

富国宝利增强债券型发起式证券投资基金

二〇二四年中期报告

2024年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024年08月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	6
2.1	基金基本情况	6
2.2	基金产品说明	6
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	8
§4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6	中期财务报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	17
6.3	净资产变动表	18
6.4	报表附注	19
§7	投资组合报告	43
7.1	期末基金资产组合情况	43

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	52
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	52
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12	投资组合报告附注.....	52
§8	基金份额持有人信息.....	58
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	58
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况.....	58
§9	开放式基金份额变动.....	59
§10	重大事件揭示.....	60
10.1	基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4	基金投资策略的改变.....	60
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8	其他重大事件.....	64
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	65
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	65
§12	备查文件目录.....	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国宝利增强债券型发起式证券投资基金
基金简称	富国宝利增强债券
基金主代码	005078
交易代码	005078
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年02月08日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,059,128,417.19份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	富国基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	赵瑛	王小飞
	联系电话	021-20361818	021-60637103
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	95105686、4008880688		021-60637228
传真	021-20361616		021-60635778
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层		北京市西城区金融大街25号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层		北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200120		100033
法定代表人	裴长江		张金良

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年01月01日至2024年06月30日)
本期已实现收益	-76,962,002.30
本期利润	26,762,046.08
加权平均基金份额本期利润	0.0090
本期加权平均净值利润率	0.73%
本期基金份额净值增长率	1.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)
期末可供分配利润	412,923,706.25
期末可供分配基金份额利润	0.2005
期末基金资产净值	2,545,923,512.07
期末基金份额净值	1.2364
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	27.64%

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.36%	0.19%	0.25%	0.05%	-0.61%	0.14%
过去三个月	0.81%	0.21%	0.75%	0.07%	0.06%	0.14%
过去六个月	1.29%	0.28%	2.31%	0.09%	-1.02%	0.19%
过去一年	-0.29%	0.25%	1.96%	0.09%	-2.25%	0.16%
过去三年	0.77%	0.27%	2.00%	0.11%	-1.23%	0.16%

自基金合同生效起至今	27.64%	0.28%	11.50%	0.12%	16.14%	0.16%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

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

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



注：1、截止日期为2024年6月30日。

2、本基金于2018年2月8日成立，建仓期6个月，从2018年2月8日起至2018年8月7日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈斯扬	本基金现任基金经理	2018-03-19	—	11	硕士，曾任交银施罗德基金管理有限公司研究员、投资经理；自 2016 年 10 月加入富国基金管理有限公司，历任定量投资经理；现任富国基金量化投资部定量基金经

					理。自 2018 年 03 月起任富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2018 年 03 月起任富国丰利增强债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2018 年 04 月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2024 年 03 月起任富国盛利增强债券型发起式证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国宝利增强债券型发起式证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本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7次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

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

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2024年6月30日，本基金份额净值为1.2364元；份额累计净值为1.2764元；本报告期，本基金份额净值增长率为1.29%，同期业绩比较基准收益率为2.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国宝利增强债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2024年06月 30日	上年度末 2023年12月31 日
资 产：		
货币资金	2,200,081.05	30,290,223.22
结算备付金	27,737,386.26	44,253,571.90
存出保证金	316,962.65	333,076.75
交易性金融资产	2,869,987,037.75	6,184,661,781.09
其中：股票投资	487,836,229.52	1,120,815,817.83
基金投资	—	—
债券投资	2,382,150,808.23	5,063,845,963.26
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	300,000.00	21,399,304.85
应收清算款	26,427,766.46	78,738,658.18
应收股利	—	—
应收申购款	199.84	199.84
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	2,926,969,434.01	6,359,676,815.83
负债和净资产	本期末 2024年06月 30日	上年度末 2023年12月31 日
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	350,393,376.84	673,215,611.97
应付清算款	28,215,186.89	49,404,689.88
应付赎回款	26,648.69	4,922,761.87
应付管理人报酬	864,640.98	2,274,756.51
应付托管费	216,160.25	568,689.15

应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—
应交税费	51,395.70	67,479.21
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	1,278,512.59	1,221,581.62
负债合计	381,045,921.94	731,675,570.21
净资产：		
实收基金	2,059,128,417.19	4,610,710,179.83
其他综合收益	—	—
未分配利润	486,795,094.88	1,017,291,065.79
净资产合计	2,545,923,512.07	5,628,001,245.62
负债和净资产总计	2,926,969,434.01	6,359,676,815.83

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2364 元，基金份额总额 2,059,128,417.19 份。

6.2 利润表

会计主体：富国宝利增强债券型发起式证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	41,943,321.81	145,119,357.09
1.利息收入	985,752.01	1,106,344.69
其中：存款利息收入	551,316.24	553,490.00
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	434,435.77	552,854.69
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	-62,981,822.76	19,703,526.75
其中：股票投资收益	-71,550,579.95	-51,653,935.80
基金投资收益	—	—
债券投资收益	2,551,146.58	56,857,699.81
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	6,017,610.61	14,499,762.74

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	—	—
其他投资收益	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	103,724,048.38	123,903,740.01
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	215,344.18	405,745.64
减：二、营业总支出	15,181,275.73	25,714,665.95
1. 管理人报酬	7,275,967.62	14,433,048.42
2. 托管费	1,818,991.92	3,608,262.13
3. 销售服务费	—	—
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	5,935,485.58	7,470,844.28
其中：卖出回购金融资产支出	5,935,485.58	7,470,844.28
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	34,746.24	84,770.27
8. 其他费用	116,084.37	117,740.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	26,762,046.08	119,404,691.14
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	26,762,046.08	119,404,691.14
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	26,762,046.08	119,404,691.14

6.3 净资产变动表

会计主体：富国宝利增强债券型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2024年01月01日至2024年06月30日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、上期期末净资产	4,610,710,179.83	1,017,291,065.79	5,628,001,245.62
二、本期期初净资产	4,610,710,179.83	1,017,291,065.79	5,628,001,245.62
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	—	-530,495,970.91	—
(一)、综合收益总额	—	26,762,046.08	26,762,046.08
(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)	—	-557,258,016.99	—
其中：1. 基金申购款	998,420,601.51	227,983,785.09	1,226,404,386.60
2. 基金赎回款	—	-785,241,802.08	—
(三)、本期向基金份额	3,550,002,364.15	—	4,335,244,166.23
	—	—	—

持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
（四）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	2,059,128,417.19	486,795,094.88	2,545,923,512.07
项目	上年度可比期间 (2023年01月01日至2023年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	6,022,680,595.05	1,329,446,412.22	7,352,127,007.27
二、本期期初净资产	6,022,680,595.05	1,329,446,412.22	7,352,127,007.27
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	—	-158,448,225.18	—
（一）、综合收益总额	1,144,041,417.17	119,404,691.14	1,302,489,642.35
（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）	—	-277,852,916.32	—
其中：1.基金申购款	1,144,041,417.17	751,823,304.60	1,421,894,333.49
2.基金赎回款	—	—	—
	4,303,162,932.99	1,029,676,220.92	5,332,839,153.91
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—
（四）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	4,878,639,177.88	1,170,998,187.04	6,049,637,364.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国宝利增强债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1252号《关于准予富国宝利增强债券型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管

理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2018 年 2 月 8 日生效，首次设立募集规模为 73,996,883.34 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

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

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和中期报告》》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

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

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

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

2 增值税

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

金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4 企业所得税

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

征企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5 个人所得税

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2024年06月30日)
活期存款	2,200,081.05

等于：本金	2,199,848.34
加：应计利息	232.71
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	2,200,081.05

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	493,738,850.24	—	487,836,229.52	—	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	1,372,822,502.32	14,292,472.16	1,385,244,870.27	—
	银行间市场	981,914,531.60	14,880,937.96	996,905,937.96	110,468.40
	合计	2,354,737,033.92	29,173,410.12	2,382,150,808.23	—
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	2,848,475,884.16	29,173,410.12	2,869,987,037.75	—	
				7,662,256.53	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	300,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	300,000.00	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	1,121,189.39
其中：交易所市场	1,113,136.89
银行间市场	8,052.50
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	97,323.20
合计	1,278,512.59

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,610,710,179.83	4,610,710,179.83
本期申购	998,420,601.51	998,420,601.51
本期赎回（以“-”号填列）	-3,550,002,364.15	-3,550,002,364.15
本期末	2,059,128,417.19	2,059,128,417.19

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	997,487,148.62	19,803,917.17	1,017,291,065.79
本期期初	997,487,148.62	19,803,917.17	1,017,291,065.79
本期利润	-76,962,002.30	103,724,048.38	26,762,046.08
本期基金份额交易产生的变动数	507,601,440.07	-49,656,576.92	-557,258,016.99

其中：基金申购款	192,942,093.65	35,041,691.44	227,983,785.09
基金赎回款	700,543,533.72	-84,698,268.36	-785,241,802.08
本期已分配利润	—	—	—
本期末	412,923,706.25	73,871,388.63	486,795,094.88

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
活期存款利息收入	86,939.22
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	413,731.90
其他	50,645.12
合计	551,316.24

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出股票成交总额	1,896,645,593.59
减：卖出股票成本总额	1,964,734,008.72
减：交易费用	3,462,164.82
买卖股票差价收入	-71,550,579.95

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
债券投资收益——利息收入	47,785,301.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-45,234,155.13
合计	2,551,146.58

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,068,771,773.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,041,386,824.43
减：应计利息总额	72,403,243.56

减：交易费用	215,860.29
买卖债券差价收入	-45,234,155.13

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
股票投资产生的股利收益	6,017,610.61
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	6,017,610.61

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
1. 交易性金融资产	103,724,048.38
股票投资	81,043,080.68
债券投资	22,680,967.70
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	103,724,048.38
----	----------------

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
基金赎回费收入	195,362.52
基金转换费收入	19,981.66
合计	215,344.18

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
审计费用	32,323.20
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	5,148.29
债券账户维护费	18,000.00
其他	612.88
合计	116,084.37

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构、基金发起人
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
富国鑫汇养老目标日期 2045 五年持有期混合	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券

型发起式基金中基金（FOF）	投资基金
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	132,697,067.23	4.22	500,131,882.21	8.58
申万宏源	79,929,404.20	2.54	430,714,992.50	7.39

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
海通证券	561,197,901.90	10.25	1,089,041,852.73	20.32
申万宏源	187,357,886.97	3.42	343,285,016.77	6.41

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）
-------	-----------------------------	----------------------------------

	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)
海通证券	1,422,500,000.00	2.96	8,483,200,000.00	20.14
申万宏源	1,453,700,000.00	3.03	1,000,900,000.00	2.38

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
海通证券	97,656.17	4.22	70,254.90	6.31
申万宏源	58,819.58	2.54	46,486.72	4.18
关联方名称	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
海通证券	360,750.55	8.58	360,750.55	22.38
申万宏源	310,675.86	7.39	310,675.86	19.28

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	7,275,967.62	14,433,048.42
其中：支付销售机构的客户维护费	139,776.25	481,370.66

应支付基金管理人的净管理费	7,136,191.37	13,951,677.76
---------------	--------------	---------------

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.4% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	1,818,991.92	3,608,262.13

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）
基金合同生效日（2018年02月08日）持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
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	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.49%	0.20%

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末（2024年06月30日）		上年度末（2023年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
富国鑫汇养老目标日期2045五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	3,483,145.74	0.17	3,483,145.74	0.08
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中	3,229,974.16	0.16	3,229,974.16	0.07

基金 (FOF)				
申万宏源证券有限公司	123,726,219.65	6.01	347,574,725.89	7.54

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	2,200,081.05	86,939.22	57,363,769.95	123,063.60

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
300630	普利制药	2024年05月06日	重大事项停牌	9.56	2024年07月08日	9.88	60,300.00	867,538.11	576,468.00	—

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 350,393,376.84 元，于 2024 年 7 月 1 日、2024 年 7 月 2 日、2024 年 7 月 10 日、2024 年 7 月 15 日、2024 年 10 月 11 日、2024 年 10 月 14 日、2024 年 10 月 16 日、2024 年 10 月 17 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
AAA	1,464,482,148.30	3,581,592,713.54
AAA以下	347,700,013.26	913,696,357.58
未评级	184,048,979.75	40,677,044.87
合计	1,996,231,141.31	4,535,966,115.99

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

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末及上年度末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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（2024年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	2,200,081.05	—	—	—	—	—	2,200,081.05
结算备付金	27,737,386.26	—	—	—	—	—	27,737,386.26
存出保证金	316,962.65	—	—	—	—	—	316,962.65
交易性金融资产	102,597,769.62	531,128,885.02	1,123,027,322.49	466,632,996.77	158,763,834.33	487,836,229.52	2,869,987,037.75
买入返售金融资产	300,000.00	—	—	—	—	—	300,000.00
应收清算款	—	—	—	—	—	26,427,766.46	26,427,766.46
应收申购款	—	—	—	—	—	199.84	199.84
资产总计	133,152,199.58	531,128,885.02	1,123,027,322.49	466,632,996.77	158,763,834.33	514,264,195.82	2,926,969,434.01
负债							
卖出回购金融资产款	335,669,770.15	—	14,723,606.69	—	—	—	350,393,376.84
应付清算款	—	—	—	—	—	28,215,186.89	28,215,186.89
应付赎回款	—	—	—	—	—	26,648.69	26,648.69
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	864,640.98	864,640.98
应付托管费	—	—	—	—	—	216,160.25	216,160.25
应交税费	—	—	—	—	—	51,395.70	51,395.70
其他负债	—	—	—	—	—	1,278,512.59	1,278,512.59
负债总计	335,669,770.15	—	14,723,606.69	—	—	30,652,545.10	381,045,921.94
利率敏感度缺口	-202,517,570.57	531,128,885.02	1,108,303,715.80	466,632,996.77	158,763,834.33	483,611,650.72	2,545,923,512.07
上年度末（2023年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产							
货币资金	30,290,223.22	—	—	—	—	—	30,290,223.22
结算备付金	44,253,571.90	—	—	—	—	—	44,253,571.90
存出保证金	333,076.75	—	—	—	—	—	333,076.75
交易性金融资产	601,404,822.77	860,195,048.59	2,826,469,235.75	775,776,856.15	—	1,120,815,817.83	6,184,661,781.09
买入返售金融资产	21,399,304.85	—	—	—	—	—	21,399,304.85
应收清算款	—	—	—	—	—	78,738,658.18	78,738,658.18
应收申购款	—	—	—	—	—	199.84	199.84
资产总计	697,680,999.49	860,195,048.59	2,826,469,235.75	775,776,856.15	—	1,199,554,675.85	6,359,676,815.83
负债							
卖出回购金融资产款	649,937,586.81	23,278,025.16	—	—	—	—	673,215,611.97
应付清算款	—	—	—	—	—	49,404,689.88	49,404,689.88
应付赎回款	—	—	—	—	—	4,922,761.87	4,922,761.87
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,274,756.51	2,274,756.51
应付托管费	—	—	—	—	—	568,689.15	568,689.15
应交税费	—	—	—	—	—	67,479.21	67,479.21
其他负债	—	—	—	—	—	1,221,581.62	1,221,581.62
负债总计	649,937,586.81	23,278,025.16	—	—	—	58,459,958.24	731,675,570.21
利率敏感度缺口	47,743,412.68	836,917,023.43	2,826,469,235.75	775,776,856.15	—	1,141,094,717.61	5,628,001,245.62

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
分析	1. 基准点利率增加 0.1%	-3,804,456.67	-7,489,557.46
	2. 基准点利率减少 0.1%	3,804,456.67	7,489,557.46

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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

律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票、存托凭证、权证的比例不超过基金资产的 20%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2024 年 06 月 30 日）		上年度末（2023 年 12 月 31 日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	487,836,229.52	19.16	1,120,815,817.83	19.91
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	2,382,150,808.23	93.57	5,063,845,963.26	89.98
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	2,869,987,037.75	112.73	6,184,661,781.09	109.89

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

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 06 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 市场基准增加 1%	7,190,754.37	13,413,504.86

	2. 市场基准减少 1%	-7, 190, 754. 37	-13, 413, 504. 86
--	--------------	------------------	-------------------

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 (2024年06月30日)	上年度末 (2023年12月31日)
第一层次	971, 013, 013. 41	2, 340, 422, 520. 29
第二层次	1, 898, 974, 024. 34	3, 844, 239, 260. 80
第三层次	—	—
合计	2, 869, 987, 037. 75	6, 184, 661, 781. 09

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	487,836,229.52	16.67
	其中：股票	487,836,229.52	16.67
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	2,382,150,808.23	81.39
	其中：债券	2,382,150,808.23	81.39
	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	300,000.00	0.01
	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	29,937,467.31	1.02
8	其他各项资产	26,744,928.95	0.91
9	合计	2,926,969,434.01	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	7,418,134.00	0.29
B	采矿业	13,563,632.00	0.53
C	制造业	278,915,075.05	10.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,326,600.00	0.60
E	建筑业	13,328,731.99	0.52
F	批发和零售业	4,272,774.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	12,430,061.18	0.49
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,684,145.20	1.21
J	金融业	101,179,188.10	3.97
K	房地产业	4,762,337.00	0.19
L	租赁和商务服务业	3,334,648.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	1,347,060.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	418,880.00	0.02
Q	卫生和社会工作	166,051.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	688,912.00	0.03
S	综合	—	—
	合计	487,836,229.52	19.16

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	600519	贵州茅台	15,349	22,522,969.11	0.88
2	601318	中国平安	322,135	13,323,503.60	0.52
3	300750	宁德时代	61,877	11,139,716.31	0.44
4	600030	中信证券	478,700	8,726,701.00	0.34
5	600887	伊利股份	322,000	8,320,480.00	0.33
6	601328	交通银行	1,110,000	8,291,700.00	0.33
7	601169	北京银行	1,390,700	8,121,688.00	0.32
8	002475	立讯精密	201,300	7,913,103.00	0.31
9	601166	兴业银行	437,200	7,703,464.00	0.30
10	601989	中国重工	1,520,500	7,496,065.00	0.29
11	300433	蓝思科技	406,500	7,418,625.00	0.29
12	000725	京东方A	1,735,849	7,099,622.41	0.28
13	600989	宝丰能源	395,000	6,845,350.00	0.27
14	600999	招商证券	485,270	6,750,105.70	0.27
15	600406	国电南瑞	265,740	6,632,870.40	0.26
16	300122	智飞生物	228,300	6,399,249.00	0.25
17	000338	潍柴动力	393,000	6,382,320.00	0.25
18	000651	格力电器	158,902	6,232,136.44	0.24
19	601766	中国中车	807,800	6,066,578.00	0.24
20	601728	中国电信	980,800	6,031,920.00	0.24
21	600036	招商银行	175,400	5,996,926.00	0.24
22	000568	泸州老窖	40,700	5,840,043.00	0.23
23	300498	温氏股份	294,300	5,833,026.00	0.23
24	600050	中国联通	1,233,000	5,795,100.00	0.23
25	603195	公牛集团	75,009	5,784,694.08	0.23
26	002001	新和成	300,300	5,765,760.00	0.23
27	000100	TCL科技	1,323,290	5,716,612.80	0.22
28	601668	中国建筑	1,050,429	5,577,777.99	0.22
29	600941	中国移动	51,800	5,568,500.00	0.22
30	600015	华夏银行	851,043	5,446,675.20	0.21
31	600104	上汽集团	378,731	5,249,211.66	0.21
32	300059	东方财富	494,500	5,221,920.00	0.21

33	002252	上海莱士	650,500	5,086,910.00	0.20
34	601600	中国铝业	661,600	5,048,008.00	0.20
35	600018	上港集团	779,691	4,506,613.98	0.18
36	600089	特变电工	321,001	4,452,283.87	0.17
37	601319	中国人保	858,300	4,420,245.00	0.17
38	601818	光大银行	1,327,100	4,206,907.00	0.17
39	600900	长江电力	142,200	4,112,424.00	0.16
40	002078	太阳纸业	293,700	4,097,115.00	0.16
41	601012	隆基绿能	287,228	4,026,936.56	0.16
42	000157	中联重科	520,100	3,994,368.00	0.16
43	600845	宝信软件	116,560	3,721,760.80	0.15
44	600219	南山铝业	952,400	3,628,644.00	0.14
45	601607	上海医药	188,600	3,604,146.00	0.14
46	000538	云南白药	65,916	3,371,603.40	0.13
47	601985	中国核电	315,100	3,358,966.00	0.13
48	601816	京沪高铁	618,700	3,322,419.00	0.13
49	600760	中航沈飞	81,800	3,280,180.00	0.13
50	002371	北方华创	10,200	3,262,878.00	0.13
51	600016	民生银行	852,800	3,232,112.00	0.13
52	000333	美的集团	49,200	3,173,400.00	0.12
53	002027	分众传媒	521,200	3,158,472.00	0.12
54	603501	韦尔股份	31,200	3,100,344.00	0.12
55	601669	中国电建	547,400	3,059,966.00	0.12
56	000858	五粮液	23,600	3,021,744.00	0.12
57	600489	中金黄金	194,400	2,877,120.00	0.11
58	688036	传音控股	36,974	2,829,989.96	0.11
59	601601	中国太保	99,900	2,783,214.00	0.11
60	002938	鹏鼎控股	68,000	2,703,680.00	0.11
61	002304	洋河股份	31,700	2,559,458.00	0.10
62	605499	东鹏饮料	11,800	2,545,850.00	0.10
63	300308	中际旭创	17,960	2,476,324.80	0.10
64	600183	生益科技	114,800	2,417,688.00	0.09
65	688981	中芯国际	52,123	2,402,870.30	0.09
66	600938	中国海油	71,700	2,366,100.00	0.09
67	601688	华泰证券	188,600	2,336,754.00	0.09
68	601899	紫金矿业	132,300	2,324,511.00	0.09
69	601231	环旭电子	144,100	2,312,805.00	0.09
70	600886	国投电力	125,200	2,283,648.00	0.09
71	600346	恒力石化	160,800	2,243,160.00	0.09
72	000596	古井贡酒	10,200	2,152,914.00	0.08
73	600919	江苏银行	286,300	2,127,209.00	0.08

74	601658	邮储银行	414,000	2,098,980.00	0.08
75	002241	歌尔股份	106,900	2,085,619.00	0.08
76	002240	盛新锂能	153,200	2,055,944.00	0.08
77	002736	国信证券	228,500	1,985,665.00	0.08
78	688009	中国通号	329,924	1,979,544.00	0.08
79	003816	中国广核	425,400	1,969,602.00	0.08
80	601857	中国石油	189,000	1,950,480.00	0.08
81	600048	保利发展	219,100	1,919,316.00	0.08
82	600926	杭州银行	145,720	1,901,646.00	0.07
83	600547	山东黄金	69,100	1,891,958.00	0.07
84	601800	中国交建	211,400	1,889,916.00	0.07
85	601156	东航物流	89,200	1,815,220.00	0.07
86	600019	宝钢股份	271,600	1,806,140.00	0.07
87	601838	成都银行	118,900	1,806,091.00	0.07
88	000617	中油资本	322,400	1,779,648.00	0.07
89	001979	招商蛇口	196,400	1,726,356.00	0.07
90	000786	北新建材	57,400	1,702,484.00	0.07
91	600362	江西铜业	71,700	1,697,856.00	0.07
92	301308	江波龙	17,600	1,667,424.00	0.07
93	600988	赤峰黄金	100,900	1,648,706.00	0.06
94	300316	晶盛机电	56,100	1,611,753.00	0.06
95	002463	沪电股份	43,600	1,591,400.00	0.06
96	600741	华域汽车	96,600	1,582,308.00	0.06
97	688506	百利天恒	8,700	1,578,180.00	0.06
98	603605	珀莱雅	14,200	1,576,058.00	0.06
99	600875	东方电气	82,700	1,525,815.00	0.06
100	688578	艾力斯	23,553	1,501,268.22	0.06
101	601058	赛轮轮胎	105,600	1,478,400.00	0.06
102	603160	汇顶科技	21,500	1,478,125.00	0.06
103	603871	嘉友国际	83,180	1,471,454.20	0.06
104	601390	中国中铁	223,800	1,459,176.00	0.06
105	002422	科伦药业	48,100	1,458,873.00	0.06
106	000423	东阿阿胶	23,000	1,439,800.00	0.06
107	300502	新易盛	13,600	1,435,480.00	0.06
108	688278	特宝生物	26,367	1,411,952.85	0.06
109	300573	兴齐眼药	8,580	1,407,120.00	0.06
110	688235	百济神州	12,132	1,405,370.88	0.06
111	688408	中信博	15,000	1,381,200.00	0.05
112	300724	捷佳伟创	25,500	1,377,255.00	0.05
113	300394	天孚通信	15,540	1,374,046.80	0.05
114	688516	奥特维	32,480	1,357,988.80	0.05

115	603338	浙江鼎力	22,400	1,353,408.00	0.05
116	002594	比亚迪	5,400	1,351,350.00	0.05
117	300492	华图山鼎	14,300	1,347,060.00	0.05
118	000998	隆平高科	136,600	1,342,778.00	0.05
119	002237	恒邦股份	115,100	1,324,801.00	0.05
120	002601	龙佰集团	71,300	1,324,041.00	0.05
121	000543	皖能电力	145,000	1,283,250.00	0.05
122	002847	盐津铺子	29,940	1,280,533.80	0.05
123	300979	华利集团	20,500	1,247,425.00	0.05
124	601398	工商银行	208,300	1,187,310.00	0.05
125	688147	微导纳米	44,200	1,100,580.00	0.04
126	300142	沃森生物	91,400	1,040,132.00	0.04
127	600642	申能股份	115,500	1,019,865.00	0.04
128	603198	迎驾贡酒	17,600	1,012,000.00	0.04
129	300601	康泰生物	64,500	1,006,845.00	0.04
130	000550	江铃汽车	46,200	1,003,002.00	0.04
131	002385	大北农	257,000	989,450.00	0.04
132	000002	万科A	137,200	950,796.00	0.04
133	600312	平高电气	48,300	939,435.00	0.04
134	002648	卫星化学	52,000	934,960.00	0.04
135	001965	招商公路	76,500	907,290.00	0.04
136	002466	天齐锂业	30,200	903,282.00	0.04
137	600703	三安光电	68,900	807,508.00	0.03
138	000521	长虹美菱	101,000	765,580.00	0.03
139	300017	网宿科技	95,200	752,080.00	0.03
140	600025	华能水电	67,200	724,416.00	0.03
141	000800	一汽解放	91,200	714,096.00	0.03
142	601868	中国能建	329,800	699,176.00	0.03
143	601229	上海银行	91,960	667,629.60	0.03
144	601117	中国化学	78,000	642,720.00	0.03
145	000630	铜陵有色	176,400	636,804.00	0.03
146	601009	南京银行	59,600	619,244.00	0.02
147	300001	特锐德	30,200	607,624.00	0.02
148	300630	普利制药	60,300	576,468.00	0.02
149	300857	协创数据	9,800	558,600.00	0.02
150	688111	金山办公	2,300	523,250.00	0.02
151	601019	山东出版	43,400	512,988.00	0.02
152	002128	电投能源	23,800	502,180.00	0.02
153	300383	光环新网	59,000	498,550.00	0.02
154	601877	正泰电器	26,000	495,560.00	0.02
155	000526	学大教育	6,800	418,880.00	0.02

156	688256	寒武纪	2,100	417,207.00	0.02
157	600893	航发动力	10,900	398,395.00	0.02
158	000625	长安汽车	27,900	374,697.00	0.01
159	600481	双良节能	76,500	357,255.00	0.01
160	002745	木林森	44,200	356,252.00	0.01
161	601988	中国银行	75,700	349,734.00	0.01
162	002139	拓邦股份	32,700	347,274.00	0.01
163	688472	阿特斯	34,100	347,138.00	0.01
164	600458	时代新材	34,300	346,430.00	0.01
165	002152	广电运通	32,600	340,996.00	0.01
166	688276	百克生物	12,000	340,440.00	0.01
167	002415	海康威视	10,600	327,646.00	0.01
168	600779	水井坊	8,700	327,381.00	0.01
169	600933	爱柯迪	22,100	326,859.00	0.01
170	000661	长春高新	3,500	321,195.00	0.01
171	688556	高测股份	26,800	318,652.00	0.01
172	002035	华帝股份	51,000	317,730.00	0.01
173	000999	华润三九	7,200	306,576.00	0.01
174	600023	浙能电力	39,500	280,845.00	0.01
175	603556	海兴电力	5,900	276,297.00	0.01
176	000913	钱江摩托	17,300	272,648.00	0.01
177	688223	晶科能源	34,900	247,790.00	0.01
178	603087	甘李药业	4,400	203,808.00	0.01
179	301391	卡莱特	4,500	197,010.00	0.01
180	301011	华立科技	11,800	181,838.00	0.01
181	600556	天下秀	48,800	177,632.00	0.01
182	688551	科威尔	5,600	176,400.00	0.01
183	300226	上海钢联	10,400	176,176.00	0.01
184	603466	风语筑	20,600	175,924.00	0.01
185	601298	青岛港	18,400	175,904.00	0.01
186	600350	山东高速	19,800	175,230.00	0.01
187	301078	孩子王	34,600	175,076.00	0.01
188	002860	星帅尔	21,300	174,447.00	0.01
189	002765	蓝黛科技	37,100	174,370.00	0.01
190	600398	海澜之家	18,800	173,712.00	0.01
191	605020	永和股份	9,000	172,620.00	0.01
192	603508	思维列控	9,200	172,500.00	0.01
193	603708	家家悦	21,200	171,932.00	0.01
194	301260	格力博	12,600	171,612.00	0.01
195	300687	赛意信息	12,300	171,216.00	0.01
196	301029	怡合达	8,700	171,042.00	0.01

197	002041	登海种业	21,100	170,488.00	0.01
198	603408	建霖家居	12,900	170,151.00	0.01
199	000589	贵州轮胎	33,400	169,338.00	0.01
200	688236	春立医疗	11,900	168,742.00	0.01
201	600803	新奥股份	8,100	168,480.00	0.01
202	301239	普瑞眼科	4,700	166,051.00	0.01
203	600998	九州通	34,000	165,920.00	0.01
204	601155	新城控股	18,700	165,869.00	0.01
205	603305	旭升集团	15,700	165,792.00	0.01
206	301291	明阳电气	5,500	165,275.00	0.01
207	600559	老白干酒	9,000	163,620.00	0.01
208	603688	石英股份	5,400	159,894.00	0.01
209	000555	神州信息	16,900	157,508.00	0.01
210	605266	健之佳	6,000	155,700.00	0.01
211	002777	久远银海	8,900	133,411.00	0.01
212	601137	博威合金	7,600	115,824.00	0.00
213	002153	石基信息	18,000	103,140.00	0.00
214	601916	浙商银行	34,100	94,116.00	0.00
215	600027	华电国际	11,200	77,728.00	0.00
216	300972	万辰集团	3,400	71,842.00	0.00
217	600276	恒瑞医药	1,600	61,536.00	0.00
218	601000	唐山港	11,900	55,930.00	0.00
219	000598	兴蓉环境	6,300	47,376.00	0.00
220	688076	诺泰生物	400	31,312.00	0.00
221	601225	陕西煤业	100	2,577.00	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	601318	中国平安	27,952,153.00	0.50
2	000625	长安汽车	24,208,118.42	0.43
3	000568	泸州老窖	21,393,137.00	0.38
4	601012	隆基绿能	20,271,913.32	0.36
5	300059	东方财富	15,138,460.00	0.27
6	002475	立讯精密	13,969,603.00	0.25
7	600219	南山铝业	13,764,343.00	0.24
8	600030	中信证券	13,753,639.00	0.24
9	002415	海康威视	13,505,612.00	0.24
10	300122	智飞生物	12,659,382.00	0.22
11	601857	中国石油	12,253,313.00	0.22

12	688981	中芯国际	12,226,009.69	0.22
13	600887	伊利股份	11,992,960.00	0.21
14	002466	天齐锂业	11,702,633.70	0.21
15	603195	公牛集团	11,590,457.88	0.21
16	300760	迈瑞医疗	11,566,117.00	0.21
17	300014	亿纬锂能	11,534,547.38	0.20
18	603501	韦尔股份	11,424,899.00	0.20
19	601989	中国重工	11,159,369.00	0.20
20	601166	兴业银行	11,053,227.00	0.20

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	600519	贵州茅台	47,053,511.00	0.84
2	601318	中国平安	30,763,964.00	0.55
3	000625	长安汽车	26,582,673.28	0.47
4	603993	洛阳钼业	23,754,088.20	0.42
5	601766	中国中车	19,251,989.00	0.34
6	000725	京东方 A	19,211,489.00	0.34
7	000858	五粮液	19,012,476.88	0.34
8	600690	海尔智家	18,909,504.00	0.34
9	600887	伊利股份	18,703,550.84	0.33
10	600276	恒瑞医药	17,795,867.95	0.32
11	000338	潍柴动力	17,262,218.00	0.31
12	000568	泸州老窖	16,595,990.00	0.29
13	601006	大秦铁路	16,494,567.00	0.29
14	601012	隆基绿能	16,180,238.46	0.29
15	300760	迈瑞医疗	15,743,280.30	0.28
16	600219	南山铝业	15,348,431.10	0.27
17	600438	通威股份	15,286,604.00	0.27
18	000651	格力电器	15,204,461.00	0.27
19	002415	海康威视	15,102,198.00	0.27
20	002001	新和成	15,023,680.80	0.27

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,250,711,339.73
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	1,896,645,593.59
--------------	------------------

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	250,942,131.32	9.86
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,074,447,521.70	42.20
	其中：政策性金融债	134,977,535.60	5.30
4	企业债券	532,653,334.27	20.92
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	31,010,393.44	1.22
7	可转债（可交换债）	493,097,427.50	19.37
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,382,150,808.23	93.57

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	1928021	19 农业银行永续债 01	1,100,000	114,534,440.44	4.50
2	1928036	19 中信银行永续债	1,100,000	113,622,967.21	4.46
3	188639	国电投 10	1,000,000	102,225,830.14	4.02
4	188608	21 中证 12	1,000,000	102,208,345.21	4.01
5	230023	23 付息国债 23	850,000	95,787,475.41	3.76

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国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，中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中信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，中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚，在报告期内曾被中国证券监督管理委员会立案调查。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	316,962.65
2	应收清算款	26,427,766.46
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	199.84
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	26,744,928.95

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113053	隆 22 转债	16,992,309.48	0.67
2	113050	南银转债	11,451,377.22	0.45
3	128109	楚江转债	11,071,680.23	0.43
4	123107	温氏转债	10,745,848.35	0.42
5	110079	杭银转债	10,713,261.23	0.42
6	127049	希望转 2	10,665,940.39	0.42
7	118034	晶能转债	10,541,344.85	0.41

8	113602	景 20 转债	10,467,543.78	0.41
9	113669	景 23 转债	10,208,984.72	0.40
10	111010	立昂转债	10,142,993.38	0.40
11	118024	冠宇转债	10,137,509.77	0.40
12	110059	浦发转债	9,942,427.35	0.39
13	113065	齐鲁转债	9,907,532.84	0.39
14	113052	兴业转债	9,853,218.97	0.39
15	113042	上银转债	9,760,007.30	0.38
16	113056	重银转债	9,644,190.11	0.38
17	113632	鹤 21 转债	9,641,036.48	0.38
18	127032	苏行转债	9,523,260.32	0.37
19	132026	G 三峡 EB2	9,344,175.61	0.37
20	123119	康泰转 2	9,146,027.57	0.36
21	113651	松霖转债	9,106,322.99	0.36
22	113045	环旭转债	8,989,956.70	0.35
23	113619	世运转债	8,979,391.75	0.35
24	118031	天 23 转债	8,834,794.81	0.35
25	113623	风 21 转债	8,669,231.51	0.34
26	127052	西子转债	8,607,165.02	0.34
27	113652	伟 22 转债	7,848,813.16	0.31
28	123170	南电转债	7,841,402.52	0.31
29	127015	希望转债	7,652,592.00	0.30
30	128136	立讯转债	7,128,875.14	0.28
31	113658	密卫转债	7,119,489.02	0.28
32	127045	牧原转债	6,982,611.21	0.27
33	113068	金铜转债	6,717,664.70	0.26
34	123145	药石转债	6,670,407.24	0.26
35	127022	恒逸转债	6,565,776.67	0.26
36	113616	韦尔转债	5,923,271.24	0.23
37	113672	福蓉转债	5,860,139.49	0.23
38	113673	岱美转债	5,785,393.90	0.23
39	111002	特纸转债	5,614,709.31	0.22

40	113627	太平转债	5,531,157.02	0.22
41	123208	孩王转债	5,321,343.51	0.21
42	123035	利德转债	4,971,599.23	0.20
43	127016	鲁泰转债	4,759,531.16	0.19
44	127098	欧晶转债	4,572,550.64	0.18
45	123184	天阳转债	4,571,363.96	0.18
46	127095	广泰转债	4,560,790.50	0.18
47	123213	天源转债	4,446,882.11	0.17
48	127067	恒逸转2	4,312,736.19	0.17
49	118030	睿创转债	4,207,000.82	0.17
50	113638	台21转债	4,092,525.93	0.16
51	123228	震裕转债	4,081,315.64	0.16
52	123133	佩蒂转债	3,888,282.86	0.15
53	110074	精达转债	3,877,075.95	0.15
54	118004	博瑞转债	3,847,837.72	0.15
55	128087	孚日转债	3,834,476.56	0.15
56	123113	仙乐转债	3,819,090.00	0.15
57	123224	宇邦转债	3,812,148.01	0.15
58	123115	捷捷转债	3,700,784.30	0.15
59	123191	智尚转债	3,641,756.71	0.14
60	110076	华海转债	3,615,371.52	0.14
61	123188	水羊转债	3,258,504.30	0.13
62	123101	拓斯转债	3,170,381.12	0.12
63	113021	中信转债	3,038,902.56	0.12
64	127031	洋丰转债	2,977,933.02	0.12
65	118037	上声转债	2,808,244.61	0.11
66	113024	核建转债	2,795,373.69	0.11
67	123233	凯盛转债	2,746,699.10	0.11
68	113639	华正转债	2,672,694.52	0.10
69	118041	星球转债	2,438,281.75	0.10
70	123117	健帆转债	2,349,019.12	0.09
71	123120	隆华转债	2,253,247.11	0.09

72	110083	苏租转债	2,177,729.43	0.09
73	123235	亿田转债	2,022,929.78	0.08
74	123090	三诺转债	1,719,608.55	0.07
75	113656	嘉诚转债	1,683,978.27	0.07
76	128141	旺能转债	1,520,883.81	0.06
77	118033	华特转债	1,117,717.81	0.04
78	127082	亚科转债	1,116,517.31	0.04
79	110093	神马转债	934,862.22	0.04
80	123178	花园转债	834,152.40	0.03
81	123064	万孚转债	788,098.90	0.03
82	113676	荣23转债	714,690.32	0.03
83	113534	鼎胜转债	691,561.52	0.03
84	127053	豪美转债	682,676.23	0.03
85	128131	崇达转2	664,958.63	0.03
86	111007	永和转债	554,997.29	0.02
87	123108	乐普转2	531,228.77	0.02
88	123050	聚飞转债	495,675.22	0.02
89	127077	华宏转债	493,117.36	0.02
90	123022	长信转债	454,556.89	0.02
91	127043	川恒转债	432,102.81	0.02
92	127062	垒知转债	427,372.86	0.02
93	113054	绿动转债	419,373.72	0.02
94	113046	金田转债	309,272.20	0.01
95	128071	合兴转债	273,894.06	0.01
96	127086	恒邦转债	260,543.61	0.01
97	127083	山路转债	243,283.10	0.01
98	113662	豪能转债	225,632.02	0.01
99	127070	大中转债	147,962.61	0.01
100	127017	万青转债	127,319.65	0.01
101	110082	宏发转债	50,273.63	0.00
102	113051	节能转债	40,603.78	0.00
103	113067	燃23转债	11,122.07	0.00

104	127030	盛虹转债	10,408.30	0.00
105	111008	沿浦转债	9,528.55	0.00
106	123127	耐普转债	7,500.53	0.00
107	123198	金埔转债	7,385.45	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
2,872	716,966.72	2,047,196,117.68	99.42	11,932,299.51	0.58

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	111,790.23	0.0054

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数(份)	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数(份)	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.49	10,000,000.00	0.49	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	123,726,219.65	6.01	—	—	—
其他	6,713,119.90	0.33	—	—	—
合计	140,439,339.55	6.82	10,000,000.00	0.49	3年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年02月08日)基金份额总额	73,996,883.34
报告期期初基金份额总额	4,610,710,179.83
本报告期基金总申购份额	998,420,601.51
减：本报告期基金总赎回份额	3,550,002,364.15
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	2,059,128,417.19

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内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

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
渤海证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	3	221,630,232.64	7.05	163,098.12	7.05	—
东北证券	2	171,993,257.03	5.47	126,569.90	5.47	—
东财证券	2	49,726,720.00	1.58	36,593.94	1.58	—
方正证券	2	546,113,518.33	17.38	401,887.91	17.38	—
高盛中国	1	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—
广发证券	2	304,775,203.36	9.70	224,281.54	9.70	—
国海证券	2	—	—	—	—	—
国盛证券	2	396,754,503.32	12.63	291,970.43	12.63	—
国泰君安	2	60,678,517.72	1.93	44,653.75	1.93	—
国投证券	2	—	—	—	—	—
国信证券	2	35,494,503.12	1.13	26,120.04	1.13	—
海通证券	2	132,697,067.23	4.22	97,656.17	4.22	—
华泰证券	1	110,326,785.88	3.51	81,189.50	3.51	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	79,929,404.20	2.54	58,819.58	2.54	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	304,210,214.78	9.68	223,867.65	9.68	—
西南证券	2	13,689,584.00	0.44	10,074.21	0.44	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—
信达证券	2	136,021,317.58	4.33	100,098.49	4.33	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—

招商证券	1	40,051,103.00	1.27	29,474.45	1.27	—
中航证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	151,765,179.34	4.83	111,684.50	4.83	—
中泰证券	2	54,937,555.70	1.75	40,428.46	1.75	—
中信建投	1	33,669,843.90	1.07	24,777.17	1.07	—
中信证券	4	297,727,525.96	9.48	219,093.23	9.47	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

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。本报告期本基金退租券商交易单元：德邦证券（012561）。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
渤海证券	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	202,396,343.84	3.70	1,427,134,000.00	2.97	—	—
东北证券	133,474,042.51	2.44	1,250,000,000.00	2.60	—	—
东财证券	72,512,297.07	1.32	2,064,700,000.00	4.30	—	—
方正证券	254,445,855.03	4.65	1,368,500,000.00	2.85	—	—
高盛中国	—	—	—	—	—	—
光大证券	31,732,518.57	0.58	109,000,000.00	0.23	—	—
广发证券	411,787,149.36	7.52	4,986,426,000.00	10.38	—	—
国海证券	127,730,871.89	2.33	1,149,500,000.00	2.39	—	—
国盛证券	1,084,613,687.89	19.82	8,552,643,000.00	17.80	—	—
国泰君安	102,520,923.29	1.87	317,500,000.00	0.66	—	—
国投证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	56,200,336.64	1.03	343,800,000.00	0.72	—	—
海通证券	561,197,901.90	10.25	1,422,500,000.00	2.96	—	—
华泰证券	245,876,533.87	4.49	682,800,000.00	1.42	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—

上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	187,357,886.97	3.42	1,453,700,000.00	3.03	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	605,204,765.82	11.06	3,880,200,000.00	8.08	—	—
西南证券	34,433,375.28	0.63	77,416,000.00	0.16	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	197,515,596.31	3.61	1,191,100,000.00	2.48	—	—
兴业证券	114,954,617.59	2.10	1,560,000,000.00	3.25	—	—
招商证券	24,100,889.80	0.44	87,000,000.00	0.18	—	—
中航证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	201,084,344.40	3.67	2,010,300,000.00	4.18	—	—
中泰证券	65,380,109.75	1.19	185,900,000.00	0.39	—	—
中信建投	111,002,997.35	2.03	217,400,000.00	0.45	—	—
中信证券	647,712,686.78	11.83	13,706,338,000.00	28.53	—	—
中银证券	—	—	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

注：本基金本报告期无需要说明的重大事件。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024-02-06 至 2024-05-28	716,826,842.41	—	716,826,842.41	—	—
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宝利增强债券型发起式证券投资基金的文件	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 。
2、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金基金合同		
3、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金托管协议		
4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件		
5、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金财务报表及报表附注		
6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告		