

富国盛利增强债券型发起式证券投资基金
二〇二五年年度报告

2025年12月31日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026年03月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	15
§ 4 管理人报告	16
4.1 基金管理人及基金经理情况	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	17
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	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	21
4.9 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.....	21
§ 5 托管人报告	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	22
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.....	22
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	22
§ 6 审计报告	23
6.1 审计报告基本信息	23
6.2 审计报告的基本内容	23
§ 7 年度财务报告	25
7.1 资产负债表	25

7.2 利润表	26
7.3 净资产变动表	27
7.4 报表附注	28
§ 8 投资组合报告	62
8.1 期末基金资产组合情况	62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
8.3 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.....	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	83
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	87
8.6 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.....	88
8.7 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.....	88
8.8 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.....	88
8.9 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.....	88
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	88
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	88
8.12 本报告期投资基金情况	89
8.13 投资组合报告附注	90
§ 9 基金份额持有人信息	93
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	93
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	93
9.3 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.....	93
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	93
§ 10 开放式基金份额变动	95
§ 11 重大事件揭示	96
11.1 基金份额持有人大会决议	96
11.2 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.....	96
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	96
11.4 基金投资策略的改变	96
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	96
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	96
11.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	96
11.8 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	98
11.9 其他重大事件	99
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	101

12.1 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	101
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	101
§ 13 备查文件目录	103

§ 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	972,095,471.28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 (单位:份)	268,118,613.33份	112,635,790.84份	591,341,067.11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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年	2024 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,453,641.76	4,431,969.05
本期利润	3,283,033.79	4,671,037.45
加权平均基金份额本期利润	0.0555	0.0165
本期加权平均净值利润率	5.17%	1.64%
本期基金份额净值增长率	6.56%	2.88%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	25,815,971.43	1,170,506.20
期末可供分配基金份额利润	0.0963	0.0246
期末基金资产净值	293,939,153.82	48,921,499.16
期末基金份额净值	1.0963	1.0288
3.1.3 累计期末指标	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	9.63%	2.88%

(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	2025 年	2024 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,151,600.93	3,081,224.93
本期利润	3,810,170.31	3,365,203.08
加权平均基金份额本期利润	0.0641	0.0149
本期加权平均净值利润率	5.97%	1.49%
本期基金份额净值增长率	6.17%	2.62%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	10,085,624.34	719,935.72
期末可供分配基金份额利润	0.0895	0.0221
期末基金资产净值	122,721,415.18	33,417,997.02
期末基金份额净值	1.0895	1.0262
3.1.3 累计期末指标	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日

基金份额累计净值增长率	8.95%	2.62%
-------------	-------	-------

(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	2025 年	2024 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,300,826.35	13.97
本期利润	3,824,754.83	15.24
加权平均基金份额本期利润	0.0450	0.0144
本期加权平均净值利润率	4.14%	1.41%
本期基金份额净值增长率	6.52%	1.42%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	56,678,711.11	24.22
期末可供分配基金份额利润	0.0958	0.0246
期末基金资产净值	648,019,778.22	1,014.21
期末基金份额净值	1.0958	1.0287
3.1.3 累计期末指标	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	8.04%	1.42%

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国盛利增强债券发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.37%	0.15%	0.10%	0.20%	1.27%	-0.05%
过去六个月	4.29%	0.15%	2.26%	0.18%	2.03%	-0.03%
过去一年	6.56%	0.15%	3.47%	0.21%	3.09%	-0.06%
自基金合同生效起至今	9.63%	0.17%	9.05%	0.25%	0.58%	-0.08%

(2) 富国盛利增强债券发起式 C

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	--------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	1.22%	0.15%	0.10%	0.20%	1.12%	-0.05%
过去六个月	4.05%	0.15%	2.26%	0.18%	1.79%	-0.03%
过去一年	6.17%	0.15%	3.47%	0.21%	2.70%	-0.06%
自基金合同生效起 至今	8.95%	0.17%	9.05%	0.25%	-0.10%	-0.08%

(3) 富国盛利增强债券发起式 E

阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	1.36%	0.15%	0.10%	0.20%	1.26%	-0.05%
过去六个月	4.27%	0.15%	2.26%	0.18%	2.01%	-0.03%
过去一年	6.52%	0.15%	3.47%	0.21%	3.05%	-0.06%
自基金分级生效日 起至今	8.04%	0.16%	5.48%	0.22%	2.56%	-0.06%

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

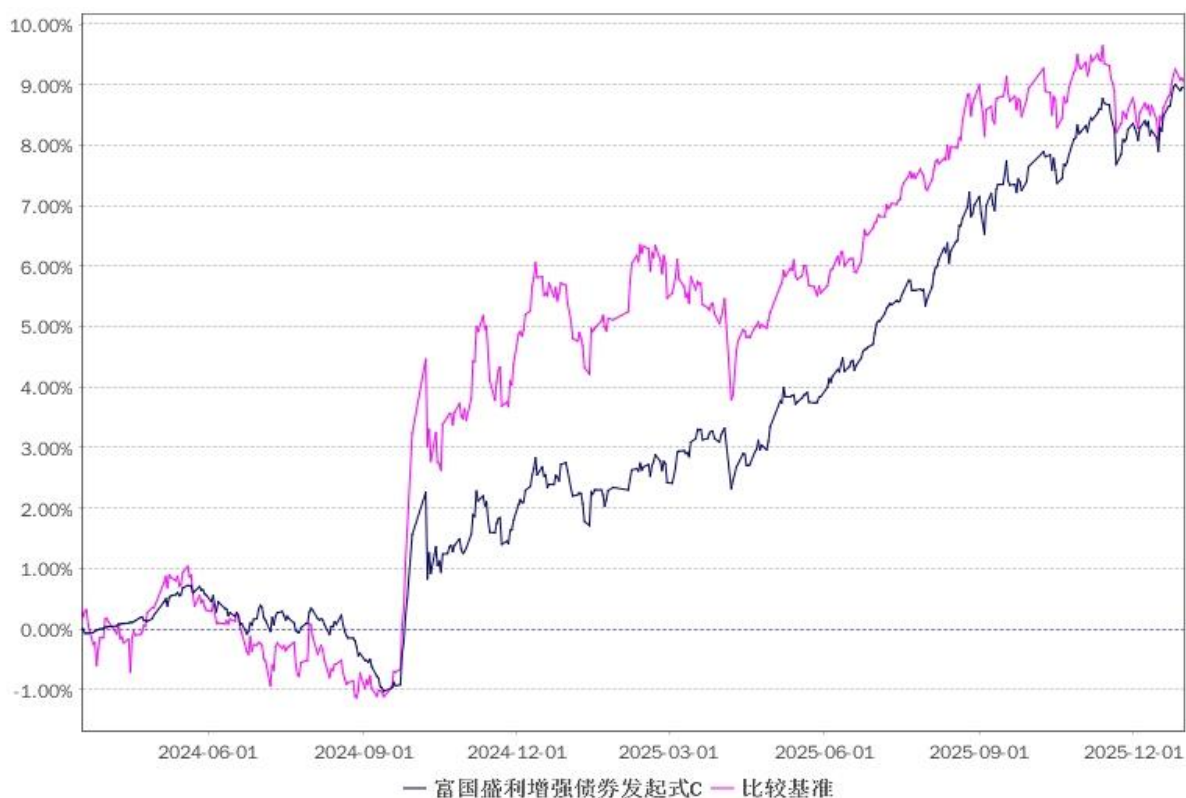
(1) 自基金合同生效以来富国盛利增强债券发起式 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 12 月 31 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 12 月 31 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

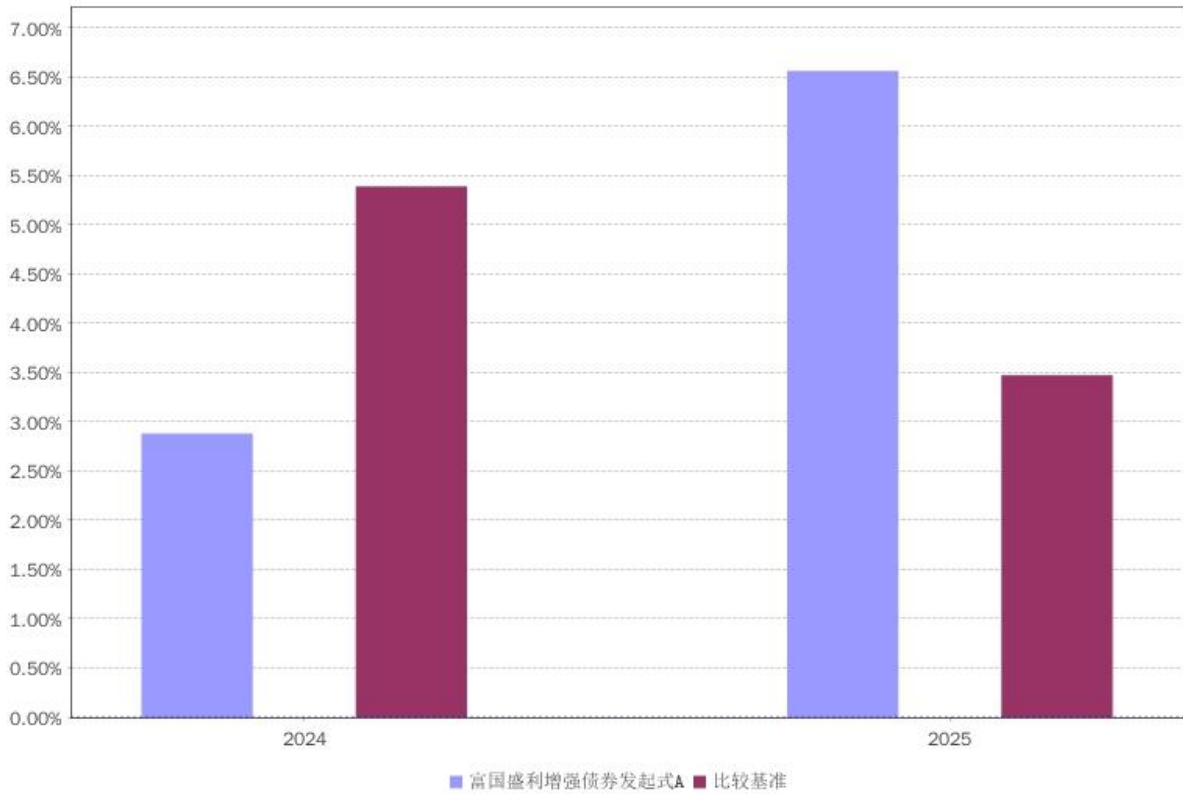


注：1、截止日期为 2025 年 12 月 31 日。

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。

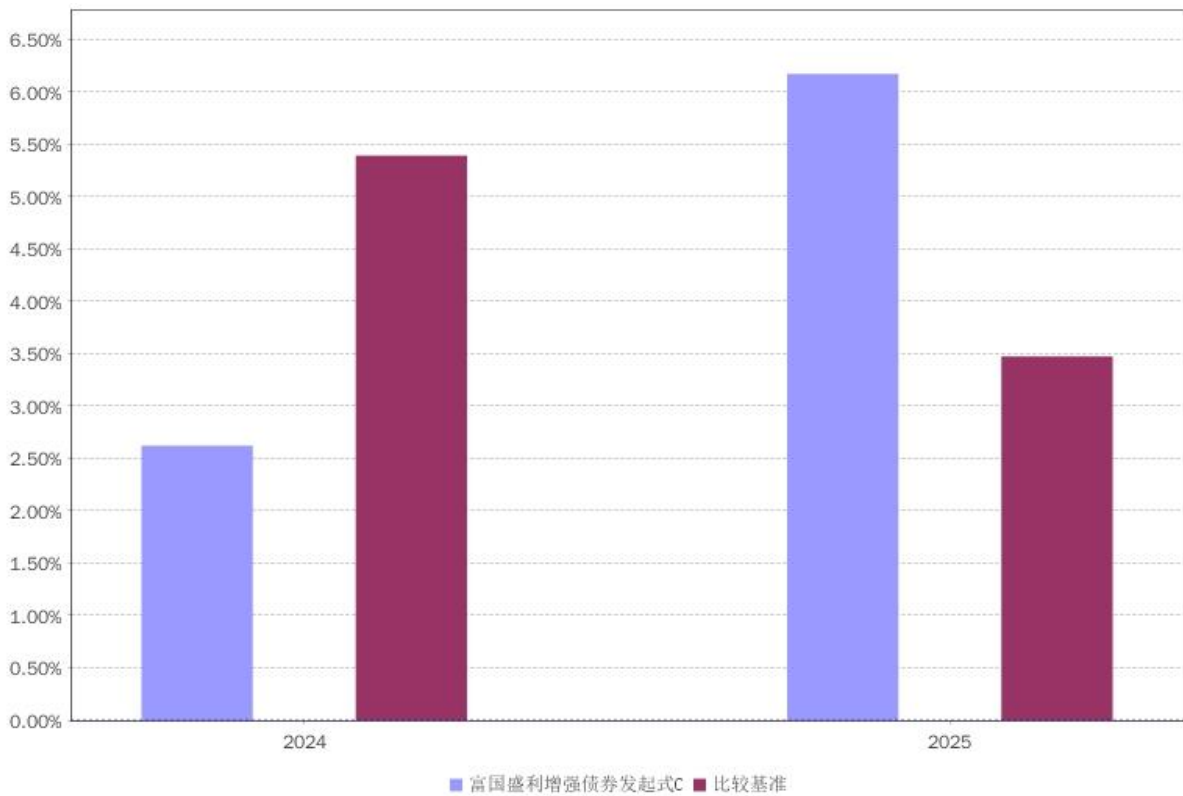
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 自基金合同生效以来富国盛利增强债券发起式 A 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



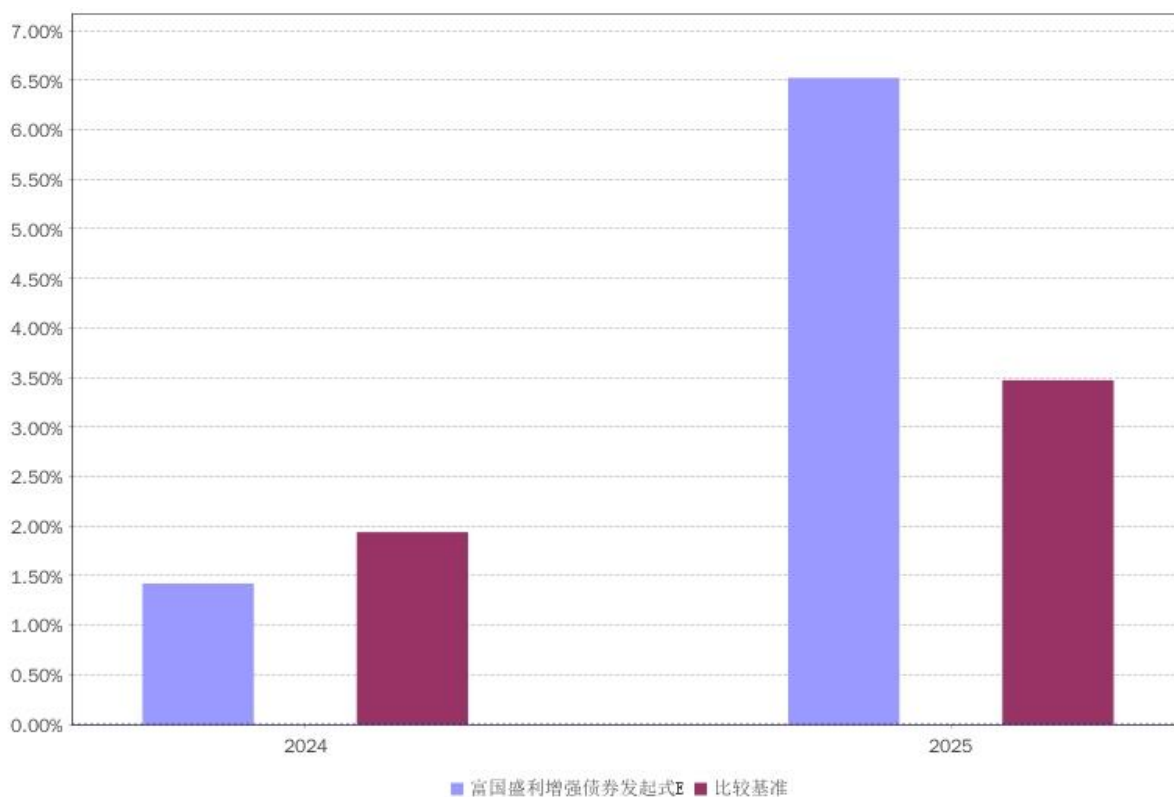
注：2024 年按实际存续期计算。

(2) 自基金合同生效以来富国盛利增强债券发起式 C 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2024 年按实际存续期计算。

(3) 自基金合同生效以来富国盛利增强债券发起式 E 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：E 类份额自 2024 年 10 月 21 日起有基金份额。2024 年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

(1) 富国盛利增强债券发起式 A

注：本基金 2024 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日未进行利润分配

(2) 富国盛利增强债券发起式 C

注：本基金 2024 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日未进行利润分配

(3) 富国盛利增强债券发起式 E

注：本基金 2024 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日未进行利润分配

§ 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、深圳设立有分公司，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《国泰君安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 12 月 31 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 422 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈斯扬	本基金现任基金经理	2024-03-18	—	13	硕士，曾任交银施罗德基金管理有限公司研究员、投资经理；自2016年10月加入富国基金管理有限公司，历任定量投资经理、定量基金经理；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《证券投资基金经营机构董事、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 公平交易制度和控制方法

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。通过实行事前控制、事中监控、

事后评估反馈的流程化管理，对投资管理活动相关的各个环节加强控制，确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待。

一级市场投资通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；二级市场通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。管理人同时关注投资交易过程中组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制、银行间市场交易价格的公允性评估等。管理人对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日反向交易进行监控，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的反向交易；同日同向交易方面，通过交易系统对投资组合间的交易公平性进行自动化处理，并专项评估不同时间窗口下（1日内、3日内、5日内）投资组合间同一投资标同向交易价差的合理性。

管理人定期对涉及公平交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类投资组合间、同一基金经理管理的不同投资组合间的交易行为。若发现异常事项，风险管理部门要求相关当事人做出合理性解释，并及时进行报告。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，公司严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规和内部管理办法的要求，通过自动化系统、人工审核等方式在各投资业务环节加强管控，确保公平对待旗下管理的所有投资组合。管理人对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析评估。在同向交易价差分析方面，采集连续四个季度不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，对同向交易价差进行假设检验并对检验结果进行分析。分析结果表明在同向交易价差方面，本投资组合与公司管理的其他投资组合未出现可能导致不公平交易、利益输送的交易事项。本报告期内公司旗下基金严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.3 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 81 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，国内权益市场整体延续了去年末以来的动能，多数股指于年末创下或接近新高。但期间市场也经历了显著的波动和结构变化。市场从一季度的 AI 变革和机器人主题热点，到二季度的以关税事件为代表的全球地缘局势巨震，再到三季度成长龙头股领涨，最后到四季度的震荡整固，市场波动率呈现先放大、后逐渐收敛的过程，尤其自二季度起，在中央汇金等资金的影响下，市场逐渐进入阶梯式稳步上涨的阶段。期间，组合的权益仓位整体运行稳健，全年超额收益尚可，为组合贡献了一定的增厚。

债券市场则与过去几年不同，受市场风险偏好回升和财政供给压力影响，全年债市整体偏弱，超长端利率有所上行。尽管二季度地缘局势的变化推动长端阶段性下行，但窗口期很短，参与难度非常大。全年来看，组合整体上及时缩短了久期敞口，以偏短的久期应对偏弱的债市表现。

可转债市场全年表现始终较强，尤其一季度叠加小市值风格的强势，表现显著好于权益宽基指数。但受到供不应求的市场状态影响，转债估值也出现了持续大幅的拉升，至年末转债估值已抬升到了历史极值附近水平，性价比显著下降。尽管在一季度转债曾是组合收益贡献的重要部分，但此后随着估值水平逐渐变贵、交易难度加大、收益贡献潜力逐渐被压缩，组合的转债敞口也随之持续压降。但组合的转债仓位仍将保持灵活性，后续将视估值水平变化而作相应调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 12 月 31 日，本基金份额净值富国盛利增强债券发起式 A 为 1.0963 元，富国盛利增强债券发起式 C 为 1.0895 元，富国盛利增强债券发起式 E 为 1.0958 元；份额累计净值富国盛利增强债券发起式 A 为 1.0963 元，富国盛利增强债券发起式 C 为 1.0895 元，富国盛利增强债券发起式 E 为 1.0958 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 6.56%，富国盛利增强债券发起式 C 为 6.17%，富国盛利增强债券发起式 E 为 6.52%；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 3.47%，富国盛利增强债券发起式 C 为 3.47%，富国盛利增强债券发起式 E 为 3.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内传统经济增长指标已有企稳的些微迹象，房地产市场经历漫长的调整后，似乎也有迎来曙光的可能，或许 26 年市场对于国内经济的长期景气预期有望得到扭转。而从上市公司的

成长景气度来看，盈利已有向上的印证，25年国内权益市场的上涨，并不只是估值的抬升，也有盈利的初步支持。因此，后续权益市场继续走好的逻辑或许能得到越来越多的来自基本面的佐证，这意味着中期风险资产或仍然相对债市占优。

不过，全球地缘局势的变化仍然蕴藏着巨大的不确定性，从贵金属持续的强势表现也可见一斑。国内经济增长动能的初步修复与央行维持宽松货币政策的基调相交织，使得债券市场在利率绝对低位上的波动仍会放大，但随时可能再度承担起避险资产的职责，迎来阶段性的利率下行窗口。如果这样的机会来临，我们也会积极把握交易和配置性窗口。

可转债市场在经过近两年的牛市后，估值已经抬升到了历史极高位水平，这当然是供需面共振下的结果，但也意味着转债在一个典型多资产组合当中的重要性正在下移，后续交易上的风险会大于配置层面的机会。作为陪伴我们组合已久的重要伙伴，我们当然期待转债重新恢复性价比的那一日，但从经验来看，这一过程或许需要较长的时间，因此组合在转债敞口上的重心或趋势性下移，我们会积极观察这一市场的变化，并随时做出相应调整。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

报告期内，基金管理人始终秉持“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持持有人利益优先原则，持续完善内控机制，强化合规管理，切实防范风险，保障公司各项业务合法合规、稳健有序开展。除积极落实各项监管新规要求外，主要开展以下监察稽核工作：

一、深化合规文化建设与员工行为管理

持续推动合规文化建设，通过多层次、多维度合规培训、考试、谈话及宣导活动进行全员覆盖，着重加强投资研究和基金销售等重点业务领域的合规督导，强化员工主动合规意识。同时，持续强化员工行为管控，通过事前宣导、事中监测、事后检查等措施，落细落实各项监管要求。

二、完善制度流程与系统化建设

持续推进制度流程优化，新增及修订多项内部管理制度，范围涵盖基本管理制度及业务操作细则。推动合规风控系统升级，完成多项系统、平台等信息化工具重构，提升合规风控管理效率。优化多项合规风控业务流程，提升全流程覆盖广度深度与规范化管控质效。

三、强化投资合规与风险管理

加强投资组合合规监控，持续优化关联交易、公平交易及异常交易监测机制。升级风控系统功能，开展多维度专项风险评估，提升事前、事中、事后风险管理能力。

四、落实反洗钱与投资者保护工作要求

积极落实各项反洗钱监管要求，贯彻落实风险为本的工作方法，持续完善洗钱风险管理体系，进一步健全内控制度流程，深入开展反洗钱系统建设与数据治理，优化客户尽职调查与可疑交易监测模型，持续提升洗钱风险管理水平。认真开展投资者适当性、信息披露、宣传推介材料审核等工作，将投资者保护工作落到实处。

五、加强内外部审计与监督

深入开展内部审计，在基础风险点例行检查基础上开展多项专项审计检查，涵盖投研、销售、信息技术等重点领域。配合外部机构完成信息技术全面审计与合规有效性评估等工作。积极落实问题整改，持续提升内控水平。

本基金管理人将一如既往恪守受托责任，勤勉尽责，切实保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

基金合同生效后继续存续的，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

报告期内，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，本托管人未发现有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 托管人对本年度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年度报告中的财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70015656_B190 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富国盛利增强债券型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了富国盛利增强债券型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的富国盛利增强债券型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了富国盛利增强债券型发起式证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。</p> <p>审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富国盛利增强债券型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>富国盛利增强债券型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估富国盛利增强债券型发起式证券</p>

	<p>投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督富国盛利增强债券型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对富国盛利增强债券型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富国盛利增强债券型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>王珊珊 赵梓云</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2026年03月27日</p>

§ 7 年度财务报告

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	30,735,262.48	137,116.98
结算备付金	8,451,799.25	855,644.31
存出保证金	154,845.41	29,419.53
交易性金融资产	1,043,767,985.76	80,860,879.43
其中：股票投资	175,147,786.05	13,420,169.40
基金投资	—	—
债券投资	868,620,199.71	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	2,698,288.11	599,735.93
应收清算款	5,730,935.23	3,100,528.14
应收股利	—	—
应收申购款	39,695,411.41	530.97
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	1,131,234,527.65	85,583,855.29
负债和净资产	本期末	上年度末
	2025 年 12 月 31 日	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	28,184,082.82	-203.83
应付清算款	34,304,705.30	3,000,434.51
应付赎回款	2,897,287.35	103,649.76
应付管理人报酬	322,467.44	29,140.38
应付托管费	80,616.84	7,285.08
应付销售服务费	43,547.59	8,819.16
应付投资顾问费	—	—
应交税费	12,458.21	336.77

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	709,014.88	93,883.07
负债合计	66,554,180.43	3,243,344.90
净资产：		
实收基金	972,095,471.28	80,117,445.02
其他综合收益	—	—
未分配利润	92,584,875.94	2,223,065.37
净资产合计	1,064,680,347.22	82,340,510.39
负债和净资产总计	1,131,234,527.65	85,583,855.29

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0952 元，基金份额总额 972,095,471.28 份。其中：富国盛利增强债券发起式 A 份额净值 1.0963 元，份额总额 268,118,613.33 份；富国盛利增强债券发起式 C 份额净值 1.0895 元，份额总额 112,635,790.84 份；富国盛利增强债券发起式 E 份额净值 1.0958 元，份额总额 591,341,067.11 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 (2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日)	上年度可比期间(2024 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日)
一、营业总收入	12,575,128.64	10,904,230.88
1. 利息收入	115,048.95	4,656,114.47
其中：存款利息收入	59,133.72	358,918.38
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	55,915.23	4,297,196.09
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	11,403,938.45	5,724,303.15
其中：股票投资收益	5,277,668.62	586,637.90
基金投资收益	—	—
债券投资收益	5,758,796.00	3,957,650.83
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	367,473.83	1,180,014.42
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）	1,011,889.89	523,047.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	44,251.35	765.44
减：二、营业总支出	1,657,169.71	2,867,975.11
1. 管理人报酬	835,845.74	1,544,199.26
2. 托管费	208,961.40	386,049.78
3. 销售服务费	190,928.07	515,316.74
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	305,656.33	229,425.54
其中：卖出回购金融资产支出	305,656.33	229,425.54
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	3,284.36	9,355.65
8. 其他费用	112,493.81	183,628.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	10,917,958.93	8,036,255.77
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	10,917,958.93	8,036,255.77
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	10,917,958.93	8,036,255.77

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2025年01月01日至2025年12月31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）	891,978,026.26	90,361,810.57	982,339,836.83
（一）、综合收益总额	—	10,917,958.93	10,917,958.93
（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）	891,978,026.26	79,443,851.64	971,421,877.90
其中：1. 基金申购款	1,424,100,837.01	121,390,026.14	1,545,490,863.15
2. 基金赎回款	-532,122,810.75	-41,946,174.50	-574,068,985.25
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—

四、本期期末净资产	972,095,471.28	92,584,875.94	1,064,680,347.22
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12月31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)	- 2,536,422,526.86	2,223,065.37	- 2,534,199,461.49
(一)、综合收益总额	—	8,036,255.77	8,036,255.77
(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)	- 2,536,422,526.86	-5,813,190.40	- 2,542,235,717.26
其中:1.基金申购款	4,579,054.19	40,225.68	4,619,279.87
2.基金赎回款	- 2,541,001,581.05	-5,853,416.08	- 2,546,854,997.13
(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)	—	—	—
三、本期期末净资产	80,117,445.02	2,223,065.37	82,340,510.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富国盛利增强债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]215号文《关于准予富国盛利增强债券型发起式证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人富国基金管理有限公司自2024年3月1日至2024年3月14日止期间向社会公开发行募集,募集期结束经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具德师报(验)字(24)第00038号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2024年3月18日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。富国盛利增强债券发起式收到的净有效认购金额为人民币2,615,340,376.61元,其中归属于A类基金份额为人民币1,508,035,293.17元,归属于C类基金份额为人民币1,107,305,083.44元。经基金注册登记机构计算并确认的认购资金利息计人民币1,199,595.27元,其中归属于A类基金份额为727,621.10元,归属于C类基金份额为

471,974.17 元。合计为人民币 2,616,539,971.88 元，折算基金份额计 2,616,539,971.88 份。根据基金管理人于 2024 年 10 月 16 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国盛利增强债券型发起式证券投资基金增加 E 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自 2024 年 10 月 18 日起，本基金增加 E 类份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

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

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

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

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

本基金业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率×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%。

7.4.2 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2号《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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2025年1月1日至2025年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2025年1月1日至2025年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）

或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的可相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的可相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融

负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红；若基金合同生效不满 3 个月，本基金可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权，由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类和 E 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所

产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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；

根据财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照

规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4 企业所得税

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

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

5 个人所得税

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

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

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

6 境外投资

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2025年12月31日)	上年度末 (2024年12月31日)
活期存款	30,735,262.48	137,116.98
等于：本金	30,730,879.43	137,069.40
加：应计利息	4,383.05	47.58
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	30,735,262.48	137,116.98

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末(2025年12月31日)				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	173,145,162.44	—	175,147,786.05	2,002,623.61	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	428,070,394.19	3,083,644.32	431,320,457.40	166,418.89
	银行间市场	435,124,804.79	2,809,042.31	437,299,742.31	-634,104.79
	合计	863,195,198.98	5,892,686.63	868,620,199.71	-467,685.90
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	1,036,340,361.42	5,892,686.63	1,043,767,985.76	1,534,937.71	
项目	上年度末(2024年12月31日)				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	13,194,110.71	—	13,420,169.40	226,058.69	

贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	25,712,992.43	219,854.54	26,347,225.10	414,378.13
	银行间市场	41,051,389.00	159,484.93	41,093,484.93	-117,389.00
	合计	66,764,381.43	379,339.47	67,440,710.03	296,989.13
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		79,958,492.14	379,339.47	80,860,879.43	523,047.82

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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12月31日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,698,288.11	—
银行间市场	—	—
合计	2,698,288.11	—
项目	上年度末（2024年12月31日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	599,735.93	—
银行间市场	—	—
合计	599,735.93	—

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
----	------------------	-------------------

应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	0.01	—
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	691,014.87	40,883.07
其中：交易所市场	674,894.87	38,810.57
银行间市场	16,120.00	2,072.50
应付利息	—	—
预提审计费	18,000.00	53,000.00
合计	709,014.88	93,883.07

7.4.7.7 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12月31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	280,910,729.79	280,910,729.79
本期赎回（以“-”号填列）	-60,345,288.43	-60,345,288.43
本期末	268,118,613.33	268,118,613.33

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12月31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	414,188,350.28	414,188,350.28
本期赎回（以“-”号填列）	-334,115,846.59	-334,115,846.59
本期末	112,635,790.84	112,635,790.84

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12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	985.90	985.90
本期申购	729,001,756.94	729,001,756.94
本期赎回（以“-”号填列）	-137,661,675.73	-137,661,675.73
本期末	591,341,067.11	591,341,067.11

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 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	3,453,641.76	-170,607.97	3,283,033.79
本期基金份额交易产生的变动数	21,191,823.47	-22,643.96	21,169,179.51
其中：基金申购款	25,188,941.64	-184,163.21	25,004,778.43
基金赎回款	-3,997,118.17	161,519.25	-3,835,598.92
本期已分配利润	—	—	—
本期末	25,815,971.43	4,569.06	25,820,540.49

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	3,151,600.93	658,569.38	3,810,170.31
本期基金份额交易产生的变动数	6,304,690.37	-883,946.21	5,420,744.16
其中：基金申购款	33,220,752.43	-1,683,778.29	31,536,974.14
基金赎回款	-26,916,062.06	799,832.08	-26,116,229.98
本期已分配利润	—	—	—
本期末	10,176,227.02	-90,602.68	10,085,624.34

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	3,300,826.35	523,928.48	3,824,754.83
本期基金份额交易产生的变动数	53,407,203.41	-553,275.44	52,853,927.97
其中：基金申购款	65,759,875.58	-911,602.01	64,848,273.57
基金赎回款	-12,352,672.17	358,326.57	-11,994,345.60
本期已分配利润	—	—	—
本期末	56,708,053.98	-29,342.87	56,678,711.11

7.4.7.9 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12月31日）	上年度可比期间（2024年3月18日（基金合同生效日）至2024年12月31日）
活期存款利息收入	36,490.82	262,180.42
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	7,073.34	94,886.01
其他	15,569.56	1,851.95
合计	59,133.72	358,918.38

7.4.7.10 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12月31日）	上年度可比期间（2024年3月18日（基 金合同生效日）至2024年12月31日）
卖出股票成交总额	874,677,461.88	222,556,740.06
减：卖出股票成本总额	868,068,234.45	221,574,020.81
减：交易费用	1,331,558.81	396,081.35
买卖股票差价收入	5,277,668.62	586,637.90

7.4.7.11 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日）	上年度可比期间（2024年3月18 日（基金合同生效日）至2024年 12月31日）
债券投资收益——利息收入	4,166,073.91	7,483,420.76
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券 到期兑付）差价收入	1,592,722.09	-3,525,769.93
合计	5,758,796.00	3,957,650.83

7.4.7.12.2 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12月31日）	上年度可比期间（2024年3月 18日（基金合同生效日）至 2024年12月31日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总 额	852,643,210.68	1,387,595,036.86
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成 本总额	846,208,660.22	1,368,393,519.69
减：应计利息总额	4,808,958.36	22,713,991.15
减：交易费用	32,870.01	13,295.95
买卖债券差价收入	1,592,722.09	-3,525,769.93

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖贵金属交易。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年3月18日（基金合同生效日）至2024年12月31日）
股票投资产生的股利收益	367,473.83	1,180,014.42
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	367,473.83	1,180,014.42

7.4.7.17 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12月31日）	上年度可比期间（2024年3月18日（基金合同生效日）至2024年12月31日）
1. 交易性金融资产	1,011,889.89	523,047.82
股票投资	1,776,564.92	226,058.69
债券投资	-764,675.03	296,989.13
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	1,011,889.89	523,047.82

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年3月18日（基金合同生效日）至2024年12月31日）
基金赎回费收入	44,225.21	679.06
基金转换费收入	26.14	86.38
合计	44,251.35	765.44

7.4.7.19 持有基金产生的费用

项目	本期（2025年01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年3月18日（基金合同生效日）至2024年12月31日）
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	—	—
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	—	—
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	—	—

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。

7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年3月18日（基金合同生效日）至2024年12月31日）
审计费用	18,000.00	53,000.00
信息披露费	40,000.00	100,000.00
证券出借违约金	—	—
银行费用	17,286.76	13,228.14
债券账户维护费	36,000.00	16,500.00
其他	1,207.05	900.00
合计	112,493.81	183,628.14

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
山东省金融资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
加拿大蒙特利尔银行	基金管理人的股东

注：（1）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%。

(2) 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日）		上年度可比期间（2024年3月18日（基金合同生效日）至2024年12月31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	198,291,193.24	10.42	—	—
海通证券	—	—	86,275,438.02	18.87

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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12月31日）		上年度可比期间（2024年3月18日（基金合同生效日）至2024年12月31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	52,138,508.36	6.73	—	—
海通证券	—	—	23,745,435.79	2.46

7.4.10.1.4 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12月31日）	上年度可比期间（2024年3月18日（基金合同生效日）至2024年12月31日）

	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
国泰海通	831,990,000.00	14.45	—	—
海通证券	—	—	4,014,000,000.00	29.86

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.1.6 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12月31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	80,488.19	10.42	61,537.99	9.12
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12月31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	60,301.25	23.61	1,266.22	3.26

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年3月18日（基金合同生效日）至2024年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	835,845.74	1,544,199.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	201,455.39	721,874.92
应支付基金管理人的净管理费	634,390.35	822,324.34

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

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日）	上年度可比期间（2024 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日）
当期发生的基金应支付的托管费	208,961.40	386,049.78

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。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 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	5,370.05	5,376.41
国泰海通证券股份有限公司	—	122.95	—	122.95
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	—	162,949.02	—	162,949.02
合计	—	163,085.65	5,370.05	168,455.70

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间（2024 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日）
--------------	---

方名称	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	—	64.47	—	64.47
中国农业银行股份有限公司	—	356,909.67	—	356,909.67
合计	—	356,974.14	—	356,974.14

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

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

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基础资产净值

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

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2025年01月01日至2025年12月31日）			上年度可比期间（2024年3月18日（基金合同生效日）至2024年12月31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	—	—	—	—	—	985.90
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	—	985.90
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.73%	—	0.00%	21.03%	—	100.00%

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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月31日）		上年度可比期间（2024年3月18日（基金合同生效日）至2024年12月31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	30,735,262.48	36,490.82	137,116.98	262,180.42

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

7.4.10.8.2 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。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
111024	澳弘转债	2025-12-11	1-6个月 (含)	认购新发证券	100.00	100.01	790	79,000.00	79,007.27	—

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600058	五矿发展	2025年12月30日	重大事项停牌	11.52	2026年01	12.67	5,800.00	58,270.00	66,816.00	—

					月 15 日					
--	--	--	--	--	-----------	--	--	--	--	--

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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 28,184,082.82 元，于 2026 年 1 月 5 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
AAA	497,163,175.11	4,658,078.17
AAA 以下	8,681,521.73	1,310,795.42
未评级	123,410,236.01	3,079,428.33
合计	629,254,932.85	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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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7.4.12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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 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，并按照合同约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 12月31日）	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	30,735,262.48	—	—	—	30,735,262.48
结算备付金	8,451,799.25	—	—	—	8,451,799.25
存出保证金	154,845.41	—	—	—	154,845.41
交易性金融资产	189,859,271.53	660,324,686.42	18,436,241.76	175,147,786.05	1,043,767,985.76
买入返售金融资产	2,698,288.11	—	—	—	2,698,288.11
应收清算款	—	—	—	5,730,935.23	5,730,935.23
应收申购款	—	—	—	39,695,411.41	39,695,411.41
资产总计	231,899,466.78	660,324,686.42	18,436,241.76	220,574,132.69	1,131,234,527.65
负债					
卖出回购金融资产款	28,184,082.82	—	—	—	28,184,082.82
应付清算款	—	—	—	34,304,705.30	34,304,705.30
应付赎回款	—	—	—	2,897,287.35	2,897,287.35
应付管理人报酬	—	—	—	322,467.44	322,467.44
应付托管费	—	—	—	80,616.84	80,616.84
应付销售服务费	—	—	—	43,547.59	43,547.59
应交税费	—	—	—	12,458.21	12,458.21
其他负债	—	—	—	709,014.88	709,014.88
负债总计	28,184,082.82	—	—	38,370,097.61	66,554,180.43
利率敏感度缺口	203,715,383.96	660,324,686.42	18,436,241.76	182,204,035.08	1,064,680,347.22
上年度末（2024 年12月31日）	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	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	41,480,833.04	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	43,102,749.79	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	43,102,953.62	17,745,425.59	8,214,451.40	13,277,679.78	82,340,510.39

7.4.13.4.1.2 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12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-1,970,534.82	-242,510.96
2. 基准点利率减少0.1%	1,970,534.82	242,510.96	

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末（2025年12月31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	175,147,786.05	16.45	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	868,620,199.71	81.59	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	1,043,767,985.76	98.04	80,860,879.43	98.20

7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加1%	6,919,742.82	470,582.12
2. 业绩比较基准减少1%	-6,919,742.82	-470,582.12	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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12月31日)	上年度末 (2024年12月31日)
第一层次	186,931,274.58	15,103,067.54
第二层次	856,836,711.18	65,757,811.89
第三层次	—	—
合计	1,043,767,985.76	80,860,879.43

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 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。

7.4.15.2 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	175,147,786.05	15.48
	其中：股票	175,147,786.05	15.48
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	868,620,199.71	76.79
	其中：债券	868,620,199.71	76.79
	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	2,698,288.11	0.24
	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	39,187,061.73	3.46
8	其他各项资产	45,581,192.05	4.03
9	合计	1,131,234,527.65	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	1,352,469.00	0.13
B	采矿业	6,059,327.00	0.57
C	制造业	123,150,902.47	11.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,850,451.46	0.46
E	建筑业	2,558,346.00	0.24
F	批发和零售业	2,781,736.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	5,557,409.00	0.52
H	住宿和餐饮业	177,300.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,068,242.83	0.85
J	金融业	10,922,596.00	1.03
K	房地产业	1,512,688.00	0.14
L	租赁和商务服务业	1,966,080.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	1,152,389.97	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	2,985,479.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	75,281.00	0.01
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	968,638.32	0.09
S	综合	8,450.00	0.00
	合计	175,147,786.05	16.45

8.3 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	603019	中科曙光	16,300	1,395,932.00	0.13
2	301007	德迈仕	34,100	1,381,732.00	0.13
3	000408	藏格矿业	15,200	1,282,880.00	0.12
4	600066	宇通客车	37,700	1,232,790.00	0.12
5	002625	光启技术	25,100	1,223,876.00	0.11
6	601318	中国平安	17,300	1,183,320.00	0.11
7	300502	新易盛	2,700	1,163,376.00	0.11
8	603379	三美股份	17,600	1,068,672.00	0.10
9	002028	思源电气	6,900	1,066,671.00	0.10
10	601601	中国太保	25,300	1,060,323.00	0.10
11	601066	中信建投	39,200	1,049,384.00	0.10
12	002373	千方科技	88,400	1,040,468.00	0.10
13	600970	中材国际	99,700	1,035,883.00	0.10
14	300394	天孚通信	5,100	1,035,453.00	0.10
15	002690	美亚光电	50,300	1,034,671.00	0.10
16	000157	中联重科	119,300	1,029,559.00	0.10
17	000831	中国稀土	22,100	1,026,324.00	0.10
18	300303	聚飞光电	150,000	1,026,000.00	0.10
19	600938	中国海油	33,900	1,023,102.00	0.10
20	000100	TCL 科技	224,400	1,018,776.00	0.10
21	300628	亿联网络	28,300	1,008,895.00	0.09
22	601857	中国石油	95,000	988,950.00	0.09
23	600298	安琪酵母	22,600	988,524.00	0.09
24	603993	洛阳钼业	49,300	986,000.00	0.09
25	688520	神州细胞	22,644	980,711.64	0.09
26	300308	中际旭创	1,600	976,000.00	0.09
27	601628	中国人寿	21,000	955,500.00	0.09
28	600887	伊利股份	33,000	943,800.00	0.09
29	301076	新瀚新材	19,000	936,890.00	0.09
30	600309	万华化学	12,200	935,496.00	0.09
31	000301	东方盛虹	84,600	921,294.00	0.09
32	600803	新奥股份	44,100	915,516.00	0.09

33	601899	紫金矿业	26,500	913,455.00	0.09
34	000528	柳工	76,200	904,494.00	0.08
35	002204	大连重工	117,000	895,050.00	0.08
36	002664	信质集团	37,300	893,708.00	0.08
37	600795	国电电力	174,300	878,472.00	0.08
38	300476	胜宏科技	3,000	862,740.00	0.08
39	000708	中信特钢	52,600	861,062.00	0.08
40	002463	沪电股份	11,500	840,305.00	0.08
41	000895	双汇发展	31,500	833,805.00	0.08
42	601111	中国国航	88,900	832,993.00	0.08
43	000333	美的集团	10,600	828,390.00	0.08
44	600989	宝丰能源	42,000	824,460.00	0.08
45	688091	上海谊众	17,446	819,962.00	0.08
46	605499	东鹏饮料	3,000	802,170.00	0.08
47	601336	新华保险	11,500	801,550.00	0.08
48	300199	翰宇药业	44,600	798,340.00	0.07
49	688521	芯原股份	5,733	785,249.01	0.07
50	000959	首钢股份	159,100	779,590.00	0.07
51	600415	小商品城	48,600	775,170.00	0.07
52	688678	福立旺	31,950	772,551.00	0.07
53	601919	中远海控	50,200	762,036.00	0.07
54	300950	德固特	33,300	761,238.00	0.07
55	603766	隆鑫通用	47,200	760,392.00	0.07
56	000975	山金国际	31,100	756,663.00	0.07
57	300274	阳光电源	4,400	752,576.00	0.07
58	688041	海光信息	3,343	750,202.63	0.07
59	600660	福耀玻璃	11,500	744,855.00	0.07
60	600372	中航机载	54,900	736,758.00	0.07
61	002601	龙佰集团	37,600	736,208.00	0.07
62	603043	广州酒家	41,500	731,645.00	0.07
63	603579	荣泰健康	30,700	730,967.00	0.07
64	002195	岩山科技	102,100	723,889.00	0.07
65	002587	奥拓电子	106,000	716,560.00	0.07
66	002050	三花智控	12,700	702,437.00	0.07
67	601688	华泰证券	29,500	695,905.00	0.07
68	002946	新乳业	36,900	683,757.00	0.06
69	002516	旷达科技	103,000	678,770.00	0.06
70	688111	金山办公	2,205	677,089.35	0.06
71	601339	百隆东方	115,800	670,482.00	0.06
72	002402	和而泰	17,100	668,952.00	0.06
73	300750	宁德时代	1,800	661,068.00	0.06

74	600029	南方航空	80,800	647,208.00	0.06
75	002371	北方华创	1,400	642,712.00	0.06
76	688127	蓝特光学	16,442	632,852.58	0.06
77	600009	上海机场	18,900	619,164.00	0.06
78	688278	特宝生物	7,380	617,558.40	0.06
79	603799	华友钴业	9,000	614,340.00	0.06
80	688591	泰凌微	14,396	612,693.76	0.06
81	688116	天奈科技	12,624	595,221.60	0.06
82	601319	中国人保	65,800	588,910.00	0.06
83	600251	冠农股份	63,000	581,490.00	0.05
84	301052	果麦文化	15,128	577,738.32	0.05
85	301039	中集车辆	63,100	577,365.00	0.05
86	002265	建设工业	21,500	576,630.00	0.05
87	300457	赢合科技	20,700	576,495.00	0.05
88	603200	上海洗霸	8,000	569,120.00	0.05
89	688153	唯捷创芯	15,083	567,724.12	0.05
90	300682	朗新科技	36,800	559,728.00	0.05
91	688100	威胜信息	13,816	542,968.80	0.05
92	002493	荣盛石化	46,000	538,660.00	0.05
93	002243	力合科创	54,100	538,295.00	0.05
94	002233	塔牌集团	59,600	536,996.00	0.05
95	002311	海大集团	9,500	526,110.00	0.05
96	002999	天禾股份	76,600	523,178.00	0.05
97	300550	和仁科技	35,400	513,654.00	0.05
98	300283	温州宏丰	67,800	510,534.00	0.05
99	300866	安克创新	4,400	503,316.00	0.05
100	002367	康力电梯	62,100	500,526.00	0.05
101	000415	渤海租赁	123,200	498,960.00	0.05
102	600195	中牧股份	62,700	493,449.00	0.05
103	000425	徐工机械	42,200	488,676.00	0.05
104	000498	山东路桥	80,400	484,812.00	0.05
105	601162	天风证券	115,100	478,816.00	0.04
106	600352	浙江龙盛	44,900	478,634.00	0.04
107	600749	西藏旅游	27,900	476,532.00	0.04
108	603967	中创物流	34,400	472,312.00	0.04
109	001322	箭牌家居	53,100	470,997.00	0.04
110	600967	内蒙一机	28,000	470,400.00	0.04
111	300176	鸿特科技	70,000	466,900.00	0.04
112	600004	白云机场	48,800	461,648.00	0.04
113	300911	亿田智能	13,500	449,550.00	0.04
114	301376	致欧科技	24,300	439,101.00	0.04

115	603289	泰瑞机器	43,300	438,196.00	0.04
116	300007	汉威科技	8,000	428,800.00	0.04
117	300436	广生堂	4,700	419,005.00	0.04
118	300539	横河精密	9,900	415,998.00	0.04
119	600320	振华重工	80,100	412,515.00	0.04
120	601369	陕鼓动力	41,100	411,411.00	0.04
121	002117	东港股份	29,700	410,157.00	0.04
122	300615	欣天科技	30,600	406,368.00	0.04
123	600993	马应龙	14,400	403,200.00	0.04
124	001338	永顺泰	33,100	400,841.00	0.04
125	601009	南京银行	34,900	398,907.00	0.04
126	688062	迈威生物	10,108	388,854.76	0.04
127	300711	广哈通信	16,700	387,774.00	0.04
128	301160	翔楼新材	5,300	381,017.00	0.04
129	603568	伟明环保	14,900	378,162.00	0.04
130	000967	盈峰环境	51,500	378,010.00	0.04
131	300415	伊之密	14,500	377,870.00	0.04
132	600690	海尔智家	14,400	375,696.00	0.04
133	001219	青岛食品	26,300	374,775.00	0.04
134	002687	乔治白	77,700	374,514.00	0.04
135	300341	麦克奥迪	22,900	374,186.00	0.04
136	002489	浙江永强	97,000	371,510.00	0.03
137	601108	财通证券	42,600	371,472.00	0.03
138	002009	天奇股份	16,300	368,706.00	0.03
139	000919	金陵药业	46,300	368,085.00	0.03
140	002119	康强电子	22,300	367,281.00	0.03
141	603391	力聚热能	5,600	366,632.00	0.03
142	300566	激智科技	19,900	365,165.00	0.03
143	002340	格林美	43,500	363,660.00	0.03
144	600011	华能国际	48,501	361,817.46	0.03
145	600371	万向德农	41,100	358,392.00	0.03
146	000529	广弘控股	59,200	355,792.00	0.03
147	000063	中兴通讯	9,400	355,696.00	0.03
148	688277	天智航	23,363	354,883.97	0.03
149	002318	久立特材	12,000	347,400.00	0.03
150	000792	盐湖股份	12,300	346,368.00	0.03
151	300723	一品红	10,300	345,565.00	0.03
152	300112	万讯自控	40,000	344,400.00	0.03
153	301539	宏鑫科技	16,400	342,760.00	0.03
154	600662	外服控股	67,800	340,356.00	0.03
155	300378	鼎捷数智	7,500	339,450.00	0.03

156	601229	上海银行	33,600	339,360.00	0.03
157	002552	宝鼎科技	20,400	336,804.00	0.03
158	688006	杭可科技	11,373	333,115.17	0.03
159	301519	舜禹股份	24,800	332,816.00	0.03
160	000029	深深房A	15,100	332,502.00	0.03
161	600028	中国石化	53,700	331,866.00	0.03
162	002381	双箭股份	50,300	331,477.00	0.03
163	600521	华海药业	19,500	330,915.00	0.03
164	603519	立霸股份	27,500	330,825.00	0.03
165	603808	歌力思	38,600	328,872.00	0.03
166	000548	湖南投资	60,300	328,032.00	0.03
167	603897	长城科技	12,000	326,400.00	0.03
168	600987	航民股份	46,675	321,590.75	0.03
169	600909	华安证券	46,600	315,948.00	0.03
170	002142	宁波银行	11,200	314,608.00	0.03
171	301219	腾远钴业	4,600	314,088.00	0.03
172	000726	鲁泰A	44,000	313,280.00	0.03
173	002363	隆基机械	31,000	313,100.00	0.03
174	300707	威唐工业	19,000	312,550.00	0.03
175	301102	兆讯传媒	29,600	310,504.00	0.03
176	000703	恒逸石化	28,800	310,176.00	0.03
177	600742	富维股份	30,700	307,000.00	0.03
178	300005	探路者	28,300	306,489.00	0.03
179	600716	凤凰股份	79,100	306,117.00	0.03
180	600613	神奇制药	49,900	302,893.00	0.03
181	301090	华润材料	42,800	301,312.00	0.03
182	605507	国邦医药	11,900	295,120.00	0.03
183	600750	华润江中	12,700	294,259.00	0.03
184	300618	寒锐钴业	6,500	293,865.00	0.03
185	603071	物产环能	22,200	293,484.00	0.03
186	601226	华电科工	37,300	292,432.00	0.03
187	000089	深圳机场	41,800	292,182.00	0.03
188	002897	意华股份	5,400	291,978.00	0.03
189	600359	新农开发	40,700	291,005.00	0.03
190	300011	鼎汉技术	33,900	290,862.00	0.03
191	688166	博瑞医药	5,925	290,680.50	0.03
192	301028	鼎熔岩	19,900	290,142.00	0.03
193	300162	雷曼光电	35,100	285,363.00	0.03
194	603275	众辰科技	6,200	282,596.00	0.03
195	601991	大唐发电	79,700	278,153.00	0.03
196	000419	通程控股	43,400	277,326.00	0.03

197	603081	大丰实业	19,700	276,391.00	0.03
198	300113	顺网科技	13,600	275,264.00	0.03
199	600598	北大荒	18,400	275,080.00	0.03
200	600497	驰宏锌锗	37,500	274,125.00	0.03
201	000543	皖能电力	34,200	271,890.00	0.03
202	300639	凯普生物	50,100	269,538.00	0.03
203	600487	亨通光电	10,700	264,611.00	0.02
204	002293	罗莱生活	25,600	262,912.00	0.02
205	002790	瑞尔特	30,900	259,251.00	0.02
206	603590	康辰药业	6,500	258,375.00	0.02
207	000930	中粮科技	44,300	255,611.00	0.02
208	300636	同和药业	33,700	253,087.00	0.02
209	301175	中科环保	42,700	252,357.00	0.02
210	002631	德尔未来	41,900	250,562.00	0.02
211	002375	亚厦股份	65,500	248,245.00	0.02
212	002398	垒知集团	44,000	247,280.00	0.02
213	688045	必易微	6,349	245,642.81	0.02
214	301571	国科天成	4,200	242,256.00	0.02
215	688439	振华风光	3,745	241,927.00	0.02
216	603663	三祥新材	6,800	240,380.00	0.02
217	002033	丽江股份	26,100	238,815.00	0.02
218	000739	普洛药业	14,400	234,288.00	0.02
219	000617	中油资本	24,400	234,240.00	0.02
220	600851	海欣股份	34,100	232,903.00	0.02
221	688391	钜泉科技	8,150	230,889.50	0.02
222	002156	通富微电	6,000	226,200.00	0.02
223	000863	三湘印象	36,100	224,903.00	0.02
224	300302	同有科技	12,300	223,122.00	0.02
225	600997	开滦股份	38,800	223,100.00	0.02
226	000589	贵州轮胎	42,500	220,150.00	0.02
227	603701	德宏股份	10,900	219,744.00	0.02
228	688063	派能科技	3,847	218,586.54	0.02
229	600801	华新建材	8,900	218,406.00	0.02
230	603787	新日股份	15,500	217,930.00	0.02
231	002064	华峰化学	19,800	217,800.00	0.02
232	002078	太阳纸业	13,800	217,350.00	0.02
233	600354	敦煌种业	33,400	216,098.00	0.02
234	002749	国光股份	16,200	215,946.00	0.02
235	603306	华懋科技	3,400	214,234.00	0.02
236	603767	中马传动	8,900	214,045.00	0.02
237	002296	辉煌科技	19,100	213,920.00	0.02

238	300683	海特生物	7,700	213,521.00	0.02
239	603132	金徽股份	14,500	212,715.00	0.02
240	601328	交通银行	29,300	212,425.00	0.02
241	001286	陕西能源	22,500	209,475.00	0.02
242	600808	马钢股份	49,400	208,468.00	0.02
243	300932	三友联众	17,200	206,228.00	0.02
244	600026	中远海能	17,600	205,568.00	0.02
245	601999	出版传媒	29,900	205,413.00	0.02
246	688567	孚能科技	13,027	203,872.55	0.02
247	000911	广农糖业	27,700	202,487.00	0.02
248	300857	协创数据	1,200	202,416.00	0.02
249	301031	中熔电气	1,800	201,942.00	0.02
250	000598	兴蓉环境	28,100	201,477.00	0.02
251	000659	珠海中富	49,600	201,376.00	0.02
252	003816	中国广核	53,500	201,160.00	0.02
253	603070	万控智造	15,400	199,584.00	0.02
254	300412	迦南科技	37,000	197,950.00	0.02
255	688359	三孚新科	2,966	197,624.58	0.02
256	600392	盛和资源	9,100	195,923.00	0.02
257	688553	汇宇制药	10,856	193,128.24	0.02
258	601689	拓普集团	2,500	192,950.00	0.02
259	603699	纽威股份	3,693	191,925.21	0.02
260	603755	日辰股份	5,200	190,684.00	0.02
261	688525	佰维存储	1,655	189,977.45	0.02
262	300154	瑞凌股份	19,000	187,150.00	0.02
263	002886	沃特股份	8,600	186,792.00	0.02
264	605118	力鼎光电	6,200	186,682.00	0.02
265	300032	金龙机电	34,600	185,802.00	0.02
266	000030	富奥股份	32,000	183,680.00	0.02
267	002039	黔源电力	10,100	183,517.00	0.02
268	002600	领益智造	11,800	183,372.00	0.02
269	603281	江瀚新材	6,600	183,150.00	0.02
270	600986	浙文互联	23,400	182,988.00	0.02
271	603027	千禾味业	18,600	182,838.00	0.02
272	600686	金龙汽车	10,300	182,722.00	0.02
273	000603	盛达资源	5,900	182,664.00	0.02
274	002454	松芝股份	20,900	182,039.00	0.02
275	300317	珈伟新能	47,200	181,248.00	0.02
276	605196	华通线缆	5,200	180,648.00	0.02
277	300681	英搏尔	7,200	180,432.00	0.02
278	002171	楚江新材	13,600	180,336.00	0.02

279	600759	洲际油气	57,400	179,088.00	0.02
280	301158	德石股份	8,000	178,960.00	0.02
281	688661	和林微纳	3,448	178,468.48	0.02
282	002409	雅克科技	2,400	177,840.00	0.02
283	688286	敏芯股份	2,250	177,637.50	0.02
284	000630	铜陵有色	29,500	177,295.00	0.02
285	600533	栖霞建设	69,200	177,152.00	0.02
286	002913	奥士康	4,100	175,234.00	0.02
287	600331	宏达股份	13,700	175,223.00	0.02
288	002281	光迅科技	2,500	174,875.00	0.02
289	688248	南网科技	3,906	174,754.44	0.02
290	688538	和辉光电	65,690	174,735.40	0.02
291	301210	金杨精密	4,800	174,720.00	0.02
292	301215	中汽股份	25,500	174,675.00	0.02
293	601608	中信重工	26,400	173,976.00	0.02
294	688680	海优新材	4,547	173,922.75	0.02
295	002436	兴森科技	8,200	173,594.00	0.02
296	600273	嘉化能源	19,800	173,052.00	0.02
297	300054	鼎龙股份	4,600	172,960.00	0.02
298	600141	兴发集团	5,000	172,900.00	0.02
299	688120	华海清科	1,152	172,892.16	0.02
300	002517	恺英网络	7,900	172,773.00	0.02
301	300787	海能实业	14,700	172,725.00	0.02
302	600820	隧道股份	26,600	172,634.00	0.02
303	688598	金博股份	5,872	172,401.92	0.02
304	605117	德业股份	2,000	172,400.00	0.02
305	002241	歌尔股份	6,000	172,380.00	0.02
306	603659	璞泰来	6,300	172,242.00	0.02
307	301095	广立微	2,400	172,104.00	0.02
308	600570	恒生电子	5,700	171,855.00	0.02
309	002130	沃尔核材	6,500	171,080.00	0.02
310	601609	金田股份	15,800	170,640.00	0.02
311	300041	回天新材	15,400	170,632.00	0.02
312	002459	晶澳科技	14,900	170,605.00	0.02
313	600489	中金黄金	7,300	170,528.00	0.02
314	002779	中坚科技	1,500	170,340.00	0.02
315	300035	中科电气	8,000	170,320.00	0.02
316	002475	立讯精密	3,000	170,130.00	0.02
317	301186	超达装备	3,500	169,960.00	0.02
318	603328	依顿电子	15,500	169,880.00	0.02
319	603012	创力集团	28,100	169,724.00	0.02

320	300223	北京君正	1,600	169,664.00	0.02
321	300593	新雷能	5,700	169,632.00	0.02
322	000858	五粮液	1,600	169,504.00	0.02
323	601777	千里科技	15,900	169,017.00	0.02
324	688352	颀中科技	13,402	168,999.22	0.02
325	002008	大族激光	4,100	168,879.00	0.02
326	688008	澜起科技	1,431	168,571.80	0.02
327	600036	招商银行	4,000	168,400.00	0.02
328	600549	厦门钨业	4,100	168,346.00	0.02
329	001387	雪祺电气	12,150	167,913.00	0.02
330	688025	杰普特	1,186	167,902.02	0.02
331	600207	安彩高科	32,600	167,890.00	0.02
332	002971	和远气体	5,600	167,328.00	0.02
333	688320	禾川科技	4,472	166,895.04	0.02
334	003035	南网能源	36,300	166,254.00	0.02
335	002662	峰璟股份	41,300	166,026.00	0.02
336	002244	滨江集团	16,500	165,825.00	0.02
337	600863	华能蒙电	37,000	165,760.00	0.02
338	300850	新强联	4,000	165,480.00	0.02
339	002805	丰元股份	9,300	164,889.00	0.02
340	688401	路维光电	3,377	164,831.37	0.02
341	601816	京沪高铁	32,000	164,800.00	0.02
342	002014	永新股份	13,800	164,496.00	0.02
343	688469	芯联集成	24,561	164,313.09	0.02
344	601166	兴业银行	7,800	164,268.00	0.02
345	600930	华电新能	26,100	164,169.00	0.02
346	002460	赣锋锂业	2,600	163,514.00	0.02
347	600900	长江电力	6,000	163,140.00	0.02
348	603429	集友股份	16,400	162,524.00	0.02
349	689009	九号公司	2,919	162,267.21	0.02
350	603330	天洋新材	22,400	162,176.00	0.02
351	600386	北巴传媒	36,900	161,991.00	0.02
352	600262	北方股份	6,200	161,386.00	0.02
353	002553	南方精工	5,900	161,129.00	0.02
354	688200	华峰测控	847	161,099.40	0.02
355	601398	工商银行	20,300	160,979.00	0.02
356	300469	信息发展	2,600	160,680.00	0.02
357	600426	华鲁恒升	5,100	160,293.00	0.02
358	603096	新经典	9,200	160,264.00	0.02
359	600016	民生银行	41,800	160,094.00	0.02
360	000635	英力特	18,000	160,020.00	0.02

361	000629	钒钛股份	51,500	159,650.00	0.01
362	002159	三特索道	10,400	159,432.00	0.01
363	600114	东睦股份	5,200	158,860.00	0.01
364	300413	芒果超媒	6,500	158,730.00	0.01
365	002812	恩捷股份	2,800	158,592.00	0.01
366	600115	中国东航	26,377	158,262.00	0.01
367	601963	重庆银行	14,600	158,118.00	0.01
368	601939	建设银行	17,000	157,760.00	0.01
369	000928	中钢国际	23,700	156,657.00	0.01
370	301316	慧博云通	3,500	156,380.00	0.01
371	688428	诺诚健华	7,528	154,474.56	0.01
372	300206	理邦仪器	12,000	153,480.00	0.01
373	601330	绿色动力	22,500	151,425.00	0.01
374	600050	中国联通	29,600	151,256.00	0.01
375	605305	中际联合	3,600	149,976.00	0.01
376	600461	洪城环境	16,100	149,247.00	0.01
377	300842	帝科股份	2,500	148,175.00	0.01
378	300916	朗特智能	4,500	147,510.00	0.01
379	600584	长电科技	4,000	147,120.00	0.01
380	002273	水晶光电	5,800	145,696.00	0.01
381	605599	菜百股份	8,900	145,693.00	0.01
382	600919	江苏银行	14,000	145,600.00	0.01
383	000039	中集集团	14,400	145,296.00	0.01
384	300263	隆华科技	16,400	144,976.00	0.01
385	000707	双环科技	23,800	143,990.00	0.01
386	605376	博迁新材	2,200	143,880.00	0.01
387	300131	英唐智控	9,800	143,668.00	0.01
388	605162	新中港	16,800	143,472.00	0.01
389	002849	威星智能	9,000	143,100.00	0.01
390	603345	安井食品	1,800	142,704.00	0.01
391	601728	中国电信	22,600	142,380.00	0.01
392	300791	仙乐健康	5,500	142,230.00	0.01
393	600160	巨化股份	3,700	142,154.00	0.01
394	000001	平安银行	12,300	140,343.00	0.01
395	600901	江苏金租	22,900	140,148.00	0.01
396	600846	同济科技	10,600	139,390.00	0.01
397	002007	华兰生物	9,200	139,196.00	0.01
398	600594	益佰制药	33,600	133,728.00	0.01
399	600177	雅戈尔	17,400	132,240.00	0.01
400	002012	凯恩股份	20,500	132,225.00	0.01
401	000014	沙河股份	9,700	130,465.00	0.01

402	002062	宏润建设	14,100	130,425.00	0.01
403	000902	新洋丰	8,300	129,646.00	0.01
404	002935	天奥电子	5,800	129,630.00	0.01
405	688297	中无人机	2,690	129,173.80	0.01
406	000915	华特达因	3,900	128,856.00	0.01
407	600108	亚盛集团	40,600	127,890.00	0.01
408	600258	首旅酒店	7,600	127,300.00	0.01
409	002483	润邦股份	17,800	127,092.00	0.01
410	002807	江阴银行	27,700	126,589.00	0.01
411	601827	三峰环境	14,900	126,203.00	0.01
412	603077	和邦生物	55,400	125,204.00	0.01
413	300243	瑞丰高材	12,000	125,160.00	0.01
414	688299	长阳科技	7,393	125,089.56	0.01
415	688625	呈和科技	3,018	124,341.60	0.01
416	300470	中密控股	3,300	124,080.00	0.01
417	600583	海油工程	22,400	122,976.00	0.01
418	001389	广合科技	1,500	122,445.00	0.01
419	688065	凯赛生物	2,456	122,308.80	0.01
420	002863	今飞凯达	20,800	122,096.00	0.01
421	301285	鸿日达	1,800	122,004.00	0.01
422	600885	宏发股份	4,000	121,600.00	0.01
423	300083	创世纪	13,200	121,572.00	0.01
424	603915	国茂股份	6,600	121,506.00	0.01
425	300558	贝达药业	2,600	121,394.00	0.01
426	301413	安培龙	900	121,320.00	0.01
427	002677	浙江美大	14,500	121,075.00	0.01
428	600428	中远海特	17,000	120,700.00	0.01
429	603187	海容冷链	7,600	119,244.00	0.01
430	600905	三峡能源	29,100	119,019.00	0.01
431	002056	横店东磁	6,100	118,950.00	0.01
432	300616	尚品宅配	8,400	117,012.00	0.01
433	002602	世纪华通	6,800	116,008.00	0.01
434	301310	鑫宏业	2,700	115,965.00	0.01
435	301628	强达电路	1,300	115,375.00	0.01
436	002468	申通快递	8,500	114,070.00	0.01
437	600010	包钢股份	47,900	114,002.00	0.01
438	688002	睿创微纳	1,130	113,904.00	0.01
439	000977	浪潮信息	1,700	113,220.00	0.01
440	300407	凯发电气	9,900	112,068.00	0.01
441	600684	珠江股份	25,400	110,744.00	0.01
442	000733	振华科技	2,100	110,061.00	0.01

443	688588	凌志软件	7,680	109,900.80	0.01
444	002090	金智科技	9,300	109,740.00	0.01
445	300802	矩子科技	5,700	109,098.00	0.01
446	002972	科安达	9,100	108,745.00	0.01
447	300925	法本信息	5,100	108,324.00	0.01
448	688022	瀚川智能	7,067	108,125.10	0.01
449	000530	冰山冷热	14,600	106,872.00	0.01
450	300105	龙源技术	14,900	106,684.00	0.01
451	001207	联科科技	4,200	106,554.00	0.01
452	002746	仙坛股份	17,500	106,225.00	0.01
453	002148	北纬科技	11,900	105,910.00	0.01
454	605016	百龙创园	4,900	105,840.00	0.01
455	002182	宝武镁业	6,900	105,570.00	0.01
456	603577	汇金通	10,000	105,200.00	0.01
457	300806	斯迪克	3,400	104,516.00	0.01
458	002546	新联电子	14,800	103,452.00	0.01
459	300219	鸿利智汇	14,300	103,103.00	0.01
460	600361	创新新材	24,300	103,032.00	0.01
461	000990	诚志股份	13,000	102,960.00	0.01
462	002895	川恒股份	2,800	102,648.00	0.01
463	300111	向日葵	16,600	101,758.00	0.01
464	603816	顾家家居	3,300	101,442.00	0.01
465	688577	浙海德曼	1,046	101,315.56	0.01
466	002899	英派斯	3,700	101,269.00	0.01
467	002484	江海股份	3,400	100,980.00	0.01
468	300195	长荣股份	12,600	100,926.00	0.01
469	301086	鸿富瀚	900	100,701.00	0.01
470	603609	禾丰股份	14,200	100,678.00	0.01
471	301260	格力博	5,900	100,595.00	0.01
472	300972	万辰集团	500	100,535.00	0.01
473	688372	伟测科技	917	100,035.53	0.01
474	002839	张家港行	21,700	99,169.00	0.01
475	002773	康弘药业	3,300	98,901.00	0.01
476	603118	共进股份	8,600	98,900.00	0.01
477	001872	招商港口	5,100	98,583.00	0.01
478	600100	同方股份	11,000	98,120.00	0.01
479	601107	四川成渝	16,100	97,888.00	0.01
480	601156	东航物流	5,300	97,573.00	0.01
481	600966	博汇纸业	14,200	96,986.00	0.01
482	002920	德赛西威	800	96,240.00	0.01
483	000570	苏常柴A	17,200	95,632.00	0.01

484	301106	骏成科技	3,200	95,264.00	0.01
485	001326	联域股份	2,000	94,440.00	0.01
486	688071	华依科技	2,829	93,837.93	0.01
487	300382	斯莱克	6,000	93,360.00	0.01
488	600323	瀚蓝环境	3,200	91,520.00	0.01
489	301337	亚华电子	3,300	90,783.00	0.01
490	301117	佳缘科技	1,700	90,525.00	0.01
491	000639	西王食品	26,900	89,039.00	0.01
492	300590	移为通信	7,000	88,760.00	0.01
493	002137	实益达	10,100	86,658.00	0.01
494	002452	长高电新	10,500	86,415.00	0.01
495	603815	交建股份	11,300	84,072.00	0.01
496	603129	春风动力	300	83,604.00	0.01
497	603661	恒林股份	2,600	83,226.00	0.01
498	688295	中复神鹰	2,508	82,287.48	0.01
499	688308	欧科亿	2,530	80,049.20	0.01
500	600111	北方稀土	1,700	78,404.00	0.01
501	002903	宇环数控	3,400	78,200.00	0.01
502	300239	东宝生物	13,300	77,938.00	0.01
503	605319	无锡振华	3,700	77,848.00	0.01
504	002884	凌霄泵业	4,400	77,836.00	0.01
505	300047	天源迪科	6,200	77,810.00	0.01
506	003039	顺控发展	4,800	76,464.00	0.01
507	601825	沪农商行	8,200	76,178.00	0.01
508	002938	鹏鼎控股	1,500	75,870.00	0.01
509	300458	全志科技	1,800	75,654.00	0.01
510	688036	传音控股	1,130	74,760.80	0.01
511	002787	华源控股	6,000	74,700.00	0.01
512	603629	利通电子	2,800	74,620.00	0.01
513	301487	盟固利	3,400	74,562.00	0.01
514	301126	达嘉维康	6,000	73,740.00	0.01
515	000159	国际实业	12,700	73,406.00	0.01
516	688262	国芯科技	2,382	72,293.70	0.01
517	300975	商络电子	5,600	71,064.00	0.01
518	300730	科创信息	5,300	70,914.00	0.01
519	600523	贵航股份	4,500	70,695.00	0.01
520	600236	桂冠电力	9,000	70,470.00	0.01
521	002940	昂利康	2,100	70,392.00	0.01
522	603190	亚通精工	2,600	70,122.00	0.01
523	301168	通灵股份	1,500	70,050.00	0.01
524	605128	上海沿浦	1,900	70,034.00	0.01

525	605020	永和股份	2,600	69,914.00	0.01
526	603950	长源东谷	2,400	69,480.00	0.01
527	000778	新兴铸管	16,600	69,388.00	0.01
528	002048	宁波华翔	2,200	69,212.00	0.01
529	600313	农发种业	10,700	68,908.00	0.01
530	300933	中辰股份	8,300	68,807.00	0.01
531	002915	中欣氟材	2,800	68,600.00	0.01
532	688070	纵横股份	1,233	68,308.20	0.01
533	002406	远东传动	8,600	68,284.00	0.01
534	600058	五矿发展	5,800	66,816.00	0.01
535	002238	天威视讯	8,200	66,666.00	0.01
536	000958	电投产融	10,300	66,641.00	0.01
537	002074	国轩高科	1,700	66,487.00	0.01
538	688072	拓荆科技	201	66,330.00	0.01
539	603199	九华旅游	1,800	66,168.00	0.01
540	600039	四川路桥	6,400	63,680.00	0.01
541	300201	海伦哲	9,200	62,836.00	0.01
542	002978	安宁股份	1,900	62,795.00	0.01
543	603607	京华激光	2,300	62,790.00	0.01
544	300739	明阳电路	3,400	62,492.00	0.01
545	000978	桂林旅游	8,600	62,264.00	0.01
546	300824	北鼎股份	5,400	61,074.00	0.01
547	002556	辉隆股份	10,100	61,004.00	0.01
548	688138	清溢光电	2,143	60,346.88	0.01
549	000554	泰山石油	9,300	60,264.00	0.01
550	002479	富春环保	12,200	59,780.00	0.01
551	002328	新朋股份	9,000	59,490.00	0.01
552	002067	景兴纸业	10,500	59,325.00	0.01
553	688512	慧智微	5,315	59,315.40	0.01
554	003002	壶化股份	1,800	58,266.00	0.01
555	600566	济川药业	2,200	57,860.00	0.01
556	688088	虹软科技	1,164	57,618.00	0.01
557	002759	天际股份	1,200	55,716.00	0.01
558	300687	赛意信息	2,400	55,128.00	0.01
559	603360	百傲化学	1,700	54,774.00	0.01
560	600176	中国巨石	3,200	54,720.00	0.01
561	301296	新巨丰	6,400	54,528.00	0.01
562	688182	灿勤科技	1,847	54,523.44	0.01
563	688312	燕麦科技	1,631	54,116.58	0.01
564	300976	达瑞电子	900	54,063.00	0.01
565	300918	南山智尚	2,900	53,911.00	0.01

566	300416	苏试试验	3,000	53,520.00	0.01
567	301091	深城交	2,000	53,480.00	0.01
568	301568	思泰克	1,100	53,383.00	0.01
569	601599	浙文影业	13,400	53,332.00	0.01
570	688419	耐科装备	1,905	53,320.95	0.01
571	301125	腾亚精工	2,900	53,302.00	0.01
572	002801	微光股份	1,500	53,115.00	0.00
573	688556	高测股份	4,633	52,908.86	0.00
574	688087	英科再生	1,714	52,825.48	0.00
575	000576	甘化科工	5,000	52,650.00	0.00
576	000421	南京公用	7,600	52,516.00	0.00
577	603151	邦基科技	2,900	52,258.00	0.00
578	002284	亚太股份	3,500	52,255.00	0.00
579	002539	云图控股	4,400	52,008.00	0.00
580	002145	钛能化学	10,600	51,940.00	0.00
581	002216	三全食品	4,600	51,934.00	0.00
582	002337	赛象科技	7,900	51,903.00	0.00
583	300572	安车检测	1,800	51,174.00	0.00
584	688259	创耀科技	1,221	51,037.80	0.00
585	300184	力源信息	5,100	50,949.00	0.00
586	600288	大恒科技	3,400	50,932.00	0.00
587	600706	曲江文旅	4,800	50,880.00	0.00
588	002595	豪迈科技	600	50,706.00	0.00
589	600367	红星发展	2,900	50,663.00	0.00
590	002716	湖南白银	7,300	50,516.00	0.00
591	600661	昂立教育	4,900	50,225.00	0.00
592	300002	神州泰岳	4,300	49,536.00	0.00
593	000523	红棉股份	13,000	49,010.00	0.00
594	603768	常青股份	4,200	48,720.00	0.00
595	600526	菲达环保	9,000	48,240.00	0.00
596	603511	爱慕股份	3,100	48,019.00	0.00
597	300194	福安药业	10,800	47,844.00	0.00
598	002558	巨人网络	1,100	47,619.00	0.00
599	600774	汉商集团	5,200	47,528.00	0.00
600	603168	莎普爱思	6,400	47,104.00	0.00
601	002022	科华生物	7,700	45,738.00	0.00
602	600295	鄂尔多斯	3,700	45,732.00	0.00
603	600629	华建集团	2,100	45,570.00	0.00
604	000036	华联控股	6,700	44,220.00	0.00
605	301418	协昌科技	1,200	43,800.00	0.00
606	301555	惠柏新材	1,300	43,459.00	0.00

607	300480	光力科技	2,600	43,446.00	0.00
608	002441	众业达	4,600	43,240.00	0.00
609	603662	柯力传感	600	43,200.00	0.00
610	301138	华研精机	1,100	42,680.00	0.00
611	300410	正业科技	5,200	42,536.00	0.00
612	300360	炬华科技	2,400	41,736.00	0.00
613	002758	浙农股份	4,100	41,287.00	0.00
614	603538	美诺华	2,100	40,404.00	0.00
615	002555	三七互娱	1,700	40,120.00	0.00
616	002006	精工科技	1,700	39,372.00	0.00
617	000876	新希望	4,200	38,724.00	0.00
618	601519	大智慧	3,000	38,610.00	0.00
619	000750	国海证券	9,000	38,160.00	0.00
620	688488	艾迪药业	2,329	38,032.57	0.00
621	688551	科威尔	1,026	37,787.58	0.00
622	688510	航亚科技	1,390	37,391.00	0.00
623	603396	金辰股份	1,100	36,905.00	0.00
624	002414	高德红外	2,500	36,675.00	0.00
625	002956	西麦食品	1,300	36,556.00	0.00
626	600965	福成股份	6,100	36,295.00	0.00
627	301121	紫建电子	900	35,856.00	0.00
628	002111	威海广泰	3,400	35,768.00	0.00
629	300224	正海磁材	2,300	35,558.00	0.00
630	603318	水发燃气	5,300	35,510.00	0.00
631	601929	吉视传媒	10,300	35,432.00	0.00
632	002823	凯中精密	2,200	35,332.00	0.00
633	600926	杭州银行	2,300	35,144.00	0.00
634	002331	皖通科技	3,900	34,788.00	0.00
635	688708	佳驰科技	554	34,486.50	0.00
636	601068	中铝国际	6,500	34,385.00	0.00
637	601007	金陵饭店	4,400	34,364.00	0.00
638	002041	登海种业	3,600	34,344.00	0.00
639	301096	百诚医药	600	34,284.00	0.00
640	600403	大有能源	4,900	34,202.00	0.00
641	300318	博晖创新	5,400	33,858.00	0.00
642	688084	晶品特装	407	33,699.60	0.00
643	002670	国盛证券	2,000	33,680.00	0.00
644	603727	博迈科	2,400	33,552.00	0.00
645	601121	宝地矿业	4,500	33,210.00	0.00
646	601577	长沙银行	3,400	32,980.00	0.00
647	301588	美新科技	1,800	32,706.00	0.00

648	300087	荃银高科	2,800	32,704.00	0.00
649	600908	无锡银行	5,500	32,615.00	0.00
650	600860	京城股份	2,600	32,604.00	0.00
651	688533	上声电子	1,111	32,485.64	0.00
652	300025	华星创业	5,600	32,256.00	0.00
653	000900	现代投资	7,800	31,902.00	0.00
654	300467	迅游科技	1,100	31,570.00	0.00
655	600252	中恒集团	11,500	31,510.00	0.00
656	002560	通达股份	3,100	31,248.00	0.00
657	688529	豪森智能	1,668	30,757.92	0.00
658	603038	华立股份	1,900	30,590.00	0.00
659	603811	诚意药业	2,900	30,450.00	0.00
660	600867	通化东宝	3,700	30,229.00	0.00
661	688579	地纬智能	2,774	29,903.72	0.00
662	601200	上海环境	3,700	29,785.00	0.00
663	002125	湘潭电化	2,100	29,736.00	0.00
664	300316	晶盛机电	800	29,400.00	0.00
665	300721	怡达股份	2,300	29,279.00	0.00
666	002643	万润股份	1,900	28,481.00	0.00
667	600982	宁波能源	6,400	27,776.00	0.00
668	300936	中英科技	700	27,300.00	0.00
669	600784	鲁银投资	3,900	27,222.00	0.00
670	002203	海亮股份	2,100	26,586.00	0.00
671	300667	必创科技	1,500	26,520.00	0.00
672	002408	齐翔腾达	5,400	26,352.00	0.00
673	688112	鼎阳科技	699	26,177.55	0.00
674	000065	北方国际	2,100	26,166.00	0.00
675	301507	民生健康	1,700	26,112.00	0.00
676	002448	中原内配	2,000	25,860.00	0.00
677	002054	德美化工	3,500	25,830.00	0.00
678	002023	海特高新	1,900	25,726.00	0.00
679	688226	威腾电气	693	25,710.30	0.00
680	002099	海翔药业	4,100	25,584.00	0.00
681	600688	上海石化	9,200	25,576.00	0.00
682	002732	燕塘乳业	1,500	25,530.00	0.00
683	002036	联创电子	2,300	25,346.00	0.00
684	605098	行动教育	600	25,056.00	0.00
685	300762	上海瀚讯	600	25,008.00	0.00
686	000520	凤凰航运	5,100	24,684.00	0.00
687	002550	千红制药	3,100	24,366.00	0.00
688	688378	奥来德	845	23,068.50	0.00

689	001311	多利科技	700	22,456.00	0.00
690	600537	亿晶光电	5,200	21,632.00	0.00
691	603660	苏州科达	1,900	20,957.00	0.00
692	300245	天玑科技	1,700	20,553.00	0.00
693	002444	巨星科技	600	20,412.00	0.00
694	688622	禾信仪器	200	20,226.00	0.00
695	000962	东方钽业	600	19,836.00	0.00
696	000997	新大陆	700	19,824.00	0.00
697	001316	润贝航科	500	19,740.00	0.00
698	300766	每日互动	600	19,662.00	0.00
699	002594	比亚迪	200	19,544.00	0.00
700	000923	河钢资源	900	19,053.00	0.00
701	601985	中国核电	2,200	19,030.00	0.00
702	601233	桐昆股份	1,100	18,931.00	0.00
703	300747	锐科激光	700	18,921.00	0.00
704	601018	宁波港	5,200	18,876.00	0.00
705	301038	深水规院	800	18,760.00	0.00
706	002043	兔宝宝	1,300	18,733.00	0.00
707	300645	正元智慧	1,000	18,730.00	0.00
708	003026	中晶科技	600	18,528.00	0.00
709	300828	锐新科技	1,100	18,513.00	0.00
710	603500	祥和实业	1,500	17,970.00	0.00
711	002908	德生科技	1,700	17,901.00	0.00
712	301135	瑞德智能	637	17,899.70	0.00
713	600724	宁波富达	3,100	17,856.00	0.00
714	603116	红蜻蜓	2,900	17,777.00	0.00
715	688458	美芯晟	447	17,719.08	0.00
716	603378	亚士创能	2,600	17,706.00	0.00
717	688162	巨一科技	574	17,679.20	0.00
718	000973	佛塑科技	1,200	17,640.00	0.00
719	002085	万丰奥威	1,100	17,611.00	0.00
720	600476	湘邮科技	1,100	17,611.00	0.00
721	603387	基蛋生物	2,100	17,577.00	0.00
722	603982	泉峰汽车	2,100	17,577.00	0.00
723	301512	智信精密	400	17,496.00	0.00
724	002097	山河智能	1,400	17,374.00	0.00
725	000510	新金路	1,500	17,370.00	0.00
726	002523	天桥起重	4,000	17,160.00	0.00
727	600173	卧龙新能	2,400	17,112.00	0.00
728	002236	大华股份	900	17,046.00	0.00
729	300426	华智数媒	2,200	16,984.00	0.00

730	603739	蔚蓝生物	1,200	16,980.00	0.00
731	301320	豪江智能	1,000	16,970.00	0.00
732	600257	大湖股份	2,700	16,956.00	0.00
733	002282	博深股份	2,300	16,905.00	0.00
734	603049	中策橡胶	300	16,785.00	0.00
735	688377	迪威尔	457	16,771.90	0.00
736	003019	宸展光电	500	16,740.00	0.00
737	688383	新益昌	211	16,514.97	0.00
738	002399	海普瑞	1,400	16,506.00	0.00
739	605056	咸亨国际	1,000	16,500.00	0.00
740	603612	索通发展	700	16,450.00	0.00
741	002380	科远智慧	600	16,320.00	0.00
742	002551	尚荣医疗	4,400	16,060.00	0.00
743	002135	东南网架	3,500	15,890.00	0.00
744	002224	三力士	3,600	15,804.00	0.00
745	300365	恒华科技	2,500	15,800.00	0.00
746	600796	钱江生化	2,600	15,756.00	0.00
747	605186	健麾信息	800	15,720.00	0.00
748	000597	东北制药	3,000	15,660.00	0.00
749	301073	君亭酒店	600	15,636.00	0.00
750	301508	中机认检	500	15,630.00	0.00
751	001323	慕思股份	600	15,576.00	0.00
752	300335	迪森股份	2,700	15,552.00	0.00
753	688778	厦钨新能	200	15,474.00	0.00
754	603779	威龙股份	2,400	15,456.00	0.00
755	603329	上海雅仕	1,400	15,400.00	0.00
756	002001	新和成	600	15,114.00	0.00
757	688584	上海合晶	687	15,072.78	0.00
758	002345	潮宏基	1,200	15,000.00	0.00
759	002438	江苏神通	900	14,310.00	0.00
760	000761	本钢板材	3,900	13,065.00	0.00
761	300779	惠城环保	100	13,011.00	0.00
762	300985	致远新能	700	12,845.00	0.00
763	002324	普利特	800	12,792.00	0.00
764	601198	东兴证券	900	12,492.00	0.00
765	300487	蓝晓科技	200	12,350.00	0.00
766	688508	芯朋微	200	12,180.00	0.00
767	688177	百奥泰	521	12,055.94	0.00
768	688003	天准科技	200	11,780.00	0.00
769	601869	长飞光纤	100	11,636.00	0.00
770	688049	炬芯科技	220	11,572.00	0.00

771	003025	思进智能	800	11,496.00	0.00
772	688159	有方科技	230	11,118.20	0.00
773	002167	东方锆业	900	11,115.00	0.00
774	002335	科华数据	200	11,106.00	0.00
775	002658	雪迪龙	1,200	10,836.00	0.00
776	301080	百普赛斯	200	10,800.00	0.00
777	002268	电科网安	500	10,270.00	0.00
778	688090	瑞松科技	230	10,230.40	0.00
779	000021	深科技	400	10,112.00	0.00
780	688136	科兴制药	307	9,722.69	0.00
781	300772	运达股份	500	9,530.00	0.00
782	688007	光峰科技	506	9,396.42	0.00
783	600732	爱旭股份	700	9,380.00	0.00
784	300278	华昌达	1,500	9,150.00	0.00
785	002194	武汉凡谷	700	9,135.00	0.00
786	603885	吉祥航空	600	8,928.00	0.00
787	603002	宏昌电子	1,200	8,868.00	0.00
788	300222	科大智能	800	8,752.00	0.00
789	002707	众信旅游	1,200	8,628.00	0.00
790	002181	粤传媒	1,000	8,620.00	0.00
791	300483	首华燃气	600	8,508.00	0.00
792	600620	天宸股份	1,300	8,450.00	0.00
793	002654	万润科技	600	8,442.00	0.00
794	603273	天元智能	400	8,396.00	0.00
795	603018	华设集团	1,100	8,371.00	0.00
796	002877	智能自控	900	8,262.00	0.00
797	001319	铭科精技	300	8,241.00	0.00
798	300291	百纳千成	1,100	8,239.00	0.00
799	603239	浙江仙通	400	8,204.00	0.00
800	002051	中工国际	900	8,163.00	0.00
801	002271	东方雨虹	600	8,154.00	0.00
802	600785	新华百货	600	8,130.00	0.00
803	688590	新致软件	429	8,005.14	0.00
804	300708	聚灿光电	900	7,992.00	0.00
805	605183	确成股份	400	7,968.00	0.00
806	600817	宇通重工	700	7,959.00	0.00
807	002394	联发股份	500	7,930.00	0.00
808	300100	双林股份	200	7,924.00	0.00
809	002561	徐家汇	900	7,902.00	0.00
810	300994	久祺股份	500	7,895.00	0.00
811	301051	信濠光电	400	7,840.00	0.00

812	300042	朗科科技	300	7,710.00	0.00
813	600713	南京医药	1,400	7,644.00	0.00
814	688135	利扬芯片	274	7,606.24	0.00
815	301132	满坤科技	200	6,660.00	0.00
816	300835	龙磁科技	100	6,558.00	0.00
817	300438	鹏辉能源	100	5,322.00	0.00
818	000777	中核科技	200	5,170.00	0.00
819	002057	中钢天源	500	5,095.00	0.00
820	301021	英诺激光	100	4,865.00	0.00
821	300674	宇信科技	200	4,852.00	0.00
822	000862	银星能源	800	4,672.00	0.00
823	600479	千金药业	400	4,064.00	0.00
824	300149	睿智医药	400	3,824.00	0.00
825	002968	新大正	300	3,648.00	0.00
826	002638	勤上股份	900	2,781.00	0.00
827	600875	东方电气	100	2,428.00	0.00
828	301030	仕净科技	200	2,366.00	0.00
829	600517	国网英大	100	601.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000408	藏格矿业	3,593,831.00	4.36
2	601398	工商银行	3,477,549.00	4.22
3	600066	宇通客车	3,321,939.00	4.03
4	601857	中国石油	3,321,578.00	4.03
5	300750	宁德时代	3,268,831.00	3.97
6	300308	中际旭创	3,214,516.00	3.90
7	300502	新易盛	3,176,468.00	3.86
8	300394	天孚通信	3,143,301.00	3.82
9	601899	紫金矿业	3,133,382.00	3.81
10	600660	福耀玻璃	3,116,207.00	3.78
11	601628	中国人寿	2,961,068.00	3.60
12	000157	中联重科	2,927,050.00	3.55
13	000333	美的集团	2,810,328.00	3.41
14	000708	中信特钢	2,804,517.00	3.41
15	603993	洛阳钼业	2,773,687.00	3.37
16	002142	宁波银行	2,762,904.00	3.36
17	688520	神州细胞	2,750,941.21	3.34

18	601318	中国平安	2,700,544.00	3.28
19	600298	安琪酵母	2,685,229.00	3.26
20	000498	山东路桥	2,646,946.00	3.21
21	600795	国电电力	2,633,331.00	3.20
22	300866	安克创新	2,608,576.00	3.17
23	601939	建设银行	2,556,556.00	3.10
24	600309	万华化学	2,536,384.00	3.08
25	600011	华能国际	2,522,520.86	3.06
26	605499	东鹏饮料	2,507,924.00	3.05
27	002028	思源电气	2,456,671.00	2.98
28	601339	百隆东方	2,388,955.00	2.90
29	601058	赛轮轮胎	2,385,580.00	2.90
30	600970	中材国际	2,383,248.00	2.89
31	601988	中国银行	2,380,196.00	2.89
32	601336	新华保险	2,372,981.00	2.88
33	301007	德迈仕	2,369,248.00	2.88
34	600803	新奥股份	2,368,802.00	2.88
35	688108	赛诺医疗	2,368,172.27	2.88
36	601088	中国神华	2,364,779.00	2.87
37	601319	中国人保	2,339,525.00	2.84
38	301397	溯联股份	2,319,393.00	2.82
39	600251	冠农股份	2,309,405.00	2.80
40	002999	天禾股份	2,260,643.00	2.75
41	300476	胜宏科技	2,248,643.00	2.73
42	601919	中远海控	2,236,131.00	2.72
43	600926	杭州银行	2,236,012.00	2.72
44	603967	中创物流	2,212,733.00	2.69
45	300872	天阳科技	2,204,467.00	2.68
46	002463	沪电股份	2,194,383.00	2.67
47	000988	华工科技	2,178,430.00	2.65
48	603019	中科曙光	2,168,739.00	2.63
49	688521	芯原股份	2,156,473.59	2.62
50	002204	大连重工	2,143,769.00	2.60
51	301052	果麦文化	2,127,077.00	2.58
52	600415	小商品城	2,101,591.00	2.55
53	688166	博瑞医药	2,095,309.11	2.54
54	002625	光启技术	2,092,512.00	2.54
55	002265	建设工业	2,091,211.00	2.54
56	603579	荣泰健康	2,090,023.00	2.54
57	002233	塔牌集团	2,063,626.00	2.51
58	603568	伟明环保	2,062,490.00	2.50

59	600989	宝丰能源	2,061,543.00	2.50
60	301018	申菱环境	2,051,474.00	2.49
61	300547	川环科技	2,039,241.00	2.48
62	601009	南京银行	2,015,241.00	2.45
63	600938	中国海油	2,011,878.00	2.44
64	600887	伊利股份	1,954,371.00	2.37
65	600025	华能水电	1,946,824.00	2.36
66	000568	泸州老窖	1,935,428.00	2.35
67	000975	山金国际	1,934,683.00	2.35
68	002687	乔治白	1,914,879.00	2.33
69	601991	大唐发电	1,912,610.00	2.32
70	002396	星网锐捷	1,911,212.00	2.32
71	688141	杰华特	1,892,846.97	2.30
72	300274	阳光电源	1,874,400.00	2.28
73	000895	双汇发展	1,855,318.00	2.25
74	601328	交通银行	1,855,255.00	2.25
75	600372	中航机载	1,852,457.00	2.25
76	301316	慧博云通	1,847,148.00	2.24
77	603629	利通电子	1,844,095.00	2.24
78	300803	指南针	1,829,549.00	2.22
79	000726	鲁泰A	1,827,484.00	2.22
80	301095	广立微	1,822,771.00	2.21
81	000528	柳工	1,819,254.00	2.21
82	000915	华特达因	1,818,587.00	2.21
83	001219	青岛食品	1,811,841.00	2.20
84	600323	瀚蓝环境	1,806,203.00	2.19
85	300085	银之杰	1,796,580.00	2.18
86	000419	通程控股	1,791,813.00	2.18
87	000582	北部湾港	1,768,116.00	2.15
88	301039	中集车辆	1,761,732.00	2.14
89	601111	中国国航	1,760,625.00	2.14
90	601601	中国太保	1,759,088.00	2.14
91	600016	民生银行	1,754,848.00	2.13
92	688709	成都华微	1,745,755.31	2.12
93	301076	新瀚新材	1,743,050.00	2.12
94	002241	歌尔股份	1,734,612.00	2.11
95	300005	探路者	1,721,862.00	2.09
96	600028	中国石化	1,709,234.00	2.08
97	301215	中汽股份	1,699,996.00	2.06
98	000529	广弘控股	1,690,602.00	2.05
99	300400	劲拓股份	1,675,222.00	2.03

100	688111	金山办公	1,675,108.91	2.03
101	688041	海光信息	1,661,039.88	2.02
102	002104	恒宝股份	1,646,994.00	2.00

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。

8.4.2 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	601398	工商银行	3,440,604.00	4.18
2	000408	藏格矿业	2,688,035.00	3.26
3	300750	宁德时代	2,597,137.00	3.15
4	601988	中国银行	2,505,754.00	3.04
5	601088	中国神华	2,434,764.00	2.96
6	601939	建设银行	2,433,209.00	2.96
7	002142	宁波银行	2,419,932.00	2.94
8	300308	中际旭创	2,412,507.00	2.93
9	601857	中国石油	2,390,620.00	2.90
10	688108	赛诺医疗	2,382,000.85	2.89
11	601058	赛轮轮胎	2,381,211.00	2.89
12	600660	福耀玻璃	2,378,089.00	2.89
13	601899	紫金矿业	2,361,295.00	2.87
14	301397	溯联股份	2,341,238.00	2.84
15	600926	杭州银行	2,298,974.00	2.79
16	000988	华工科技	2,273,078.00	2.76
17	300502	新易盛	2,240,267.00	2.72
18	300872	天阳科技	2,149,127.00	2.61
19	300866	安克创新	2,131,604.00	2.59
20	600011	华能国际	2,130,414.00	2.59
21	300394	天孚通信	2,128,214.00	2.58
22	000498	山东路桥	2,124,444.00	2.58
23	300547	川环科技	2,086,511.00	2.53
24	600066	宇通客车	2,072,066.00	2.52
25	301018	申菱环境	2,071,761.00	2.52
26	000708	中信特钢	2,036,926.00	2.47
27	601628	中国人寿	2,008,491.00	2.44
28	688141	杰华特	1,989,431.55	2.42
29	000333	美的集团	1,975,506.64	2.40
30	002396	星网锐捷	1,934,870.00	2.35
31	603993	洛阳钼业	1,927,220.00	2.34
32	000582	北部湾港	1,925,905.00	2.34
33	000157	中联重科	1,923,391.00	2.34

34	600025	华能水电	1,911,728.00	2.32
35	300803	指南针	1,906,502.00	2.32
36	000568	泸州老窖	1,887,889.00	2.29
37	300085	银之杰	1,847,389.00	2.24
38	600298	安琪酵母	1,813,115.00	2.20
39	688709	成都华微	1,786,707.15	2.17
40	603967	中创物流	1,774,977.40	2.16
41	688166	博瑞医药	1,773,664.23	2.15
42	605499	东鹏饮料	1,767,858.00	2.15
43	601328	交通银行	1,759,764.00	2.14
44	601319	中国人保	1,759,666.00	2.14
45	603629	利通电子	1,753,127.00	2.13
46	600251	冠农股份	1,734,133.00	2.11
47	601339	百隆东方	1,726,365.00	2.10
48	600323	瀚蓝环境	1,714,421.00	2.08
49	002999	天禾股份	1,710,378.00	2.08
50	603568	伟明环保	1,706,775.00	2.07
51	600795	国电电力	1,700,891.00	2.07
52	600016	民生银行	1,696,395.00	2.06
53	601009	南京银行	1,696,206.00	2.06
54	688520	神州细胞	1,679,103.60	2.04
55	600309	万华化学	1,676,131.00	2.04
56	601818	光大银行	1,675,235.00	2.03
57	002104	恒宝股份	1,669,480.00	2.03
58	301316	慧博云通	1,665,660.00	2.02
59	300400	劲拓股份	1,665,203.00	2.02
60	301095	广立微	1,658,799.00	2.01
61	000915	华特达因	1,658,059.40	2.01
62	002151	北斗星通	1,648,133.00	2.00

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,028,019,286.18
卖出股票收入（成交）总额	874,677,461.88

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。

8.5 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	117,495,718.91	11.04
2	央行票据	—	—
3	金融债券	610,757,268.06	57.37
	其中：政策性金融债	121,869,547.95	11.45
4	企业债券	128,437,900.94	12.06
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	11,929,311.80	1.12
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	868,620,199.71	81.59

8.6 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	092202005	22 国开行二级资本 债 01A	600,000	61,375,726.03	5.76
2	312510012	25 中行 TLAC 非资 本债 02 (BC)	550,000	55,413,087.67	5.20
3	092280083	22 建行永续债 01	500,000	51,651,342.47	4.85
4	019773	25 国债 08	500,000	50,504,821.92	4.74
5	243912	25 中证 G7	500,000	50,474,882.19	4.74

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.13 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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

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。

8.13.2 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。

8.13.3 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	154,845.41

2	应收清算款	5,730,935.23
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	39,695,411.41
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	45,581,192.05

8.13.4 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	113052	兴业转债	748,558.27	0.07
2	127039	北港转债	659,318.09	0.06
3	118031	天23转债	617,156.89	0.06
4	111004	明新转债	600,424.52	0.06
5	127024	盈峰转债	579,824.84	0.05
6	123158	宙邦转债	548,695.89	0.05
7	113042	上银转债	543,799.21	0.05
8	113056	重银转债	536,649.13	0.05
9	111010	立昂转债	533,072.48	0.05
10	113062	常银转债	532,724.69	0.05
11	123128	首华转债	528,165.37	0.05
12	128141	旺能转债	512,892.47	0.05
13	123215	铭利转债	512,814.74	0.05
14	127041	弘亚转债	412,813.26	0.04
15	118043	福立转债	388,045.60	0.04
16	127022	恒逸转债	377,744.77	0.04
17	113584	家悦转债	326,667.62	0.03
18	113048	晶科转债	324,301.39	0.03
19	128125	华阳转债	314,598.01	0.03
20	127089	晶澳转债	263,992.80	0.02
21	113671	武进转债	252,754.85	0.02
22	113623	凤21转债	180,796.56	0.02
23	113625	江山转债	160,537.67	0.02

24	127016	鲁泰转债	147,643.85	0.01
25	123213	天源转债	140,508.23	0.01
26	127018	本钢转债	121,058.36	0.01
27	110070	凌钢转债	106,475.02	0.01
28	113037	紫银转债	106,426.14	0.01
29	123178	花园转债	105,923.79	0.01
30	110073	国投转债	105,682.32	0.01
31	127061	美锦转债	98,815.71	0.01
32	127099	盛航转债	75,568.34	0.01
33	113631	皖天转债	70,508.38	0.01
34	127105	龙星转债	69,802.50	0.01
35	113656	嘉诚转债	65,765.55	0.01
36	118034	晶能转债	60,008.33	0.01
37	113640	苏利转债	56,194.09	0.01
38	118000	嘉元转债	24,716.23	0.00
39	118038	金宏转债	15,008.20	0.00
40	113051	节能转债	10,882.38	0.00
41	123250	嘉益转债	497.67	0.00

8.13.5 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。

8.13.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	324	827,526.58	244,177,801.77	91.07	23,940,811.56	8.93
富国盛利增强债券发起式 C	487	231,284.99	6,282,727.67	5.58	106,353,063.17	94.42
富国盛利增强债券发起式 E	62	9,537,759.15	590,936,484.66	99.93	404,582.45	0.07
合计	873	1,113,511.42	841,397,014.10	86.55	130,698,457.18	13.45

9.2 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	1,180,254.14	0.4402
	富国盛利增强债券发起式 C	30.08	0.0000
	富国盛利增强债券发起式 E	—	—
	合计	1,180,284.22	0.1214

9.3 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、基金投资和相关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

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数(份)	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数(份)	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金	10,002,336.04	1.03	10,001,350.14	1.03	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	1.03	10,001,350.14	1.03	3年

§ 10 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	280,910,729.79	414,188,350.28	729,001,756.94
减：本报告期基金总赎回份额	60,345,288.43	334,115,846.59	137,661,675.73
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
报告期期末基金份额总额	268,118,613.33	112,635,790.84	591,341,067.11

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

2025年9月，中国农业银行总行决定蔡崎峰任托管业务部总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金本报告期所持有的基金未发生具有重大影响的事件。

11.6 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。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为1.8万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为23年。

11.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.7.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	富国基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025年11月11日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局

受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正
受到调查或处罚等措施的原因	公司治理、合规内控、投资运作、人员管理、其他问题（销售管理、财务管理）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《关于实施〈公开募集证券投资基金管理人监督管理办法〉有关问题的规定》《证券投资基金管理公司管理办法》《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》《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》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券投资基金评价业务管理暂行办法》《证券期货投资者适当性管理办法》《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	截至报告期末，公司已采取包括完善公司相关制度细则、优化相关系统流程、完善合规内控机制在内的一系列整改措施。公司整改成果已经上海证监局验收通过，相关措施已被解除。
其他	—

11.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 11 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《证券投资基金管理公司管理办法》《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	截至报告期末，公司已采取包括完善公司相关制度细则、优化相关系统流程、完善合规内控机制在内的一系列整改措施。公司整改成果已经上海证监局验收通过，相关措施已被解除。
其他	—
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 2
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 11 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施

受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（销售管理）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券投资基金评价业务管理暂行办法》《证券期货投资者适当性管理办法》《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	截至报告期末，公司已采取包括完善公司相关制度细则、优化相关系统流程、完善合规内控机制在内的一系列整改措施。公司整改成果已经上海证监局验收通过，相关措施已被解除。
其他	—

11.7.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

11.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.8 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	726,110,494.46	38.17	294,741.75	38.17	—
国泰海通	4	198,291,193.24	10.42	80,488.19	10.42	—
国泰君安	2	2,208,765.00	0.12	896.64	0.12	—
海通证券	2	—	—	—	—	—
西部证券	1	189,493,805.55	9.96	76,924.11	9.96	—
兴业证券	2	4,733,006.75	0.25	1,921.09	0.25	—
中金公司	1	79,219,746.45	4.16	32,156.15	4.16	—
中信证券	2	676,565,755.67	35.56	274,622.08	35.56	—
中银证券	1	25,833,506.70	1.36	10,485.78	1.36	—

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12月31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。

11.8.2 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	72,970,699.40	9.42	1,371,400,000.00	23.82	—	—	—	—
国泰海通	52,138,508.36	6.73	831,990,000.00	14.45	—	—	—	—
国泰君安	3,485,284.60	0.45	11,600,000.00	0.20	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—	—	—
西部证券	49,461,928.20	6.39	450,500,000.00	7.82	—	—	—	—
兴业证券	5,718,048.75	0.74	21,600,000.00	0.38	—	—	—	—
中金公司	92,551,765.53	11.95	900,500,000.00	15.64	—	—	—	—
中信证券	497,933,765.70	64.30	2,168,100,000.00	37.66	—	—	—	—
中银证券	177,844.86	0.02	2,000,000.00	0.03	—	—	—	—

11.9 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
---	-------------------------	--------	-------------

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2025-06-25 至 2025-07-16	—	18,323,094.36	10,762,114.68	7,560,979.68	0.78%
	2	2025-02-28 至 2025-08-27	10,002,336.04	5,942,178.96	5,030,019.88	10,914,495.12	1.12%
	3	2025-08-28 至 2025-10-12	—	78,245,122.01	9,500,000.00	68,745,122.01	7.07%
	4	2025-12-29	—	182,950,212.40	—	182,950,212.40	18.82%
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。

12.2 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》。根据国泰君安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。

§ 13 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 。