

富国盛利增强债券型发起式证券投资基金

二〇二五年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国农业银行股份有限公司

送出日期： 2025 年 08 月 30 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 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.....	7
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.....	9
§ 4	管理人报告	14
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	16
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§ 5	托管人报告	19
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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	19
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.....	19
§ 6	中期财务报告（未经审计）	20
6.1	资产负债表.....	20
6.2	利润表.....	21
6.3	净资产变动表.....	22
6.4	报表附注.....	23
§ 7	投资组合报告	53

7.1	期末基金资产组合情况.....	53
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	53
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.....	54
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	66
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.....	67
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..	67
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..	67
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.....	67
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	67
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	67
7.12	本报告期投资基金情况.....	68
7.13	投资组合报告附注.....	69
§ 8	基金份额持有人信息	72
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	72
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
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.....	72
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况.....	72
§ 9	开放式基金份额变动	74
§ 10	重大事件揭示.....	75
10.1	基金份额持有人大会决议.....	75
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.....	75
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	75
10.4	基金投资策略的改变.....	75
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	75
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	75
10.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	75
10.8	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	75
10.9	其他重大事件.....	78
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	79
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	79
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	79
§ 12	备查文件目录.....	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国盛利增强债券型发起式证券投资基金		
基金简称	富国盛利增强债券发起式		
基金主代码	020811		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2024 年 03 月 18 日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	42,258,203.36 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	富国盛利增强债券发起式 A	富国盛利增强债券发起式 C	富国盛利增强债券发起式 E
下属分级基金的交易代码	020811	020812	022357
报告期末下属分级基金的份额总额	21,948,525.96 份	13,960,539.70 份	6,349,137.70 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	任航
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		裴长江	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告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 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国盛利增强债券发起式 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	1,080,447.97
本期利润	634,329.94
加权平均基金份额本期利润	0.0198
本期加权平均净值利润率	1.92%
本期基金份额净值增长率	2.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	1,124,460.71
期末可供分配基金份额利润	0.0512
期末基金资产净值	23,072,986.67
期末基金份额净值	1.0512
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	5.12%

(2) 富国盛利增强债券发起式 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	485,390.14
本期利润	200,603.72
加权平均基金份额本期利润	0.0142
本期加权平均净值利润率	1.38%
本期基金份额净值增长率	2.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	657,239.42
期末可供分配基金份额利润	0.0471
期末基金资产净值	14,617,779.12
期末基金份额净值	1.0471
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	4.71%

(3) 富国盛利增强债券发起式 E

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	29,232.27
本期利润	22,465.13
加权平均基金份额本期利润	0.0308
本期加权平均净值利润率	2.95%
本期基金份额净值增长率	2.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	323,209.85
期末可供分配基金份额利润	0.0509
期末基金资产净值	6,672,347.55
期末基金份额净值	1.0509
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	3.61%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国盛利增强债券发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.86%	0.09%	1.02%	0.13%	-0.16%	-0.04%
过去三个月	1.63%	0.17%	1.51%	0.25%	0.12%	-0.08%
过去六个月	2.18%	0.16%	1.18%	0.24%	1.00%	-0.08%
过去一年	4.84%	0.20%	6.91%	0.29%	-2.07%	-0.09%
自基金合同生效起至今	5.12%	0.18%	6.63%	0.27%	-1.51%	-0.09%

(2) 富国盛利增强债券发起式 C

阶段	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准收益	①—③	②—④
----	--------	--------	--------	----------	-----	-----

	率①	率标准 差②	收益率 ③	率标准差 ④		
过去一个月	0.84%	0.09%	1.02%	0.13%	-0.18%	-0.04%
过去三个月	1.57%	0.17%	1.51%	0.25%	0.06%	-0.08%
过去六个月	2.04%	0.16%	1.18%	0.24%	0.86%	-0.08%
过去一年	4.53%	0.20%	6.91%	0.29%	-2.38%	-0.09%
自基金合同生效 起至今	4.71%	0.18%	6.63%	0.27%	-1.92%	-0.09%

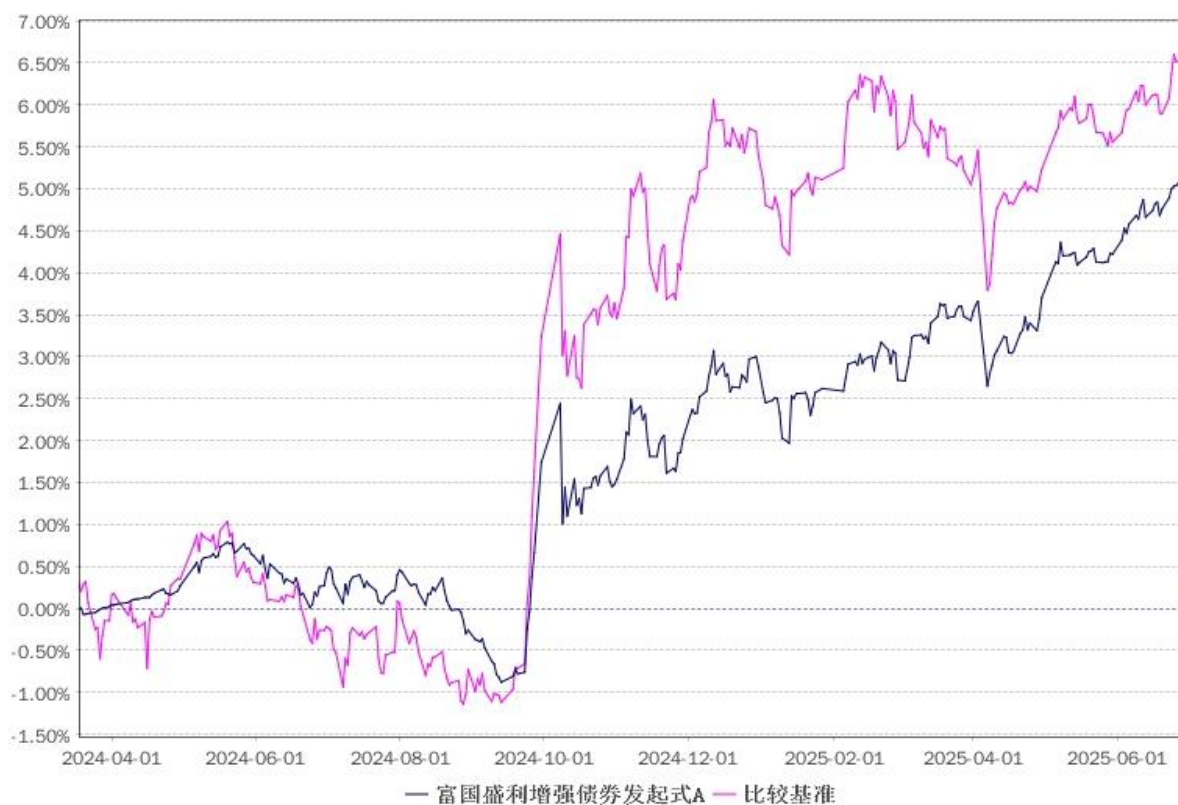
(3) 富国盛利增强债券发起式 E

阶段	份额净 值增长 率①	份额净 值增长 率标准 差②	业绩比 较基准 收益率 ③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去一个月	0.86%	0.09%	1.02%	0.13%	-0.16%	-0.04%
过去三个月	1.62%	0.17%	1.51%	0.25%	0.11%	-0.08%
过去六个月	2.16%	0.16%	1.18%	0.24%	0.98%	-0.08%
自基金分级生效 日起至今	3.61%	0.16%	3.14%	0.24%	0.47%	-0.08%

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

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

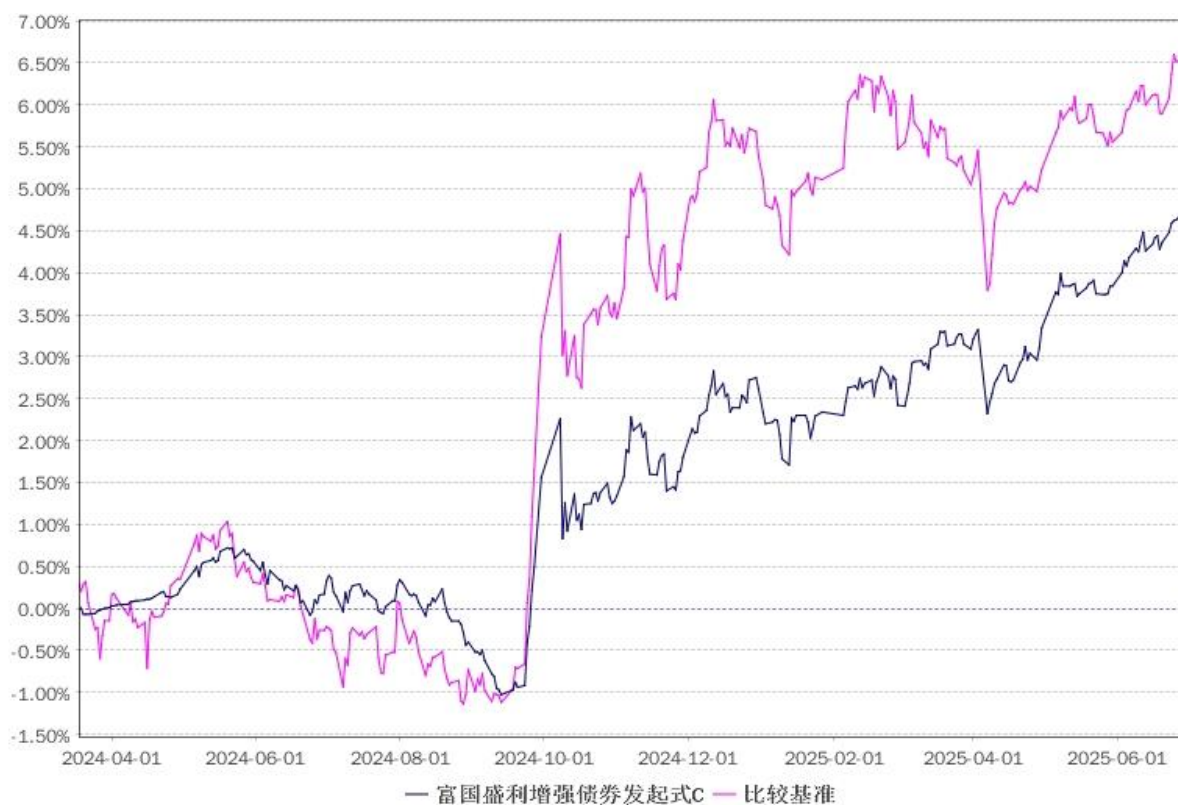
(1) 自基金合同生效以来富国盛利增强债券发起式 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2024 年 3 月 18 日成立，建仓期 6 个月，从 2024 年 3 月 18 日起至 2024 年 9 月 17 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

（2）自基金合同生效以来富国盛利增强债券发起式 C 基金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 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2024 年 3 月 18 日成立，建仓期 6 个月，从 2024 年 3 月 18 日起至 2024 年 9 月 17 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

（3）自基金合同生效以来富国盛利增强债券发起式 E 基金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 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2024 年 10 月 18 日起增加 E 类份额，相关数据按实际存续期计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安（以下简称“存续公司”）承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持本公司股权亦归属于存续公司，即存续公司成为本公司的主要股东。根据 2025 年 4 月 4 日《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，存续公司正式更名为“国泰海通证券股份有限公司”。

截至 2025 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 391 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈斯扬	本基金现任基金经理	2024-03-18	—	12	硕士，曾任交银施罗德基金管理有限公司研究员、投资经理；自 2016 年 10 月加入富国基金管理有限公司，历任定量投资经理、定量基金经理；现任富国基金量化投资部债券投资总监助理兼定量基金经理。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盛利增强债券型发起式证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国盛利增强债券型发起式证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和相关法规要求，制定了《证券投资公平交易管理办法》，保证公司旗下不同投资组合在系统控制、日常操作层面享有公平的交易机会，并保持各投资组合的独立投资决策权。

本报告期内公司旗下基金严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间，出现 34 次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况，为投资组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平对待投资组合或利益输送等情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内市场经历了一轮快跌后的反转修复，风险资产普遍回到年内高点位置，驱动力一方面来自于全球关税事件冲击和随后的预期修复，另一方面也来自于国内自身的经济企稳改善和包括 AI 模型在内的科技领域进步。中国资产的估值折价逐渐被修复，市场信心得到进一步提振。

在策略方面，组合的权益仓位维持指数增强的配置，上半年市场风格从红利切换到科技，随后海外事件冲击再度引发了风格的反转，指增策略因此受到了一定的挑战，不过模型在克服这段波折后，整体超额收益还是稳健回升的。

组合的转债仓位继续运用择券模型，但挑战较大的还是整个转债市场估值逐渐走高的状况，一方面使得资产性价比显著不及去年四季度，一方面也使得择券的难度在提升。但整体而言，上半年转债资产的表现还是较为突出的，无论是权重银行板块还是数量占比较大的小市值风格，都贡献了不错的收益。

组合的纯债方面，继续在维持信用底仓配置的同时，择机参与了利率的交易。

上半年利率出现了一波较大的回调和震荡，使得去年以来的利率下行趋势有戛然而止的势头，组合依据模型上的变化，也及时调整了组合久期的暴露，使得上半年纯债整体上表现稳健。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金份额净值富国盛利增强债券发起式 A 为 1.0512 元，富国盛利增强债券发起式 C 为 1.0471 元，富国盛利增强债券发起式 E 为 1.0509 元；份额累计净值富国盛利增强债券发起式 A 为 1.0512 元，富国盛利增强债券发起式 C 为 1.0471 元，富国盛利增强债券发起式 E 为 1.0509 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国盛利增强债券发起式 A 为 2.18%，富国盛利增强债券发起式 C 为 2.04%，富国盛利增强债券发起式 E 为 2.16%；同期业绩比较基准收益率情况：富国盛利增强债券发起式 A 为 1.18%，富国盛利增强债券发起式 C 为 1.18%，富国盛利增强债券发起式 E 为 1.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前国内风险资产的修复更多还是以权益资产估值抬升的方式来实现的，盈利层面仍有待改善，不过货币和财政政策维持积极，政策在供给端推动反内卷，在需求端推动包括雅江水电站在内的重大基建项目，合力之下有望推动工业品价格的回升和企业盈利的改善，如果逻辑逐渐得到印证，市场的风险偏好仍有抬升的空间。

策略端，组合的权益仓位继续维持指数增强配置；转债或视估值水平的进一步动向调整仓位权重，后续高估值仍然是转债市场面临的最大挑战，也使得市场的脆弱性有所积累，不过若正股能延续趋势性的上行，估值也有可能会进入被动压缩的正向循环，但当前我们只能拭目以待；纯债仓位继续维持灵活的交易操作，目前利率水平在绝对低位，通胀水平又存在低位回升的潜在可能，对债券市场可能是较大的潜在威胁，因此组合久期有必要保持灵活的调整空间，以应对未来变化。

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。

基金合同生效三年后继续存续的，自基金合同生效满三年后的基金存续期内，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，基金管理人应当在十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 中期财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国盛利增强债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	125,180.42	137,116.98
结算备付金	455,547.41	855,644.31
存出保证金	16,859.44	29,419.53
交易性金融资产	44,393,446.02	80,860,879.43
其中：股票投资	6,899,386.70	13,420,169.40
基金投资	—	—
债券投资	37,494,059.32	67,440,710.03
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	500,000.00	599,735.93
应收清算款	1,133,766.10	3,100,528.14
应收股利	—	—
应收申购款	—	530.97
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	46,624,799.39	85,583,855.29
负债和净资产	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	1,000,000.00	-203.83
应付清算款	1,114,575.53	3,000,434.51
应付赎回款	20,947.33	103,649.76
应付管理人报酬	12,202.84	29,140.38
应付托管费	3,050.72	7,285.08
应付销售服务费	2,730.02	8,819.16
应付投资顾问费	—	—
应交税费	223.94	336.77
应付利润	—	—

递延所得税负债	—	—
其他负债	107,955.67	93,883.07
负债合计	2,261,686.05	3,243,344.90
净资产：		
实收基金	42,258,203.36	80,117,445.02
其他综合收益	—	—
未分配利润	2,104,909.98	2,223,065.37
净资产合计	44,363,113.34	82,340,510.39
负债和净资产总计	46,624,799.39	85,583,855.29

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0498 元，基金份额总额 42,258,203.36 份。其中：富国盛利增强债券发起式 A 份额净值 1.0512 元，份额总额 21,948,525.96 份；富国盛利增强债券发起式 C 份额净值 1.0471 元，份额总额 13,960,539.70 份；富国盛利增强债券发起式 E 份额净值 1.0509 元，份额总额 6,349,137.70 份。

6.2 利润表

会计主体：富国盛利增强债券型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2024 年 3 月 18 日 (基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日)
一、营业总收入	1,098,475.09	7,146,048.76
1. 利息收入	13,831.53	4,609,569.17
其中：存款利息收入	2,259.02	336,765.74
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	11,572.51	4,272,803.43
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,822,306.87	3,468,457.81
其中：股票投资收益	497,708.45	188,331.48
基金投资收益	—	—
债券投资收益	1,229,988.32	2,561,326.46
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	94,610.10	718,799.87
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）	-737,671.59	-932,516.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	8.28	537.95
减：二、营业总支出	241,076.30	2,160,200.54
1. 管理人报酬	97,041.73	1,241,664.23
2. 托管费	24,260.45	310,416.04
3. 销售服务费	22,050.75	416,405.54
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	46,213.10	117,519.44
其中：卖出回购金融资产支出	46,213.10	117,519.44
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	354.50	8,644.94
8. 其他费用	51,155.77	65,550.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	857,398.79	4,985,848.22
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	857,398.79	4,985,848.22
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	857,398.79	4,985,848.22

6.3 净资产变动表

会计主体：富国盛利增强债券型发起式证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2025年01月01日至2025年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	80,117,445.02	2,223,065.37	82,340,510.39
二、本期期初净资产	80,117,445.02	2,223,065.37	82,340,510.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	— 37,859,241.66	-118,155.39	— 37,977,397.05
（一）、综合收益总额	—	857,398.79	857,398.79
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	— 37,859,241.66	-975,554.18	— 38,834,795.84
其中：1. 基金申购款	16,167,148.76	696,616.06	16,863,764.82
2. 基金赎回款	— 54,026,390.42	-1,672,170.24	— 55,698,560.66
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”	—	—	—

号填列)			
(四)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	42,258,203.36	2,104,909.98	44,363,113.34
项目	上年度可比期间(2024年3月18日(基金合同生效日)至2024年6月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、本期期初净资产	2,616,539,971.88	—	2,616,539,971.88
二、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,364,679,666.92	559,426.41	2,364,120,240.51
(一)、综合收益总额	—	4,985,848.22	4,985,848.22
(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)	2,364,679,666.92	-4,426,421.81	2,369,106,088.73
其中:1.基金申购款	2,781,576.79	17,214.99	2,798,791.78
2.基金赎回款	2,367,461,243.71	-4,443,636.80	2,371,904,880.51
(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	251,860,304.96	559,426.41	252,419,731.37

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
_____	_____	_____
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国盛利增强债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]215号文《关于准予富国盛利增强债券型发起式证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人富国基金管理有限公司自2024年3月1日至2024年3月14日止期间向社会

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

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

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

基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，本基金对股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产及可转

换债券、分离交易可转债、可交换债券资产的合计投资比例不超过基金资产的20%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%；本基金持有其他基金，其市值不超过基金资产净值的10%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：

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

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

本基金业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率 $\times$ 80%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算） $\times$ 2%+中证全指指数收益率 $\times$ 18%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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2025年6月30日的财务状况以及2025年1月1日至2025年6月30日止期间的经营成

果和净资产变动情况。

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

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

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

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

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

2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》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）及地方教育附加。

4 企业所得税

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

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

5 个人所得税

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

起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

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

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

6 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2025年06月30日)
活期存款	125,180.42
等于：本金	125,020.68
加：应计利息	159.74
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	125,180.42

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（2025年06月30日）			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		6,785,807.88	—	6,899,386.70	113,578.82
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	16,773,624.93	108,967.94	16,892,870.28	10,277.41
	银行间市场	20,548,480.00	391,189.04	20,601,189.04	-338,480.00
	合计	37,322,104.93	500,156.98	37,494,059.32	-328,202.59
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		44,107,912.81	500,156.98	44,393,446.02	-214,623.77

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（2025年06月30日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	500,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	500,000.00	—

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（2025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	26,028.75
其中：交易所市场	25,388.75
银行间市场	640.00
应付利息	—
预提信息披露费	20,000.00
预提审计费	61,926.92
合计	107,955.67

6.4.7.7 实收基金

富国盛利增强债券发起式 A：

金额单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	47,553,171.97	47,553,171.97
本期申购	3,735,427.53	3,735,427.53
本期赎回（以“-”号填列）	-29,340,073.54	-29,340,073.54
本期末	21,948,525.96	21,948,525.96

富国盛利增强债券发起式 C：

金额单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,563,287.15	32,563,287.15
本期申购	6,083,569.43	6,083,569.43
本期赎回（以“-”号填列）	-24,686,316.88	-24,686,316.88
本期末	13,960,539.70	13,960,539.70

富国盛利增强债券发起式 E：

金额单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	985.90	985.90
本期申购	6,348,151.80	6,348,151.80
本期赎回（以“-”号填列）	—	—

本期末	6,349,137.70	6,349,137.70
-----	--------------	--------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

富国盛利增强债券发起式 A:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,170,506.20	197,820.99	1,368,327.19
本期期初	1,170,506.20	197,820.99	1,368,327.19
本期利润	1,080,447.97	-446,118.03	634,329.94
本期基金份额交易产生的变动数	-1,001,307.20	123,110.78	-878,196.42
其中：基金申购款	168,629.50	-27,729.22	140,900.28
基金赎回款	-1,169,936.70	150,840.00	-1,019,096.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,249,646.97	-125,186.26	1,124,460.71

富国盛利增强债券发起式 C:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	719,935.72	134,774.15	854,709.87
本期期初	719,935.72	134,774.15	854,709.87
本期利润	485,390.14	-284,786.42	200,603.72
本期基金份额交易产生的变动数	-468,474.89	70,400.72	-398,074.17
其中：基金申购款	290,583.02	-35,583.65	254,999.37
基金赎回款	-759,057.91	105,984.37	-653,073.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	736,850.97	-79,611.55	657,239.42

富国盛利增强债券发起式 E:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24.22	4.09	28.31
本期期初	24.22	4.09	28.31
本期利润	29,232.27	-6,767.14	22,465.13
本期基金份额交易产生的变动数	330,580.41	-29,864.00	300,716.41

其中：基金申购款	330,580.41	-29,864.00	300,716.41
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	—	—	—
本期末	359,836.90	-36,627.05	323,209.85

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
活期存款利息收入	786.40
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	1,345.61
其他	127.01
合计	2,259.02

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
卖出股票成交总额	60,489,013.05
减：卖出股票成本总额	59,907,477.65
减：交易费用	83,826.95
买卖股票差价收入	497,708.45

6.4.7.11 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
债券投资收益——利息收入	726,843.09
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	503,145.23
合计	1,229,988.32

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
----	-----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	93,236,654.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	92,041,115.28
减：应计利息总额	688,630.82
减：交易费用	3,762.67
买卖债券差价收入	503,145.23

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
股票投资产生的股利收益	94,610.10
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	94,610.10

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
1. 交易性金融资产	-737,671.59
股票投资	-112,479.87
债券投资	-625,191.72

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	-737,671.59

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
基金赎回费收入	8.28
合计	8.28

6.4.7.19 持有基金产生的费用

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

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
审计费用	8,926.92
信息披露费	20,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	3,628.85
债券账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	51,155.77

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

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰海通证券股份有限公司（由国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 4 月变更名称而来，以下简称“国泰海通”）承继及承接海通证券股份有限公司的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持本公司股权亦归属于国泰海通，即国泰海通成为本公司的主要股东。变更后，本公司的股东为国泰海通证券股份有限公司，出资比例为 27.775%；申万宏源证券有限公司，出资比例为 27.775%；加拿大蒙特利尔银行，出资比例为 27.775%；山东省金融资产管理股份有限公司，出资比例为 16.675%。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构、基金发起人
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构（2025 年 3 月 14 日前）
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	基金管理人的股东、基金代销机构（自 2025 年 3 月 14 日起）
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。关联方国泰海通证券有限公司（简称“国泰海通”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原关联方海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2024年3月18日（基金合同生效日）至2024年6月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国泰海通	37,199,802.80	32.63	—	—
海通证券	—	—	76,619,164.38	36.20

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2024年3月18日（基金合同生效日）至2024年6月30日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
国泰海通	34,297,223.73	26.58	—	—
海通证券	—	—	23,245,435.79	2.65

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2024年3月18日（基金合同生效日）至2024年6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（%）
国泰海通	245,490,000.00	35.99	—	—

海通证券	—	—	3,965,900,000.00	33.15
------	---	---	------------------	-------

6.4.10.1.5 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国泰海通	15,099.61	32.63	13,077.51	51.51
关联方名称	上年度可比期间（2024年3月18日（基金合同生效日）至2024年6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	56,381.93	36.20	56,381.93	36.20

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

6.4.10.2关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2024 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日）
当期发生的基金应支付的管理费	97,041.73	1,241,664.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	35,241.91	586,484.03
应支付基金管理人的净管理费	61,799.82	655,180.20

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

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值减去持有基金管理人管理基金的基金资产净值
基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	上年度可比期间(2024 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日)
当期发生的基金应支付的托管费	24,260.45	310,416.04

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

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值减去持有基金托管人托管基金的基金资产净值
基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	富国盛利增强债券发起式 A	富国盛利增强债券发起式 C	富国盛利增强债券发起式 E	合计
富国基金管理有限公司	—	6.36	1.73	8.09
国泰海通证券股份有限公司	—	44.25	—	44.25
海通证券股份有限公司	—	7.32	—	7.32
中国农业银行股份有限公司	—	13,749.10	—	13,749.10
合计	—	13,807.03	1.73	13,808.76

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间(2024 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日)			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	富国盛利增强债券发起式 A	富国盛利增强债券发起式 C	富国盛利增强债券发起式 E	合计

富国基金管理有限公司	—	51.15	—	51.15
中国农业银行股份有限公司	—	293,161.05	—	293,161.05
合计	—	293,212.20	—	293,212.20

注：自 2024 年 10 月 18 日起，本基金增加收取销售服务费的 E 类基金份额。

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.30% 年费率计提，E 类基金份额的销售服务费按前一日 E 类基金份额资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

C 类和 E 类基金份额销售服务费每日计提，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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）			上年度可比期间(2024 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日)		
	富国盛利增强债券发起式 A	富国盛利增强债券发起式 C	富国盛利增强债券发起式 E	富国盛利增强债券发起式 A	富国盛利增强债券发起式 C	富国盛利增强债券发起式 E
基金合同生效日（2024 年 03 月 18 日）持有的基金份额	10,001,350.14	—	—	10,001,350.14	—	—
期初持有的基金份额	10,001,350.14	—	985.90	10,001,350.14	—	—
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	10,001,350.14	—	985.90	10,001,350.14	—	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	45.57%	—	0.02%	7.61%	—	—

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2024 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	125,180.42	786.40	20,623,229.27	253,907.25

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

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

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

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2025 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 2025 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,000,000.00 元，于 2025 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元		
长期信用评级	本期末（2025 年 06 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
AAA	527,344.85	4,658,078.17
AAA 以下	1,286,993.30	1,310,795.42
未评级	3,097,794.41	3,079,428.33
合计	4,912,132.56	9,048,301.92

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

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各

类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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（2025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	125,180.42	—	—	—	—	—	125,180.42
结算备付金	455,547.41	—	—	—	—	—	455,547.41
存出保证金	16,859.44	—	—	—	—	—	16,859.44
交易性金融资产	362,176.14	333,670.75	24,728,950.71	3,097,794.41	8,971,467.31	6,899,386.70	44,393,446.02
买入返售金融资产	500,000.00	—	—	—	—	—	500,000.00
应收清算款	—	—	—	—	—	1,133,766.10	1,133,766.10
资产总计	1,459,763.41	333,670.75	24,728,950.71	3,097,794.41	8,971,467.31	8,033,152.80	46,624,799.39
负债							
卖出回购金融资产款	1,000,000.00	—	—	—	—	—	1,000,000.00
应付清算款	—	—	—	—	—	1,114,575.53	1,114,575.53
应付赎回款	—	—	—	—	—	20,947.33	20,947.33
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	12,202.84	12,202.84
应付托管费	—	—	—	—	—	3,050.72	3,050.72
应付销售服务费	—	—	—	—	—	2,730.02	2,730.02
应交税费	—	—	—	—	—	223.94	223.94
其他负债	—	—	—	—	—	107,955.67	107,955.67
负债总计	1,000,000.00	—	—	—	—	1,261,686.05	2,261,686.05
利率敏感度缺口	459,763.41	333,670.75	24,728,950.71	3,097,794.41	8,971,467.31	6,771,466.75	44,363,113.34
上年度末（2024年	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

12月31日)							
资产							
货币资金	137,116.98	—	—	—	—	—	137,116.98
结算备付金	855,644.31	—	—	—	—	—	855,644.31
存出保证金	29,419.53	—	—	—	—	—	29,419.53
交易性金融资产	318,308.96	—	41,162,524.08	17,745,425.59	8,214,451.40	13,420,169.40	80,860,879.43
买入返售金融资产	599,735.93	—	—	—	—	—	599,735.93
应收清算款	—	—	—	—	—	3,100,528.14	3,100,528.14
应收申购款	—	—	—	—	—	530.97	530.97
资产总计	1,940,225.71	—	41,162,524.08	17,745,425.59	8,214,451.40	16,521,228.51	85,583,855.29
负债							
卖出回购金融资产款	-203.83	—	—	—	—	—	-203.83
应付清算款	—	—	—	—	—	3,000,434.51	3,000,434.51
应付赎回款	—	—	—	—	—	103,649.76	103,649.76
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	29,140.38	29,140.38
应付托管费	—	—	—	—	—	7,285.08	7,285.08
应付销售服务费	—	—	—	—	—	8,819.16	8,819.16
应交税费	—	—	—	—	—	336.77	336.77
其他负债	—	—	—	—	—	93,883.07	93,883.07
负债总计	-203.83	—	—	—	—	3,243,548.73	3,243,344.90
利率敏感度缺口	1,940,429.54	—	41,162,524.08	17,745,425.59	8,214,451.40	13,277,679.78	82,340,510.39

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：人民币元)	
		本期末 (2025 年 06 月 30 日)	上年度末 (2024 年 12 月 31 日)
	1. 基准点利率增加 0.1%	-209,634.51	-242,510.96
	2. 基准点利率减少 0.1%	209,634.51	242,510.96

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债、

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

基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，本基金对股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产及可转换债券、分离交易可转债、可交换债券资产的合计投资比例不超过基金资产的 20%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；本基金持有其他基金，其市值不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：

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

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

本基金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 (2025 年 06 月 30 日)		上年度末 (2024 年 12 月 31 日)	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	6,899,386.70	15.55	13,420,169.40	16.30
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	37,494,059.32	84.52	67,440,710.03	81.90
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	44,393,446.02	100.07	80,860,879.43	98.20

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 (2025年06月30日)	上年度末 (2024年12月31日)
	1. 业绩比较基准增加 1%	259,683.53	470,582.12
	2. 业绩比较基准减少 1%	-259,683.53	-470,582.12

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 (2025 年 06 月 30 日)	上年度末 (2024 年 12 月 31 日)
第一层次	8,713,724.85	15,103,067.54
第二层次	35,679,721.17	65,757,811.89
第三层次	—	—
合计	44,393,446.02	80,860,879.43

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	6,899,386.70	14.80
	其中：股票	6,899,386.70	14.80
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	37,494,059.32	80.42
	其中：债券	37,494,059.32	80.42
	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	500,000.00	1.07
	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	580,727.83	1.25
8	其他各项资产	1,150,625.54	2.47
9	合计	46,624,799.39	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	7,149.00	0.02
B	采矿业	123,682.00	0.28
C	制造业	3,411,856.94	7.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	199,831.00	0.45
E	建筑业	103,733.00	0.23
F	批发和零售业	294,548.00	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	240,723.00	0.54
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	517,415.44	1.17
J	金融业	1,425,462.30	3.21
K	房地产业	98,604.00	0.22
L	租赁和商务服务业	78,691.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	95,671.38	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	129,883.64	0.29

O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	43,200.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	115,286.00	0.26
S	综合	13,650.00	0.03
	合计	6,899,386.70	15.55

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	601988	中国银行	12,100	68,002.00	0.15
2	002091	江苏国泰	8,500	61,795.00	0.14
3	603187	海容冷链	5,200	61,152.00	0.14
4	601398	工商银行	5,700	43,263.00	0.10
5	002524	光正眼科	9,600	43,200.00	0.10
6	301170	锡南科技	1,600	42,832.00	0.10
7	000751	锌业股份	13,600	42,704.00	0.10
8	301515	港通医疗	2,100	42,693.00	0.10
9	002999	天禾股份	6,100	42,578.00	0.10
10	603987	康德莱	5,500	42,350.00	0.10
11	300246	宝莱特	5,300	42,347.00	0.10
12	000988	华工科技	900	42,309.00	0.10
13	002451	摩恩电气	6,100	42,273.00	0.10
14	002666	德联集团	8,300	42,247.00	0.10
15	000001	平安银行	3,500	42,245.00	0.10
16	603909	建发合诚	4,300	41,882.00	0.09
17	002578	闽发铝业	12,500	41,875.00	0.09
18	002350	北京科锐	6,100	41,846.00	0.09
19	601997	贵阳银行	6,700	41,808.00	0.09
20	002687	乔治白	9,000	41,760.00	0.09
21	000548	湖南投资	7,800	41,652.00	0.09
22	601939	建设银行	4,400	41,536.00	0.09
23	600482	中国动力	1,800	41,526.00	0.09
24	600036	招商银行	900	41,355.00	0.09
25	301386	未来电器	1,900	41,287.00	0.09
26	600015	华夏银行	5,200	41,132.00	0.09
27	002142	宁波银行	1,500	41,040.00	0.09
28	601169	北京银行	6,000	40,980.00	0.09
29	600016	民生银行	8,600	40,850.00	0.09

30	601818	光大银行	9,800	40,670.00	0.09
31	601658	邮储银行	7,400	40,478.00	0.09
32	600908	无锡银行	6,400	40,384.00	0.09
33	600926	杭州银行	2,400	40,368.00	0.09
34	601728	中国电信	5,200	40,300.00	0.09
35	601857	中国石油	4,700	40,185.00	0.09
36	601128	常熟银行	5,440	40,092.80	0.09
37	002545	东方铁塔	4,500	40,005.00	0.09
38	002807	江阴银行	8,400	39,900.00	0.09
39	601577	长沙银行	4,000	39,760.00	0.09
40	603601	再升科技	9,700	39,382.00	0.09
41	600900	长江电力	1,300	39,182.00	0.09
42	300239	东宝生物	6,300	37,359.00	0.08
43	601838	成都银行	1,800	36,180.00	0.08
44	002966	苏州银行	4,100	35,998.00	0.08
45	002367	康力电梯	5,100	35,853.00	0.08
46	002926	华西证券	4,000	35,760.00	0.08
47	601009	南京银行	3,000	34,860.00	0.08
48	601998	中信银行	4,100	34,850.00	0.08
49	002839	张家港行	7,700	34,650.00	0.08
50	603071	物产环能	2,700	34,371.00	0.08
51	600000	浦发银行	2,400	33,312.00	0.08
52	600057	厦门象屿	4,700	33,041.00	0.07
53	603617	君禾股份	4,500	32,265.00	0.07
54	001360	南矿集团	2,300	32,016.00	0.07
55	301388	欣灵电气	1,300	31,993.00	0.07
56	301469	恒达新材	1,200	31,824.00	0.07
57	300383	光环新网	2,200	31,460.00	0.07
58	603201	常润股份	1,700	31,365.00	0.07
59	601107	四川成渝	5,200	31,304.00	0.07
60	601328	交通银行	3,900	31,200.00	0.07
61	001378	德冠新材	1,400	31,038.00	0.07
62	002414	高德红外	3,000	30,750.00	0.07
63	601528	瑞丰银行	5,300	30,687.00	0.07
64	002638	勤上股份	11,600	30,508.00	0.07
65	000156	华数传媒	3,800	30,172.00	0.07
66	601033	永兴股份	1,900	30,039.00	0.07
67	601311	骆驼股份	3,300	29,799.00	0.07
68	001324	长青科技	1,500	29,550.00	0.07
69	300018	中元股份	3,700	29,415.00	0.07
70	002352	顺丰控股	600	29,256.00	0.07

71	601899	紫金矿业	1,500	29,250.00	0.07
72	001266	宏英智能	1,100	29,095.00	0.07
73	002441	众业达	3,200	29,024.00	0.07
74	301519	舜禹股份	2,100	28,854.00	0.07
75	301126	达嘉维康	2,600	28,834.00	0.06
76	600126	杭钢股份	3,200	28,800.00	0.06
77	300264	佳创视讯	4,500	28,710.00	0.06
78	301083	百胜智能	1,800	28,566.00	0.06
79	300105	龙源技术	3,700	28,527.00	0.06
80	601187	厦门银行	4,200	28,518.00	0.06
81	300335	迪森股份	5,200	28,392.00	0.06
82	300519	新光药业	1,900	28,196.00	0.06
83	300160	秀强股份	5,000	28,100.00	0.06
84	002160	常铝股份	6,500	28,080.00	0.06
85	601166	兴业银行	1,200	28,008.00	0.06
86	600273	嘉化能源	3,300	27,918.00	0.06
87	600919	江苏银行	2,330	27,820.20	0.06
88	600665	天地源	8,300	27,805.00	0.06
89	601916	浙商银行	8,200	27,798.00	0.06
90	600064	南京高科	3,600	27,756.00	0.06
91	600716	凤凰股份	7,500	27,750.00	0.06
92	605177	东亚药业	1,500	27,705.00	0.06
93	002736	国信证券	2,400	27,648.00	0.06
94	600854	春兰股份	5,300	27,560.00	0.06
95	300625	三雄极光	2,300	27,347.00	0.06
96	600901	江苏金租	4,500	27,270.00	0.06
97	002877	智能自控	3,100	27,125.00	0.06
98	601919	中远海控	1,800	27,072.00	0.06
99	600956	新天绿能	3,500	27,020.00	0.06
100	000551	创元科技	2,100	26,985.00	0.06
101	601717	中创智领	1,600	26,592.00	0.06
102	603323	苏农银行	4,730	26,535.30	0.06
103	002958	青农商行	7,300	26,353.00	0.06
104	000719	中原传媒	2,100	26,061.00	0.06
105	600350	山东高速	2,400	25,584.00	0.06
106	603309	维力医疗	2,000	25,440.00	0.06
107	300613	富瀚微	500	24,440.00	0.06
108	603636	南威软件	1,900	24,016.00	0.05
109	600012	皖通高速	1,400	23,772.00	0.05
110	002461	珠江啤酒	2,100	23,709.00	0.05
111	601860	紫金银行	7,800	23,400.00	0.05

112	603808	歌力思	2,800	23,240.00	0.05
113	600704	物产中大	4,400	23,188.00	0.05
114	300512	中亚股份	2,700	23,166.00	0.05
115	600741	华域汽车	1,300	22,945.00	0.05
116	601133	柏诚股份	1,800	22,878.00	0.05
117	603289	泰瑞机器	2,400	22,848.00	0.05
118	600660	福耀玻璃	400	22,804.00	0.05
119	600941	中国移动	200	22,510.00	0.05
120	600111	北方稀土	900	22,410.00	0.05
121	300657	弘信电子	800	22,312.00	0.05
122	002014	永新股份	1,840	22,300.80	0.05
123	600267	海正药业	2,400	22,200.00	0.05
124	300425	中建环能	4,200	22,008.00	0.05
125	000685	中山公用	2,500	21,950.00	0.05
126	601555	东吴证券	2,500	21,875.00	0.05
127	301261	恒工精密	300	21,867.00	0.05
128	600875	东方电气	1,300	21,762.00	0.05
129	600977	中国电影	2,000	21,440.00	0.05
130	688037	芯源微	200	21,440.00	0.05
131	301166	优宁维	700	21,413.00	0.05
132	688343	云天励飞	422	20,855.24	0.05
133	300718	长盛轴承	300	20,847.00	0.05
134	605090	九丰能源	800	20,648.00	0.05
135	002948	青岛银行	4,100	20,418.00	0.05
136	000089	深圳机场	2,900	20,010.00	0.05
137	600560	金自天正	1,200	19,416.00	0.04
138	001255	博菲电气	600	19,362.00	0.04
139	605598	上海港湾	900	19,233.00	0.04
140	601609	金田股份	2,700	18,927.00	0.04
141	300738	奥飞数据	900	18,837.00	0.04
142	600098	广州发展	3,000	18,750.00	0.04
143	300616	尚品宅配	1,400	18,438.00	0.04
144	002790	瑞尔特	2,500	18,175.00	0.04
145	600873	梅花生物	1,700	18,173.00	0.04
146	600602	云赛智联	900	18,153.00	0.04
147	002337	赛象科技	3,100	18,104.00	0.04
148	002420	毅昌科技	2,900	18,096.00	0.04
149	301090	华润材料	2,400	18,072.00	0.04
150	300732	设研院	2,500	18,050.00	0.04
151	300041	回天新材	1,900	17,898.00	0.04
152	002539	云图控股	1,900	17,822.00	0.04

153	601921	浙版传媒	2,200	17,732.00	0.04
154	600380	健康元	1,600	17,648.00	0.04
155	600757	长江传媒	1,900	17,632.00	0.04
156	601336	新华保险	300	17,550.00	0.04
157	601881	中国银河	1,000	17,150.00	0.04
158	002351	漫步者	1,300	17,056.00	0.04
159	001326	联域股份	500	17,020.00	0.04
160	688156	路德环境	1,004	16,977.64	0.04
161	002381	双箭股份	2,500	16,875.00	0.04
162	603230	内蒙新华	1,300	16,783.00	0.04
163	600925	苏能股份	3,200	16,736.00	0.04
164	600329	达仁堂	500	16,680.00	0.04
165	600475	华光环能	1,600	16,672.00	0.04
166	601686	友发集团	2,900	16,472.00	0.04
167	600362	江西铜业	700	16,401.00	0.04
168	603687	大胜达	2,200	16,346.00	0.04
169	000705	浙江震元	1,900	16,055.00	0.04
170	300615	欣天科技	1,200	16,044.00	0.04
171	603012	创力集团	2,900	16,037.00	0.04
172	000030	富奥股份	2,700	15,903.00	0.04
173	688220	翱捷科技	200	15,660.00	0.04
174	601928	凤凰传媒	1,400	15,638.00	0.04
175	601218	吉鑫科技	3,800	15,618.00	0.04
176	002885	京泉华	1,100	15,565.00	0.04
177	002587	奥拓电子	2,400	15,480.00	0.03
178	603421	鼎信通讯	2,300	15,479.00	0.03
179	601958	金钼股份	1,400	15,316.00	0.03
180	002896	中大力德	260	15,056.60	0.03
181	605289	罗曼股份	500	15,025.00	0.03
182	000153	丰原药业	2,400	14,808.00	0.03
183	000948	南天信息	700	14,805.00	0.03
184	002442	龙星科技	2,300	14,674.00	0.03
185	300701	森霸传感	1,400	14,644.00	0.03
186	002777	久远银海	800	14,608.00	0.03
187	002026	山东威达	1,200	14,580.00	0.03
188	688369	致远互联	548	14,461.72	0.03
189	300891	惠云钛业	1,500	14,430.00	0.03
190	002045	国光电器	900	14,364.00	0.03
191	301195	北路智控	400	14,320.00	0.03
192	688122	西部超导	276	14,318.88	0.03
193	301338	凯格精机	300	14,313.00	0.03

194	301270	汉仪股份	300	14,298.00	0.03
195	000823	超声电子	1,200	14,220.00	0.03
196	002084	海鸥住工	4,000	14,200.00	0.03
197	002863	今飞凯达	2,800	14,196.00	0.03
198	301102	兆讯传媒	1,300	14,196.00	0.03
199	002282	博深股份	1,900	14,193.00	0.03
200	600095	湘财股份	1,400	14,042.00	0.03
201	600513	联环药业	1,400	14,042.00	0.03
202	000027	深圳能源	2,200	14,036.00	0.03
203	000068	华控赛格	4,100	14,022.00	0.03
204	300062	中能电气	2,600	13,988.00	0.03
205	688697	纽威数控	1,048	13,980.32	0.03
206	300314	戴维医疗	1,100	13,970.00	0.03
207	688468	科美诊断	1,897	13,961.92	0.03
208	603969	银龙股份	1,900	13,927.00	0.03
209	002669	康达新材	1,200	13,920.00	0.03
210	300556	丝路视觉	700	13,909.00	0.03
211	002893	京能热力	1,300	13,897.00	0.03
212	600020	中原高速	2,900	13,862.00	0.03
213	600039	四川路桥	1,400	13,860.00	0.03
214	601668	中国建筑	2,400	13,848.00	0.03
215	000338	潍柴动力	900	13,842.00	0.03
216	600633	浙数文化	1,000	13,840.00	0.03
217	300365	恒华科技	2,100	13,839.00	0.03
218	600571	信雅达	800	13,808.00	0.03
219	688768	容知日新	311	13,805.29	0.03
220	002950	奥美医疗	1,600	13,760.00	0.03
221	603660	苏州科达	1,900	13,737.00	0.03
222	301185	鸥玛软件	700	13,699.00	0.03
223	002314	南山控股	5,200	13,676.00	0.03
224	600620	天宸股份	2,500	13,650.00	0.03
225	300993	玉马科技	900	13,644.00	0.03
226	688668	鼎通科技	218	13,616.28	0.03
227	301161	唯万密封	600	13,614.00	0.03
228	688334	西高院	791	13,589.38	0.03
229	300140	节能环保	2,200	13,574.00	0.03
230	688029	南微医学	200	13,510.00	0.03
231	301220	亚香股份	300	13,470.00	0.03
232	688225	亚信安全	660	13,457.40	0.03
233	002728	特一药业	1,600	13,456.00	0.03
234	000776	广发证券	800	13,448.00	0.03

235	603381	永臻股份	600	13,434.00	0.03
236	603303	得邦照明	1,100	13,277.00	0.03
237	601369	陕鼓动力	1,500	13,155.00	0.03
238	600826	兰生股份	1,600	13,120.00	0.03
239	688114	华大智造	200	12,966.00	0.03
240	002783	凯龙股份	1,500	12,945.00	0.03
241	603106	恒银科技	1,200	12,720.00	0.03
242	688766	普冉股份	200	12,640.00	0.03
243	300486	东杰智能	1,500	12,405.00	0.03
244	002203	海亮股份	1,200	12,384.00	0.03
245	301368	丰立智能	200	12,366.00	0.03
246	002454	松芝股份	1,600	12,352.00	0.03
247	600377	宁沪高速	800	12,272.00	0.03
248	002206	海利得	2,400	12,264.00	0.03
249	600323	瀚蓝环境	500	12,175.00	0.03
250	603776	永安行	600	12,090.00	0.03
251	600075	新疆天业	2,800	11,844.00	0.03
252	002865	钧达股份	300	11,700.00	0.03
253	002125	湘潭电化	800	11,624.00	0.03
254	600160	巨化股份	400	11,472.00	0.03
255	300229	拓尔思	600	11,064.00	0.02
256	002324	普利特	1,000	10,630.00	0.02
257	000915	华特达因	300	10,605.00	0.02
258	002686	亿利达	1,600	10,416.00	0.02
259	601568	北元集团	2,500	10,375.00	0.02
260	603881	数据港	400	10,220.00	0.02
261	600058	五矿发展	1,300	10,049.00	0.02
262	603528	多伦科技	1,200	10,008.00	0.02
263	300442	润泽科技	200	9,906.00	0.02
264	603861	白云电器	1,000	9,870.00	0.02
265	603848	好太太	600	9,240.00	0.02
266	000686	东北证券	1,200	9,156.00	0.02
267	000935	四川双马	500	9,110.00	0.02
268	600928	西安银行	2,300	9,016.00	0.02
269	603515	欧普照明	500	8,995.00	0.02
270	688327	云从科技	652	8,991.08	0.02
271	688403	汇成股份	815	8,467.85	0.02
272	002660	茂硕电源	900	8,460.00	0.02
273	601330	绿色动力	1,100	8,404.00	0.02
274	002399	海普瑞	700	8,337.00	0.02
275	600415	小商品城	400	8,272.00	0.02

276	000498	山东路桥	1,400	8,232.00	0.02
277	603779	威龙股份	1,100	8,173.00	0.02
278	002095	生意宝	400	8,112.00	0.02
279	603075	热威股份	400	7,996.00	0.02
280	000529	广弘控股	1,300	7,943.00	0.02
281	603788	宁波高发	500	7,935.00	0.02
282	003022	联泓新科	500	7,915.00	0.02
283	600011	华能国际	1,100	7,854.00	0.02
284	603324	盛剑科技	300	7,620.00	0.02
285	001203	大中矿业	800	7,560.00	0.02
286	600115	中国东航	1,800	7,254.00	0.02
287	688456	有研粉材	200	7,190.00	0.02
288	603516	淳中科技	200	7,180.00	0.02
289	301080	百普赛斯	100	7,153.00	0.02
290	605183	确成股份	400	7,000.00	0.02
291	002637	赞宇科技	700	6,986.00	0.02
292	600531	豫光金铅	900	6,966.00	0.02
293	603259	药明康德	100	6,955.00	0.02
294	688538	和辉光电	2,900	6,786.00	0.02
295	688636	智明达	200	6,758.00	0.02
296	603132	金徽股份	500	6,635.00	0.01
297	603989	艾华集团	400	6,160.00	0.01
298	600749	西藏旅游	500	5,935.00	0.01
299	002595	豪迈科技	100	5,922.00	0.01
300	600499	科达制造	600	5,880.00	0.01
301	603567	珍宝岛	500	5,875.00	0.01
302	000570	苏常柴A	1,000	5,790.00	0.01
303	603163	圣晖集成	200	5,702.00	0.01
304	601318	中国平安	100	5,548.00	0.01
305	300407	凯发电气	500	5,285.00	0.01
306	000050	深天马A	600	5,112.00	0.01
307	600167	联美控股	900	5,058.00	0.01
308	600783	鲁信创投	400	5,000.00	0.01
309	002771	真视通	300	4,998.00	0.01
310	603908	牧高笛	200	4,952.00	0.01
311	300176	鸿特科技	700	4,872.00	0.01
312	002066	瑞泰科技	400	4,808.00	0.01
313	002363	隆基机械	600	4,566.00	0.01
314	000922	佳电股份	400	4,552.00	0.01
315	301133	金钟股份	200	4,536.00	0.01
316	601877	正泰电器	200	4,534.00	0.01

317	300288	朗玛信息	300	4,533.00	0.01
318	600961	株冶集团	400	4,472.00	0.01
319	002543	万和电气	400	4,444.00	0.01
320	600739	辽宁成大	400	4,400.00	0.01
321	301208	中亦科技	100	4,378.00	0.01
322	603058	永吉股份	500	4,370.00	0.01
323	002585	双星新材	800	4,368.00	0.01
324	000803	山高环能	700	4,312.00	0.01
325	002275	桂林三金	300	4,293.00	0.01
326	000828	东莞控股	400	4,276.00	0.01
327	601236	红塔证券	500	4,235.00	0.01
328	000955	欣龙控股	900	4,230.00	0.01
329	002714	牧原股份	100	4,201.00	0.01
330	600153	建发股份	400	4,148.00	0.01
331	300707	威唐工业	300	4,143.00	0.01
332	001387	雪祺电气	300	4,122.00	0.01
333	300539	横河精密	300	4,107.00	0.01
334	300448	浩云科技	600	4,068.00	0.01
335	600166	福田汽车	1,500	4,065.00	0.01
336	600830	香溢融通	400	4,048.00	0.01
337	000758	中色股份	800	4,024.00	0.01
338	600318	新力金融	400	3,952.00	0.01
339	002703	浙江世宝	300	3,936.00	0.01
340	300236	上海新阳	100	3,880.00	0.01
341	000969	安泰科技	300	3,864.00	0.01
342	603181	皇马科技	300	3,858.00	0.01
343	002646	天佑德酒	400	3,712.00	0.01
344	603799	华友钴业	100	3,702.00	0.01
345	300470	中密控股	100	3,677.00	0.01
346	002407	多氟多	300	3,657.00	0.01
347	603519	立霸股份	300	3,648.00	0.01
348	603283	赛腾股份	100	3,394.00	0.01
349	300235	方直科技	300	3,303.00	0.01
350	001229	魅视科技	100	3,292.00	0.01
351	002487	大金重工	100	3,290.00	0.01
352	000960	锡业股份	200	3,060.00	0.01
353	600352	浙江龙盛	300	3,048.00	0.01
354	300933	中辰股份	400	3,036.00	0.01
355	600623	华谊集团	400	3,028.00	0.01
356	300547	川环科技	100	3,022.00	0.01
357	300662	科锐国际	100	2,971.00	0.01

358	605168	三人行	100	2,943.00	0.01
359	002913	奥士康	100	2,941.00	0.01
360	002705	新宝股份	200	2,940.00	0.01
361	300416	苏试试验	200	2,866.00	0.01
362	300687	赛意信息	100	2,778.00	0.01
363	605305	中际联合	100	2,778.00	0.01
364	000902	新洋丰	200	2,766.00	0.01
365	300681	英搏尔	100	2,766.00	0.01
366	002081	金螳螂	800	2,744.00	0.01
367	300112	万讯自控	300	2,715.00	0.01
368	000885	城发环境	200	2,664.00	0.01
369	002768	国恩股份	100	2,641.00	0.01
370	002788	鹭燕医药	300	2,571.00	0.01
371	600269	赣粤高速	500	2,530.00	0.01
372	603993	洛阳钼业	300	2,526.00	0.01
373	601827	三峰环境	300	2,520.00	0.01
374	603280	南方路机	100	2,519.00	0.01
375	600481	双良节能	500	2,410.00	0.01
376	002362	汉王科技	100	2,242.00	0.01
377	600426	华鲁恒升	100	2,167.00	0.00
378	301072	中捷精工	100	2,147.00	0.00
379	300938	信测标准	100	2,101.00	0.00
380	603298	杭叉集团	100	2,095.00	0.00
381	301172	君逸数码	100	2,065.00	0.00
382	605507	国邦医药	100	1,977.00	0.00
383	603111	康尼机电	300	1,974.00	0.00
384	603180	金牌家居	100	1,947.00	0.00
385	300802	矩子科技	100	1,884.00	0.00
386	301215	中汽股份	300	1,860.00	0.00
387	301539	宏鑫科技	100	1,852.00	0.00
388	002925	盈趣科技	100	1,798.00	0.00
389	605277	新亚电子	100	1,796.00	0.00
390	603698	航天工程	100	1,762.00	0.00
391	603933	睿能科技	100	1,722.00	0.00
392	002939	长城证券	200	1,676.00	0.00
393	605555	德昌股份	100	1,657.00	0.00
394	002576	通达动力	100	1,645.00	0.00
395	002243	力合科创	200	1,632.00	0.00
396	000650	仁和药业	300	1,626.00	0.00
397	603878	武进不锈	300	1,626.00	0.00
398	603858	步长制药	100	1,624.00	0.00

399	600201	生物股份	200	1,604.00	0.00
400	601108	财通证券	200	1,582.00	0.00
401	600435	北方导航	100	1,559.00	0.00
402	600998	九州通	300	1,542.00	0.00
403	300996	普联软件	100	1,503.00	0.00
404	600540	新赛股份	300	1,500.00	0.00
405	002593	日上集团	300	1,461.00	0.00
406	600626	申达股份	400	1,452.00	0.00
407	601969	海南矿业	200	1,450.00	0.00
408	600359	新农开发	200	1,448.00	0.00
409	300195	长荣股份	200	1,422.00	0.00
410	300614	百川畅银	100	1,331.00	0.00
411	300590	移为通信	100	1,301.00	0.00
412	002404	嘉欣丝绸	200	1,294.00	0.00
413	000726	鲁 泰 A	200	1,268.00	0.00
414	601991	大唐发电	400	1,268.00	0.00
415	601665	齐鲁银行	200	1,264.00	0.00
416	002972	科安达	100	1,229.00	0.00
417	300500	启迪设计	100	1,215.00	0.00
418	600640	国脉文化	100	1,212.00	0.00
419	300206	理邦仪器	100	1,202.00	0.00
420	300349	金卡智能	100	1,195.00	0.00
421	002061	浙江交科	300	1,188.00	0.00
422	600796	钱江生化	200	1,174.00	0.00
423	000715	中兴商业	200	1,146.00	0.00
424	300603	立昂技术	100	1,130.00	0.00
425	002296	辉煌科技	100	1,115.00	0.00
426	002598	山东章鼓	100	1,112.00	0.00
427	605228	神通科技	100	1,099.00	0.00
428	301370	国科恒泰	100	1,065.00	0.00
429	002116	中国海诚	100	1,023.00	0.00
430	000829	天音控股	100	1,021.00	0.00
431	603937	丽岛新材	100	978.00	0.00
432	601326	秦港股份	300	969.00	0.00
433	600004	白云机场	100	910.00	0.00
434	000514	渝 开 发	200	906.00	0.00
435	002606	大连电瓷	100	892.00	0.00
436	603633	徕木股份	100	869.00	0.00
437	002535	林州重机	200	798.00	0.00
438	002334	英威腾	100	793.00	0.00
439	601061	中信金属	100	791.00	0.00

440	601901	方正证券	100	791.00	0.00
441	000925	众合科技	100	768.00	0.00
442	600251	冠农股份	100	763.00	0.00
443	000042	中洲控股	100	711.00	0.00
444	300081	恒信东方	100	708.00	0.00
445	300279	和晶科技	100	693.00	0.00
446	603122	合富中国	100	683.00	0.00
447	600682	南京新百	100	672.00	0.00
448	002279	久其软件	100	655.00	0.00
449	000593	德龙汇能	100	602.00	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	002456	欧菲光	306,903.00	0.37
2	601988	中国银行	277,519.00	0.34
3	601398	工商银行	249,518.00	0.30
4	601166	兴业银行	222,388.00	0.27
5	600000	浦发银行	216,462.00	0.26
6	002966	苏州银行	211,667.00	0.26
7	600273	嘉化能源	211,213.00	0.26
8	600016	民生银行	208,806.00	0.25
9	002312	川发龙蟒	206,971.00	0.25
10	601169	北京银行	205,917.00	0.25
11	002461	珠江啤酒	205,373.00	0.25
12	603323	苏农银行	204,806.00	0.25
13	000685	中山公用	204,564.00	0.25
14	601077	渝农商行	199,349.00	0.24
15	600267	海正药业	195,741.00	0.24
16	601916	浙商银行	194,327.00	0.24
17	601187	厦门银行	194,123.00	0.24
18	600535	天士力	193,401.00	0.23
19	600036	招商银行	189,399.00	0.23
20	002267	陕天然气	186,746.00	0.23

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	601169	北京银行	329,276.00	0.40
2	601398	工商银行	320,463.00	0.39
3	601988	中国银行	318,749.00	0.39
4	002456	欧菲光	304,014.00	0.37
5	601211	国泰海通	290,788.00	0.35
6	601077	渝农商行	288,639.00	0.35
7	601916	浙商银行	284,629.00	0.35
8	601187	厦门银行	283,687.00	0.34
9	601166	兴业银行	278,220.00	0.34
10	002267	陕天然气	276,917.00	0.34
11	600926	杭州银行	268,345.00	0.33
12	603323	苏农银行	265,266.00	0.32
13	601998	中信银行	262,658.00	0.32
14	600000	浦发银行	262,616.00	0.32
15	002948	青岛银行	257,629.00	0.31
16	600016	民生银行	256,781.00	0.31
17	002966	苏州银行	254,699.00	0.31
18	600919	江苏银行	251,221.00	0.31
19	601328	交通银行	247,051.00	0.30
20	600901	江苏金租	244,847.00	0.30

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	53,499,174.82
卖出股票收入（成交）总额	60,489,013.05

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	11,980,737.72	27.01
2	央行票据	—	—
3	金融债券	20,601,189.04	46.44
	其中：政策性金融债	20,601,189.04	46.44
4	企业债券	3,097,794.41	6.98

5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	1,814,338.15	4.09
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	37,494,059.32	84.52

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	200219	20 国开 19	200,000	20,601,189.04	46.44
2	019756	24 特国 06	35,000	3,729,880.00	8.41
3	019742	24 特国 01	30,000	3,426,771.78	7.72
4	240132	23 电力 03	30,000	3,097,794.41	6.98
5	019773	25 国债 08	30,000	3,009,270.41	6.78

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现

货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

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

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

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

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

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

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

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

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资 明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局北京监管局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海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上海监管局、中国人民银行的处罚。

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

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

7.13.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	16,859.44
2	应收清算款	1,133,766.10
3	应收股利	—

4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,150,625.54

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113042	上银转债	128,971.33	0.29
2	110081	闻泰转债	110,544.62	0.25
3	127049	希望转2	109,856.25	0.25
4	118031	天23转债	109,202.56	0.25
5	123120	隆华转债	109,140.61	0.25
6	123247	万凯转债	108,732.58	0.25
7	110086	精工转债	108,544.93	0.24
8	127103	东南转债	108,146.69	0.24
9	110093	神马转债	108,121.53	0.24
10	113656	嘉诚转债	108,017.11	0.24
11	113062	常银转债	108,010.05	0.24
12	113058	友发转债	106,500.03	0.24
13	113606	荣泰转债	106,053.59	0.24
14	127040	国泰转债	70,800.16	0.16
15	113065	齐鲁转债	54,406.40	0.12
16	127054	双箭转债	53,680.12	0.12
17	113625	江山转债	53,203.32	0.12
18	113068	金铜转债	28,165.79	0.06
19	113037	紫银转债	25,098.38	0.06
20	127041	弘亚转债	18,426.58	0.04
21	123236	家联转债	18,397.40	0.04
22	127018	本钢转债	17,979.29	0.04
23	127082	亚科转债	17,569.98	0.04
24	127052	西子转债	17,372.79	0.04
25	128132	交建转债	8,911.01	0.02

26	123250	嘉益转债	485.05	0.00
----	--------	------	--------	------

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
富国盛利增强债券 发起式 A	204	107,590.81	12,161,238 .31	55.41	9,787,287 .65	44.59
富国盛利增强债券 发起式 C	283	49,330.53	4,635,455. 62	33.20	9,325,084 .08	66.80
富国盛利增强债券 发起式 E	9	705,459.74	6,157,461. 97	96.98	191,675.7 3	3.02
合计	496	85,197.99	22,954,155 .90	54.32	19,304,04 7.46	45.68

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	富国盛利增强债券发起式 A	206,074.86	0.9389
	富国盛利增强债券发起式 C	30.08	0.0002
	富国盛利增强债券发起式 E	—	—
	合计	206,104.94	0.4877

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数 (份)	持有份额 占基金总	发起份额总数 (份)	发起份额占 基金总份额	发起份额 承诺持有 期限
----	---------------	--------------	---------------	----------------	--------------------

		份额比例 (%)		比例 (%)	
基金管理人固有资金	10,002,336.04	23.67	10,001,350.14	23.67	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,002,336.04	23.67	10,001,350.14	23.67	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国盛利增强债券发起式 A	富国盛利增强债券发起式 C	富国盛利增强债券发起式 E
基金合同生效日 (2024 年 03 月 18 日) 基金份额总额	1, 508, 762, 914. 27	1, 107, 777, 057. 61	—
报告期期初基金份额总额	47, 553, 171. 97	32, 563, 287. 15	985. 90
本报告期基金总申购份额	3, 735, 427. 53	6, 083, 569. 43	6, 348, 151. 80
减：本报告期基金总赎回份额	29, 340, 073. 54	24, 686, 316. 88	—
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
报告期期末基金份额总额	21, 948, 525. 96	13, 960, 539. 70	6, 349, 137. 70

§ 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。

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

注：本基金本报告期末未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7.2 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。

10.8 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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 (%)	
东方证券	4	9,747,024.66	8.55	3,956.18	8.55	—
国泰海通	4	37,199,802.80	32.63	15,099.61	32.63	—
国泰君安	2	2,208,765.00	1.94	896.64	1.94	—
海通证券	2	—	—	—	—	—
西部证券	1	4,090,047.96	3.59	1,660.14	3.59	—
兴业证券	2	3,738,076.75	3.28	1,517.22	3.28	—
中金公司	1	11,586,811.87	10.16	4,703.06	10.16	—
中信证券	2	45,417,658.83	39.84	18,435.30	39.84	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

注：1、我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

2、国泰海通证券有限公司（简称“国泰海通”）是由国泰君安证券股份有限公司与海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。上表显示的国泰海通数据为自 2025 年 3 月 15 日至 2025 年 6 月 30 日通过国泰海通证券席位交易的情况，本期海通证券、国泰君安数据为自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 3 月 14 日通过海通证券、国泰君安席位交易的情况。

10.8.2 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	9,611,843.72	7.45	37,900,000.00	5.56	—	—	—	—
国泰海通	34,297,223.73	26.58	245,490,000.00	35.99	—	—	—	—
国泰君安	3,485,284.60	2.70	11,600,000.00	1.70	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—	—	—
西部证券	12,306,524.09	9.54	50,500,000.00	7.40	—	—	—	—

兴业证券	4,948,543.04	3.84	21,600,000.00	3.17	—	—	—	—
中金公司	9,776,602.31	7.58	120,900,000.00	17.72	—	—	—	—
中信证券	54,591,661.95	42.31	192,100,000.00	28.16	—	—	—	—
中银证券	—	—	2,000,000.00	0.29	—	—	—	—

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	规定披露媒介	2025年01月02日
2	富国基金管理有限公司关于变更主要股东事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告	规定披露媒介	2025年01月21日
3	富国基金管理有限公司关于公司主要股东变更的公告	规定披露媒介	2025年03月18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	2025-02-28 至 2025-06-30	10,002,336.04	—	—	10,002,336.04	23.67%
	2	2025-06-25 至 2025-06-30	—	10,791,931.69	—	10,791,931.69	25.54%
个人	1	2025-02-28 至 2025-05-08	10,004,850.00	—	10,004,850.00	—	—
产品特有风险							
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，根据中国证券监督管理委员会于 2025 年 1 月 17 日出具的《关于同意国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司并募集配套资金注册、核准国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司、海富通基金管理有限公司变更主要股东及实际控制人、富国基金管理有限公司变更主要股东、海通期货股份有限公司变更主要股东及实际控制人的批复》，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司，并依法承接富国基金管理有限公司 14,443 万元出资（占注册资本比例 27.775%）。自吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安成为基金管理人的主要股东。具体可参见基金管理人于 2025 年 1 月 21 日发布的《富国基金管理有限公司关于变更主要股东事项获得中国证

券监督管理委员会批复的公告》、2025 年 3 月 18 日发布的《富国基金管理有
限公司关于公司主要股东变更的公告》。根据国泰海通证券股份有限公司于
2025 年 4 月 4 日发布的相关公告，国泰君安的公司名称变更为国泰海通证券
股份有限公司。

§ 12 备查文件目录

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