

富国丰利增强债券型发起式证券投资基金

二〇二〇年中期报告

2020年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2020年08月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。本报告中财务资料未经审计。本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§3	主要财务指标、基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§5	托管人报告	11
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	12
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§6	中期财务报表(未经审计)	12
6.1	资产负债表	12
6.2	利润表	13
6.3	所有者权益(基金净值)变动表	14
6.4	报表附注	15
§7	投资组合报告	34
7.1	期末基金资产组合情况	34
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	44
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	45
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	45

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12	投资组合报告附注	45
§8	基金份额持有人信息	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	47
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	48
§9	开放式基金份额变动	48
§10	重大事件揭示	48
10.1	基金份额持有人大会决议	48
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4	基金投资策略的改变	49
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8	其他重大事件	51
§11	影响投资者决策的其他重要信息	51
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	51
§12	备查文件目录	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国丰利增强债券型发起式证券投资基金
基金简称	富国丰利增强债券
基金主代码	004902
交易代码	004902
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年09月05日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	390,624,934.06份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。本基金在债券投资过程中突出主动性的投资管理，在对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势进行客观判断的基础上，通过合理配置收益率相对较高的企业债、公司债、资产支持证券，以及风险收益特征优异的可转换公司债券、可分离交易可转债、中小企业私募债券、可交换债券等债券品种，加以对国家债券、金融债券、中央银行票据以及质押及买断式回购等高流动性品种的投资，灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略，在保证基金流动性的前提下，积极把握固定收益证券市场中投资机会，获取各类债券的超额投资收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数收益率*80%+中证500指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人	
名称	富国基金管理有限公司	交通银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	赵瑛	陆志俊
	联系电话	021-20361818	95559
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话	95105686、4008880688	95559	
传真	021-20361616	021-62701216	

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	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 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	中国(上海)长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	裴长江	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 交通银行 上海市浦东新区银城中路 188 号

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	17,309,291.39
本期利润	17,332,838.56
加权平均基金份额本期利润	0.0490
本期加权平均净值利润率	4.34%
本期基金份额净值增长率	4.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	57,982,758.95
期末可供分配基金份额利润	0.1484
期末基金资产净值	448,933,985.60

期末基金份额净值	1.1493
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)
基金份额累计净值增长率	14.93%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

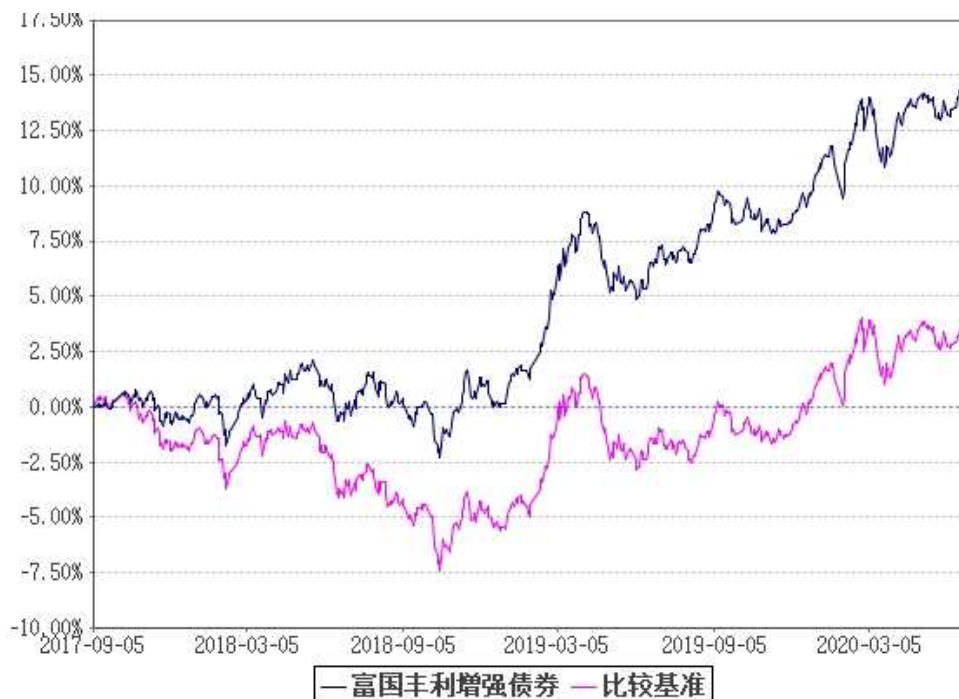
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.58%	0.21%	0.89%	0.19%	0.69%	0.02%
过去三个月	3.07%	0.25%	2.28%	0.25%	0.79%	0.00%
过去六个月	4.44%	0.34%	3.14%	0.34%	1.30%	0.00%
过去一年	7.87%	0.28%	5.45%	0.28%	2.42%	0.00%
自基金合同生效日起至今	14.93%	0.28%	3.72%	0.29%	11.21%	-0.01%

注：根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*80%+中证500指数收益率*20%。中债综合全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。中证500指数是从上海和深圳证券交易所中选取500只A股作为样本编制而成的成份股指数，综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况，具有良好的投资价值。该指数由中证指数公司在引进国际指数编制和管理经验的基础上编制和维护，编制方法的透明度高，具有独立性。本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1日收益率（benchmark_t）按下列公式计算： $benchmark_t = 80\% * [中债综合全价指数收益率_t / (中债综合全价指数收益率_{t-1} - 1)] + 20\% * [中证500指数收益率_t / (中证500指数收益率_{t-1} - 1)]$ ；其中，t=1, 2, 3, ..., T，T表示时间截至日；期间T日收益率（benchmark_T）按下列公式计算： $benchmark_T = [\prod_{t=1}^T (1 + benchmark_t)] - 1$ 其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=1}^T (1 + benchmark_t)$ 表示t日至T日的(1+benchmark_t)数学连乘。

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



注：1、截止日期为2020年6月30日。
2、本基金于2017年9月5日成立，建仓期6个月，从2017年9月5日起至2018年3月4日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至2020年6月30日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券

投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3年国开行债券指数证券投资基金、富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金、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等一百六十八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）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	本基金基金经理	2018-03-19	—	7.4	硕士，自2013年2月至2016年10月任交银施罗德基金管理有限公司研究员、投资经理；2016年10月加入富国基金管理有限公司，自2016年10月至2018年3月任投资经理，自2018年3月起任富国丰利增强债券型发起式证券投资基金、富国宝利增强债券型发起式证券投资基金、富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2018年4月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现4次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在新冠疫情的影响下，上半年全球遭受了巨大冲击，主要经济体的增长呈现了三次转折。

在疫情爆发初期，2-4月份增长短暂向下衰退。期间严格的封锁措施使主要经济活动全面中断，与之相伴的是各国激进的财政刺激和宽松的货币政策，债券利率也回落到历史性低位水平。面对高流动性与低增长的组合，股市在短暂的调整后，即选择以创业板等高成长板块为主要突破方向。对应这一阶段，组合也增加了对长久期利率债的配置，和高弹性可转债的参与度。

第二是首轮疫情缓解后，4-6月份增长的迅速修复，衰退结束。期间以中国为首的成功抗疫国家复产复工推动经济数据反弹。由于中国的响应效率远强于其他国家，经济活动的显著改善给了中国央行信心以提前回收流动性，债券利率即从4月末的历史性低点反弹至今年初的水平，作为应对，我们也降低了组合债券杠杆和久期水平。股票市场则受经济改善预期的推动，继续走强，风格仍以成长为主。

第三是复工后期的再度放缓。自二季度末，全球疫情的反弹使部分地区复工

停滞甚至倒退。将重新体现为海外经济数据的拖累。而中国在成功守住外部疫情输入的同时，宏观总量政策也有减弱的迹象，可能会降温下半年增长的强度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2020年6月30日，本基金份额净值为1.1493元；份额累计净值为1.1493元；本报告期，本基金份额净值增长率为4.44%，同期业绩比较基准收益率为3.14%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前我们正处在今年以来全球增长的第三个拐点，即复工后期的再度放缓期。一方面，海外疫情二次爆发将拖累后续的海外经济增长，如美国首次申领失业救济人数又有重新回升迹象；另一方面，国内刺激政策的退出也可能削弱下半年增长的强度。此外，临近美国大选，中美关系的不确定性也可能随时压制市场风险偏好。

央行货币政策经历二季度的收紧后，大概率将维持平稳，因此债券利率的调整可能已经到位。对于权益资产，在稳健的流动性和平缓的增长水平下，可能较难出现大级别的行情，但仍然会有积极的结构性机会。

组合可能适当增加对债券的配置，并继续通过量化方法寻找个股和可转债上的Alpha机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2020 中期，基金托管人在富国丰利增强债券型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2020 中期，富国基金管理有限公司在富国丰利增强债券型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2020 中期，由富国基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富国丰利增强债券型发起式证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 中期财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国丰利增强债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2020 年 06 月 30 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
资 产：		
银行存款	582,583.35	532,383.92
结算备付金	1,528,475.18	1,495,507.98
存出保证金	94,332.40	46,566.36
交易性金融资产	487,991,531.56	298,927,366.62
其中：股票投资	88,061,753.02	51,679,831.60
基金投资	—	—
债券投资	399,929,778.54	247,247,535.02
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	600,000.00	—
应收证券清算款	—	998,241.09
应收利息	5,952,863.64	2,698,498.10
应收股利	—	—
应收申购款	28,187.49	6,788.70
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	496,777,973.62	304,705,352.77
负债和所有者权益	本期末 (2020 年 06 月 30 日)	上年度末 (2019 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	46,800,000.00	42,595,000.00
应付证券清算款	451,020.64	1,322,931.93
应付赎回款	176,193.84	1,179,287.71
应付管理人报酬	136,963.42	82,381.10
应付托管费	34,240.86	20,595.25
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	152,413.89	74,087.39
应交税费	12,979.25	12,921.51
应付利息	5,257.58	-1,387.34
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	74,918.54	170,000.00
负债合计	47,843,988.02	45,455,817.55
所有者权益：		
实收基金	390,624,934.06	235,598,395.86
未分配利润	58,309,051.54	23,651,139.36
所有者权益合计	448,933,985.60	259,249,535.22
负债和所有者权益总计	496,777,973.62	304,705,352.77

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1493 元，基金份额总额 390,624,934.06 份。

6.2 利润表

会计主体：富国丰利增强债券型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日)
一、收入	19,359,435.43	14,185,964.84
1. 利息收入	5,433,369.00	3,896,756.62
其中：存款利息收入	87,856.81	68,973.63
债券利息收入	5,316,049.73	3,808,144.90
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	29,462.46	19,638.09
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	13,769,109.22	6,980,028.12

其中：股票投资收益	8,023,274.42	2,565,093.70
基金投资收益	—	—
债券投资收益	4,974,313.03	3,917,740.29
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	771,521.77	497,194.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	23,547.17	3,277,674.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	133,410.04	31,505.72
减：二、费用	2,026,596.87	1,640,055.53
1.管理人报酬	791,019.88	421,492.96
2.托管费	197,754.97	105,373.23
3.销售服务费	—	—
4.交易费用	511,233.38	202,609.55
5.利息支出	420,594.80	795,444.63
其中：卖出回购金融资产支出	420,594.80	795,444.63
6.税金及附加	8,682.76	7,532.02
7.其他费用	97,311.08	107,603.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	17,332,838.56	12,545,909.31
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	17,332,838.56	12,545,909.31

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国丰利增强债券型发起式证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2020年01月01日至2020年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	235,598,395.86	23,651,139.36	259,249,535.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	17,332,838.56	17,332,838.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	155,026,538.20	17,325,073.62	172,351,611.82
其中：1.基金申购款	573,540,495.07	70,417,749.22	643,958,244.29
2.基金赎回款	-418,513,956.87	-53,092,675.60	-471,606,632.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少）	—	—	—

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	390,624,934.06	58,309,051.54	448,933,985.60
项目	上年度可比期间 (2019年01月01日至2019年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	193,880,465.71	297,711.15	194,178,176.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,545,909.31	12,545,909.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	48,446,259.74	3,003,883.64	51,450,143.38
其中: 1. 基金申购款	295,704,433.28	15,496,319.43	311,200,752.71
2. 基金赎回款	-247,258,173.54	-12,492,435.79	-259,750,609.33
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	242,326,725.45	15,847,504.10	258,174,229.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

陈 戈	林志松	徐 慧
—————	—————	—————
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国丰利增强债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]769号《关于准予富国丰利增强债券型发起式证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开募集,基金合同于2017年9月5日生效,首次设立募集规模为150,004,400.62份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券、中小企业私募债券等)、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、股票(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适

当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

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

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*80%+中证 500 指数收益率*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和中期报告》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

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

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

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

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

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

2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内

全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本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。对本基金在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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）
活期存款	582,583.35
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
合计	582,583.35

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	82,486,309.92	88,061,753.02	5,575,443.10	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	
债券	交易所市场	168,056,757.46	168,035,778.54	-20,978.92
	银行间市场	233,086,552.10	231,894,000.00	-1,192,552.10
	合计	401,143,309.56	399,929,778.54	-1,213,531.02
资产支持证券	—	—	—	
基金	—	—	—	
其他	—	—	—	

合计	483,629,619.48	487,991,531.56	4,361,912.08
----	----------------	----------------	--------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

金额单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	600,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	600,000.00	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）
应收活期存款利息	44.53
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	619.02
应收债券利息	5,952,161.84
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	38.25
合计	5,952,863.64

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）
交易所市场应付交易费用	148,486.39
银行间市场应付交易费用	3,927.50
合计	152,413.89

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）
----	------------------

应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	14,918.54
合计	74,918.54

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	235,598,395.86	235,598,395.86
本期申购	573,540,495.07	573,540,495.07
本期赎回（以“-”号填列）	-418,513,956.87	-418,513,956.87
本期末	390,624,934.06	390,624,934.06

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,912,717.03	3,738,422.33	23,651,139.36
本期利润	17,309,291.39	23,547.17	17,332,838.56
本期基金份额交易产生的变动数	20,760,750.53	-3,435,676.91	17,325,073.62
其中：基金申购款	69,470,774.36	946,974.86	70,417,749.22
基金赎回款	-48,710,023.83	-4,382,651.77	-53,092,675.60
本期已分配利润	—	—	—
本期末	57,982,758.95	326,292.59	58,309,051.54

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
活期存款利息收入	40,468.52
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	18,319.16
其他	29,069.13

合计	87,856.81
----	-----------

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
卖出股票成交总额	157,683,663.30
减：卖出股票成本总额	149,660,388.88
买卖股票差价收入	8,023,274.42

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	488,349,303.79
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	476,641,878.46
减：应收利息总额	6,733,112.30
买卖债券差价收入	4,974,313.03

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
----	-----------------------------

股票投资产生的股利收益	771,521.77
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	771,521.77

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
1. 交易性金融资产	23,547.17
股票投资	1,662,253.50
债券投资	-1,638,706.33
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	23,547.17

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
基金赎回费收入	133,197.23
转换费收入	212.81
合计	133,410.04

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
交易所市场交易费用	501,255.88
银行间市场交易费用	9,977.50
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	511,233.38

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）
审计费用	14,918.54
信息披露费	60,000.00

证券出借违约金	—
银行费用	3,792.54
债券账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	97,311.08

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2020年01月01日至2020年06月30日)		上年度可比期间(2019年01月01日至2019年06月30日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
海通证券	62,197,908.06	18.23	4,334,714.96	3.37
申万宏源	51,618,362.51	15.13	—	—

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2020年01月01日至2020年06月30日)	上年度可比期间(2019年01月01日至2019年06月30日)
-------	-----------------------------	----------------------------------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
海通证券	17,825,771.34	5.15	1,838,176.40	0.52
申万宏源	66,623,015.33	19.25	60,818,341.19	17.17

6.4.10.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）		上年度可比期间（2019年01月01日至2019年06月30日）	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)
海通证券	50,400,000.00	2.72	13,600,000.00	0.52
申万宏源	175,600,000.00	9.49	250,000,000.00	9.54

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
申万宏源	47,569.76	15.28	22,834.10	15.38
海通证券	56,681.33	18.20	18,182.21	12.25
关联方名称	上年度可比期间（2019年01月01日至2019年06月30日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
海通证券	3,950.33	3.37	—	—

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）	上年度可比期间（2019年01月01日至2019年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	791,019.88	421,492.96
其中：支付销售机构的客户维护费	7,537.55	1,852.83

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.4%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2020年01月01日至 2020年06月30日)	上年度可比期间(2019年01月 01日至2019年06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	197,754.97	105,373.23

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期(2020年01月01日至2020 年06月30日)	上年度可比期间(2019年01 月01日至2019年06月30日)
基金合同生效日(2017年 09月05日)持有的基金份额	10,006,200.62	10,006,200.62
期初持有的基金份额	10,006,200.62	10,006,200.62
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—

减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	10,006,200.62	10,006,200.62
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.56%	4.13%

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2020年01月01日至2020年06月30日）		上年度可比期间（2019年01月01日至2019年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	582,583.35	40,468.52	140,085.62	26,285.27

注：本基金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户的证券交易结算资金余额 2020 年上半年末为 1,528,475.18 元，2019 年上半年末为 2,431,432.78 元。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002500	山西证券	2020-06-29	2020-07-10	网上配股限售	5.00	6.54	3,810	19,050.00	24,917.40	—

6.4.12.1.2 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	可流通日	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
128115	巨星转债	2020-06-24	2020-07-16	认购新发证券	100.00	100.00	3	300.00	300.00	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002470	金正大	2020-06-30	重大事项停牌	2.27	2020-07-01	2.16	128,300	329,163.67	291,241.00	—

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2020年06月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年06月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额46,800,000.00元，于2020年7月6日、2020年7月8日、2020年7月13日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风

险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末（2020年06月30日）	上年度末（2019年12月31日）
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	100,190,000.00	59,828,000.00
合计	100,190,000.00	59,828,000.00

注：本表主要列示短期融资券和超短期融资券，债券评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券列示超短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2020年06月30日）	上年度末（2019年12月31日）
AAA	98,605,168.10	82,848,101.40
AAA 以下	21,588,176.74	17,757,859.12
未评级	—	—
合计	120,193,344.84	100,605,960.52

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

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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

单位：人民币元

本期末（2020年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	582,583.35	—	—	—	—	—	582,583.35
结算备付金	1,528,475.18	—	—	—	—	—	1,528,475.18
存出保证金	94,332.40	—	—	—	—	—	94,332.40
交易性金融资产	2,582,220.00	61,118,500.00	111,527,024.84	120,925,223.70	103,776,810.00	88,061,753.02	487,991,531.56
买入返售金融资产	600,000.00	—	—	—	—	—	600,000.00
应收利息	—	—	—	—	—	5,952,863.64	5,952,863.64
应收申购款	—	—	—	—	—	28,187.49	28,187.49
资产总计	5,387,610.93	61,118,500.00	111,527,024.84	120,925,223.70	103,776,810.00	94,042,804.15	496,777,973.62
负债							
卖出回购金融资产款	46,800,000.00	—	—	—	—	—	46,800,000.00
应付证券清算款	—	—	—	—	—	451,020.64	451,020.64
应付赎回款	—	—	—	—	—	176,193.84	176,193.84
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	136,963.42	136,963.42
应付托管费	—	—	—	—	—	34,240.86	34,240.86
应付交易费用	—	—	—	—	—	152,413.89	152,413.89
应付税费	—	—	—	—	—	12,979.25	12,979.25
应付利息	—	—	—	—	—	5,257.58	5,257.58
其他负债	—	—	—	—	—	74,918.54	74,918.54
负债总计	46,800,000.00	—	—	—	—	1,043,988.02	47,843,988.02
利率敏感度缺口	-41,412,389.07	61,118,500.00	111,527,024.84	120,925,223.70	103,776,810.00	92,998,816.13	448,933,985.60

上年度末（2019年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	532,383.92	—	—	—	—	—	532,383.92
结算备付金	1,495,507.98	—	—	—	—	—	1,495,507.98
存出保证金	46,566.36	—	—	—	—	—	46,566.36
交易性金融资产	444,530.00	22,240,686.00	81,103,871.92	125,473,247.10	17,985,200.00	51,679,831.60	298,927,366.62
应收证券清算款	—	—	—	—	—	998,241.09	998,241.09
应收利息	—	—	—	—	—	2,698,498.10	2,698,498.10
应收申购款	—	—	—	—	—	6,788.70	6,788.70
资产总计	2,518,988.26	22,240,686.00	81,103,871.92	125,473,247.10	17,985,200.00	55,383,359.49	304,705,352.77
负债							
卖出回购金融资产款	42,595,000.00	—	—	—	—	—	42,595,000.00
应付证券清算款	—	—	—	—	—	1,322,931.93	1,322,931.93
应付赎回款	—	—	—	—	—	1,179,287.71	1,179,287.71
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	82,381.10	82,381.10
应付托管费	—	—	—	—	—	20,595.25	20,595.25
应付交易费用	—	—	—	—	—	74,087.39	74,087.39
应付税费	—	—	—	—	—	12,921.51	12,921.51
应付利息	—	—	—	—	—	-1,387.34	-1,387.34
其他负债	—	—	—	—	—	170,000.00	170,000.00
负债总计	42,595,000.00	—	—	—	—	2,860,817.55	45,455,817.55
利率敏感度缺口	-40,076,011.74	22,240,686.00	81,103,871.92	125,473,247.10	17,985,200.00	52,522,541.94	259,249,535.22

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动； 2. 利率变动范围合理。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2020年06月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-997,509.14	-452,747.93
	2. 基准点利率减少0.1%	997,509.14	452,747.93

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股票、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；投资于股票、权证等资产的比例不超过基金资产的20%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2020年06月30日）		上年度末（2019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	88,061,753.02	19.62	51,679,831.60	19.93
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	399,929,778.54	89.08	247,247,535.02	95.37
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	487,991,531.56	108.70	298,927,366.62	115.30

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2020年06月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加1%	4,377,443.68	2,519,459.94
2. 业绩比较基准减少1%	-4,377,443.68	-2,519,459.94	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2020年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币100,206,851.36元，属于第二层次的余额为人民币387,784,680.20元，属于第三层次余额为人民币0.00元。

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	88,061,753.02	17.73
	其中：股票	88,061,753.02	17.73
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	399,929,778.54	80.50
	其中：债券	399,929,778.54	80.50
	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	600,000.00	0.12
	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	2,111,058.53	0.42
8	其他各项资产	6,075,383.53	1.22
9	合计	496,777,973.62	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	813,327.00	0.18
B	采矿业	1,934,723.80	0.43
C	制造业	52,382,737.95	11.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,206,464.00	0.49
E	建筑业	1,265,517.00	0.28
F	批发和零售业	5,683,835.42	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	2,217,638.00	0.49

H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,367,049.78	2.31
J	金融业	3,625,950.15	0.81
K	房地产业	3,290,326.52	0.73
L	租赁和商务服务业	782,672.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	1,055,647.20	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	527,436.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	6,017.20	0.00
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	1,554,316.00	0.35
S	综合	348,095.00	0.08
	合计	88,061,753.02	19.62

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002439	启明星辰	35,800	1,506,106.00	0.34
2	300558	贝达药业	9,600	1,343,808.00	0.30
3	603233	大参林	15,011	1,219,193.42	0.27
4	002414	高德红外	41,585	1,217,608.80	0.27
5	600380	健康元	74,100	1,203,384.00	0.27
6	600216	浙江医药	62,400	1,201,824.00	0.27
7	000513	丽珠集团	24,969	1,198,761.69	0.27
8	603712	七一二	31,000	1,189,780.00	0.27
9	300482	万孚生物	11,300	1,175,200.00	0.26
10	002353	杰瑞股份	36,100	1,119,100.00	0.25
11	000090	天健集团	160,900	1,111,819.00	0.25
12	300271	华宇软件	37,800	1,066,338.00	0.24
13	002557	洽洽食品	18,600	1,007,934.00	0.22
14	000581	威孚高科	47,400	980,232.00	0.22
15	600143	金发科技	74,200	977,214.00	0.22
16	002028	思源电气	47,600	973,896.00	0.22
17	600486	扬农化工	11,800	973,500.00	0.22
18	600325	华发股份	130,700	922,742.00	0.21
19	601615	明阳智能	72,700	905,115.00	0.20
20	603444	吉比特	1,600	878,416.00	0.20
21	002233	塔牌集团	71,400	858,942.00	0.19
22	002216	三全食品	35,800	855,620.00	0.19
23	603501	韦尔股份	4,100	827,995.00	0.18

24	002697	红旗连锁	73,300	800,436.00	0.18
25	300607	拓斯达	19,260	783,689.40	0.17
26	601966	玲珑轮胎	38,400	775,680.00	0.17
27	603313	梦百合	32,200	757,666.00	0.17
28	002368	太极股份	17,200	751,468.00	0.17
29	603127	昭衍新药	7,140	750,628.20	0.17
30	300418	昆仑万维	28,400	708,864.00	0.16
31	601099	太平洋	210,500	667,285.00	0.15
32	600845	宝信软件	10,672	630,501.76	0.14
33	002241	歌尔股份	20,600	604,816.00	0.13
34	300315	掌趣科技	82,100	601,793.00	0.13
35	002156	通富微电	23,600	591,180.00	0.13
36	002048	宁波华翔	38,200	589,808.00	0.13
37	600466	蓝光发展	108,160	582,982.40	0.13
38	000501	鄂武商A	35,800	561,344.00	0.13
39	002475	立讯精密	10,859	557,609.65	0.12
40	002223	鱼跃医疗	15,200	553,280.00	0.12
41	002124	天邦股份	42,100	540,985.00	0.12
42	600060	海信视像	44,400	539,460.00	0.12
43	600529	山东药玻	9,200	533,600.00	0.12
44	603338	浙江鼎力	7,020	531,905.40	0.12
45	300433	蓝思科技	18,900	529,956.00	0.12
46	300207	欣旺达	27,700	523,530.00	0.12
47	600782	新钢股份	126,500	516,120.00	0.11
48	002064	华峰氨纶	99,600	504,972.00	0.11
49	600338	西藏珠峰	50,300	503,000.00	0.11
50	600827	百联股份	34,800	502,860.00	0.11
51	002928	华夏航空	33,000	496,650.00	0.11
52	000547	航天发展	35,900	490,753.00	0.11
53	000563	陕国投A	131,800	488,978.00	0.11
54	600282	南钢股份	151,300	488,699.00	0.11
55	002217	合力泰	92,200	484,050.00	0.11
56	603707	健友股份	7,400	477,818.00	0.11
57	300274	阳光电源	33,200	477,748.00	0.11
58	000488	晨鸣纸业	96,000	474,240.00	0.11
59	002191	劲嘉股份	52,800	470,448.00	0.10
60	600811	东方集团	105,800	467,636.00	0.10
61	600745	闻泰科技	3,700	466,015.00	0.10
62	002174	游族网络	17,800	464,224.00	0.10
63	002195	二三四五	165,062	463,824.22	0.10
64	600446	金证股份	23,900	463,660.00	0.10

65	000878	云南铜业	43,100	457,291.00	0.10
66	002131	利欧股份	116,800	450,848.00	0.10
67	002013	中航机电	56,300	444,770.00	0.10
68	600350	山东高速	71,000	435,940.00	0.10
69	600153	建发股份	53,200	430,920.00	0.10
70	002387	维信诺	30,100	429,828.00	0.10
71	600875	东方电气	47,800	423,030.00	0.09
72	300474	景嘉微	6,200	417,260.00	0.09
73	000876	新希望	13,800	411,240.00	0.09
74	002572	索菲亚	16,900	408,473.00	0.09
75	000932	华菱钢铁	108,300	408,291.00	0.09
76	000156	华数传媒	37,500	406,125.00	0.09
77	600862	中航高科	23,900	404,388.00	0.09
78	601200	上海环境	33,600	403,200.00	0.09
79	000717	韶钢松山	103,100	391,780.00	0.09
80	002244	滨江集团	91,500	390,705.00	0.09
81	000528	柳工	61,500	388,065.00	0.09
82	000800	一汽解放	35,600	382,344.00	0.09
83	600026	中远海能	59,000	381,140.00	0.08
84	002839	张家港行	66,000	380,160.00	0.08
85	300618	寒锐钴业	6,100	378,322.00	0.08
86	000028	国药一致	8,400	378,084.00	0.08
87	603208	江山欧派	3,640	354,536.00	0.08
88	300496	中科创达	4,500	349,650.00	0.08
89	002926	华西证券	32,600	346,538.00	0.08
90	600008	首创股份	114,600	344,946.00	0.08
91	600459	贵研铂业	11,400	339,834.00	0.08
92	002214	大立科技	12,000	338,160.00	0.08
93	002531	天顺风能	56,100	335,478.00	0.07
94	002714	牧原股份	4,070	333,740.00	0.07
95	002010	传化智联	61,300	333,472.00	0.07
96	600155	华创阳安	27,500	329,725.00	0.07
97	603000	人民网	16,300	323,229.00	0.07
98	600584	长电科技	10,300	322,081.00	0.07
99	600316	洪都航空	20,300	320,740.00	0.07
100	600027	华电国际	93,500	319,770.00	0.07
101	300115	长盈精密	13,921	318,094.85	0.07
102	000402	金融街	47,300	314,072.00	0.07
103	002128	露天煤业	40,100	310,775.00	0.07
104	600348	阳泉煤业	73,400	309,748.00	0.07
105	600460	士兰微	21,100	309,748.00	0.07

106	600765	中航重机	29,900	305,578.00	0.07
107	000598	兴蓉环境	65,600	301,760.00	0.07
108	002390	信邦制药	65,100	296,856.00	0.07
109	300324	旋极信息	44,400	295,704.00	0.07
110	000690	宝新能源	62,200	293,584.00	0.07
111	002084	海鸥住工	32,400	293,220.00	0.07
112	002470	*ST金正	128,300	291,241.00	0.06
113	000848	承德露露	41,000	287,000.00	0.06
114	601717	郑煤机	48,700	286,843.00	0.06
115	600376	首开股份	48,700	285,382.00	0.06
116	603218	日月股份	15,520	284,016.00	0.06
117	600266	城建发展	56,016	284,001.12	0.06
118	600673	东阳光	40,400	279,164.00	0.06
119	300498	温氏股份	12,760	278,168.00	0.06
120	600125	铁龙物流	47,900	267,282.00	0.06
121	601718	际华集团	80,100	265,932.00	0.06
122	000400	许继电气	19,700	260,040.00	0.06
123	600760	中航沈飞	7,900	259,278.00	0.06
124	601928	凤凰传媒	38,100	259,080.00	0.06
125	600739	辽宁成大	13,400	253,662.00	0.06
126	000543	皖能电力	63,100	253,662.00	0.06
127	300308	中际旭创	4,000	252,000.00	0.06
128	601598	中国外运	76,600	247,418.00	0.06
129	603766	隆鑫通用	63,900	247,293.00	0.06
130	600639	浦东金桥	15,300	244,494.00	0.05
131	600582	天地科技	82,400	241,432.00	0.05
132	002797	第一创业	34,800	240,816.00	0.05
133	002807	江阴银行	60,740	238,708.20	0.05
134	002085	万丰奥威	36,800	238,464.00	0.05
135	603858	步长制药	8,200	236,570.00	0.05
136	002511	中顺洁柔	10,500	234,150.00	0.05
137	600657	信达地产	56,400	232,368.00	0.05
138	600704	物产中大	55,100	231,971.00	0.05
139	603606	东方电缆	15,900	231,186.00	0.05
140	002389	航天彩虹	17,000	228,650.00	0.05
141	002416	爱施德	31,500	226,170.00	0.05
142	603613	国联股份	2,400	225,600.00	0.05
143	000060	中金岭南	60,000	223,200.00	0.05
144	000813	德展健康	35,400	219,480.00	0.05
145	600449	宁夏建材	17,800	217,516.00	0.05
146	002203	海亮股份	24,700	216,125.00	0.05

147	600339	中油工程	94,200	213,834.00	0.05
148	600985	淮北矿业	26,800	208,772.00	0.05
149	002110	三钢闽光	31,200	207,792.00	0.05
150	600804	鹏博士	23,000	206,540.00	0.05
151	603556	海兴电力	14,200	205,048.00	0.05
152	000883	湖北能源	56,900	200,288.00	0.04
153	600063	皖维高新	61,100	199,186.00	0.04
154	002583	海能达	26,100	198,099.00	0.04
155	002458	益生股份	12,900	196,983.00	0.04
156	600643	爱建集团	24,769	196,913.55	0.04
157	300014	亿纬锂能	4,110	196,663.50	0.04
158	600623	华谊集团	37,800	195,048.00	0.04
159	600764	中国海防	7,400	187,220.00	0.04
160	601003	柳钢股份	41,800	185,174.00	0.04
161	002818	富森美	15,000	184,500.00	0.04
162	300770	新媒股份	800	178,928.00	0.04
163	600126	杭钢股份	17,200	178,880.00	0.04
164	300759	康龙化成	1,800	177,120.00	0.04
165	000686	东北证券	20,500	173,225.00	0.04
166	000301	东方盛虹	31,000	172,360.00	0.04
167	600901	江苏租赁	32,400	168,804.00	0.04
168	601811	新华文轩	16,400	166,788.00	0.04
169	601872	招商轮船	28,400	165,572.00	0.04
170	601677	明泰铝业	18,000	156,240.00	0.03
171	002605	姚记科技	4,100	155,800.00	0.03
172	002273	水晶光电	9,000	154,260.00	0.03
173	601801	皖新传媒	27,400	152,344.00	0.03
174	300772	运达股份	12,300	151,905.00	0.03
175	601163	三角轮胎	11,400	150,936.00	0.03
176	300529	健帆生物	2,160	150,120.00	0.03
177	601390	中国中铁	29,900	150,098.00	0.03
178	601019	山东出版	24,000	150,000.00	0.03
179	601098	中南传媒	14,000	148,120.00	0.03
180	600507	方大特钢	28,400	147,396.00	0.03
181	002948	青岛银行	28,700	146,083.00	0.03
182	603659	璞泰来	1,400	144,228.00	0.03
183	002463	沪电股份	5,700	142,386.00	0.03
184	601233	桐昆股份	11,100	141,636.00	0.03
185	600273	嘉化能源	16,100	140,714.00	0.03
186	300677	英科医疗	1,100	140,580.00	0.03
187	002371	北方华创	800	136,728.00	0.03

188	600392	盛和资源	19,300	136,065.00	0.03
189	000921	海信家电	11,100	134,976.00	0.03
190	601168	西部矿业	23,200	134,560.00	0.03
191	600757	长江传媒	26,100	132,849.00	0.03
192	603180	金牌厨柜	2,800	132,104.00	0.03
193	300182	捷成股份	33,000	131,670.00	0.03
194	600038	中直股份	3,200	131,424.00	0.03
195	300214	日科化学	16,000	130,240.00	0.03
196	600428	中远海特	42,200	129,976.00	0.03
197	000158	常山北明	12,300	128,412.00	0.03
198	603806	福斯特	2,520	125,773.20	0.03
199	600058	五矿发展	20,700	125,028.00	0.03
200	300676	华大基因	800	124,728.00	0.03
201	300070	碧水源	15,300	124,236.00	0.03
202	002049	紫光国微	1,700	123,675.00	0.03
203	000988	华工科技	5,000	122,150.00	0.03
204	000062	深圳华强	8,200	119,228.00	0.03
205	300134	大富科技	8,500	118,830.00	0.03
206	000672	上峰水泥	5,000	118,050.00	0.03
207	000975	银泰黄金	7,360	115,404.80	0.03
208	002312	三泰控股	24,900	113,295.00	0.03
209	000960	锡业股份	13,200	112,992.00	0.03
210	000600	建投能源	21,600	109,944.00	0.02
211	000685	中山公用	14,200	109,340.00	0.02
212	002709	天赐材料	3,200	108,128.00	0.02
213	002500	山西证券	16,510	107,975.40	0.02
214	002505	大康农业	47,500	106,875.00	0.02
215	600138	中青旅	10,800	106,596.00	0.02
216	002384	东山精密	3,550	106,322.50	0.02
217	002100	天康生物	6,500	104,650.00	0.02
218	600298	安琪酵母	2,100	103,908.00	0.02
219	600335	国机汽车	22,400	103,488.00	0.02
220	600959	江苏有线	27,500	103,400.00	0.02
221	000564	供销大集	22,900	102,821.00	0.02
222	300253	卫宁健康	4,420	101,394.80	0.02
223	002869	金溢科技	1,500	99,120.00	0.02
224	002653	海思科	3,700	98,457.00	0.02
225	603866	桃李面包	1,900	96,691.00	0.02
226	601000	唐山港	42,000	93,660.00	0.02
227	002555	三七互娱	2,000	93,600.00	0.02
228	601139	深圳燃气	14,300	92,950.00	0.02

229	002812	恩捷股份	1,400	92,120.00	0.02
230	000930	中粮科技	13,200	90,156.00	0.02
231	002183	怡亚通	16,400	87,904.00	0.02
232	300383	光环新网	3,200	83,424.00	0.02
233	600062	华润双鹤	5,960	78,791.20	0.02
234	000426	兴业矿业	11,200	77,056.00	0.02
235	002831	裕同科技	2,800	77,028.00	0.02
236	002925	盈趣科技	1,300	75,322.00	0.02
237	002503	搜于特	26,300	73,903.00	0.02
238	002544	杰赛科技	5,500	72,325.00	0.02
239	600021	上海电力	9,700	71,780.00	0.02
240	600536	中国软件	900	71,280.00	0.02
241	300058	蓝色光标	9,000	70,200.00	0.02
242	000009	中国宝安	8,100	68,931.00	0.02
243	000807	云铝股份	15,300	66,708.00	0.01
244	300129	泰胜风能	17,500	64,225.00	0.01
245	000987	越秀金控	5,500	64,130.00	0.01
246	002092	中泰化学	13,800	62,514.00	0.01
247	300199	翰宇药业	11,200	62,272.00	0.01
248	603983	丸美股份	700	60,221.00	0.01
249	300002	神州泰岳	9,400	58,186.00	0.01
250	002625	光启技术	8,000	58,000.00	0.01
251	601058	赛轮轮胎	13,900	49,067.00	0.01
252	600562	国睿科技	3,300	48,906.00	0.01
253	600694	大商股份	2,000	47,980.00	0.01
254	603328	依顿电子	4,600	47,978.00	0.01
255	000066	中国长城	3,400	44,880.00	0.01
256	601001	大同煤业	11,200	43,904.00	0.01
257	000966	长源电力	11,500	43,010.00	0.01
258	600053	九鼎投资	1,400	41,776.00	0.01
259	600990	四创电子	1,000	39,700.00	0.01
260	600131	国网信通	2,000	37,940.00	0.01
261	600388	龙净环保	4,200	36,960.00	0.01
262	000519	中兵红箭	3,900	36,738.00	0.01
263	600909	华安证券	5,100	34,833.00	0.01
264	000537	广宇发展	4,600	33,580.00	0.01
265	002701	奥瑞金	7,859	32,929.21	0.01
266	000980	*ST众泰	20,700	31,671.00	0.01
267	002065	东华软件	2,500	31,300.00	0.01
268	300159	新研股份	6,400	25,024.00	0.01
269	002440	闰土股份	2,600	23,764.00	0.01

270	600166	福田汽车	10,700	19,260.00	0.00
271	002373	千方科技	800	19,192.00	0.00
272	002019	亿帆医药	800	18,376.00	0.00
273	603008	喜临门	1,500	16,095.00	0.00
274	603517	绝味食品	200	14,148.00	0.00
275	002425	凯撒文化	700	12,292.00	0.00
276	000027	深圳能源	2,400	11,136.00	0.00
277	000877	天山股份	700	10,570.00	0.00
278	603538	美诺华	200	10,196.00	0.00
279	002249	大洋电机	2,500	9,025.00	0.00
280	600884	杉杉股份	725	8,547.75	0.00
281	600461	洪城水业	1,300	8,281.00	0.00
282	000997	新大陆	500	7,990.00	0.00
283	600037	歌华有线	500	7,600.00	0.00
284	300027	华谊兄弟	2,000	7,340.00	0.00
285	601515	东风股份	1,200	7,332.00	0.00
286	000739	普洛药业	300	6,987.00	0.00
287	002517	恺英网络	2,000	6,880.00	0.00
288	600499	科达制造	1,600	6,592.00	0.00
289	002250	联化科技	300	6,540.00	0.00
290	002024	苏宁易购	700	6,139.00	0.00
291	002621	美吉姆	980	6,017.20	0.00
292	000983	西山煤电	1,560	5,850.00	0.00
293	002798	帝欧家居	180	5,844.60	0.00
294	300034	钢研高纳	300	5,628.00	0.00
295	000157	中联重科	800	5,144.00	0.00
296	603916	苏博特	200	5,030.00	0.00
297	000933	神火股份	1,100	4,565.00	0.00
298	601699	潞安环能	800	4,456.00	0.00
299	002234	民和股份	200	4,436.00	0.00
300	002266	浙富控股	1,100	4,257.00	0.00
301	600642	申能股份	700	4,137.00	0.00
302	600410	华胜天成	300	4,080.00	0.00
303	600863	内蒙华电	1,600	3,936.00	0.00
304	002734	利民股份	260	3,892.20	0.00
305	601958	金钼股份	600	3,708.00	0.00
306	600971	恒源煤电	800	3,656.00	0.00
307	002431	棕榈股份	1,200	3,600.00	0.00
308	002444	巨星科技	300	3,564.00	0.00
309	600720	祁连山	200	3,250.00	0.00
310	002398	垒知集团	300	3,171.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002439	启明星辰	2,241,065.26	0.86
2	600745	闻泰科技	2,128,430.72	0.82
3	600026	中远海能	1,925,715.00	0.74
4	300014	亿纬锂能	1,878,204.00	0.72
5	002463	沪电股份	1,829,124.00	0.71
6	600466	蓝光发展	1,784,323.00	0.69
7	603233	大参林	1,768,385.76	0.68
8	600143	金发科技	1,752,095.00	0.68
9	002028	思源电气	1,708,862.40	0.66
10	002414	高德红外	1,702,256.50	0.66
11	601233	桐昆股份	1,678,723.00	0.65
12	603712	七一二	1,668,090.00	0.64
13	300529	健帆生物	1,634,355.00	0.63
14	000547	航天发展	1,625,360.00	0.63
15	002191	劲嘉股份	1,582,265.00	0.61
16	002353	杰瑞股份	1,578,127.00	0.61
17	000581	威孚高科	1,546,779.81	0.60
18	601615	明阳智能	1,503,280.00	0.58
19	603517	绝味食品	1,486,762.00	0.57
20	300498	温氏股份	1,428,483.54	0.55

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300014	亿纬锂能	2,854,436.29	1.10
2	002463	沪电股份	2,635,531.00	1.02
3	300529	健帆生物	2,582,457.00	1.00
4	603517	绝味食品	2,453,950.00	0.95
5	600745	闻泰科技	2,405,030.43	0.93
6	600026	中远海能	2,142,806.00	0.83
7	000547	航天发展	2,092,004.00	0.81
8	000877	天山股份	2,051,485.20	0.79
9	601233	桐昆股份	2,022,801.57	0.78
10	002414	高德红外	1,928,443.23	0.74
11	600143	金发科技	1,804,206.00	0.70

12	002028	思源电气	1,777,593.80	0.69
13	603233	大参林	1,648,798.00	0.64
14	002065	东华软件	1,607,230.00	0.62
15	300166	东方国信	1,605,534.00	0.62
16	601872	招商轮船	1,595,643.00	0.62
17	002440	闰土股份	1,576,912.80	0.61
18	000157	中联重科	1,552,466.00	0.60
19	601058	赛轮轮胎	1,517,233.02	0.59
20	300002	神州泰岳	1,500,211.00	0.58

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	184,380,056.80
卖出股票收入（成交）总额	157,683,663.30

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	30,438,150.00	6.78
2	央行票据	—	—
3	金融债券	151,445,773.70	33.73
	其中：政策性金融债	149,108,283.70	33.21
4	企业债券	73,561,278.10	16.39
5	企业短期融资券	100,190,000.00	22.32
6	中期票据	10,162,000.00	2.26
7	可转债（可交换债）	34,132,576.74	7.60
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	399,929,778.54	89.08

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	190210	19国开10	400,000	40,876,000.00	9.11
2	190208	19国开08	300,000	30,525,000.00	6.80
3	019627	20国债01	290,000	29,014,500.00	6.46
4	132013	17宝武EB	200,000	20,446,000.00	4.55
5	012000398	20豫水利SCP001	200,000	20,058,000.00	4.47

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本报告期本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	94,332.40
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	5,952,863.64
5	应收申购款	28,187.49
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,075,383.53

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	132013	17 宝武 EB	20,446,000.00	4.55
2	132009	17 中油 EB	1,003,100.00	0.22
3	128088	深南转债	943,680.00	0.21
4	113509	新泉转债	475,260.00	0.11
5	128086	国轩转债	439,260.00	0.10
6	128077	华夏转债	427,320.00	0.10
7	113504	艾华转债	410,520.00	0.09
8	128080	顺丰转债	407,700.00	0.09
9	123018	溢利转债	372,840.00	0.08
10	123037	新莱转债	364,680.00	0.08
11	113551	福特转债	343,560.00	0.08
12	127007	湖广转债	328,620.00	0.07
13	113008	电气转债	326,640.00	0.07
14	128074	游族转债	303,900.00	0.07
15	113558	日月转债	302,419.20	0.07
16	128059	视源转债	265,680.00	0.06
17	113518	顾家转债	258,900.00	0.06
18	128084	木森转债	244,860.00	0.05
19	127013	创维转债	237,040.00	0.05
20	113029	明阳转债	228,940.00	0.05
21	132018	G 三峡 EB1	221,920.00	0.05

22	110052	贵广转债	216,180.00	0.05
23	128022	众信转债	211,280.00	0.05
24	128042	凯中转债	210,040.00	0.05
25	128067	一心转债	164,279.70	0.04
26	113521	科森转债	141,780.00	0.03
27	113526	联泰转债	135,580.00	0.03
28	113554	仙鹤转债	121,680.00	0.03
29	110055	伊力转债	121,340.00	0.03
30	123002	国祯转债	115,520.00	0.03
31	113527	维格转债	88,560.00	0.02

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
348	1,122,485.44	387,720,757.16	99.26	2,904,176.90	0.74

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	0
本基金基金经理持有本开放式 基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数(份)	持有份额占 基金总份额 比例(%)	发起份额总数(份)	发起份额占 基金总份额 比例(%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,006,200.62	2.56	10,006,200.62	2.56	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	10,006,200.62	2.56	10,006,200.62	2.56	3年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年09月05日)基金份额总额	150,004,400.62
报告期期初基金份额总额	235,598,395.86
本报告期基金总申购份额	573,540,495.07
减：本报告期基金总赎回份额	418,513,956.87
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期末基金份额总额	390,624,934.06

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长城证券	1	18,130,459.22	5.32	7,884,079.62	2.28	9,000,000.00	0.49	—	—	16,522.75	5.31	
方正证券	2	153,976,781.75	45.14	161,419,289.22	46.64	786,600,000.00	42.52	—	—	140,323.80	45.07	
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
海通证券	1	62,197,908.06	18.23	17,825,771.34	5.15	50,400,000.00	2.72	—	—	56,681.33	18.20	
华泰证券	1	15,699,812.60	4.60	28,776,855.29	8.31	178,100,000.00	9.63	—	—	14,308.28	4.60	
平安证券	2	20,261,931.47	5.94	23,943,814.22	6.92	302,700,000.00	16.36	—	—	18,464.01	5.93	
申万宏源	2	51,618,362.51	15.13	66,623,015.33	19.25	175,600,000.00	9.49	—	—	47,569.76	15.28	
银河证券	2	2,153,155.57	0.63	8,239,895.32	2.38	195,800,000.00	10.58	—	—	1,962.20	0.63	
招商证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
中金公司	1	—	—	10,464.30	0.00	50,000,000.00	2.70	—	—	—	—	
中泰证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
中投证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
中信证券	1	17,058,583.20	5.00	31,373,125.18	9.06	101,900,000.00	5.51	—	—	15,545.69	4.99	

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于提醒投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	规定披露媒介	2020年01月11日
2	富国基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下公募基金基金合同的公告	规定披露媒介	2020年01月20日
3	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	规定披露媒介	2020年02月03日
4	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	规定披露媒介	2020年03月13日
5	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	2020年03月17日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020-01-21至2020-02-19;2020-03-18至2020-03-26	10,103,803.05	69,764,758.50	79,868,561.55	-	-
	2	2020-01-01至2020-01-09;2020-01-21至2020-04-27;2020-05-06至	130,145,401.07	199,998,075.89	225,877,015.54	104,266,461.42	26.69%

		2020-05-13;2020-06-17 至 2020-06-30					
	3	2020-01-01 至 2020-06-30	74,256,939.28	36,260,538.48	-	110,517,477.76	28.29%
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							

§ 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国丰利增强债券型发起式证券投资基金的文件	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址： http://www.fullgoal.com.cn
2、富国丰利增强债券型发起式证券投资基金基金合同		
3、富国丰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、富国丰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		