

富国兴利增强债券型发起式证券投资基金
二〇一八年半年度报告

2018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： 2018年08月29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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 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、基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
§4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5	托管人报告.....	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6	半年度财务报表(未经审计).....	15
6.1	资产负债表.....	15
6.2	利润表.....	16
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	17
6.4	报表附注.....	18
§7	投资组合报告.....	36
7.1	期末基金资产组合情况.....	36
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12	投资组合报告附注	50
§8	基金份额持有人信息	51
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	51
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	51
§9	开放式基金份额变动	52
§10	重大事件揭示	52
10.1	基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4	基金投资策略的改变	52
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8	其他重大事件	54
§11	影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
§12	备查文件目录	55

§ 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
交易代码	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	85,907,165.64份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。本基金在债券投资过程中突出主动性的投资管理，在对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势进行客观判断的基础上，通过合理配置收益率相对较高的企业债、公司债、资产支持证券，以及风险收益特征优异的可转换公司债券、可分离交易可转债、中小企业私募债券、可交换债券等债券品种，加以对国家债券、金融债券、中央银行票据以及质押及买断式回购等高流动性品种的投资，灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略，在保证基金流动性的前提下，积极把握固定收益证券市场中投资机会，获取各类债券的超额投资收益。
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，属于证券投资基金中的较低风险品种，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	010-66105798
	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	010-66105799

注册地址	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 楼	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 8 号上海国金中心二期 16-17 楼	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	薛爱东	易会满

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 楼 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 8 号上海国金中心二期 16, 17 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	1,114,268.99
本期利润	1,095,011.74
加权平均基金份额本期利润	0.0109
本期加权平均净值利润率	1.08%
本期基金份额净值增长率	1.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	978,436.86
期末可供分配基金份额利润	0.0114

期末基金资产净值	86,885,602.50
期末基金份额净值	1.0114
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)
基金份额累计净值增长率	1.14%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.62%	0.28%	-0.47%	0.13%	-0.15%	0.15%
过去三个月	-0.40%	0.22%	-0.11%	0.14%	-0.29%	0.08%
过去六个月	1.01%	0.21%	0.62%	0.13%	0.39%	0.08%
自基金合同生效日起至今	1.14%	0.17%	0.17%	0.11%	0.97%	0.06%

注：本基金业绩比较基准为：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%。

中债综合全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票，能够反映A股市场总体价格走势。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够忠实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进行再平衡处理，1日收益率（benchmark_t）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 90\% * [\text{中债综合全价指数}_t / (\text{中债综合全价指数}_{t-1}) - 1] + 10\% * [\text{沪深300指数}_t / (\text{沪深300指数}_{t-1}) - 1];$$

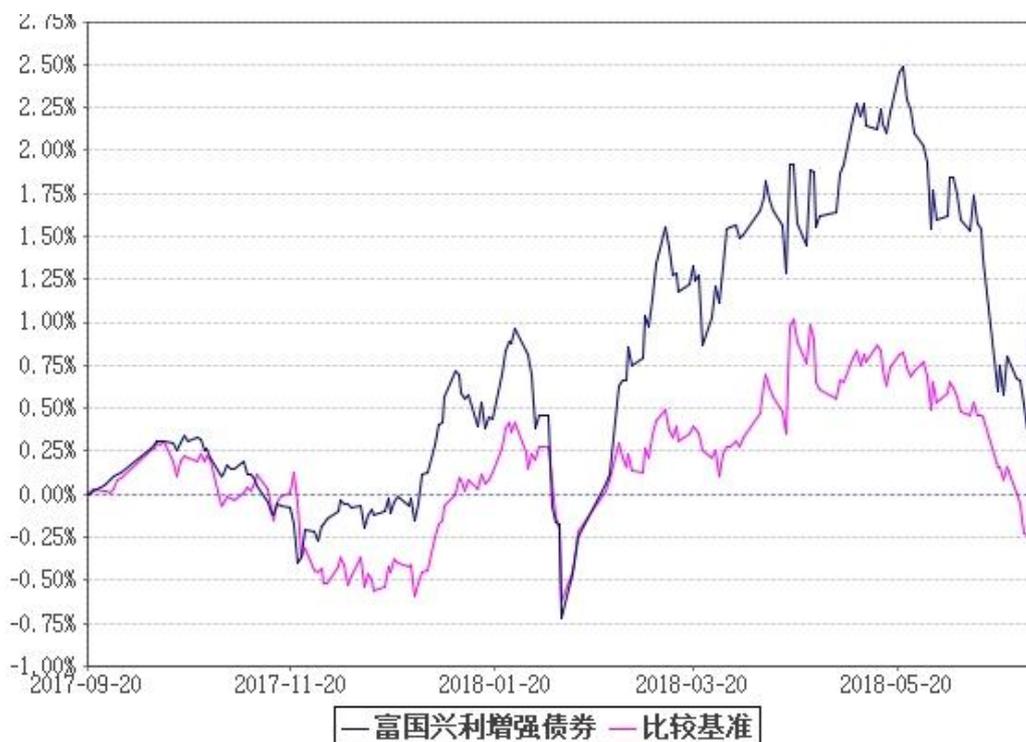
其中，t=1, 2, 3, ..., T, T表示时间截至日；

期间T日收益率（benchmark_T）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示t日至T日的(1+benchmark_t)数学连乘。

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



注：1、截止日期为2018年6月30日。
2、本基金于2017年9月20日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月，从2017年9月20日起至2018年3月19日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

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。截至2018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、富国消费主题混合型证券投资基金、富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值混合型证券投资基金、富国天瑞强势地区精选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）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选混合型证券投资基金、富国天博创新主题混合型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增

强债券型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金、富国汇利回报两年定期开放债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈债券型证券投资基金（LOF）、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国低碳环保混合型证券投资基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业混合型证券投资基金、富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、富国稳健增强债券型证券投资基金、富国信用债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国医疗保健行业混合型证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国城镇发展股票型证券投资基金、富国高端制造行业股票型证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金、富国安益货币市场基金、富国中小盘精选混合型证券投资基金、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金、富国文体健康股票型证券投资基金、富国国家安全主题混合型证券投资基金、富国改革动力混合型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金、富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育指数分级证券投资基金、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金、富国新动力灵活配置混合型证券投资基金、富国收益宝交易型货币市场基金、富国低碳新经济混合型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国研究优选沪港深灵活配置混合型证券投资基金、富国价值优势混合型证券投资基金、富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国美丽中国混合型证券投资基金、富国创新科技混合型证券投资基金、富国睿利定期开放混合型发起式证券投资基金、富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）、富国两年期理财债券型证券投资基金、富国久利稳健配置混合型证券投资基金、富国富利稳健配置混合型证券投资基金、富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金（LOF）、富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）、富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国产业升级混合型证券投资基金、富国鼎利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）、富国泓利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新优享灵活配置混合型证券投资基金、富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利一年期定期开放债券型证券投资基金、富国丰利增强债券型发起式证券投资基金、富国兴利增强债券型发起式证券投资基金、富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金、富国景利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国精准医疗灵活配置混合型证券投资基金、富

国研究量化精选混合型证券投资基金、富国沪港深行业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国金利定期开放混合型证券投资基金、富国新优选灵活配置定期开放混合型证券投资基金、富国绿色纯债一年定期开放债券型证券投资基金、富国成长优选三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、富国国企改革灵活配置混合型证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金、富国新趋势灵活配置混合型证券投资基金、富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、富国价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、富国军工主题混合型证券投资基金、富国臻利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、富国转型机遇混合型证券投资基金、富国尊利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、富国港股通量化精选股票型证券投资基金、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）等一百一十二只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）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		
黄纪亮	本基金基金经理	2017-09-20	—	10	硕士，曾任国泰君安证券股份有限公司助理研究员；2012 年 11 月至 2013 年 2 月任富国基金管理有限公司债券研究员；2013 年 2 月起任富国强回报定期开放债券型证券投资基金基金经理，2014 年 3 月起任富国汇利回报两年定期开放债券型证券投资基金（原：富国汇利回报分级债券型证券投资基金）基金经理和富国天利增长债券投资基金基金经理，2014 年 6 月起任富国信用债债券型证券投资基金基金经理，2016 年 8 月起任富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2016 年 9 月起任富国产业债债券型证券投资基金、富国睿利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，2017 年 8 月起任富国祥利一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，2017 年 9 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，2018 年 4 月起任富国臻利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、富国尊利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、富国鼎利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；兼任固定收益策略研究部总经理兼固定收益投资部总经

					理。具有基金从业资格。
王乐乐	本基金基金经理	2017-10-09	—	8	博士，自 2010 年 6 月至 2011 年 11 月在上海证券有限责任公司任研究员；自 2011 年 11 月至 2012 年 6 月在华泰联合证券有限责任公司任研究员；自 2012 年 7 月至 2015 年 5 月在华泰证券股份有限公司历任研究员、创新规划团队负责人；自 2015 年 5 月加入富国基金管理有限公司，2015 年 8 月起任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 10 月起任富国全球债券证券投资基金基金经理，2017 年 10 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，2017 年 11 月起任富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理；兼量化投资部量化投资总监助理。具有基金从业资格。
陈斯扬	本基金基金经理	2018-04-02	—	5	硕士，自 2013 年 2 月至 2016 年 10 月任交银施罗德基金管理有限公司研究员、投资经理；2016 年 10 月加入富国基金管理有限公司，自 2016 年 10 月至 2018 年 3 月任投资经理，自 2018 年 3 月起任富国丰利增强债券型发起式证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金、富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2018 年 4 月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现1次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

从债券来看，今年以来货币政策出现了一定程度的调整。二季度货币政策沿着之前稳健偏松的方向继续演绎。4月25日实施的定向降准置换9000亿元MLF，同时释放增量资金约4000亿元，6月份央行再次定向降准，显示出央行通过“定

向宽松对冲紧信用、支持中小微企业”的政策目的，市场对于政策延续性的预期加强。

货币政策例会延续了央行之前的政策精神，比如：“加强形势预判和前瞻性政策微调”、“引导货币信贷和社会融资规模的合理增长”等。除此之外，在货币政策口径上进一步趋宽，比如：保持流动性“合理稳定”改为“合理充裕”，改善了市场对于货币政策的预期。

在政策引导、贸易战发酵以及国内经济下行等因素驱动之下，上半年来看长端利率债收益率触顶回落、逐步震荡下行，本基金的长期债券配置上主要以十年期国开债为主，较好地分享到了这波利率下行带来的收益。

从股票来看，2018年以来，A股市场内忧外患，总体震荡下跌。年初，随着估值处于历史低位且行业景气预期改善的地产板块率先上涨，A股开启了春季躁动行情。进入2月，由于美国经济相关数据亮眼，引发市场对美联储货币政策加速收紧的担忧，美股带动全球市场迎来一轮深幅调整。3月起，贸易摩擦阴霾笼罩全球资本市场。3月初，美国对进口钢、铝分别征收25%、10%的关税，开启全球贸易摩擦的窗口。3月下旬，随着美国发布301调查结果，拟对约500亿美元的中国进口商品增加关税，市场对全球贸易担忧加剧，全球股指调整幅度加大。5月末，由于部分上市公司债券违约，投资者对上市公司信用风险担忧加剧，市场再次快速调整。6月中旬，由于美国正式公布针对中国进口商品的征税清单，并针对中国的反击着手准备进一步增加2000亿美元征税清单，导致全球资本市场避险情绪上升。尽管后续国务院出台缓解中小企业融资难政策，同时央行制定定向降准措施，货币政策出现放松迹象，但受全球贸易环境不确定的影响，A股市场整体出现大幅回调。总体来看，2018年上半年上证综指下跌13.9%，沪深300下跌12.9%，创业板指下跌8.33%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日，本基金份额净值为1.0114元；份额累计净值为1.0114元；本报告期，本基金份额净值增长率为1.01%，同期业绩比较基准收益率为0.62%

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，由于外部贸易战的影响以及国内经济的下行压力，货币政策会继续演绎适度充裕的节奏，而且财政政策有望持续发力、改善国内经济状况，对于长期利率债形成一定的扰动，尤其是前期对于经济悲观的预期可能会有所修复。

另外，困扰A股运行的两大压力有望逐步减轻。从中美贸易摩擦来看，由于美国政府已宣布将对价值2000亿美元的中国商品额外加征10%关税，市场对中美贸易摩擦的加剧已有较为充分的预期。短期来看，随着美国国会中期选举进入尾声，同时继续扩大征税范围对美国消费者的影响将明显加大，美国进一步加大贸易摩擦的概率较小，后续中美贸易摩擦有望出现阶段性缓和。从信用风险来看，随着央行进一步采取结构性货币宽松政策及加大窗口指导力度，同时财政政策有望发挥更大作用，中小企业融资难的问题将逐步缓解，市场对信用风险的担忧也将逐步降低。总体来看，随着投资者对经济加速下行的担忧逐渐消除，市场有望迎来新的行情。

在投资管理上，本基金尽力保证该组合的风险相对平衡，力争在控制组合下行风险的情况下，获取稳健的长期投资回报。

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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满3年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

基金合同生效后继续存续的，基金存续期内，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对富国兴利增强债券型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，富国兴利增强债券型发起式证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国兴利增强债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，富国兴利增强债券型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度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富国兴利增强债券型发起式证券投资基金2018半年度报告中财务指标、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 半年度财务报表(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：2018年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2018年06月30日)	上年度末 (2017年12月31日)
资 产：		
银行存款	203,147.88	157,768.60
结算备付金	182,531.29	4,136,363.64
存出保证金	7,653.30	844.96
交易性金融资产	97,227,819.09	80,566,103.10
其中：股票投资	16,620,803.19	11,803,203.10
基金投资	—	—
债券投资	80,607,015.90	68,762,900.00
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	24,800,000.00
应收证券清算款	—	40,462.03
应收利息	1,668,584.65	1,052,345.93
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	99,289,736.21	110,753,888.26
负债和所有者权益	本期末 (2018年06月30日)	上年度末 (2017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	12,200,000.00	—
应付证券清算款	111,741.59	—
应付赎回款	1,987.03	—
应付管理人报酬	31,489.99	37,516.97
应付托管费	7,872.50	9,379.26
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	9,932.71	11,704.92
应交税费	392.78	—

应付利息	-3,913.87	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	44,630.98	40,000.00
负债合计	12,404,133.71	98,601.15
所有者权益：		
实收基金	85,907,165.64	110,514,857.88
未分配利润	978,436.86	140,429.23
所有者权益合计	86,885,602.50	110,655,287.11
负债和所有者权益总计	99,289,736.21	110,753,888.26

注：报告截止日 2018 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0114 元，基金份额总额 85,907,165.64 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：2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日)
一、收入	1,494,631.84
1. 利息收入	1,599,180.58
其中：存款利息收入	15,507.61
债券利息收入	1,511,680.36
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	71,992.61
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-85,321.01
其中：股票投资收益	-47,889.89
基金投资收益	—
债券投资收益	-203,834.96
资产支持证券投资收益	—
贵金属投资收益	—
衍生工具投资收益	—
股利收益	166,403.84
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-19,257.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	29.52
减：二、费用	399,620.10
1. 管理人报酬	201,717.74
2. 托管费	50,429.44

3. 销售服务费	—
4. 交易费用	40,098.54
5. 利息支出	52,711.23
其中：卖出回购金融资产支出	52,711.23
6. 税金及附加	113.17
7. 其他费用	54,549.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,095,011.74
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,095,011.74

注：本基金合同生效日为2017年9月20日，无上年度同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）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：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2018年01月01日至2018年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	110,514,857.88	140,429.23	110,655,287.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	1,095,011.74	1,095,011.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-24,607,692.24	-257,004.11	-24,864,696.35
其中：1. 基金申购款	5,419,837.42	64,286.60	5,484,124.02
2. 基金赎回款	-30,027,529.66	-321,290.71	-30,348,820.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	85,907,165.64	978,436.86	86,885,602.50

注：所附附注为本会计报表的组成部分。本基金合同生效日为2017年9月20日，无上年度同期对比数据。

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,由富国基金管理有限公司作为管理人自2017年9月4日至2017年9月15日期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2017)验字第60467606_B16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2017年9月20日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币99,993,000.00元,在募集期间产生的存款利息为人民币2,250.23元,以上实收基金(本息)合计为人民币99,995,250.23元,折合99,995,250.23份基金份额。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)、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、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%。

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和半年度报告》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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2018

年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

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

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3%调整为1%；

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

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

2 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2018年06月30日）
活期存款	203,147.88
定期存款	—
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	—
合计	203,147.88

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2018年06月30日）			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	18,278,172.55	16,620,803.19	-1,657,369.36	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	
债券	交易所市场	30,022,713.64	30,172,015.90	149,302.26
	银行间市场	49,887,053.33	50,435,000.00	547,946.67
	合计	79,909,766.97	80,607,015.90	697,248.93
资产支持证券	—	—	—	
基金	—	—	—	
其他	—	—	—	
合计	98,187,939.52	97,227,819.09	-960,120.43	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

金额单位：人民币元

项目	本期末（2018年06月30日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	—	—
银行间市场	—	—
合计	—	—

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2018年06月30日）
应收活期存款利息	480.46
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	73.89
应收债券利息	1,668,027.24
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	3.06
合计	1,668,584.65

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2018年06月30日）
交易所市场应付交易费用	9,057.71
银行间市场应付交易费用	875.00
合计	9,932.71

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2018年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	19,835.79
合计	44,630.98

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2018年01月01日至2018年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	110,514,857.88	110,514,857.88
本期申购	5,419,837.42	5,419,837.42
本期赎回（以“-”号填列）	-30,027,529.66	-30,027,529.66
本期末	85,907,165.64	85,907,165.64

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,085,976.91	-945,547.68	140,429.23
本期利润	1,114,268.99	-19,257.25	1,095,011.74
本期基金份额交易产生的变动数	-368,687.10	111,682.99	-257,004.11
其中：基金申购款	53,877.72	10,408.88	64,286.60
基金赎回款	-422,564.82	101,274.11	-321,290.71
本期已分配利润	—	—	—
本期末	1,831,558.80	-853,121.94	978,436.86

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2018年01月01日至2018年06月30日）
活期存款利息收入	6,324.76
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	8,565.33
其他	617.52
合计	15,507.61

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2018年01月01日至2018年06月30日）
卖出股票成交总额	10,622,947.19
减：卖出股票成本总额	10,670,837.08
买卖股票差价收入	-47,889.89

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2018年01月01日至2018年06月30日）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	50,192,554.75
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	49,141,026.67
减：应收利息总额	1,255,363.04
买卖债券差价收入	-203,834.96

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 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。

6.4.7.16.2 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。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2018年01月01日至2018年06月30日）
股票投资产生的股利收益	166,403.84
基金投资产生的股利收益	—
合计	166,403.84

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2018年01月01日至2018年06月30日）
1. 交易性金融资产	-19,257.25
股票投资	-1,742,626.18
债券投资	1,723,368.93
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	-19,257.25

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2018年01月01日至2018年06月30日）
基金赎回费收入	29.42
转换费收入	0.10
合计	29.52

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2018年01月01日至2018年06月30日）
交易所市场交易费用	38,523.54
银行间市场交易费用	1,575.00
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	40,098.54

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2018年01月01日至2018年06月30日）
审计费用	24,795.19
信息披露费	19,835.79
银行费用	919.00
债券账户维护费	9,000.00
合计	54,549.98

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
海通证券股份有限公司	基金管理人的股东
申万宏源证券有限公司	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2018年01月01日至2018年06月30日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
海通证券	17,447,933.82	62.74
申万宏源	10,362,165.72	37.26

注：本基金合同生效日为2017年09月20日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为2017年09月20日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2018年01月01日至2018年06月30日)	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
海通证券	4,568,988.91	22.73
申万宏源	15,532,710.57	77.27

注：本基金合同生效日为2017年09月20日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2018年01月01日至2018年06月30日)	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)
海通证券	352,280,000.00	53.09
申万宏源	311,291,000.00	46.91

注：本基金合同生效日为2017年09月20日，无上年度同期对比数据。

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(2018年01月01日至2018年06月30日)			
	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
海通证券	15,903.36	62.66	6,879.83	75.96
申万宏源	9,475.74	37.34	2,177.88	24.04

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。本基金合同生效日为2017年09月20日，无上年度同期对比数据。

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（2018年01月01日至 2018年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	201,717.74
其中：支付销售机构的客户维护费	6.42

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。

本基金合同生效日为2017年09月20日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2018年01月01日至 2018年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	50,429.44

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。

本基金合同生效日为2017年09月20日，无上年度同期对比数据。

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：本基金本期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

本基金合同生效日为2017年09月20日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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（2018年01月01日至2018 年06月30日）
基金合同生效日（2017年 09月20日）持有的基金份额	10,002,250.23
期初持有的基金份额	10,002,250.23
期间申购/买入总份额	—

期间因拆分变动份额	—
减：期间赎回/卖出总份额	—
期末持有的基金份额	10,002,250.23
期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.64%

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。本基金合同生效日为2017年9月20日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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（2018年01月01日至2018年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	203,147.88	6,324.76

注：本基金合同生效日为2017年09月20日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期内本基金未在承销期内直接购入关联方承销证券。本基金合同生效日为2017年09月20日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金无其他关联方交易事项。本基金合同生效日为2017年09月20日，无上年度同期对比数据。

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（2018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
000426	兴业矿业	2018-06-19	重大事项停牌	7.21	2018-08-27	6.47	2,900	28,139.00	20,909.00	—
000669	金鸿控股	2018-05-18	重大事项停牌	7.25	2018-08-06	6.53	4,900	48,270.25	35,525.00	—
000825	太钢不锈	2018-04-16	重大事项停牌	6.00	—	—	7,600	38,530.00	45,600.00	—
002102	冠福股份	2018-06-01	重大事项停牌	4.07	—	—	6,900	28,649.00	28,083.00	—
002668	奥马电器	2018-06-15	重大事项停牌	20.10	—	—	400	8,476.00	8,040.00	—
002699	美盛文化	2018-02-05	重大事项停牌	18.76	2018-07-02	16.88	4,900	87,891.40	91,924.00	—
300072	三聚环保	2018-06-19	重大事项停牌	23.28	2018-07-10	24.00	2,400	77,572.24	55,872.00	—
300118	东方日升	2018-05-07	重大事项停牌	9.46	2018-08-07	9.63	1,300	14,746.33	12,298.00	—
300197	铁汉生态	2018-05-28	重大事项停牌	5.37	—	—	3,600	24,535.06	19,332.00	—
300266	兴源环境	2018-02-05	重大事项停牌	19.99	2018-07-02	17.99	5,700	154,208.00	113,943.00	—
300324	旋极信息	2018-05-30	重大事项停牌	9.49	—	—	2,559	26,599.59	24,284.91	—
300362	天翔环境	2018-06-08	重大事项停牌	9.68	—	—	100	1,319.52	968.00	—
600022	山东钢铁	2018-03-27	重大事项停牌	2.02	2018-08-16	1.83	1,100	2,470.23	2,222.00	—
600122	宏图高科	2018-06-19	重大事项停牌	7.40	—	—	500	4,820.00	3,700.00	—
600335	国机汽车	2018-04-03	重大事项停牌	10.43	—	—	400	4,239.00	4,172.00	—
600811	东方集团	2018-05-30	重大事项停牌	4.30	—	—	1,000	4,741.43	4,300.00	—
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项停牌	7.47	2018-08-20	7.25	6,200	46,376.00	46,314.00	—

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 2018 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 2018 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 12,200,000.00 元，于 2018 年 7 月 6 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。

6.4.13 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、监察稽核部、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股票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。

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银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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

单位：人民币元

本期末（2018年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	203,147.88	—	—	—	—	—	203,147.88
结算备付金	182,531.29	—	—	—	—	—	182,531.29
存出保证金	7,653.30	—	—	—	—	—	7,653.30
交易性金融资产	10,000,000.00	—	43,972,850.40	6,205,165.50	20,429,000.00	16,620,803.19	97,227,819.09
应收利息	—	—	—	—	—	1,668,584.65	1,668,584.65
资产总计	10,393,332.47	—	43,972,850.40	6,205,165.50	20,429,000.00	18,289,387.84	99,289,736.21
负债							
卖出回购金融资产款	12,200,000.00	—	—	—	—	—	12,200,000.00
应付证券清算款	—	—	—	—	—	111,741.59	111,741.59
应付赎回款	—	—	—	—	—	1,987.03	1,987.03
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	31,489.99	31,489.99
应付托管费	—	—	—	—	—	7,872.50	7,872.50
应付交易费用	—	—	—	—	—	9,932.71	9,932.71
应付税费	—	—	—	—	—	392.78	392.78
应付利息	—	—	—	—	—	-3,913.87	-3,913.87
其他负债	—	—	—	—	—	44,630.98	44,630.98
负债总计	12,200,000.00	—	—	—	—	204,133.71	12,404,133.71
利率敏感度缺口	-1,806,667.53	—	43,972,850.40	6,205,165.50	20,429,000.00	18,085,254.13	86,885,602.50
上年度末（2017年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	157,768.60	—	—	—	—	—	157,768.60
结算备付金	4,136,363.64	—	—	—	—	—	4,136,363.64
存出保证金	844.96	—	—	—	—	—	844.96
交易性金融资产	—	—	39,763,900.00	9,889,000.00	19,110,000.00	11,803,203.10	80,566,103.10
买入返售金融资产	24,800,000.00	—	—	—	—	—	24,800,000.00
应收证券清算款	—	—	—	—	—	40,462.03	40,462.03
应收利息	—	—	—	—	—	1,052,345.93	1,052,345.93
资产总计	29,094,977.20	—	39,763,900.00	9,889,000.00	19,110,000.00	12,896,011.06	110,753,888.26
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	37,516.97	37,516.97
应付托管费	—	—	—	—	—	9,379.26	9,379.26
应付交易费用	—	—	—	—	—	11,704.92	11,704.92
其他负债	—	—	—	—	—	40,000.00	40,000.00
负债总计	—	—	—	—	—	98,601.15	98,601.15
利率敏感度缺口	29,094,977.20	—	39,763,900.00	9,889,000.00	19,110,000.00	12,797,409.91	110,655,287.11

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动； 2. 利率变动范围合理		
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：元）	
		本期末（2018年06月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-184,957.42	-182,968.84
	2. 基准点利率减少0.1%	184,957.42	182,968.84

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股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、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）、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。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2018年06月30日）		上年度末（2017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	16,620,803.19	19.13	11,803,203.10	10.67
交易性金融资产—债券投资	80,607,015.90	92.77	68,762,900.00	62.14
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	97,227,819.09	111.90	80,566,103.10	72.81

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2018年06月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加1%	1,208,074.30	465,112.18
2. 业绩比较基准减少1%	-1,208,074.30	-465,112.18	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币16,103,316.28元，属于第二层次的余额为人民币81,124,502.81元，属于第三层次余额为人民币0.00元。

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.14.2 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。

6.4.14.3 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	16,620,803.19	16.74
	其中：股票	16,620,803.19	16.74
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	80,607,015.90	81.18
	其中：债券	80,607,015.90	81.18
	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	—	—
	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	385,679.17	0.39
8	其他各项资产	1,676,237.95	1.69
9	合计	99,289,736.21	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	124,589.60	0.14
B	采矿业	499,237.40	0.57
C	制造业	8,073,973.26	9.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,109,773.00	1.28
E	建筑业	246,070.60	0.28
F	批发和零售业	649,848.50	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	563,979.00	0.65

H	住宿和餐饮业	76,237.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,611,245.65	1.85
J	金融业	1,402,929.40	1.61
K	房地产业	936,562.00	1.08
L	租赁和商务服务业	193,007.28	0.22
M	科学研究和技术服务业	26,066.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	394,943.00	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	292,583.50	0.34
R	文化、体育和娱乐业	415,816.00	0.48
S	综合	3,942.00	0.00
	合计	16,620,803.19	19.13

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	601288	农业银行	72,700	250,088.00	0.29
2	601939	建设银行	37,500	245,625.00	0.28
3	300059	东方财富	18,200	239,876.00	0.28
4	601998	中信银行	32,900	204,309.00	0.24
5	300124	汇川技术	5,400	177,228.00	0.20
6	300122	智飞生物	3,800	173,812.00	0.20
7	300003	乐普医疗	4,600	168,728.00	0.19
8	000895	双汇发展	6,100	161,101.00	0.19
9	600036	招商银行	5,600	148,064.00	0.17
10	600104	上汽集团	4,200	146,958.00	0.17
11	000651	格力电器	3,100	146,165.00	0.17
12	600900	长江电力	9,000	145,260.00	0.17
13	601088	中国神华	7,000	139,580.00	0.16
14	601006	大秦铁路	17,000	139,570.00	0.16
15	300015	爱尔眼科	4,250	137,232.50	0.16
16	300408	三环集团	5,700	133,950.00	0.15
17	300142	沃森生物	6,300	125,874.00	0.14
18	002001	新和成	6,630	125,704.80	0.14
19	000157	中联重科	29,300	120,423.00	0.14
20	300136	信维通信	3,900	119,847.00	0.14
21	600028	中国石化	18,400	119,416.00	0.14
22	600383	金地集团	11,600	118,204.00	0.14
23	600023	浙能电力	24,700	115,102.00	0.13

24	300024	机器人	6,600	114,840.00	0.13
25	000528	柳工	10,700	114,597.00	0.13
26	300266	兴源环境	5,700	113,943.00	0.13
27	002146	荣盛发展	12,900	112,617.00	0.13
28	600011	华能国际	17,700	112,572.00	0.13
29	300070	碧水源	8,000	111,440.00	0.13
30	000581	威孚高科	5,000	110,550.00	0.13
31	000338	潍柴动力	12,600	110,250.00	0.13
32	600027	华电国际	27,600	108,192.00	0.12
33	600585	海螺水泥	3,200	107,136.00	0.12
34	300274	阳光电源	11,100	99,567.00	0.11
35	000830	鲁西化工	5,800	99,064.00	0.11
36	600642	申能股份	19,100	95,882.00	0.11
37	600153	建发股份	10,600	95,294.00	0.11
38	000998	隆平高科	5,000	94,300.00	0.11
39	300144	宋城演艺	4,000	94,000.00	0.11
40	603568	伟明环保	3,700	93,610.00	0.11
41	000625	长安汽车	10,300	92,700.00	0.11
42	603589	口子窖	1,500	92,175.00	0.11
43	002699	美盛文化	4,900	91,924.00	0.11
44	300296	利亚德	7,100	91,448.00	0.11
45	000661	长春高新	400	91,080.00	0.10
46	000002	万科 A	3,700	91,020.00	0.10
47	002127	南极电商	9,500	89,205.00	0.10
48	300017	网宿科技	8,300	88,893.00	0.10
49	600240	华业资本	12,000	87,960.00	0.10
50	600572	康恩贝	12,100	86,757.00	0.10
51	300168	万达信息	4,200	85,680.00	0.10
52	600741	华域汽车	3,600	85,392.00	0.10
53	603658	安图生物	1,000	82,460.00	0.09
54	600398	海澜之家	6,400	81,536.00	0.09
55	600580	卧龙电气	10,700	81,534.00	0.09
56	002419	天虹股份	5,550	81,030.00	0.09
57	600260	凯乐科技	3,000	80,520.00	0.09
58	601688	华泰证券	5,300	79,341.00	0.09
59	601717	郑煤机	13,600	79,016.00	0.09
60	002304	洋河股份	600	78,960.00	0.09
61	300182	捷成股份	10,400	78,832.00	0.09
62	000050	深天马 A	5,500	78,210.00	0.09
63	600704	物产中大	14,900	77,927.00	0.09
64	600823	世茂股份	18,300	76,494.00	0.09

65	601678	滨化股份	12,230	75,581.40	0.09
66	600325	华发股份	9,700	74,981.00	0.09
67	600066	宇通客车	3,900	74,841.00	0.09
68	600655	豫园股份	7,900	74,655.00	0.09
69	600787	中储股份	9,600	74,304.00	0.09
70	300347	泰格医药	1,200	74,244.00	0.09
71	300253	卫宁健康	5,900	73,101.00	0.08
72	000069	华侨城 A	9,600	69,408.00	0.08
73	000425	徐工机械	16,300	69,112.00	0.08
74	000876	新希望	10,900	69,106.00	0.08
75	600406	国电南瑞	4,300	67,940.00	0.08
76	002044	美年健康	3,000	67,800.00	0.08
77	601877	正泰电器	3,000	66,960.00	0.08
78	600177	雅戈尔	8,500	65,450.00	0.08
79	000553	沙隆达 A	4,100	64,821.00	0.07
80	600020	中原高速	16,900	63,713.00	0.07
81	601009	南京银行	8,200	63,386.00	0.07
82	603766	隆鑫通用	11,600	62,988.00	0.07
83	002195	二三四五	14,690	62,873.20	0.07
84	601016	节能风电	21,900	62,853.00	0.07
85	002372	伟星新材	3,510	62,091.90	0.07
86	300166	东方国信	4,200	61,866.00	0.07
87	601158	重庆水务	11,300	61,246.00	0.07
88	300467	迅游科技	1,900	60,990.00	0.07
89	000858	五粮液	800	60,800.00	0.07
90	300088	长信科技	10,400	60,320.00	0.07
91	600872	中炬高新	2,100	58,800.00	0.07
92	002589	瑞康医药	4,300	58,652.00	0.07
93	300207	欣旺达	6,400	57,664.00	0.07
94	002517	恺英网络	7,950	57,160.50	0.07
95	300170	汉得信息	3,500	56,840.00	0.07
96	000926	福星股份	7,900	56,801.00	0.07
97	300418	昆仑万维	3,000	56,640.00	0.07
98	300009	安科生物	3,040	56,057.60	0.06
99	300072	三聚环保	2,400	55,872.00	0.06
100	300315	掌趣科技	13,100	54,758.00	0.06
101	000726	鲁泰 A	5,000	53,950.00	0.06
102	300027	华谊兄弟	8,700	53,592.00	0.06
103	002544	杰赛科技	3,900	53,391.00	0.06
104	600894	广日股份	9,000	53,370.00	0.06
105	000066	中国长城	7,500	53,325.00	0.06

106	300433	蓝思科技	2,500	52,450.00	0.06
107	300450	先导智能	1,699	51,377.76	0.06
108	002422	科伦药业	1,600	51,360.00	0.06
109	600409	三友化工	5,800	49,938.00	0.06
110	600897	厦门空港	2,400	49,488.00	0.06
111	300014	亿纬锂能	2,800	49,280.00	0.06
112	000598	兴蓉环境	12,100	49,126.00	0.06
113	600660	福耀玻璃	1,900	48,849.00	0.06
114	002543	万和电气	2,500	48,300.00	0.06
115	000786	北新建材	2,600	48,178.00	0.06
116	600578	京能电力	15,400	48,048.00	0.06
117	300251	光线传媒	4,700	47,846.00	0.06
118	600536	中国软件	2,202	47,629.26	0.05
119	600426	华鲁恒升	2,700	47,493.00	0.05
120	000001	平安银行	5,200	47,268.00	0.05
121	000776	广发证券	3,500	46,445.00	0.05
122	600516	方大炭素	1,900	46,322.00	0.05
123	601390	中国中铁	6,200	46,314.00	0.05
124	603108	润达医疗	4,100	46,002.00	0.05
125	000027	深圳能源	9,300	45,942.00	0.05
126	000825	太钢不锈	7,600	45,600.00	0.05
127	600019	宝钢股份	5,800	45,182.00	0.05
128	600201	生物股份	2,600	44,434.00	0.05
129	300271	华宇软件	2,500	44,200.00	0.05
130	000975	银泰资源	4,340	44,007.60	0.05
131	603328	依顿电子	4,000	43,400.00	0.05
132	600141	兴发集团	3,720	43,338.00	0.05
133	600525	长园集团	4,100	43,337.00	0.05
134	300297	蓝盾股份	5,300	42,983.00	0.05
135	002228	合兴包装	9,000	42,930.00	0.05
136	300316	晶盛机电	3,190	42,395.10	0.05
137	000524	岭南控股	4,600	42,044.00	0.05
138	000988	华工科技	2,900	41,905.00	0.05
139	600886	国投电力	5,700	41,439.00	0.05
140	000636	风华高科	2,600	41,288.00	0.05
141	600657	信达地产	9,700	41,225.00	0.05
142	000402	金融街	5,100	41,055.00	0.05
143	600438	通威股份	5,900	40,710.00	0.05
144	300133	华策影视	3,800	40,470.00	0.05
145	300055	万邦达	3,500	40,215.00	0.05
146	600256	广汇能源	9,820	40,163.80	0.05

147	002600	领益智造	7,700	39,963.00	0.05
148	000059	华锦股份	5,800	39,962.00	0.05
149	300058	蓝色光标	7,000	39,900.00	0.05
150	000100	TCL集团	13,500	39,150.00	0.05
151	600273	嘉化能源	4,300	38,958.00	0.04
152	600566	济川药业	800	38,552.00	0.04
153	600999	招商证券	2,800	38,304.00	0.04
154	300287	飞利信	5,300	38,107.00	0.04
155	000703	恒逸石化	2,560	38,092.80	0.04
156	603556	海兴电力	2,080	37,793.60	0.04
157	600875	东方电气	5,100	37,791.00	0.04
158	600410	华胜天成	4,300	37,625.00	0.04
159	300073	当升科技	1,100	37,466.00	0.04
160	300355	蒙草生态	6,200	37,262.00	0.04
161	300113	顺网科技	2,100	36,561.00	0.04
162	000333	美的集团	700	36,554.00	0.04
163	600729	重庆百货	1,100	36,245.00	0.04
164	000429	粤高速A	5,000	36,100.00	0.04
165	600801	华新水泥	2,400	36,072.00	0.04
166	300203	聚光科技	1,400	35,840.00	0.04
167	002745	木林森	2,000	35,580.00	0.04
168	000669	金鸿控股	4,900	35,525.00	0.04
169	600048	保利地产	2,900	35,380.00	0.04
170	000400	许继电气	4,500	35,145.00	0.04
171	601788	光大证券	3,200	35,136.00	0.04
172	000061	农产品	6,500	35,100.00	0.04
173	600511	国药股份	1,300	35,035.00	0.04
174	300367	东方网力	2,800	35,000.00	0.04
175	300033	同花顺	900	34,983.00	0.04
176	300219	鸿利智汇	3,600	34,848.00	0.04
177	601186	中国铁建	4,000	34,480.00	0.04
178	002807	江阴银行	6,100	34,282.00	0.04
179	300199	翰宇药业	2,400	34,272.00	0.04
180	601007	金陵饭店	3,100	34,193.00	0.04
181	002478	常宝股份	7,600	34,048.00	0.04
182	300053	欧比特	2,900	33,640.00	0.04
183	300618	寒锐钴业	260	33,368.40	0.04
184	600338	西藏珠峰	1,600	33,152.00	0.04
185	002142	宁波银行	2,000	32,580.00	0.04
186	300026	红日药业	8,900	32,485.00	0.04
187	000600	建投能源	5,800	32,306.00	0.04

188	300098	高新兴	4,046	32,287.08	0.04
189	000039	中集集团	2,400	31,872.00	0.04
190	002332	仙琚制药	3,600	31,500.00	0.04
191	300145	中金环境	4,000	31,320.00	0.04
192	002384	东山精密	1,300	31,200.00	0.04
193	601238	广汽集团	2,800	31,192.00	0.04
194	000488	晨鸣纸业	2,400	31,008.00	0.04
195	002491	通鼎互联	2,800	30,996.00	0.04
196	002233	塔牌集团	2,700	30,888.00	0.04
197	600887	伊利股份	1,100	30,690.00	0.04
198	300459	金科文化	3,100	29,946.00	0.03
199	601229	上海银行	1,900	29,944.00	0.03
200	300180	华峰超纤	2,760	29,890.80	0.03
201	600277	亿利洁能	5,700	29,868.00	0.03
202	002798	帝欧家居	1,000	29,600.00	0.03
203	600346	恒力股份	2,000	29,320.00	0.03
204	002635	安洁科技	1,700	29,240.00	0.03
205	601231	环旭电子	3,200	29,024.00	0.03
206	000158	常山北明	4,200	28,854.00	0.03
207	600057	厦门象屿	5,772	28,802.28	0.03
208	300068	南都电源	2,400	28,752.00	0.03
209	600033	福建高速	9,500	28,690.00	0.03
210	002083	孚日股份	5,100	28,611.00	0.03
211	300383	光环新网	2,100	28,161.00	0.03
212	002102	冠福股份	6,900	28,083.00	0.03
213	600674	川投能源	3,200	27,904.00	0.03
214	600282	南钢股份	6,300	27,846.00	0.03
215	300558	贝达药业	500	27,835.00	0.03
216	600936	广西广电	5,800	27,608.00	0.03
217	300002	神州泰岳	6,600	27,522.00	0.03
218	300463	迈克生物	1,100	27,423.00	0.03
219	600309	万华化学	600	27,252.00	0.03
220	601988	中国银行	7,500	27,075.00	0.03
221	300496	中科创达	900	26,523.00	0.03
222	300628	亿联网络	400	26,364.00	0.03
223	300212	易华录	1,080	25,542.00	0.03
224	000899	赣能股份	6,100	24,949.00	0.03
225	002373	千方科技	1,900	24,795.00	0.03
226	002299	圣农发展	1,600	24,784.00	0.03
227	002463	沪电股份	6,600	24,684.00	0.03
228	600826	兰生股份	1,800	24,426.00	0.03

229	300324	旋极信息	2,559	24,284.91	0.03
230	600795	国电电力	9,200	24,104.00	0.03
231	600183	生益科技	2,610	23,907.60	0.03
232	002179	中航光电	600	23,400.00	0.03
233	600970	中材国际	3,500	23,380.00	0.03
234	300323	华灿光电	1,800	23,256.00	0.03
235	601166	兴业银行	1,600	23,040.00	0.03
236	300413	芒果超媒	600	22,764.00	0.03
237	603001	奥康国际	1,900	22,629.00	0.03
238	600466	蓝光发展	3,640	22,568.00	0.03
239	600236	桂冠电力	3,900	22,269.00	0.03
240	002482	广田集团	3,700	22,089.00	0.03
241	603816	顾家家居	300	22,053.00	0.03
242	002503	搜于特	6,300	22,050.00	0.03
243	300115	长盈精密	1,700	22,049.00	0.03
244	600879	航天电子	3,100	21,793.00	0.03
245	000960	锡业股份	1,800	21,618.00	0.02
246	300376	易事特	4,000	21,480.00	0.02
247	002124	天邦股份	4,950	21,384.00	0.02
248	000552	靖远煤电	6,500	21,255.00	0.02
249	300388	国祯环保	1,100	21,197.00	0.02
250	600428	中远海特	5,900	20,945.00	0.02
251	000426	兴业矿业	2,900	20,909.00	0.02
252	601003	柳钢股份	2,600	20,592.00	0.02
253	000550	江铃汽车	1,700	20,587.00	0.02
254	600618	氯碱化工	2,400	20,424.00	0.02
255	000758	中色股份	4,500	20,250.00	0.02
256	601515	东风股份	2,600	20,072.00	0.02
257	603225	新风鸣	1,000	19,970.00	0.02
258	300010	立思辰	1,600	19,584.00	0.02
259	600743	华远地产	7,600	19,532.00	0.02
260	600863	内蒙华电	8,600	19,522.00	0.02
261	600881	亚泰集团	5,200	19,396.00	0.02
262	300197	铁汉生态	3,600	19,332.00	0.02
263	600859	王府井	900	19,143.00	0.02
264	601601	中国太保	600	19,110.00	0.02
265	600269	赣粤高速	4,600	18,814.00	0.02
266	000090	天健集团	3,000	18,600.00	0.02
267	600862	中航高科	3,000	18,450.00	0.02
268	000568	泸州老窖	300	18,258.00	0.02
269	600312	平高电气	3,200	18,048.00	0.02

270	300285	国瓷材料	900	17,946.00	0.02
271	600216	浙江医药	1,400	17,878.00	0.02
272	600478	科力远	3,500	17,850.00	0.02
273	601636	旗滨集团	4,000	17,800.00	0.02
274	601021	春秋航空	500	17,515.00	0.02
275	000762	西藏矿业	1,800	17,334.00	0.02
276	600160	巨化股份	2,340	17,128.80	0.02
277	002061	浙江交科	1,600	16,752.00	0.02
278	600018	上港集团	2,800	16,688.00	0.02
279	600449	宁夏建材	2,100	16,548.00	0.02
280	002564	天沃科技	2,900	16,385.00	0.02
281	000078	海王生物	3,400	16,354.00	0.02
282	600350	山东高速	4,000	16,200.00	0.02
283	603369	今世缘	700	15,981.00	0.02
284	603558	健盛集团	1,800	15,858.00	0.02
285	600120	浙江东方	1,170	15,853.50	0.02
286	600315	上海家化	400	15,852.00	0.02
287	000887	中鼎股份	1,100	15,851.00	0.02
288	002266	浙富控股	4,200	15,750.00	0.02
289	600548	深高速	2,000	15,700.00	0.02
290	002206	海利得	3,100	15,469.00	0.02
291	601137	博威合金	1,900	15,352.00	0.02
292	600583	海油工程	2,900	15,254.00	0.02
293	300377	赢时胜	1,100	14,949.00	0.02
294	300159	新研股份	2,100	14,868.00	0.02
295	600563	法拉电子	300	14,847.00	0.02
296	600060	海信电器	1,100	14,729.00	0.02
297	601668	中国建筑	2,660	14,523.60	0.02
298	300257	开山股份	900	13,761.00	0.02
299	000761	本钢板材	3,400	13,736.00	0.02
300	002180	纳思达	500	13,730.00	0.02
301	300338	开元股份	1,000	13,570.00	0.02
302	002048	宁波华翔	1,100	13,563.00	0.02
303	002454	松芝股份	2,300	13,501.00	0.02
304	002334	英威腾	2,300	13,455.00	0.02
305	000030	富奥股份	1,800	13,356.00	0.02
306	300244	迪安诊断	700	13,307.00	0.02
307	601169	北京银行	2,200	13,266.00	0.02
308	002159	三特索道	700	13,216.00	0.02
309	600004	白云机场	1,000	13,090.00	0.02
310	300222	科大智能	700	12,978.00	0.01

311	603608	天创时尚	1,400	12,726.00	0.01
312	002128	露天煤业	1,400	12,684.00	0.01
313	002024	苏宁易购	900	12,672.00	0.01
314	300294	博雅生物	400	12,396.00	0.01
315	300078	思创医惠	1,300	12,324.00	0.01
316	300118	东方日升	1,300	12,298.00	0.01
317	002003	伟星股份	1,430	12,112.10	0.01
318	300409	道氏技术	300	12,033.00	0.01
319	300308	中际旭创	200	12,008.00	0.01
320	000828	东莞控股	1,500	11,970.00	0.01
321	601919	中远海控	2,400	11,808.00	0.01
322	601318	中国平安	200	11,716.00	0.01
323	603167	渤海轮渡	1,200	11,556.00	0.01
324	000543	皖能电力	2,600	11,466.00	0.01
325	300020	银江股份	1,200	11,412.00	0.01
326	300001	特锐德	1,000	11,360.00	0.01
327	600376	首开股份	1,600	11,248.00	0.01
328	600779	水井坊	200	11,046.00	0.01
329	300038	梅泰诺	1,000	10,660.00	0.01
330	601222	林洋能源	2,100	10,458.00	0.01
331	300676	华大基因	100	9,681.00	0.01
332	600971	恒源煤电	1,300	9,282.00	0.01
333	300364	中文在线	1,300	9,152.00	0.01
334	600308	华泰股份	1,800	8,964.00	0.01
335	002530	金财互联	960	8,745.60	0.01
336	000537	广宇发展	900	8,676.00	0.01
337	002468	申通快递	500	8,575.00	0.01
338	600643	爱建集团	900	8,460.00	0.01
339	603883	老百姓	100	8,316.00	0.01
340	600908	无锡银行	1,400	8,246.00	0.01
341	002668	奥马电器	400	8,040.00	0.01
342	601800	中国交建	700	7,973.00	0.01
343	002221	东华能源	800	7,816.00	0.01
344	600651	飞乐音响	2,000	7,800.00	0.01
345	002176	江特电机	800	7,776.00	0.01
346	300431	暴风集团	500	7,590.00	0.01
347	000662	天夏智慧	1,170	7,523.10	0.01
348	000712	锦龙股份	700	6,986.00	0.01
349	000591	太阳能	1,900	6,954.00	0.01
350	600115	东方航空	1,000	6,620.00	0.01
351	000997	新大陆	400	6,300.00	0.01

352	002599	盛通股份	600	6,258.00	0.01
353	600673	东阳光科	600	6,198.00	0.01
354	002088	鲁阳节能	400	6,080.00	0.01
355	603025	大豪科技	300	5,802.00	0.01
356	600703	三安光电	300	5,766.00	0.01
357	600155	华创阳安	800	5,752.00	0.01
358	002670	国盛金控	520	5,600.40	0.01
359	300511	雪榕生物	620	5,505.60	0.01
360	002536	西泵股份	500	5,485.00	0.01
361	000546	金圆股份	400	5,348.00	0.01
362	600291	西水股份	400	5,344.00	0.01
363	601168	西部矿业	800	5,024.00	0.01
364	002518	科士达	500	4,985.00	0.01
365	002273	水晶光电	380	4,890.60	0.01
366	002078	太阳纸业	500	4,845.00	0.01
367	002354	天神娱乐	500	4,630.00	0.01
368	600197	伊力特	200	4,510.00	0.01
369	601211	国泰君安	300	4,422.00	0.01
370	600811	东方集团	1,000	4,300.00	0.00
371	300422	博世科	300	4,275.00	0.00
372	300335	迪森股份	400	4,256.00	0.00
373	000822	山东海化	600	4,182.00	0.00
374	600335	国机汽车	400	4,172.00	0.00
375	002685	华东重机	500	4,115.00	0.00
376	000652	泰达股份	1,300	4,056.00	0.00
377	600777	新潮能源	1,800	3,942.00	0.00
378	002202	金风科技	300	3,792.00	0.00
379	600122	宏图高科	500	3,700.00	0.00
380	600098	广州发展	500	3,225.00	0.00
381	002572	索菲亚	100	3,218.00	0.00
382	600231	凌钢股份	880	3,106.40	0.00
383	603599	广信股份	200	2,872.00	0.00
384	603609	禾丰牧业	300	2,832.00	0.00
385	000049	德赛电池	100	2,822.00	0.00
386	000821	京山轻机	300	2,763.00	0.00
387	600452	涪陵电力	100	2,731.00	0.00
388	601991	大唐发电	900	2,727.00	0.00
389	000783	长江证券	500	2,715.00	0.00
390	600021	上海电力	400	2,696.00	0.00
391	600502	安徽水利	600	2,412.00	0.00
392	600614	鹏起科技	400	2,284.00	0.00

393	600022	山东钢铁	1,100	2,222.00	0.00
394	601818	光大银行	600	2,196.00	0.00
395	600483	福能股份	300	2,061.00	0.00
396	002449	国星光电	190	2,021.60	0.00
397	000732	泰禾集团	100	1,945.00	0.00
398	601369	陕鼓动力	300	1,920.00	0.00
399	000878	云南铜业	200	1,908.00	0.00
400	000970	中科三环	200	1,870.00	0.00
401	600012	皖通高速	300	1,788.00	0.00
402	002626	金达威	100	1,735.00	0.00
403	000910	大亚圣象	100	1,690.00	0.00
404	600628	新世界	200	1,436.00	0.00
405	002039	黔源电力	100	1,416.00	0.00
406	601328	交通银行	200	1,148.00	0.00
407	600208	新湖中宝	300	1,146.00	0.00
408	600037	歌华有线	100	1,032.00	0.00
409	002706	良信电器	150	981.00	0.00
410	300362	天翔环境	100	968.00	0.00
411	600000	浦发银行	100	956.00	0.00
412	300230	永利股份	180	927.00	0.00
413	601699	潞安环能	100	926.00	0.00
414	600958	东方证券	100	913.00	0.00
415	002472	双环传动	100	857.00	0.00
416	000667	美好置业	400	852.00	0.00
417	600029	南方航空	100	845.00	0.00
418	002064	华峰氨纶	200	826.00	0.00
419	600015	华夏银行	100	745.00	0.00
420	600705	中航资本	100	467.00	0.00
421	600567	山鹰纸业	100	386.00	0.00
422	000060	中金岭南	50	243.00	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	300059	东方财富	256,268.00	0.23
2	601939	建设银行	220,198.00	0.20
3	601998	中信银行	219,761.00	0.20
4	002001	新和成	197,711.00	0.18
5	300124	汇川技术	194,921.14	0.18
6	300136	信维通信	186,989.00	0.17

7	300003	乐普医疗	167,161.00	0.15
8	601288	农业银行	165,044.00	0.15
9	300122	智飞生物	159,207.00	0.14
10	002146	荣盛发展	148,718.00	0.13
11	300408	三环集团	148,499.15	0.13
12	300070	碧水源	141,479.00	0.13
13	300142	沃森生物	136,557.00	0.12
14	600383	金地集团	133,865.00	0.12
15	300015	爱尔眼科	133,586.00	0.12
16	300024	机器人	130,026.00	0.12
17	000061	农产品	124,980.00	0.11
18	000625	长安汽车	124,608.00	0.11
19	300274	阳光电源	118,448.00	0.11
20	000528	柳工	117,566.00	0.11

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	000651	格力电器	130,738.00	0.12
2	603816	顾家家居	118,182.00	0.11
3	601818	光大银行	116,972.00	0.11
4	601988	中国银行	116,434.00	0.11
5	601328	交通银行	116,388.00	0.11
6	000333	美的集团	113,786.00	0.10
7	000078	海王生物	113,607.00	0.10
8	000090	天健集团	103,835.00	0.09
9	601166	兴业银行	103,394.00	0.09
10	600201	生物股份	101,745.00	0.09
11	601939	建设银行	101,025.00	0.09
12	600826	兰生股份	97,290.00	0.09
13	600104	上汽集团	96,274.00	0.09
14	000066	中国长城	94,600.00	0.09
15	600000	浦发银行	90,797.00	0.08
16	000661	长春高新	90,442.00	0.08
17	600618	氯碱化工	87,843.00	0.08
18	600409	三友化工	85,908.00	0.08
19	600536	中国软件	85,692.00	0.08
20	600160	巨化股份	85,477.00	0.08

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	17,231,063.35
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	10,622,947.19
--------------	---------------

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	74,682,015.90	85.95
	其中：政策性金融债	74,682,015.90	85.95
4	企业债券	5,925,000.00	6.82
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	80,607,015.90	92.77

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开 1701	209,080	20,987,450.40	24.16
2	180205	18 国开 05	100,000	10,487,000.00	12.07
3	170211	17 国开 11	100,000	10,013,000.00	11.52
4	170207	17 国开 07	100,000	10,000,000.00	11.51
5	150223	15 国开 23	100,000	9,993,000.00	11.50

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	—
股指期货投资本期收益(元)	—

股指期货投资本期公允价值变动(元)	—
-------------------	---

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计（元）	—
国债期货投资本期收益（元）	—
国债期货投资本期公允价值变动（元）	—

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 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 申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。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,653.30
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,668,584.65
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,676,237.95

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
37	2,321,815.29	84,906,511.32	98.84	1,000,654.32	1.16

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	984.34	0.0011

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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	11.64	10,002,250.23	11.64	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	11.64	10,002,250.23	11.64	3年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年09月20日)基金份额总额	99,995,250.23
报告期期初基金份额总额	110,514,857.88
本报告期基金总申购份额	5,419,837.42
减：本报告期基金总赎回份额	30,027,529.66
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	85,907,165.64

§ 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

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。
本报告期本基金管理人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		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 (%)	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 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
海通证券	2	17,447,933.82	62.74	4,568,988.91	22.73	352,280,000.00	53.09	—	—	15,903.36	62.66	—
申万宏源	2	10,362,165.72	37.26	15,532,710.57	77.27	311,291,000.00	46.91	—	—	9,475.74	37.34	—

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司旗下基金 2017 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	公司网站	2018 年 01 月 02 日
2	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2018 年 02 月 02 日
3	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站	2018 年 02 月 06 日
4	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2018 年 02 月 07 日
5	关于富国基金管理有限公司旗下 91 只基金修订基金合同及托管协议等法律文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2018 年 03 月 24 日
6	富国基金管理有限公司关于增聘富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理的公告	中国证券报和公司网站	2018 年 04 月 03 日
7	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2018 年 06 月 19 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-------	----------------	------------

	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018-01-01 至 2018-06-30	40,000,250.23	-	-	40,000,250.23	46.56%
	2	2018-04-13 至 2018-06-30	19,999,000.00	-	-	19,999,000.00	23.28%
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							

§ 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国兴利增强债券型发起式证券投资基金的文件	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 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
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		
----------	--	--