

富国中证红利指数增强型证券投资基金

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： 中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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.....	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.....	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.....	16
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	17
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
§ 5	托管人报告	20
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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	20
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.....	20
§ 6	中期财务报告（未经审计）	21
6.1	资产负债表.....	21
6.2	利润表.....	22
6.3	净资产变动表.....	23
6.4	报表附注.....	25
§ 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股票投资明细.....	54
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	68
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	69
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..	69
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..	69
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	69
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	69
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	69
7.12	投资组合报告附注.....	70
§ 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
§ 9	开放式基金份额变动	73
§ 10	重大事件揭示.....	74
10.1	基金份额持有人大会决议.....	74
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.....	74
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
10.4	基金投资策略的改变.....	74
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
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.....	74
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
10.8	其他重大事件.....	78
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	79
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	79
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	79
§ 12	备查文件目录.....	80

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证红利指数增强型证券投资基金		
基金简称	富国中证红利指数增强		
基金主代码	100032		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2008 年 11 月 20 日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	5,848,829,197.04 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	富国中证红利指数增强 A/B	富国中证红利指数增强 C	富国中证红利指数增强 Y
下属分级基金的交易代码	前端	后端	008682
	100032	100033	
报告期末下属分级基金的份额总额	5,310,327,128.70 份	509,806,444.72 份	28,695,623.62 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，其在遵循“程序化指数投资、有限度个股调整、精细化风险管理”原则的基础上，实现对中证红利指数的有效跟踪并力争实现超越，分享中国经济长期增长所带来的收益。
投资策略	本基金将采用“指数化投资为主、主动性投资为辅”的投资策略，主要采用完全复制目标指数策略，即按照成份股在目标指数中的基准权重来构建股票投资组合，从而有效跟踪目标指数，控制跟踪误差，防止出现相对于目标指数的大幅度偏离。在完全复制目标指数的基础上本基金有限度地调整个股，从而最大限度降低由于交易成本造成的股票投资组合相对于目标指数的偏离，并力求投资收益能够有效跟踪并适度超越目标指数。本基金的存托凭证投资策略、对目标指数的跟踪调整、跟踪误差的控制和再平衡调整详见法律文件。
业绩比较基准	$90\% \times \text{中证红利指数收益率} + 10\% \times \text{一年期银行储蓄存款利率（税后）}$
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	郭明

	联系电话	021-20361818	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95588
传真		021-20361616	010—66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		裴长江	廖林

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 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国中证红利指数增强 A/B

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	83,022,355.44
本期利润	76,144,450.63
加权平均基金份额本期利润	0.0140
本期加权平均净值利润率	1.45%
本期基金份额净值增长率	1.53%
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	402,449,210.97
期末可供分配基金份额利润	0.0758
期末基金资产净值	5,273,819,732.22
期末基金份额净值	0.993
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	386.08%

(2) 富国中证红利指数增强 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	6,806,375.08
本期利润	4,110,063.14
加权平均基金份额本期利润	0.0058
本期加权平均净值利润率	0.61%
本期基金份额净值增长率	1.32%
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	32,596,808.08
期末可供分配基金份额利润	0.0639
期末基金资产净值	499,736,374.11
期末基金份额净值	0.980
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	50.77%

(3) 富国中证红利指数增强 Y

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	587,242.50
本期利润	1,048,762.80
加权平均基金份额本期利润	0.0488
本期加权平均净值利润率	5.03%
本期基金份额净值增长率	1.93%
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	2,291,207.80
期末可供分配基金份额利润	0.0798
期末基金资产净值	28,632,277.20
期末基金份额净值	0.998
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	3.11%

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) 富国中证红利指数增强 A/B

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	1.95%	0.39%	-0.57%	0.34%	2.52%	0.05%
过去三个月	3.98%	0.91%	0.11%	0.93%	3.87%	-0.02%
过去六个月	1.53%	0.80%	-2.65%	0.81%	4.18%	-0.01%
过去一年	4.32%	1.08%	1.24%	1.08%	3.08%	0.00%
过去三年	15.67%	0.90%	6.16%	0.89%	9.51%	0.01%
自基金合同生效起至今	386.08%	1.29%	178.79%	1.28%	207.29%	0.01%

(2) 富国中证红利指数增强 C

阶段	份额净	份额净	业绩比	业绩比较	①—③	②—④
----	-----	-----	-----	------	-----	-----

	值增长率①	值增长率标准差②	较基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	1.87%	0.38%	-0.57%	0.34%	2.44%	0.04%
过去三个月	3.92%	0.91%	0.11%	0.93%	3.81%	-0.02%
过去六个月	1.32%	0.80%	-2.65%	0.81%	3.97%	-0.01%
过去一年	3.94%	1.08%	1.24%	1.08%	2.70%	0.00%
过去三年	14.70%	0.89%	6.16%	0.89%	8.54%	0.00%
自基金分级生效日起至今	50.77%	1.00%	23.47%	0.97%	27.30%	0.03%

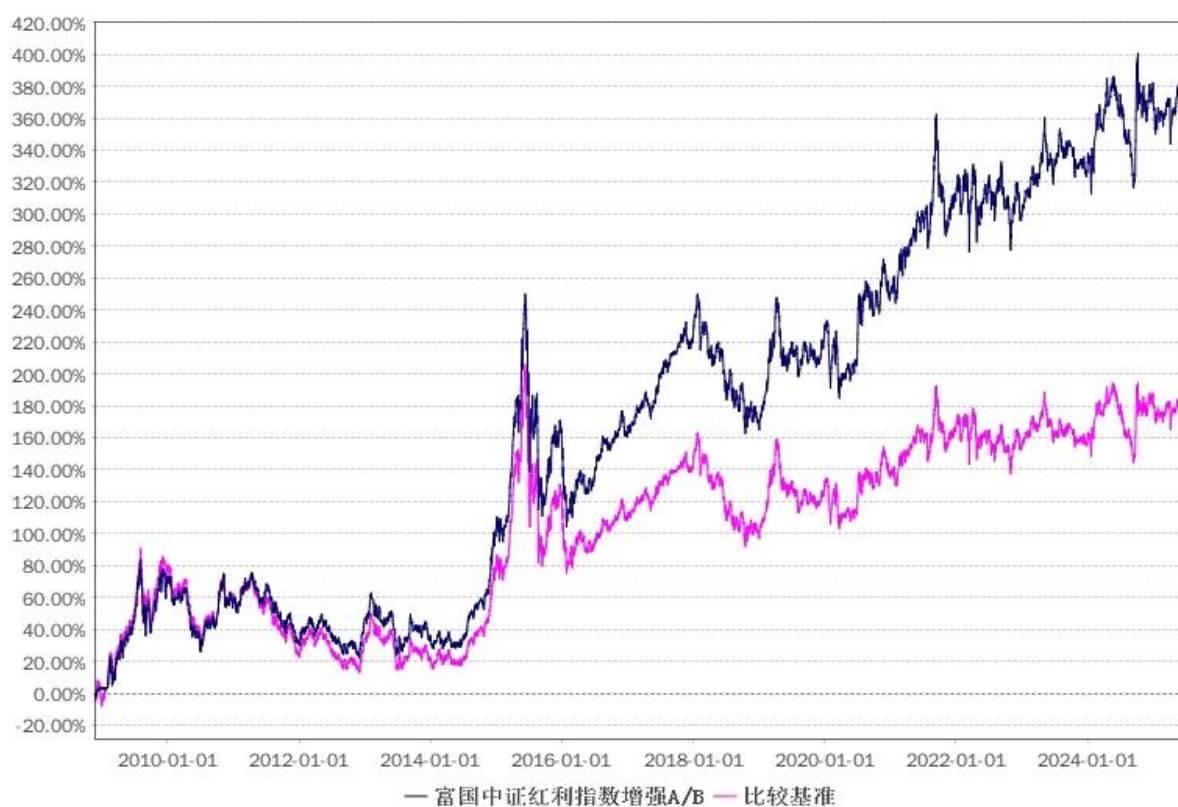
(3) 富国中证红利指数增强 Y

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	2.04%	0.40%	-0.57%	0.34%	2.61%	0.06%
过去三个月	4.18%	0.91%	0.11%	0.93%	4.07%	-0.02%
过去六个月	1.93%	0.80%	-2.65%	0.81%	4.58%	-0.01%
自基金分级生效日起至今	3.11%	0.78%	-1.53%	0.80%	4.64%	-0.02%

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 自基金转型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) 自基金转型以来富国中证红利指数增强 A/B 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 2008 年 11 月 20 日由原汉鼎证券投资基金转型而成，建仓期 6 个月，即从 2008 年 11 月 20 日至 2009 年 5 月 19 日，建仓期结束时本基金各项资产配置比例均符合基金合同的规定。

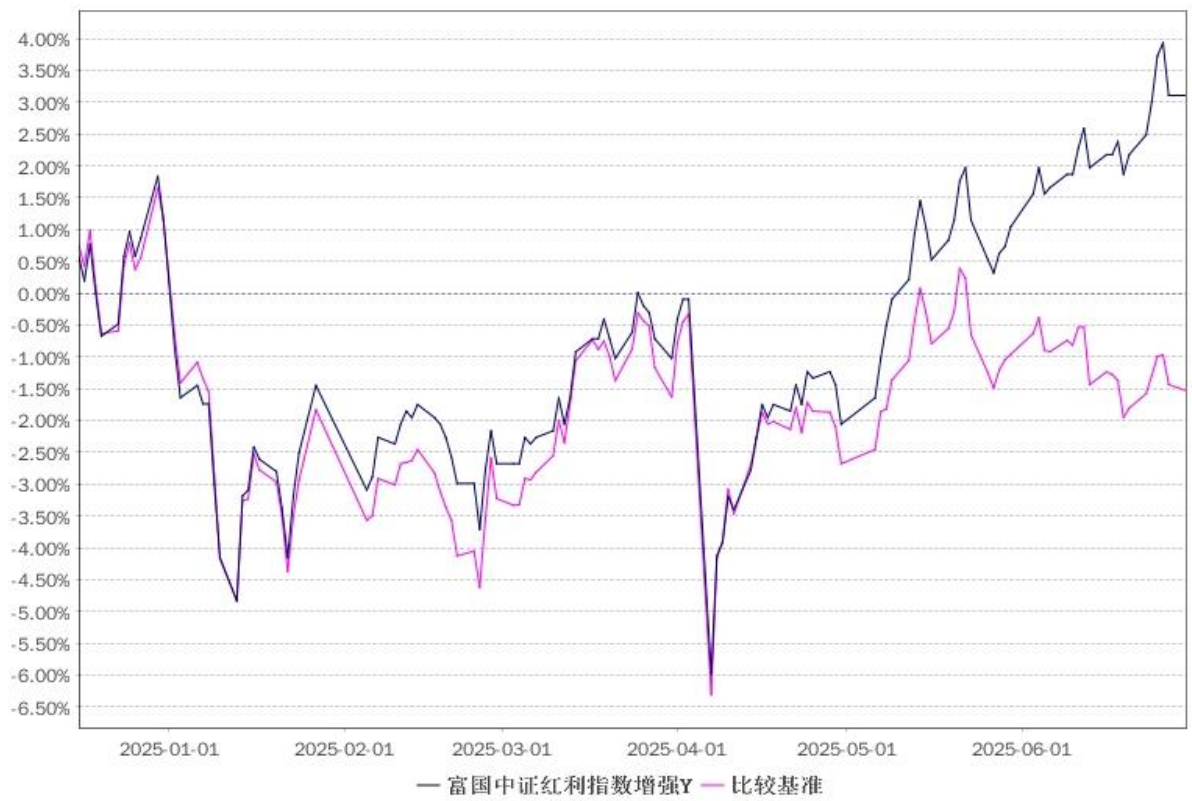
（2）自基金转型以来富国中证红利指数增强 C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2020 年 3 月 10 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

（3）自基金转型以来富国中证红利指数增强 Y 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 12 月 13 日起增加 Y 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		
徐幼华	本基金现任基金经理	2011-05-13	—	20	硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资部经理助理；自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监，量化与海外投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部副总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。自 2011 年 05 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自 2011 年 10 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2018 年 05 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2018 年 07 月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理；自 2018 年 12 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自 2024 年 04 月起任富国 MSCI 中国 A50 互联互通增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 01 月起任富国中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
方旻	本基金现任基金经理	2014-11-19	—	15	硕士，自 2010 年 2 月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、高级定量基金经理、量化投资部量化投资副总监、量化投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼资深定量基金经理。自 2014 年 11 月起任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理；自 2014 年 11

					月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理; 自 2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理; 自 2014 年 11 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理; 自 2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理; 自 2018 年 05 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理; 自 2019 年 01 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理; 自 2020 年 02 月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理; 自 2025 年 04 月起任富国致盛量化选股股票型证券投资基金基金经理; 自 2025 年 05 月起任富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金经理; 自 2025 年 06 月起任富国致享量化选股股票型证券投资基金基金经理; 具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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中证红利指数增强型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》、《富国中证红利指数增强型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 31 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

2025 年初，外部关税担忧给全球风险资产带来扰动，市场迎来快速调整。春节后，国内大模型的出现，缩小了市场对于中美 AI 发展前景的认知差异，市场以 AI 为核心开启了新一轮上行，内外资共振流入重估中国资产。随着两会积极的政策定调、以及一系列更加聚焦需求侧、民生侧的政策密集落地，市场由前期 AI 板块的“一枝独秀”，逐步扩散至消费、金融、周期等低位顺周期板块。4 月初，由于美国对全球加征不合理关税，中国随后进行反制，中美关税摩擦逐步升级，中美进入“不可贸易”状态。美国滥施关税给全球资本市场带来大规模冲击。4 月 8 日，中央汇金发布公告，通过增持 ETF 进入市场，同时中央部门、地方政府与上市公司合力维护市场稳定，指数稳步上行。国内方面，5 月 7 日国内推出一揽子金融支持政策，包含全面降准降息、维护股市楼市。海外方面，中美在关税问题上达成共识，缓解贸易摩擦，该阶段市场普涨。5 月中旬起，由于海外关税存在反复，美债及日债拍卖利率跳升，对全球市场流动性存在扰动，同时伊朗

与以色列冲突加剧全球避险情绪，市场整体振幅加大。6月下旬，随着伊朗与以色列阶段性停火，鲍威尔表态偏鸽、美联储7月降息的可能性提升，市场开始反弹。

总体来看，2025年上半年上证综指上涨2.76%，沪深300上涨0.03%，创业板指上涨0.53%，中证500指数上涨3.31%。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极获取超额收益率。

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中证红利指数增强A/B为0.993元，富国中证红利指数增强C为0.98元，富国中证红利指数增强Y为0.998元；份额累计净值富国中证红利指数增强A/B为3.23元，富国中证红利指数增强C为1.447元，富国中证红利指数增强Y为1.063元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国中证红利指数增强A/B为1.53%，富国中证红利指数增强C为1.32%，富国中证红利指数增强Y为1.93%；同期业绩比较基准收益率情况：富国中证红利指数增强A/B为-2.65%，富国中证红利指数增强C为-2.65%，富国中证红利指数增强Y为-2.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，市场逐步向好的条件在持续累积。随着稳定资本市场政策逐步深入人心，市场对于阶段性宏观数据扰动有所免疫，风险偏好有望提升。伴随着反内卷政策的出台，市场对于短期可能存在的需求回落担忧也有望缓解，着眼未来，在减少资本开支的大背景下，上游周期和中游制造产能过剩情况均有望持续好转，企业盈利有望逐步改善。与此同时，在中美谈判持续推进和国内外AI模型持续发展的背景下，科技也有望进一步打开估值空间。

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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国中证红利指数增强型证券投资基金

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	369,755,308.76	372,744,811.19
结算备付金	11,657,097.68	13,592,728.44
存出保证金	719,099.74	1,429,826.64
交易性金融资产	5,442,104,990.99	5,839,999,539.39
其中：股票投资	5,442,057,368.46	5,839,999,539.39
基金投资	—	—
债券投资	47,622.53	—
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	—	—
应收清算款	31,425.33	—
应收股利	—	—
应收申购款	26,682,718.36	15,776,391.16
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	5,850,950,640.86	6,243,543,296.82
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	—	—
应付清算款	—	—
应付赎回款	40,449,029.48	27,723,553.35
应付管理人报酬	5,706,571.79	6,707,355.89
应付托管费	951,095.26	1,117,892.63
应付销售服务费	103,029.36	255,731.31
应付投资顾问费	—	—
应交税费	—	—
应付利润	—	—

递延所得税负债	—	—
其他负债	1,552,531.44	2,086,462.11
负债合计	48,762,257.33	37,890,995.29
净资产：		
实收基金	5,195,642,268.65	5,279,812,663.03
其他综合收益	—	—
未分配利润	606,546,114.88	925,839,638.50
净资产合计	5,802,188,383.53	6,205,652,301.53
负债和净资产总计	5,850,950,640.86	6,243,543,296.82

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.992 元，基金份额总额 5,848,829,197.04 份。其中：富国中证红利指数增强 A/B 份额净值 0.993 元，份额总额 5,310,327,128.70 份；富国中证红利指数增强 C 份额净值 0.980 元，份额总额 509,806,444.72 份；富国中证红利指数增强 Y 份额净值 0.998 元，份额总额 28,695,623.62 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证红利指数增强型证券投资基金

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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	123,810,446.46	959,169,227.93
1. 利息收入	768,327.60	1,594,660.85
其中：存款利息收入	768,327.60	1,594,660.85
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	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	130,710,800.33	584,465,420.35
其中：股票投资收益	-15,388,296.05	351,524,999.24
基金投资收益	—	—
债券投资收益	3.01	—
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	146,099,093.37	232,940,421.11
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）	-9,112,696.45	370,304,389.66
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,444,014.98	2,804,757.07
减：二、营业总支出	42,507,169.89	75,011,793.65
1. 管理人报酬	35,418,062.65	59,680,633.62
2. 托管费	5,903,010.33	9,946,772.35
3. 销售服务费	837,764.24	4,292,780.02
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	—	—
8. 其他费用	348,332.67	1,091,607.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	81,303,276.57	884,157,434.28
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	81,303,276.57	884,157,434.28
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	81,303,276.57	884,157,434.28

6.3 净资产变动表

会计主体：富国中证红利指数增强型证券投资基金

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	5,279,812,663.03	925,839,638.50	6,205,652,301.53
二、本期期初净资产	5,279,812,663.03	925,839,638.50	6,205,652,301.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	84,170,394.38	319,293,523.62	403,463,918.00
（一）、综合收益总额	—	81,303,276.57	81,303,276.57
（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）	84,170,394.38	23,811,457.46	107,981,851.84
其中：1. 基金申购款	2,222,389,369.79	166,115,200.02	2,388,504,569.81

2. 基金赎回款	- 2, 306, 559, 764 . 17	- 189, 926, 657. 4 8	- 2, 496, 486, 421 . 65
(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)	-	- 376, 785, 342. 7 3	- 376, 785, 342. 7 3
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	5, 195, 642, 268 . 65	606, 546, 114. 8 8	5, 802, 188, 383 . 53
项目	上年度可比期间 (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	7, 807, 564, 954 . 08	704, 635, 017. 8 0	8, 512, 199, 971 . 88
二、本期期初净资产	7, 807, 564, 954 . 08	704, 635, 017. 8 0	8, 512, 199, 971 . 88
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	991, 607, 698. 6 0	534, 612, 715. 5 6	1, 526, 220, 414 . 16
(一)、综合收益总额	-	884, 157, 434. 2 8	884, 157, 434. 2 8
(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)	991, 607, 698. 6 0	20, 290, 539. 81	1, 011, 898, 238 . 41
其中: 1. 基金申购款	5, 288, 019, 263 . 71	594, 368, 852. 0 7	5, 882, 388, 115 . 78
2. 基金赎回款	- 4, 296, 411, 565 . 11	- 574, 078, 312. 2 6	- 4, 870, 489, 877 . 37
(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)	-	- 369, 835, 258. 5 3	- 369, 835, 258. 5 3
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	8, 799, 172, 652 . 68	1, 239, 247, 733 . 36	10, 038, 420, 38 6. 04

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

富国中证红利指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)由汉鼎证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2008年11月11日证监许可[2008]1261号文《关于核准汉鼎证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》，汉鼎证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金，调整存续期限，终止上市交易，调整投资目标、范围和策略，修订基金合同，并更名为“富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金”。自2008年11月20日起，《富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《汉鼎证券投资基金基金合同》失效。2012年4月18日富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金更名为富国中证红利指数增强型证券投资基金。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人于2020年3月6日发布的《关于富国中证红利指数增强型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，自2020年3月10日起，本基金增加C类份额。根据基金管理人于2024年12月12日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加Y类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》，自2024年12月13日起，本基金增加Y类份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据上述证监许可[2008]1261号文的核准，基金管理人于2008年11月27日至2008年12月24日向社会开放集中申购，集中申购期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2008)验字第60467606_B02号验资报告。集中申购扣除申购费后的净申购金额为人民币341,738,891.01元，在集中申购期间产生的利息为人民币21,457.10元，以上实收基金合计为人民币341,760,348.11元，折合341,760,348.11份基金份额。另外，集中申购验资结束日同时为原汉鼎证券投资基金的拆分日。于拆分日，基金管理人对原汉鼎证券投资基金通过基金份额拆分，使得验资结束当日基金份额净值为1.000元，再根据当日基金份额净值(1.000元)计算投资者集中申购应获得的基金份额，并由注册登记机构根据基金管理人进行投资者集中申购份额的登记确认。

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、存托凭证、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于中证红利指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于股票及存托凭证资产的 80%；保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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。

本基金业绩比较基准为： $90\% \times \text{中证红利指数收益率} + 10\% \times \text{一年期银行储蓄存款利率（税后）}$ 。

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。

6.4.7 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	369,755,308.76
等于：本金	369,718,701.23
加：应计利息	36,607.53
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	369,755,308.76

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		5,194,911,307.91	—	5,442,057,368.46	247,146,060.55
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	20,800.00	3.01	47,622.53	26,819.52
	银行间市场	—	—	—	—

	合计	20,800.00	3.01	47,622.53	26,819.52
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
	合计	5,194,932,107.91	3.01	5,442,104,990.99	247,172,880.07

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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 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	72,298.68
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	997,288.47
其中：交易所市场	997,288.47
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	106,720.30
应付指数使用费	254,075.64
其他	62,148.35
合计	1,552,531.44

6.4.7.7 实收基金

富国中证红利指数增强 A/B：

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	5,171,402,329.85	4,594,402,094.02
本期申购	1,195,072,690.05	1,061,793,114.70
本期赎回（以“-”号填列）	-1,056,147,891.20	-938,373,947.42
本期末	5,310,327,128.70	4,717,821,261.30

富国中证红利指数增强 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	764,727,879.97	678,612,716.82
本期申购	1,284,271,201.75	1,139,544,615.48
本期赎回（以“-”号填列）	-1,539,192,637.00	-1,365,845,165.15
本期末	509,806,444.72	452,312,167.15

富国中证红利指数增强 Y:

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	7,646,627.47	6,797,852.19
本期申购	23,682,060.79	21,051,639.61
本期赎回（以“-”号填列）	-2,633,064.64	-2,340,651.60
本期末	28,695,623.62	25,508,840.20

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

富国中证红利指数增强 A/B:

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	649,790,546.24	166,014,231.03	815,804,777.27
本期期初	649,790,546.24	166,014,231.03	815,804,777.27
本期利润	83,022,355.44	6,877,904.81	76,144,450.63
本期基金份额交易产生的变动数	8,899,819.37	5,587,066.27	3,312,753.10
其中：基金申购款	76,615,288.31	7,979,742.17	84,595,030.48
基金赎回款	-	-	-81,282,277.38

	67,715,468. 94	13,566,808 .44	
本期已分配利润	339,263,510 .08	—	-339,263,510.08
本期末	402,449,210 .97	153,549,25 9.95	555,998,470.92

富国中证红利指数增强 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	84,259,638. 01	24,564,429. 95	108,824,067.96
本期期初	84,259,638. 01	24,564,429. 95	108,824,067.96
本期利润	6,806,375.0 8	2,696,311.9 4	4,110,063.14
本期基金份额交易产生的 变动数	21,910,010. 53	7,040,719.1 3	-28,950,729.66
其中：基金申购款	67,437,544. 58	12,045,516. 56	79,483,061.14
基金赎回款	89,347,555. 11	19,086,235. 69	-108,433,790.80
本期已分配利润	36,559,194. 48	—	-36,559,194.48
本期末	32,596,808. 08	14,827,398. 88	47,424,206.96

富国中证红利指数增强 Y:

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	965,136.89	245,656.38	1,210,793.27
本期期初	965,136.89	245,656.38	1,210,793.27
本期利润	587,242.50	461,520.30	1,048,762.80
本期基金份额交易产生的 变动数	1,701,466.5 8	125,052.52	1,826,519.10
其中：基金申购款	1,867,785.5 9	169,322.81	2,037,108.40
基金赎回款	-166,319.01	-44,270.29	-210,589.30
本期已分配利润	-962,638.17	—	-962,638.17
本期末	2,291,207.8 0	832,229.20	3,123,437.00

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	742,399.74
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	17,096.05
其他	8,831.81
合计	768,327.60

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	7,559,370,446.91
减：卖出股票成本总额	7,568,031,442.85
减：交易费用	6,727,300.11
买卖股票差价收入	-15,388,296.05

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
债券投资收益——利息收入	3.01
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	—
合计	3.01

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

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（2025年01月01日至2025年06月30日）
股票投资产生的股利收益	146,099,093.37
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	146,099,093.37

6.4.7.16 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	-9,112,696.45
股票投资	-9,139,515.97
债券投资	26,819.52
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	-9,112,696.45

6.4.7.17 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	1,348,727.31
基金转换费收入	95,287.67

合计	1,444,014.98
----	--------------

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
审计费用	33,720.30
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	483.66
指数使用费	254,075.64
其他	53.07
合计	348,332.67

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
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构（2025 年 3 月 14 日前）
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	基金管理人的股东、基金代销机构（自 2025 年 3 月 14 日起）
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
海通期货股份有限公司	基金管理人的股东控制的子公司、基金代销机构
申万宏源西部证券有限公司	基金管理人的股东控制的子公司、基金代销机构
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）	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。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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国泰海通	422,410,756.06	2.87	—	—
海通证券	527,807,974.29	3.58	1,321,549,318.04	6.59
申万宏源	431,014,195.66	2.92	209,698,159.75	1.05

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

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债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（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	57,412.24	2.87	21,005.55	2.11
海通证券	71,738.09	3.58	—	—
申万宏源	58,570.92	2.92	58,570.92	5.87
关联方名称	上年度可比期间（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	972,515.65	7.78	972,515.65	12.00
申万宏源	154,318.51	1.23	—	—

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01月01日至2024年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	35,418,062.65	59,680,633.62
其中：应支付销售机构的客户维护费	13,075,979.04	14,940,845.43
应支付基金管理人的净管理费	22,342,083.61	44,739,788.19

注：本基金 A 类和 C 类基金份额的管理费按前一日该类基金份额基金资产净值的

1. 20%年费率计提，本基金 Y 类基金份额的管理费按前一日 Y 类基金份额基金资产净值的 0.60%的年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H=E\times \text{该类份额的管理费年费率}\div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的基金管理费

E 为前一日的该类基金资产净值

基金管理费每日计算，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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	5,903,010.33	9,946,772.35

注：本基金 A 类和 C 类基金份额的托管费按前一日该类基金份额基金资产净值的 0.20%的年费率计提，本基金 Y 类基金份额的托管费按前一日 Y 类基金份额基金资产净值的 0.10%的年费率计提。

托管费的计算方法如下： $H=E\times \text{该类份额的托管费年费率}\div \text{当年天数}$

H 为该类基金份额每日应计提的基金托管费

E 为前一日的该类基金资产净值

基金托管费每日计算，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			
	富国中证红利指数增强 A/B	富国中证红利指数增强 C	富国中证红利指数增强 Y	合计
富国基金管理有限公司	—	24,790.68	—	24,790.68
国泰海通证券股份有限公司	—	6,035.77	—	6,035.77
海通期货股份有限公	—	2.54	—	2.54

司				
海通证券股份有限公司	—	370.10	—	370.10
申万宏源西部证券有限公司	—	15.94	—	15.94
申万宏源证券有限公司	—	132.51	—	132.51
中国工商银行股份有限公司	—	90,097.69	—	90,097.69
合计	—	121,445.23	—	121,445.23

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01月01日至2024年06月30日）			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	富国中证红利指数增强 A/B	富国中证红利指数增强 C	富国中证红利指数增强 Y	合计
富国基金管理有限公司	—	2,827,508.47	—	2,827,508.47
海通证券股份有限公司	—	3,740.87	—	3,740.87
申万宏源西部证券有限公司	—	19.82	—	19.82
申万宏源证券有限公司	—	993.22	—	993.22
中国工商银行股份有限公司	—	29,336.06	—	29,336.06
合计	—	2,861,598.44	—	2,861,598.44

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.25% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金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

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

富国中证红利指数增强 C:

份额单位: 份

关联方名称	本期末 (2025 年 06 月 30 日)		上期末 (2024 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)	—	—	5,460,840.45	0.71

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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	369,755,308.76	742,399.74	718,484,063.24	1,420,292.54

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

富国中证红利指数增强 A/B:

单位: 人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2025-02-	2025-02-	0.650	160,162,792	179,100,71	339,263,51	—

	06	06		. 62	7. 46	0. 08	
合 计			0. 650	160, 162, 792	179, 100, 71	339, 263, 51	—
				. 62	7. 46	0. 08	

富国中证红利指数增强 C：

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份基金 份额分红数	现金形式发 放总额	再投资形式发 放总额	利润分配 合计	备注
1	2025-02-06	2025-02-06	0. 600	25, 320, 549 . 85	11, 238, 644. 6 3	36, 559, 194 . 48	—
合 计			0. 600	25, 320, 549 . 85	11, 238, 644. 6 3	36, 559, 194 . 48	—

富国中证红利指数增强 Y：

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份基金 份额分红数	现金形式发放 总额	再投资形式 发放总额	利润分配 合计	备注
1	2025-02-06	2025-02-06	0. 650	—	962, 638. 17	962, 638. 17	—
合 计			0. 650	—	962, 638. 17	962, 638. 17	—

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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 （单位：股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月	新股限售	12. 80	28. 05	80	1, 024. 00	2, 244. 00	—
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月	新股限售	5. 30	14. 44	709	3, 757. 70	10, 237. 96	—
001382	新亚电缆	2025-03-13	6 个月	新股限售	7. 40	20. 21	366	2, 708. 40	7, 396. 86	—
001390	古麒绒材	2025-05-21	6 个月	新股限售	12. 08	18. 12	178	2, 150. 24	3, 225. 36	—
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月	新股限售	19. 08	47. 25	80	1, 526. 40	3, 780. 00	—
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	新股限售	28. 33	44. 98	173	4, 901. 09	7, 781. 54	—
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新股限售	27. 50	56. 19	397	10, 917. 50	22, 307. 43	—
301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月	新股限售	10. 40	34. 11	701	7, 290. 40	23, 911. 11	—
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新股限售	39. 92	45. 22	350	9, 620. 72	15, 827. 00	—
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	新股限售	16. 50	27. 45	190	3, 135. 00	5, 215. 50	—
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	新股限售	89. 60	139. 48	73	6, 540. 80	10, 182. 04	—

301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	新股限售	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	—
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	新股限售	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	—
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月	新股限售	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	—
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新股限售	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	—
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新股限售	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	—
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股限售	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	—
603049	中策橡胶	2025-05-27	6 个月	新股限售	46.50	42.85	724	33,666.00	31,023.40	—
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股限售	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	—
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月	新股限售	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	—
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新股限售	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	—
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新股限售	93.50	90.66	166	15,521.00	15,049.56	—
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	新股限售	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	—
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	新股限售	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	—
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	新股限售	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	—
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	新股限售	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	—
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	新股限售	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	—
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	新股限售	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	—
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	新股限售	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	—
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新股限售	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	—
688757	胜科纳米	2025-03-18	6 个月	新股限售	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	—
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月	新股限售	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	—
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	新股限售	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	—

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，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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	—	—
AAA 以下	47,622.53	—
未评级	—	—
合计	47,622.53	—

注：本基金上年度末未持有按长期信用评级列示的信用债。本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，

其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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	369,755,308.76	—	—	—	—	—	369,755,308.76
结算备付金	11,657,097.68	—	—	—	—	—	11,657,097.68
存出保证金	719,099.74	—	—	—	—	—	719,099.74
交易性金融资产	—	—	47,622.53	—	—	5,442,057,368.46	5,442,104,990.99
应收清算款	—	—	—	—	—	31,425.33	31,425.33
应收申购款	—	—	—	—	—	26,682,718.36	26,682,718.36
资产总计	382,131,506.18	—	47,622.53	—	—	5,468,771,512.15	5,850,950,640.86
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	40,449,029.48	40,449,029.48
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	5,706,571.79	5,706,571.79
应付托管费	—	—	—	—	—	951,095.26	951,095.26
应付销售服务费	—	—	—	—	—	103,029.36	103,029.36
其他负债	—	—	—	—	—	1,552,531.44	1,552,531.44
负债总计	—	—	—	—	—	48,762,257.33	48,762,257.33
利率敏感度缺口	382,131,506.18	—	47,622.53	—	—	5,420,009,254.82	5,802,188,383.53
上年度末（2024 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	372,744,811.19	—	—	—	—	—	372,744,811.19
结算备付金	13,592,728.44	—	—	—	—	—	13,592,728.44
存出保证金	1,429,826.64	—	—	—	—	—	1,429,826.64
交易性金融资产	—	—	—	—	—	5,839,999,539.39	5,839,999,539.39
应收申购款	—	—	—	—	—	15,776,391.16	15,776,391.16
资产总计	387,767,366.27	—	—	—	—	5,855,775,930.55	6,243,543,296.82
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	27,723,553.35	27,723,553.35
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	6,707,355.89	6,707,355.89
应付托管费	—	—	—	—	—	1,117,892.63	1,117,892.63
应付销售服务费	—	—	—	—	—	255,731.31	255,731.31
其他负债	—	—	—	—	—	2,086,462.11	2,086,462.11
负债总计	—	—	—	—	—	37,890,995.29	37,890,995.29
利率敏感度缺口	387,767,366.27	—	—	—	—	5,817,884,935.26	6,205,652,301.53

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大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、存托凭证、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于中证红利指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于股票及存托凭证资产的 80%。保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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 (2025 年 06 月 30 日)		上年度末 (2024 年 12 月 31 日)	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5,442,057,368.46	93.79	5,839,999,539.39	94.11
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	47,622.53	0.00	—	—
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	5,442,104,990.99	93.79	5,839,999,539.39	94.11
----	------------------	-------	------------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：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%	56,793,918.31	62,454,638.27
	2. 业绩比较基准减少 1%	-56,793,918.31	-62,454,638.27

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	5,441,693,339.84	5,834,876,465.75
第二层次	—	4,677,712.50
第三层次	411,651.15	445,361.14
合计	5,442,104,990.99	5,839,999,539.39

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,442,057,368.46	93.01
	其中：股票	5,442,057,368.46	93.01
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	47,622.53	0.00
	其中：债券	47,622.53	0.00
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	381,412,406.44	6.52
8	其他各项资产	27,433,243.43	0.47
9	合计	5,850,950,640.86	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

7.2.1.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	—	—
B	采矿业	683,468,037.10	11.78
C	制造业	898,040,051.23	15.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	101,325,059.16	1.75
E	建筑业	174,085,694.90	3.00
F	批发和零售业	79,642,014.51	1.37
G	交通运输、仓储和邮政业	511,680,956.76	8.82
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	1,596,155,713.16	27.51
K	房地产业	92,753,401.42	1.60

L	租赁和商务服务业	166,520,877.99	2.87
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	177,494,641.63	3.06
S	综合	—	—
	合计	4,481,166,447.86	77.23

7.2.1.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

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	6,948,454.00	0.12
B	采矿业	20,644,845.92	0.36
C	制造业	466,413,616.29	8.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,805,157.14	0.75
E	建筑业	17,127,221.20	0.30
F	批发和零售业	20,728,550.99	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	33,357,072.00	0.57
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	85,214,637.76	1.47
J	金融业	206,548,774.17	3.56
K	房地产业	5,302,848.60	0.09
L	租赁和商务服务业	14,904,421.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	21,464,730.02	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	8,711,473.51	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	3,038,616.00	0.05
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	6,680,502.00	0.12
S	综合	—	—
	合计	960,890,920.60	16.56

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601006	大秦铁路	14,282,279	94,263,041.40	1.62
2	601166	兴业银行	3,991,143	93,153,277.62	1.61
3	601857	中国石油	10,227,489	87,445,030.95	1.51

4	601998	中信银行	10,058,906	85,500,701.00	1.47
5	601838	成都银行	4,220,141	84,824,834.10	1.46
6	601169	北京银行	12,341,654	84,293,496.82	1.45
7	600919	江苏银行	6,976,946	83,304,735.24	1.44
8	600064	南京高科	10,783,749	83,142,704.79	1.43
9	601288	农业银行	14,072,300	82,745,124.00	1.43
10	601919	中远海控	5,417,074	81,472,792.96	1.40
11	600039	四川路桥	8,148,071	80,665,902.90	1.39
12	601668	中国建筑	13,810,400	79,686,008.00	1.37
13	600350	山东高速	7,453,021	79,449,203.86	1.37
14	600016	民生银行	16,660,623	79,137,959.25	1.36
15	600741	华域汽车	4,416,429	77,949,971.85	1.34
16	600273	嘉化能源	9,059,500	76,643,370.00	1.32
17	601077	渝农商行	10,720,122	76,541,671.08	1.32
18	601939	建设银行	8,082,447	76,298,299.68	1.31
19	601088	中国神华	1,804,625	73,159,497.50	1.26
20	600295	鄂尔多斯	8,192,138	71,353,521.98	1.23
21	601658	邮储银行	12,986,300	71,035,061.00	1.22
22	601328	交通银行	8,665,502	69,324,016.00	1.19
23	002233	塔牌集团	9,351,808	69,203,379.20	1.19
24	601009	南京银行	5,947,317	69,107,823.54	1.19
25	600377	宁沪高速	4,462,249	68,450,899.66	1.18
26	601318	中国平安	1,227,577	68,105,971.96	1.17
27	600153	建发股份	6,483,759	67,236,580.83	1.16
28	601818	光大银行	16,159,395	67,061,489.25	1.16
29	600901	江苏金租	11,017,504	66,766,074.24	1.15
30	601229	上海银行	6,257,363	66,390,621.43	1.14
31	600057	厦门象屿	9,420,107	66,223,352.21	1.14
32	601988	中国银行	11,507,090	64,669,845.80	1.11
33	601825	沪农商行	6,557,600	63,608,720.00	1.10
34	601997	贵阳银行	10,165,396	63,432,071.04	1.09
35	600015	华夏银行	7,871,439	62,263,082.49	1.07
36	600028	中国石化	10,869,793	61,305,632.52	1.06
37	600000	浦发银行	4,285,966	59,489,208.08	1.03
38	601963	重庆银行	5,442,139	59,101,629.54	1.02
39	601225	陕西煤业	3,042,659	58,540,759.16	1.01
40	600019	宝钢股份	8,826,693	58,167,906.87	1.00
41	000937	冀中能源	10,027,200	57,656,400.00	0.99
42	601928	凤凰传媒	4,982,136	55,650,459.12	0.96
43	000651	格力电器	1,216,403	54,640,822.76	0.94
44	600757	长江传媒	5,728,400	53,159,552.00	0.92

45	600012	皖通高速	3,130,200	53,150,796.00	0.92
46	601168	西部矿业	3,037,644	50,516,019.72	0.87
47	000429	粤高速A	3,541,726	47,211,207.58	0.81
48	600348	华阳股份	6,659,692	44,353,548.72	0.76
49	600282	南钢股份	10,042,940	42,180,348.00	0.73
50	600177	雅戈尔	5,560,554	40,592,044.20	0.70
51	600997	开滦股份	6,851,649	40,356,212.61	0.70
52	000895	双汇发展	1,564,382	38,186,564.62	0.66
53	600395	盘江股份	8,070,214	38,172,112.22	0.66
54	600188	兖矿能源	3,049,636	37,114,070.12	0.64
55	002267	陕天然气	4,820,128	36,488,368.96	0.63
56	601098	中南传媒	2,696,564	35,378,919.68	0.61
57	600548	深高速	3,326,655	34,830,077.85	0.60
58	600755	厦门国贸	5,464,619	33,060,944.95	0.57
59	600256	广汇能源	5,472,300	32,943,246.00	0.57
60	002416	爱施德	2,680,771	32,222,867.42	0.56
61	600036	招商银行	682,800	31,374,660.00	0.54
62	601216	君正集团	5,040,000	27,820,800.00	0.48
63	002867	周大生	2,101,600	27,699,088.00	0.48
64	002932	明德生物	1,415,898	27,553,375.08	0.47
65	000581	威孚高科	1,441,095	27,294,339.30	0.47
66	601000	唐山港	6,633,430	26,931,725.80	0.46
67	603565	中谷物流	2,714,263	25,921,211.65	0.45
68	605368	蓝天燃气	2,621,192	25,792,529.28	0.44
69	603878	武进不锈	4,748,838	25,738,701.96	0.44
70	600985	淮北矿业	2,072,362	23,500,585.08	0.41
71	601101	昊华能源	3,228,200	23,372,168.00	0.40
72	600461	洪城环境	2,405,453	23,188,566.92	0.40
73	000932	华菱钢铁	4,979,190	21,908,436.00	0.38
74	600971	恒源煤电	3,303,184	21,801,014.40	0.38
75	000983	山西焦煤	3,383,335	21,653,344.00	0.37
76	600782	新钢股份	5,946,992	21,052,351.68	0.36
77	600585	海螺水泥	962,965	20,674,858.55	0.36
78	002327	富安娜	2,688,300	19,947,186.00	0.34
79	002966	苏州银行	2,248,778	19,744,270.84	0.34
80	688606	奥泰生物	285,821	19,207,171.20	0.33
81	601019	山东出版	1,764,889	16,713,498.83	0.29
82	600373	中文传媒	1,615,600	16,592,212.00	0.29
83	600900	长江电力	542,100	16,338,894.00	0.28
84	002601	龙佰集团	996,947	16,160,510.87	0.28
85	603706	东方环宇	736,100	15,855,594.00	0.27

86	002088	鲁阳节能	1,427,148	15,327,569.52	0.26
87	601717	中创智领	914,800	15,203,976.00	0.26
88	600535	天士力	960,092	15,025,439.80	0.26
89	601577	长沙银行	1,478,000	14,691,320.00	0.25
90	601666	平煤股份	1,982,501	14,690,332.41	0.25
91	600398	海澜之家	2,094,134	14,575,172.64	0.25
92	600111	北方稀土	570,400	14,202,960.00	0.24
93	600926	杭州银行	842,300	14,167,486.00	0.24
94	000988	华工科技	299,300	14,070,093.00	0.24
95	300383	光环新网	978,400	13,991,120.00	0.24
96	000001	平安银行	1,151,400	13,897,398.00	0.24
97	002352	顺丰控股	283,600	13,828,336.00	0.24
98	000090	天健集团	3,879,600	13,733,784.00	0.24
99	600123	兰花科创	2,095,335	13,661,584.20	0.24
100	000157	中联重科	1,886,676	13,640,667.48	0.24
101	603187	海容冷链	1,135,300	13,351,128.00	0.23
102	002048	宁波华翔	715,036	13,163,812.76	0.23
103	300442	润泽科技	263,600	13,056,108.00	0.23
104	002142	宁波银行	450,400	12,322,944.00	0.21
105	601916	浙商银行	3,634,100	12,319,599.00	0.21
106	601699	潞安环能	1,136,422	11,989,252.10	0.21
107	002563	森马服饰	2,249,867	11,834,300.42	0.20
108	600546	山煤国际	1,328,000	11,593,440.00	0.20
109	600694	大商股份	589,940	10,943,387.00	0.19
110	601636	旗滨集团	2,149,188	10,767,431.88	0.19
111	000063	中兴通讯	319,300	10,374,057.00	0.18
112	000830	鲁西化工	982,218	10,116,845.40	0.17
113	002807	江阴银行	2,087,700	9,916,575.00	0.17
114	600325	华发股份	1,973,449	9,610,696.63	0.17
115	601336	新华保险	159,900	9,354,150.00	0.16
116	000726	鲁泰A	1,443,900	9,154,326.00	0.16
117	601187	厦门银行	1,301,500	8,837,185.00	0.15
118	600729	重庆百货	294,223	8,776,672.09	0.15
119	605090	九丰能源	323,400	8,346,954.00	0.14
120	300580	贝斯特	338,400	8,314,488.00	0.14
121	002027	分众传媒	1,103,700	8,057,010.00	0.14
122	600941	中国移动	69,538	7,826,501.90	0.13
123	603808	歌力思	924,100	7,670,030.00	0.13
124	603259	药明康德	109,900	7,643,545.00	0.13
125	603323	苏农银行	1,355,323	7,603,362.03	0.13
126	000333	美的集团	104,201	7,523,312.20	0.13

127	002032	苏泊爾	142,000	7,439,380.00	0.13
128	002543	万和电气	668,600	7,428,146.00	0.13
129	300115	长盈精密	339,300	7,261,020.00	0.13
130	603881	数据港	283,400	7,240,870.00	0.12
131	002714	牧原股份	165,400	6,948,454.00	0.12
132	600737	中粮糖业	725,872	6,859,490.40	0.12
133	600908	无锡银行	1,055,500	6,660,205.00	0.11
134	301368	丰立智能	103,100	6,374,673.00	0.11
135	603071	物产环能	497,800	6,336,994.00	0.11
136	002737	葵花药业	402,500	6,327,300.00	0.11
137	002896	中大力德	108,680	6,293,658.80	0.11
138	600502	安徽建工	1,338,100	6,289,070.00	0.11
139	300058	蓝色光标	938,800	6,158,528.00	0.11
140	003021	兆威机电	56,900	6,153,735.00	0.11
141	002001	新和成	283,356	6,026,982.12	0.10
142	688766	普冉股份	95,327	6,024,666.40	0.10
143	002469	三维化学	710,900	5,907,579.00	0.10
144	601899	紫金矿业	299,100	5,832,450.00	0.10
145	601555	东吴证券	661,400	5,787,250.00	0.10
146	600660	福耀玻璃	99,447	5,669,473.47	0.10
147	834599	同力股份	264,256	5,655,078.40	0.10
148	002223	鱼跃医疗	158,500	5,642,600.00	0.10
149	601369	陕鼓动力	640,000	5,612,800.00	0.10
150	002014	永新股份	457,260	5,541,991.20	0.10
151	001965	招商公路	455,296	5,463,552.00	0.09
152	603909	建发合诚	557,000	5,425,180.00	0.09
153	600007	中国国贸	257,670	5,302,848.60	0.09
154	605377	华旺科技	599,612	5,282,581.72	0.09
155	600380	健康元	477,600	5,267,928.00	0.09
156	600820	隧道股份	853,062	5,203,678.20	0.09
157	601688	华泰证券	287,700	5,123,937.00	0.09
158	300657	弘信电子	182,300	5,084,347.00	0.09
159	002839	张家港行	1,123,100	5,053,950.00	0.09
160	001203	大中矿业	526,000	4,970,700.00	0.09
161	000089	深圳机场	711,200	4,907,280.00	0.08
162	300017	网宿科技	437,100	4,685,712.00	0.08
163	603728	鸣志电器	81,300	4,672,311.00	0.08
164	600704	物产中大	886,337	4,670,995.99	0.08
165	300718	长盛轴承	64,400	4,475,156.00	0.08
166	600219	南山铝业	1,163,075	4,454,577.25	0.08
167	301328	维峰电子	103,800	4,375,170.00	0.08

168	301261	恒工精密	58,000	4,227,620.00	0.07
169	603444	吉比特	14,000	4,227,300.00	0.07
170	300502	新易盛	32,780	4,163,715.60	0.07
171	002155	湖南黄金	233,200	4,162,620.00	0.07
172	688046	药康生物	271,288	4,080,171.52	0.07
173	688220	翱捷科技	51,913	4,064,787.90	0.07
174	300993	玉马科技	266,900	4,046,204.00	0.07
175	601728	中国电信	521,600	4,042,400.00	0.07
176	603309	维力医疗	309,500	3,936,840.00	0.07
177	600098	广州发展	625,900	3,911,875.00	0.07
178	603916	苏博特	428,900	3,885,834.00	0.07
179	300738	奥飞数据	183,000	3,830,190.00	0.07
180	688023	安恒信息	66,801	3,790,288.74	0.07
181	601601	中国太保	100,600	3,773,506.00	0.07
182	601991	大唐发电	1,188,500	3,767,545.00	0.06
183	688327	云从科技	269,473	3,716,032.67	0.06
184	600602	云赛智联	179,300	3,616,481.00	0.06
185	605499	东鹏饮料	11,300	3,548,765.00	0.06
186	002384	东山精密	93,500	3,531,495.00	0.06
187	300059	东方财富	149,600	3,460,248.00	0.06
188	603057	紫燕食品	157,800	3,449,508.00	0.06
189	601311	骆驼股份	381,299	3,443,129.97	0.06
190	688551	科威尔	116,369	3,420,084.91	0.06
191	600733	北汽蓝谷	461,400	3,400,518.00	0.06
192	002865	钧达股份	86,100	3,357,900.00	0.06
193	601827	三峰环境	395,482	3,322,048.80	0.06
194	600050	中国联通	605,800	3,234,972.00	0.06
195	002206	海利得	630,500	3,221,855.00	0.06
196	300953	震裕科技	31,580	3,200,633.00	0.06
197	002539	云图控股	328,400	3,080,392.00	0.05
198	002659	凯文教育	602,900	3,038,616.00	0.05
199	000598	兴蓉环境	417,200	3,008,012.00	0.05
200	688208	道通科技	98,150	3,003,390.00	0.05
201	601528	瑞丰银行	511,210	2,959,905.90	0.05
202	600482	中国动力	124,500	2,872,215.00	0.05
203	002461	珠江啤酒	248,972	2,810,893.88	0.05
204	002459	晶澳科技	269,500	2,689,610.00	0.05
205	600269	赣粤高速	519,900	2,630,694.00	0.05
206	301338	凯格精机	55,000	2,624,050.00	0.05
207	688308	欧科亿	140,285	2,588,258.25	0.04
208	000719	中原传媒	208,400	2,586,244.00	0.04

209	300432	富临精工	197,000	2,574,790.00	0.04
210	001323	慕思股份	83,700	2,524,392.00	0.04
211	300547	川环科技	82,300	2,487,106.00	0.04
212	300369	绿盟科技	319,500	2,482,515.00	0.04
213	600875	东方电气	147,800	2,474,172.00	0.04
214	603993	洛阳钼业	287,000	2,416,540.00	0.04
215	688008	澜起科技	29,128	2,388,496.00	0.04
216	600030	中信证券	86,400	2,386,368.00	0.04
217	601886	江河集团	385,800	2,372,670.00	0.04
218	000100	TCL 科技	544,900	2,359,417.00	0.04
219	002050	三花智控	89,000	2,347,820.00	0.04
220	300590	移为通信	180,000	2,341,800.00	0.04
221	000538	云南白药	40,900	2,281,811.00	0.04
222	600873	梅花生物	212,339	2,269,903.91	0.04
223	603601	再升科技	558,200	2,266,292.00	0.04
224	605507	国邦医药	114,300	2,259,711.00	0.04
225	601901	方正证券	285,100	2,255,141.00	0.04
226	301358	湖南裕能	71,800	2,239,442.00	0.04
227	601128	常熟银行	303,310	2,235,394.70	0.04
228	688114	华大智造	34,227	2,218,936.41	0.04
229	600998	九州通	424,000	2,179,360.00	0.04
230	000708	中信特钢	185,000	2,175,600.00	0.04
231	600742	富维股份	227,100	2,159,721.00	0.04
232	603848	好太太	140,000	2,156,000.00	0.04
233	000027	深圳能源	320,600	2,045,428.00	0.04
234	603662	柯力传感	31,000	1,981,830.00	0.03
235	601686	友发集团	342,100	1,943,128.00	0.03
236	600115	中国东航	464,400	1,871,532.00	0.03
237	002600	领益智造	216,000	1,855,440.00	0.03
238	001339	智微智能	38,200	1,846,206.00	0.03
239	002739	万达电影	161,400	1,844,802.00	0.03
240	002212	天融信	239,500	1,844,150.00	0.03
241	600958	东方证券	189,200	1,831,456.00	0.03
242	600298	安琪酵母	51,200	1,800,704.00	0.03
243	002916	深南电路	16,400	1,768,084.00	0.03
244	688568	中科星图	47,094	1,695,854.94	0.03
245	688480	赛恩斯	51,928	1,669,485.20	0.03
246	002913	奥士康	55,200	1,623,432.00	0.03
247	603515	欧普照明	89,200	1,604,708.00	0.03
248	002061	浙江交科	403,000	1,595,880.00	0.03
249	601163	三角轮胎	112,700	1,583,435.00	0.03

250	601799	星宇股份	12,400	1,550,000.00	0.03
251	002790	瑞尔特	211,200	1,535,424.00	0.03
252	002236	大华股份	96,400	1,530,832.00	0.03
253	002078	太阳纸业	112,100	1,508,866.00	0.03
254	600961	株冶集团	134,600	1,504,828.00	0.03
255	601139	深圳燃气	232,800	1,480,608.00	0.03
256	002595	豪迈科技	24,800	1,468,656.00	0.03
257	002701	奥瑞金	245,800	1,462,510.00	0.03
258	300938	信测标准	69,440	1,458,934.40	0.03
259	002242	九阳股份	151,600	1,440,200.00	0.02
260	002948	青岛银行	287,550	1,431,999.00	0.02
261	601107	四川成渝	237,500	1,429,750.00	0.02
262	301413	安培龙	18,500	1,414,325.00	0.02
263	000650	仁和药业	258,600	1,401,612.00	0.02
264	300755	华致酒行	72,000	1,389,600.00	0.02
265	600323	瀚蓝环境	56,900	1,385,515.00	0.02
266	603303	得邦照明	113,500	1,369,945.00	0.02
267	688029	南微医学	20,183	1,363,361.65	0.02
268	600549	厦门钨业	64,400	1,347,248.00	0.02
269	603583	捷昌驱动	36,300	1,325,676.00	0.02
270	600517	国网英大	259,400	1,322,940.00	0.02
271	600018	上港集团	230,800	1,317,868.00	0.02
272	301195	北路智控	36,450	1,304,910.00	0.02
273	002276	万马股份	88,900	1,283,716.00	0.02
274	000426	兴业银锡	81,000	1,279,800.00	0.02
275	002511	中顺洁柔	190,100	1,277,472.00	0.02
276	301029	怡合达	55,400	1,266,444.00	0.02
277	603180	金牌家居	64,000	1,246,080.00	0.02
278	002637	赞宇科技	123,500	1,232,530.00	0.02
279	002091	江苏国泰	168,600	1,225,722.00	0.02
280	603279	景津装备	81,700	1,219,781.00	0.02
281	002690	美亚光电	72,200	1,218,014.00	0.02
282	600582	天地科技	203,200	1,217,168.00	0.02
283	000963	华东医药	29,700	1,198,692.00	0.02
284	688396	华润微	25,276	1,192,016.16	0.02
285	600167	联美控股	211,800	1,190,316.00	0.02
286	002304	洋河股份	18,400	1,187,720.00	0.02
287	600109	国金证券	135,400	1,187,458.00	0.02
288	603919	金徽酒	65,400	1,183,740.00	0.02
289	002851	麦格米特	23,600	1,183,304.00	0.02
290	603233	大参林	72,200	1,176,860.00	0.02

291	600141	兴发集团	56,700	1,164,051.00	0.02
292	300788	中信出版	36,000	1,154,880.00	0.02
293	301160	翔楼新材	14,400	1,153,152.00	0.02
294	601766	中国中车	161,600	1,137,664.00	0.02
295	601665	齐鲁银行	180,000	1,137,600.00	0.02
296	301035	润丰股份	19,000	1,127,460.00	0.02
297	688281	华秦科技	17,660	1,068,606.60	0.02
298	600572	康恩贝	241,900	1,059,522.00	0.02
299	688408	中信博	22,389	1,045,118.52	0.02
300	603889	新澳股份	179,500	1,041,100.00	0.02
301	600004	白云机场	112,100	1,020,110.00	0.02
302	601319	中国人保	116,300	1,012,973.00	0.02
303	000513	丽珠集团	27,972	1,008,110.88	0.02
304	300470	中密控股	27,200	1,000,144.00	0.02
305	600426	华鲁恒升	46,000	996,820.00	0.02
306	600021	上海电力	112,700	990,633.00	0.02
307	300418	昆仑万维	29,200	981,996.00	0.02
308	002478	常宝股份	184,700	969,675.00	0.02
309	300751	迈为股份	13,900	966,884.00	0.02
310	001288	运机集团	44,980	936,933.40	0.02
311	002821	凯莱英	10,500	926,625.00	0.02
312	301220	亚香股份	20,260	909,674.00	0.02
313	000672	上峰水泥	114,700	906,130.00	0.02
314	300308	中际旭创	6,200	904,332.00	0.02
315	600095	湘财股份	89,800	900,694.00	0.02
316	002876	三利谱	35,600	896,764.00	0.02
317	603871	嘉友国际	82,600	887,950.00	0.02
318	603699	纽威股份	28,400	885,228.00	0.02
319	002003	伟星股份	80,672	880,131.52	0.02
320	603612	索通发展	47,800	878,564.00	0.02
321	688677	海泰新光	22,400	873,824.00	0.02
322	688315	诺禾致源	61,374	866,600.88	0.01
323	600480	凌云股份	71,200	866,504.00	0.01
324	688236	春立医疗	45,544	846,662.96	0.01
325	601108	财通证券	107,000	846,370.00	0.01
326	301332	德尔玛	82,300	842,752.00	0.01
327	003022	联泓新科	53,200	842,156.00	0.01
328	601133	柏诚股份	65,400	831,234.00	0.01
329	300681	英搏尔	28,700	793,842.00	0.01
330	601958	金钼股份	72,000	787,680.00	0.01
331	688819	天能股份	28,136	781,055.36	0.01

332	688025	杰普特	10,889	778,563.50	0.01
333	603277	银都股份	47,815	765,040.00	0.01
334	605128	上海沿浦	25,128	760,373.28	0.01
335	603868	飞科电器	21,000	753,270.00	0.01
336	688018	乐鑫科技	5,052	738,097.20	0.01
337	002649	博彦科技	50,200	729,406.00	0.01
338	600008	首创环保	239,400	722,988.00	0.01
339	601865	福莱特	47,300	719,433.00	0.01
340	300857	协创数据	8,320	716,019.20	0.01
341	603393	新天然气	24,400	706,380.00	0.01
342	688692	达梦数据	3,168	706,115.52	0.01
343	002911	佛燃能源	68,639	704,236.14	0.01
344	688162	巨一科技	25,378	691,296.72	0.01
345	301091	深城交	23,530	688,017.20	0.01
346	002588	史丹利	77,800	685,418.00	0.01
347	300856	科思股份	45,040	682,356.00	0.01
348	001330	博纳影业	140,100	680,886.00	0.01
349	603136	天目湖	50,200	676,194.00	0.01
350	300679	电连技术	14,900	676,162.00	0.01
351	603035	常熟汽饰	50,300	668,990.00	0.01
352	605305	中际联合	24,000	666,720.00	0.01
353	601033	永兴股份	41,977	663,656.37	0.01
354	300803	指南针	8,195	661,008.70	0.01
355	002128	电投能源	33,400	660,652.00	0.01
356	688378	奥来德	39,199	660,503.15	0.01
357	002674	兴业科技	66,000	659,340.00	0.01
358	601600	中国铝业	93,600	658,944.00	0.01
359	600329	达仁堂	19,700	657,192.00	0.01
360	000498	山东路桥	111,500	655,620.00	0.01
361	601066	中信建投	27,200	654,160.00	0.01
362	002965	祥鑫科技	16,520	647,914.40	0.01
363	603899	晨光股份	22,300	646,477.00	0.01
364	601995	中金公司	18,200	643,552.00	0.01
365	600352	浙江龙盛	62,200	631,952.00	0.01
366	002918	蒙娜丽莎	75,600	627,480.00	0.01
367	002837	英维克	20,650	613,511.50	0.01
368	600160	巨化股份	21,100	605,148.00	0.01
369	002736	国信证券	51,400	592,128.00	0.01
370	002441	众业达	64,900	588,643.00	0.01
371	002545	东方铁塔	65,500	582,295.00	0.01
372	605089	味知香	23,400	581,256.00	0.01

373	688376	美埃科技	15,438	575,374.26	0.01
374	688358	祥生医疗	19,359	573,994.35	0.01
375	002925	盈趣科技	31,600	568,168.00	0.01
376	688169	石头科技	3,623	567,180.65	0.01
377	001283	豪鹏科技	10,400	566,280.00	0.01
378	002949	华阳国际	41,700	562,116.00	0.01
379	002831	裕同科技	23,600	552,712.00	0.01
380	600486	扬农化工	9,500	551,000.00	0.01
381	688599	天合光能	37,909	550,817.77	0.01
382	603365	水星家纺	29,800	547,128.00	0.01
383	600655	豫园股份	96,900	537,795.00	0.01
384	002780	三夫户外	38,800	519,532.00	0.01
385	688786	悦安新材	21,798	507,893.40	0.01
386	600531	豫光金铅	65,600	507,744.00	0.01
387	603755	日辰股份	19,300	504,116.00	0.01
388	600104	上汽集团	30,800	494,340.00	0.01
389	002293	罗莱生活	54,700	478,078.00	0.01
390	300969	恒帅股份	7,120	476,897.60	0.01
391	001322	箭牌家居	55,600	469,820.00	0.01
392	002353	杰瑞股份	13,200	462,000.00	0.01
393	600499	科达制造	46,700	457,660.00	0.01
394	601677	明泰铝业	36,400	452,088.00	0.01
395	600511	国药股份	15,400	449,064.00	0.01
396	002643	万润股份	38,800	446,588.00	0.01
397	600481	双良节能	92,500	445,850.00	0.01
398	300809	华辰装备	11,800	443,444.00	0.01
399	603966	法兰泰克	47,100	437,088.00	0.01
400	688156	路德环境	25,710	434,756.10	0.01
401	300041	回天新材	45,000	423,900.00	0.01
402	300699	光威复材	13,200	418,044.00	0.01
403	600418	江淮汽车	10,400	416,936.00	0.01
404	603466	风语筑	41,000	413,690.00	0.01
405	600597	光明乳业	48,000	403,680.00	0.01
406	601456	国联民生	38,800	401,580.00	0.01
407	688161	威高骨科	14,374	385,079.46	0.01
408	603877	太平鸟	25,400	368,300.00	0.01
409	600475	华光环能	35,062	365,346.04	0.01
410	300770	新媒股份	9,000	359,910.00	0.01
411	605168	三人行	12,000	353,160.00	0.01
412	600866	星湖科技	51,000	352,410.00	0.01
413	001308	康冠科技	15,300	346,086.00	0.01

414	688157	松井股份	8,433	336,308.04	0.01
415	300662	科锐国际	11,300	335,723.00	0.01
416	001328	登康口腔	6,800	332,112.00	0.01
417	605080	浙江自然	11,400	316,920.00	0.01
418	000552	甘肃能化	126,936	313,531.92	0.01
419	603661	恒林股份	10,900	311,740.00	0.01
420	603195	公牛集团	6,400	308,800.00	0.01
421	301061	匠心家居	3,800	294,652.00	0.01
422	301031	中熔电气	3,600	286,740.00	0.00
423	603039	泛微网络	5,100	284,070.00	0.00
424	600993	马应龙	9,900	279,972.00	0.00
425	600362	江西铜业	11,800	276,474.00	0.00
426	301363	美好医疗	15,500	273,420.00	0.00
427	002899	英派斯	11,800	264,910.00	0.00
428	688073	毕得医药	4,536	263,178.72	0.00
429	300737	科顺股份	54,300	261,726.00	0.00
430	688293	奥浦迈	5,480	246,654.80	0.00
431	002230	科大讯飞	5,000	239,400.00	0.00
432	600479	千金药业	22,800	237,120.00	0.00
433	605599	菜百股份	14,300	233,805.00	0.00
434	601138	工业富联	10,500	224,490.00	0.00
435	600166	福田汽车	82,300	223,033.00	0.00
436	002371	北方华创	500	221,105.00	0.00
437	688563	航材股份	3,860	218,591.80	0.00
438	600483	福能股份	21,900	211,116.00	0.00
439	688696	极米科技	1,843	210,765.48	0.00
440	002683	广东宏大	6,200	210,428.00	0.00
441	000600	建投能源	30,000	207,300.00	0.00
442	300416	苏试试验	14,400	206,352.00	0.00
443	688017	绿的谐波	1,621	202,446.69	0.00
444	688082	盛美上海	1,761	200,648.34	0.00
445	688095	福昕软件	2,928	198,840.48	0.00
446	688031	星环科技	4,252	198,270.76	0.00
447	000885	城发环境	14,600	194,472.00	0.00
448	688369	致远互联	7,145	188,556.55	0.00
449	300622	博士眼镜	5,200	180,804.00	0.00
450	601868	中国能建	80,300	179,069.00	0.00
451	600795	国电电力	35,300	170,852.00	0.00
452	600096	云天化	7,600	166,972.00	0.00
453	000778	新兴铸管	42,000	156,240.00	0.00
454	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00

455	600710	苏美达	4,000	38,440.00	0.00
456	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
457	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
458	301458	钧崑电子	701	23,911.11	0.00
459	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
460	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
461	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
462	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
463	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
464	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
465	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
466	301165	锐捷网络	220	13,521.20	0.00
467	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
468	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
469	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
470	600938	中国海油	400	10,444.00	0.00
471	600276	恒瑞医药	200	10,380.00	0.00
472	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
473	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
474	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
475	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
476	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
477	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
478	301080	百普赛斯	100	7,153.00	0.00
479	300223	北京君正	100	6,920.00	0.00
480	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
481	002318	久立特材	259	6,058.01	0.00
482	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
483	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
484	002315	焦点科技	100	4,569.00	0.00
485	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
486	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
487	300893	松原安全	180	4,413.60	0.00
488	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
489	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
490	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
491	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
492	300827	上能电气	100	3,055.00	0.00
493	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
494	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
495	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00

496	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
497	002015	协鑫能科	100	1,393.00	0.00
498	002020	京新药业	100	1,305.00	0.00
499	603170	宝立食品	100	1,247.00	0.00
500	300708	聚灿光电	100	1,200.00	0.00
501	002706	良信股份	100	891.00	0.00
502	603609	禾丰股份	100	826.00	0.00
503	600236	桂冠电力	100	627.00	0.00
504	003012	东鹏控股	100	572.00	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	601919	中远海控	88,245,387.10	1.42
2	000651	格力电器	83,313,928.00	1.34
3	601168	西部矿业	82,826,072.94	1.33
4	601006	大秦铁路	82,298,636.04	1.33
5	601857	中国石油	81,707,310.61	1.32
6	000895	双汇发展	76,917,236.03	1.24
7	600273	嘉化能源	69,626,938.00	1.12
8	601009	南京银行	67,551,104.00	1.09
9	601658	邮储银行	66,919,253.00	1.08
10	601318	中国平安	65,727,794.65	1.06
11	600064	南京高科	65,446,489.08	1.05
12	000937	冀中能源	65,182,482.00	1.05
13	601825	沪农商行	64,578,137.00	1.04
14	000333	美的集团	63,818,132.50	1.03
15	600028	中国石化	63,539,563.40	1.02
16	600039	四川路桥	60,324,154.80	0.97
17	600295	鄂尔多斯	60,171,825.27	0.97
18	600036	招商银行	59,401,933.00	0.96
19	600741	华域汽车	56,742,569.60	0.91
20	000429	粤高速 A	56,633,450.71	0.91

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	601919	中远海控	105,437,962.00	1.70
2	600585	海螺水泥	93,363,428.88	1.50
3	000830	鲁西化工	82,973,810.13	1.34
4	000581	威孚高科	80,375,795.00	1.30
5	000651	格力电器	72,834,980.00	1.17
6	601988	中国银行	72,340,907.00	1.17
7	600028	中国石化	70,694,518.00	1.14
8	601000	唐山港	67,949,744.19	1.09
9	600282	南钢股份	66,983,722.00	1.08
10	601088	中国神华	66,981,316.00	1.08
11	601098	中南传媒	66,372,394.54	1.07
12	000895	双汇发展	64,975,173.00	1.05
13	600546	山煤国际	64,008,831.45	1.03
14	601009	南京银行	62,676,152.00	1.01
15	600755	厦门国贸	58,774,456.68	0.95
16	600348	华阳股份	58,402,390.00	0.94
17	600398	海澜之家	57,605,804.00	0.93
18	600971	恒源煤电	57,537,494.97	0.93
19	600019	宝钢股份	56,767,797.12	0.91
20	600919	江苏银行	56,408,234.07	0.91

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	7,179,228,787.89
卖出股票收入（成交）总额	7,559,370,446.91

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—

6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	47,622.53	0.00
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	47,622.53	0.00

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	123256	恒帅转债	208	47,622.53	0.00

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，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。

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。

7.12.2 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	719,099.74
2	应收清算款	31,425.33
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	26,682,718.36
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

9	合计	27,433,243.43
---	----	---------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
富国中证红利指数增强 A/B	335,963	15,806.29	600,515,873.19	11.31	4,709,811,255.51	88.69
富国中证红利指数增强 C	48,748	10,458.00	117,555,336.30	23.06	392,251,108.42	76.94
富国中证红利指数增强 Y	5,524	5,194.72	—	—	28,695,623.62	100.00
合计	390,235	14,987.97	718,071,209.49	12.28	5,130,757,987.55	87.72

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	富国中证红利指数增强 A/B	3,525,321.65	0.0664
	富国中证红利指数增强 C	246,848.74	0.0484
	富国中证红利指数增强 Y	540,177.63	1.8824
	合计	4,312,348.02	0.0737

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	富国中证红利指数增强 A/B	>100
	富国中证红利指数增强 C	0
	富国中证红利指数增强 Y	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	富国中证红利指数增强 A/B	10~50
	富国中证红利指数增强 C	0~10
	富国中证红利指数增强 Y	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国中证红利指数增强 A/B	富国中证红利指数增强 C	富国中证红利指数增强 Y
基金合同生效日(2008 年 11 月 20 日)基金份额总额	500,000,000.00	—	—
报告期期初基金份额总额	5,171,402,329.85	764,727,879.97	7,646,627.47
本报告期基金总申购份额	1,195,072,690.05	1,284,271,201.75	23,682,060.79
减：本报告期基金总赎回份额	1,056,147,891.20	1,539,192,637.00	2,633,064.64
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	5,310,327,128.70	509,806,444.72	28,695,623.62

§ 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

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。

10.6.2 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 (%)	
长江证券	3	836,282,699.76	5.67	113,509.18	5.67	—

诚通证券	2	—	—	—	—	—
德邦证券	1	—	—	—	—	—
东吴证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	2	2,321,552,110.28	15.75	315,498.69	15.75	—
广发证券	2	—	—	—	—	—
国都证券	2	—	—	—	—	—
国海证券	1	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通	3	422,410,756.06	2.87	57,412.24	2.87	—
国泰君安	2	1,199,682,587.06	8.14	163,028.47	8.14	—
国元证券	1	—	—	—	—	—
海通证券	1	527,807,974.29	3.58	71,738.09	3.58	—
华宝证券	1	—	—	—	—	—
华创证券	1	538,056,332.47	3.65	73,112.53	3.65	—
华泰证券	2	216,504,124.73	1.47	29,423.83	1.47	—
民生证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	2	431,014,195.66	2.92	58,570.92	2.92	—
西部证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	2	319,549,482.70	2.17	43,427.52	2.17	—
招商证券	1	2,171,038,029.44	14.73	295,019.39	14.73	—
中金公司	2	2,164,850,345.26	14.69	294,237.65	14.69	—
中泰证券	3	—	—	—	—	—
中信建投	2	3,587,870,519.71	24.35	487,556.62	24.35	—
中信证券	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。本报告期本基金退租券商交易单元：川财证券（27548、393263）。本报告期

本基金新增券商交易单元：东吴证券（723506），华泰证券（018901、62114），银河证券（016758、59446），中金公司（005253、48489）。

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。

10.7.2 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（%）
长江证券	—	—	—	—	—	—
诚通证券	—	—	—	—	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国都证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰海通	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
国元证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华宝证券	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—
上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
西部证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—

招商证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于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	关于富国中证红利指数增强型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2025年01月28日
4	富国中证红利指数增强型证券投资基金 2024 年第一次收益分配公告	规定披露媒介	2025年01月28日
5	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
6	关于富国基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	规定披露媒介	2025年03月20日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、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。

二、本报告期内，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规的规定和基金合同的约定，为降低投资者的理财成本，经与本基金托管人协商一致，自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费调整为由基金管理人承担，并相应修订基金合同有关内容。具体可参见基金管理人于 2025 年 3 月 20 日发布的《关于富国基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》及修订后的基金合同、托管协议等法律文件。

§ 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中证红利指数增强型证券投资基金的文件 2、富国中证红利指数增强型证券投资基金基金合同 3、富国中证红利指数增强型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、富国中证红利指数增强型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 。