 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	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
----	---------------	----------------	---------------	------------------	----------------

		比例（%）		（%）	
基金管理人固有资金	10,002,336.04	0.11	10,001,350.14	0.11	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	10,002,336.04	0.11	10,001,350.14	0.11	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国盛利增强债券发起式 A	富国盛利增强债券发起式 C	富国盛利增强债券发起式 E
基金合同生效日（2024 年 03 月 18 日）基金份额总额	1, 508, 762, 914. 27	1, 107, 777, 057. 61	—
本报告期期初基金份额总额	268, 118, 613. 33	112, 635, 790. 84	591, 341, 067. 11
本报告期基金总申购份额	4, 552, 122, 441. 64	2, 028, 325, 340. 79	6, 513, 140, 970. 20
减：本报告期基金总赎回份额	931, 127, 404. 35	605, 570, 366. 45	3, 138, 500, 312. 75
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	3, 889, 113, 650. 62	1, 535, 390, 765. 18	3, 965, 981, 724. 56

§ 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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金本报告期所持有的基金未发生具有重大影响的事件。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 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。

10.7.2 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。

10.7.3 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。

10.7.4 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。

10.8 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

10.8.1 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(%)	
东方证券	4	3,180,644,559.65	13.30	1,291,046.45	13.30	—
国泰海通	2	3,163,860,937.64	13.23	1,284,246.17	13.23	—
西部证券	1	2,100,986,468.50	8.78	852,884.58	8.78	—
兴业证券	2	5,732,959,163.54	23.97	2,327,091.36	23.97	—
中金公司	1	81,848,283.92	0.34	33,226.07	0.34	—
中信证券	2	9,474,989,917.10	39.61	3,846,034.05	39.61	—
中银证券	1	183,547,192.65	0.77	74,501.41	0.77	—

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（018521、60245）。

10.8.2 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	基金交易
------	------	--------	------	------

	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	25,365,571.60	2.36	2,977,344,000.00	11.19	—	—	—	—
国泰海通	33,704,162.87	3.14	1,693,700,000.00	6.36	—	—	—	—
西部证券	55,615,057.40	5.18	3,827,000,000.00	14.38	—	—	—	—
兴业证券	88,723,929.03	8.26	6,014,800,000.00	22.60	—	—	—	—
中金公司	746,427.49	0.07	—	—	—	—	—	—
中信证券	869,831,783.11	80.97	11,954,800,000.00	44.92	—	—	—	—
中银证券	332,644.91	0.03	144,200,000.00	0.54	—	—	—	—

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