

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金

二〇二四年中期报告

2024年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2024年08月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	6
2.1	基金基本情况	6
2.2	基金产品说明	6
2.3	基金管理人和基金托管人	7
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	9
§4	管理人报告	14
4.1	基金管理人及基金经理情况	14
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	17
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§5	托管人报告	19
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	19
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	19
§6	中期财务报告（未经审计）	20
6.1	资产负债表	20
6.2	利润表	21
6.3	净资产变动表	22
6.4	报表附注	23
§7	投资组合报告	51
7.1	期末基金资产组合情况	51

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	51
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.....	52
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	71
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	73
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.....	73
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.....	73
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.....	73
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.....	73
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	73
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	74
7.12	市场中性策略执行情况.....	75
7.13	投资组合报告附注.....	75
§8	基金份额持有人信息.....	77
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
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.....	77
§9	开放式基金份额变动.....	79
§10	重大事件揭示.....	80
10.1	基金份额持有人大会决议.....	80
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.....	80
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	80
10.4	基金投资策略的改变.....	80
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	80
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.....	80
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	81
10.8	其他重大事件.....	83
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	84
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.....	84
§12	备查文件目录.....	85

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金		
基金简称	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合		
基金主代码	008835		
基金运作方式	契约型开放式。本基金每个工作日开放申购，但本基金对每份基金份额设置三个月的最短持有期限。即：自基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）至该日三个月后的对应日的期间内，投资者不能提出赎回及转换转出申请；该日三个月后的对应日之后，投资者可以提出赎回及转换转出申请。若该日三个月后实际不存在对应日的，则顺延至下一日。		
基金合同生效日	2020年02月25日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	427,709,023.76份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E
下属分级基金的交易代码	008835	008836	020353
报告期末下属分级基金的份额总额 (单位：份)	101,376,704.49份	99,225,496.94份	227,106,822.33份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，运用股指期货等衍生工具对冲市场系统风险，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金根据对市场的判断，采用“多空对冲”等投资策略，在控制基金资产的股票系统性风险暴露的前提下，实现基金资产的保值增值。本基金采用“自下而上”的数量化选股策略，根据市场状况及变化，不定期对模型进行调整，改进模型有效性，从而取得更高的收益。同时遵循数量化选股策略，优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。本基金还将根据对证券市场走势的判断，适时利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险，并采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉绝对收益机会。债券投资策略方面，本基金基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对固定收益资产的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。本基金的存托凭证投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资

	策略详见法律文件。
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，利用股指期货等金融工具对冲系统性风险，与股票市场的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金的实际收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	许俊
	联系电话	021-20361818	010-66596688
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95566
传真		021-20361616	010-66594942
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街1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1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		裴长江	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年01月01日至2024年06月30日)
本期已实现收益	-700,213.63
本期利润	3,410,237.22
加权平均基金份额本期利润	0.0247
本期加权平均净值利润率	2.23%
本期基金份额净值增长率	2.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)
期末可供分配利润	12,101,470.03
期末可供分配基金份额利润	0.1194
期末基金资产净值	113,478,174.52
期末基金份额净值	1.1194
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	11.94%

(2) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年01月01日至2024年06月30日)
本期已实现收益	-684,514.98
本期利润	3,964,001.86
加权平均基金份额本期利润	0.0222
本期加权平均净值利润率	2.04%
本期基金份额净值增长率	2.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)
期末可供分配利润	9,931,994.92
期末可供分配基金份额利润	0.1001
期末基金资产净值	109,157,491.86
期末基金份额净值	1.1001
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	10.01%

(3) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年01月01日至2024年06月30日)
本期已实现收益	-797,541.17
本期利润	3,083,534.88
加权平均基金份额本期利润	0.0198
本期加权平均净值利润率	1.79%
本期基金份额净值增长率	2.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)
期末可供分配利润	27,101,439.49
期末可供分配基金份额利润	0.1193
期末基金资产净值	254,208,261.82
期末基金份额净值	1.1193
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	2.35%

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) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.21%	0.22%	0.37%	0.01%	0.84%	0.21%
过去三个月	0.60%	0.26%	1.12%	0.01%	-0.52%	0.25%
过去六个月	2.56%	0.33%	2.24%	0.02%	0.32%	0.31%
过去一年	4.09%	0.26%	4.51%	0.01%	-0.42%	0.25%
过去三年	7.34%	0.29%	13.51%	0.01%	-6.17%	0.28%
自基金合同生效起至今	11.94%	0.30%	19.57%	0.01%	-7.63%	0.29%

(2) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

		差②	③	④		
过去一个月	1.18%	0.22%	0.37%	0.01%	0.81%	0.21%
过去三个月	0.50%	0.26%	1.12%	0.01%	-0.62%	0.25%
过去六个月	2.35%	0.33%	2.24%	0.02%	0.11%	0.31%
过去一年	3.68%	0.26%	4.51%	0.01%	-0.83%	0.25%
过去三年	6.05%	0.29%	13.51%	0.01%	-7.46%	0.28%
自基金合同生效起至今	10.01%	0.30%	19.57%	0.01%	-9.56%	0.29%

(3) 富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.20%	0.22%	0.37%	0.01%	0.83%	0.21%
过去三个月	0.59%	0.26%	1.12%	0.01%	-0.53%	0.25%
过去六个月	2.56%	0.33%	2.24%	0.02%	0.32%	0.31%
自基金分级生效日起至今	2.35%	0.33%	2.37%	0.02%	-0.02%	0.31%

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量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 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 2024 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2020 年 2 月 25 日成立，建仓期 6 个月，从 2020 年 2 月 25 日起至 2020 年 8 月 24 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量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 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 2024 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2020 年 2 月 25 日成立，建仓期 6 个月，从 2020 年 2 月 25 日起至 2020 年 8 月 24 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量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 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2024年6月30日。

2、本基金自2023年12月21日起增加E类份额，相关数据按实际存续期计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方旻	本基金现任基金经理	2020-02-25	—	14	硕士，自 2010 年 2 月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、高级定量基金经理、量化投资

					部量化投资副总监、量化投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼资深定量基金经理。自 2014 年 11 月起任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理；自 2018 年 05 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2019 年 01 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自 2020 年 02 月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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 18 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

2024 年开年以来，国内悲观预期加速释放，海外修正抢跑的降息预期，资金和情绪的负反馈导致市场调整加速。尽管月末超预期降准、地产政策优化以及资本市场政策密集出台使得权重股带领市场短暂反弹，但雪球敲入、私募强制平仓等消息面和资金面负反馈仍在持续。2 月，随着国内经济与政策预期得到重新修正，风险偏好改善驱动市场快速反弹。在海外 AI 技术迎来突破等信息刺激下，A 股迎来大幅反弹，月末沪指成功站上 3000 点。3 月，市场重新进入以景气和政策为驱动的修复期，指数围绕关键点位震荡。经过前期大幅上涨后，投资者关注点重回现实，市场在三月下旬做多动能减弱，沪指一度下挫至 3000 点以下，但月末在政策预期催化下回到 3000 点上。4 月末，美国一季度经济呈现“滞涨”态势，降息预期推后下非美货币普遍贬值，而国内基本面较为稳健，人民币汇率抗跌走出独立行情，中国资产在全球的配置性价比和逻辑开始凸显，引发外资回流。业绩期进入尾声后，内资风险偏好抬升，合力推动沪指突破 3100 点。6 月进入验证期，国内经济复苏再度放缓，PMI 回落枯荣线以下、信用扩张疲软、经济“供强需弱”特征延续。接连落空的预期验证放大悲观情绪，沪指连续调整至 3000 点以下。

总体来看，2024 年上半年上证综指下跌 0.25%，沪深 300 上涨 0.89%，创业板指下跌 10.99%，中证 500 指数下跌 8.96%。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极获取超额收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值 A 级为 1.1194 元，C 级为 1.1001 元，E 级为 1.1193 元；份额累计净值 A 级为 1.1194 元，C 级为 1.1001 元，E 级为 1.1193 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为 2.56%，C 级为 2.35%，E 级为 2.56%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 2.24%，C 级为 2.24%，E 级为 2.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 下半年，风险偏好有望迎来修复窗口。从国内来看，为完成两会

政府工作报告中提出的经济增长目标，下半年相关财政政策及货币政策有望进一步发力。从海外看，随着美国通胀数据和就业数据持续走弱，美联储开启降息的概率进一步提升，新兴市场资金有望迎来回流，有助于风险偏好的提升。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 中期财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2024年06月 30日	上年度末 2023年12月31 日
资产：		
货币资金	31,843,267.91	10,601,899.69
结算备付金	34,810,240.29	24,891,307.76
存出保证金	41,395,198.67	26,368,857.44
交易性金融资产	369,680,561.70	241,378,574.68
其中：股票投资	359,591,987.02	232,309,141.26
基金投资	—	—
债券投资	10,088,574.68	9,069,433.42
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	1,230,447.35	151,071.28
应收股利	—	—
应收申购款	47,567.48	459,653.73
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	479,007,283.40	303,851,364.58
负债和净资产	本期末 2024年06月 30日	上年度末 2023年12月31 日
负债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	—	—
应付赎回款	1,035,482.31	179,963.37
应付管理人报酬	316,109.65	203,211.80
应付托管费	79,027.44	50,802.94
应付销售服务费	39,204.47	57,460.70
应付投资顾问费	—	—
应交税费	—	—

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	693,531.33	421,946.46
负债合计	2,163,355.20	913,385.27
净资产：		
实收基金	427,709,023.76	280,018,934.31
其他综合收益	—	—
未分配利润	49,134,904.44	22,919,045.00
净资产合计	476,843,928.20	302,937,979.31
负债和净资产总计	479,007,283.40	303,851,364.58

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1149 元，基金份额总额 427,709,023.76 份。其中：富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A 份额净值 1.1194 元，份额总额 101,376,704.49 份；富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C 份额净值 1.1001 元，份额总额 99,225,496.94 份；富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E 份额净值 1.1193 元，份额总额 227,106,822.33 份。

6.2 利润表

会计主体：富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	13,582,727.51	16,306,166.42
1.利息收入	325,396.92	244,479.62
其中：存款利息收入	325,396.92	244,479.62
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	460,267.39	-4,612,769.06
其中：股票投资收益	14,054,914.49	17,709,047.14
基金投资收益	—	—
债券投资收益	90,500.16	181,856.29
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	-18,668,344.45	-24,292,032.24
股利收益	4,983,197.19	1,788,359.75

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）	12,640,043.74	20,463,194.88
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	157,019.46	211,260.98
减：二、营业总支出	3,124,953.55	2,763,101.91
1. 管理人报酬	2,086,225.67	1,811,024.78
2. 托管费	521,556.47	452,756.25
3. 销售服务费	398,066.12	393,027.08
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	15,165.36	0.12
8. 其他费用	103,939.93	106,293.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	10,457,773.96	13,543,064.51
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	10,457,773.96	13,543,064.51
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	10,457,773.96	13,543,064.51

6.3 净资产变动表

会计主体：富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2024年01月01日至2024年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	280,018,934.31	22,919,045.00	302,937,979.31
二、本期期初净资产	280,018,934.31	22,919,045.00	302,937,979.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	147,690,089.45	26,215,859.44	173,905,948.89
（一）、综合收益总额	—	10,457,773.96	10,457,773.96
（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）	147,690,089.45	15,758,085.48	163,448,174.93
其中：1. 基金申购款	498,300,331.50	50,889,228.37	549,189,559.87
2. 基金赎回款	—	—	—
	350,610,242.05	35,131,142.89	385,741,384.94
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动	—	—	—

(净资产减少以“-”号填列)			
(四)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	427,709,023.76	49,134,904.44	476,843,928.20
项目	上年度可比期间 (2023年01月01日至2023年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	891,479,301.94	29,031,992.46	920,511,294.40
二、本期期初净资产	891,479,301.94	29,031,992.46	920,511,294.40
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	—	—	—
(一)、综合收益总额	697,276,626.58	15,731,788.79	713,008,415.37
(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)	—	—	—
其中：1.基金申购款	697,276,626.58	29,274,853.30	726,551,479.88
2.基金赎回款	49,310,552.83	2,501,640.85	51,812,193.68
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	—	—	—
(四)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	194,202,675.36	13,300,203.67	207,502,879.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金（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[2019]2886号文《关于准予富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2020年2月25日正式生效，首次设立募集规模为2,990,813,376.70份基金份额，其中A类基金份额1,771,147,316.27份，C类

基金份额 1,219,666,060.43 份。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人于 2023 年 12 月 19 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金增加 E 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自 2023 年 12 月 21 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股票（包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、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、衍生工具（股指期货、国债期货）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。

本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值与权益类多头头寸的价值的净风险敞口不超过基金资产净值的 10%。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票及存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票及存托凭证市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。本基金股票及存托凭证资产的投资比例占基金资产的 0-95%，其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%。本基金投资于同业存单和银行存款的比例不超过基金资产的 20%。

每个交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，

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。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

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

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

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

2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4 企业所得税

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

5 个人所得税

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

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

6 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2024年06月30日)
活期存款	31,843,267.91
等于：本金	31,839,600.51
加：应计利息	3,667.40
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	31,843,267.91

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		360,753,371.50	—	359,591,987.02	— 1,161,384.48
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	9,914,409.00	153,464.68	10,088,574.68	20,701.00
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	9,914,409.00	153,464.68	10,088,574.68	20,701.00
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		370,667,780.50	153,464.68	369,680,561.70	— 1,140,683.48

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	— 348,597,420.00	—	—	—
股指期货	— 348,597,420.00	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	— 348,597,420.00	—	—	—

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2409	IC2409	-41.00	— 39,976,640.00	1,471,600.00
IC2407	IC2407	-43.00	— 42,291,360.00	1,455,120.00

IF2409	IF2409	-58.00	59,570,640.00	-777,000.00
IF2407	IF2407	-196.00	202,095,600.00	2,513,460.00
合计				4,663,180.00
减：可抵销期货暂收款				4,663,180.00
净额				—

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	66.94
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	571,567.33
其中：交易所市场	571,567.33
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	61,897.06
合计	693,531.33

6.4.7.7 实收基金

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A：

金额单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	118,191,095.29	118,191,095.29
本期申购	82,220,899.45	82,220,899.45
本期赎回（以“-”号填列）	-99,035,290.25	-99,035,290.25

本期末	101,376,704.49	101,376,704.49
-----	----------------	----------------

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C:

金额单位: 人民币元

项目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	161,826,924.61	161,826,924.61
本期申购	129,810,046.34	129,810,046.34
本期赎回 (以“-”号填列)	-192,411,474.01	-192,411,474.01
本期末	99,225,496.94	99,225,496.94

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E:

金额单位: 人民币元

项目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	914.41	914.41
本期申购	286,269,385.71	286,269,385.71
本期赎回 (以“-”号填列)	-59,163,477.79	-59,163,477.79
本期末	227,106,822.33	227,106,822.33

注: 申购含红利再投、转换入份额, 赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 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	18,292,931.10	- 7,483,587.74	10,809,343.36
本期期初	18,292,931.10	- 7,483,587.74	10,809,343.36
本期利润	-700,213.63	4,110,450.85	3,410,237.22
本期基金份额交易产生的变动数	-2,369,850.40	251,739.85	-2,118,110.55
其中: 基金申购款	12,520,605.70	- 3,824,811.12	8,695,794.58
基金赎回款	- 14,890,456.10	4,076,550.97	-10,813,905.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,222,867.07	- 3,121,397.04	12,101,470.03

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 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	22,256,069.47	- 10,146,451.41	12,109,618.06
本期期初	22,256,069.47	-	12,109,618.06

		10,146,451.41	
本期利润	-684,514.98	4,648,516.84	3,964,001.86
本期基金份额交易产生的变动数	-8,593,928.83	2,452,303.83	-6,141,625.00
其中：基金申购款	17,594,562.82	-6,210,135.43	11,384,427.39
基金赎回款	-	8,662,439.26	-17,526,052.39
	26,188,491.65		
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,977,625.66	-3,045,630.74	9,931,994.92

富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 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	141.48	-57.90	83.58
本期期初	141.48	-57.90	83.58
本期利润	-797,541.17	3,881,076.05	3,083,534.88
本期基金份额交易产生的变动数	34,892,814.65	-	24,017,821.03
		10,874,993.62	
其中：基金申购款	43,850,519.39	-	30,809,006.40
		13,041,512.99	
基金赎回款	-8,957,704.74	2,166,519.37	-6,791,185.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,095,414.96	-6,993,975.47	27,101,439.49

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
活期存款利息收入	78,649.35
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	241,592.60
其他	5,154.97
合计	325,396.92

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出股票成交总额	699,890,239.25
减：卖出股票成本总额	684,280,233.62
减：交易费用	1,555,091.14
买卖股票差价收入	14,054,914.49

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
债券投资收益——利息收入	92,110.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,610.00
合计	90,500.16

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,244,900.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,201,610.00
减：应计利息总额	44,900.00
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	-1,610.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
股指期货投资收益	-18,668,344.45

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
----	-----------------------------

	日)
股票投资产生的股利收益	4,983,197.19
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	4,983,197.19

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
1. 交易性金融资产	4,338,923.74
股票投资	4,327,100.74
债券投资	11,823.00
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	8,301,120.00
权证投资	—
股指期货	8,301,120.00
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	12,640,043.74

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
基金赎回费收入	105,948.27
基金转换费收入	51,071.19
合计	157,019.46

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
审计费用	18,897.06
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	6,442.27
债券账户维护费	18,000.00
其他	600.60

合计	103,939.93
----	------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	90,837,518.04	6.03	35,805,271.82	2.38
申万宏源	51,913,602.50	3.45	16,342,404.72	1.09

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
海通证券	—	—	7,507,937.04	30.95

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	66,846.02	6.03	59,765.03	10.46
申万宏源	38,202.87	3.45	38,202.87	6.68
关联方名称	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	25,826.09	2.38	13,706.50	5.86
申万宏源	11,787.95	1.09	4,697.14	2.01

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

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

研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至 2024年06月30日）	上年度可比期间（2023年01月 01日至2023年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	2,086,225.67	1,811,024.78
其中：支付销售机构的客户维护费	319,896.58	235,468.76
应支付基金管理人的净 管理费	1,766,329.09	1,575,556.02

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01 日至2024年06月30 日）	上年度可比期间（2023年01 月01日至2023年06月30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	521,556.47	452,756.25

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E	合计
富国基金管理有限公司	—	70,308.60	3,734.36	74,042.96
海通证券股份有限公司	—	466.22	—	466.22
申万宏源证券有限公司	—	22.84	—	22.84
中国银行股份有限公司	—	8,819.23	—	8,819.23
合计	—	79,616.89	3,734.36	83,351.25

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E	合计
富国基金管理有限公司	—	79,257.28	—	79,257.28
申万宏源证券有限公司	—	49.35	—	49.35
中国银行股份有限公司	—	7,365.48	—	7,365.48
合计	—	86,672.11	—	86,672.11

注：自2023年12月21日起，本基金增加收取销售服务费的E类基金份额。

本基金基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A类基金份额不收取销售服务费。本基金C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提，E类基金份额销售服务费按前一日E类基金份额的基金资产净值的0.01%年费率计提。计算方法如下：

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

H为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E为该类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，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均未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）			上年度可比期间 (2023年01月01日至2023年06月30日)		
	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E
基金合同生效日（2020年02月25日）持有的基金份额	—	—	—	—	—	—
期初持有的基金份额	—	—	914.41	—	—	—
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	—	—	914.41	—	—	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	—	0.00%	—	—	—

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。

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（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	31,843,267.91	78,649.35	13,541,746.39	43,606.24

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2024年01月01日至2024年06月30日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	301565	中仑新材	IPO网下申购	7,103	84,383.64
海通证券股份有限公司	603344	星德胜	IPO网下申购	1,813	34,773.34

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	688531	日联科技	IPO网下申购	1,845	281,141.10
海通证券股份有限公司	688515	裕太微	IPO网下申购	3,944	364,662.24
海通证券股份有限公司	688469	中芯集成	IPO网下申购	22,286	126,807.34

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024-03-19	6个月	新股限售	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	—
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月	新股限售	16.98	13.48	191	3,243.18	2,574.68	—
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月	新股限售	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	—
001387	雪祺电气	2024-06-03	2个月	新股限售 转增	—	15.25	40	—	610.00	—
001389	广合科技	2024-03-26	6个月	新股限售	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	—
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月	新股限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	—
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月	新股限售	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	—
301538	骏鼎达	2024-05-22	4个月	新股限售 转增	—	91.24	43	—	3,923.32	—
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月	新股限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	—
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月	新股限售	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	—
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	新股限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	—
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月	新股限售	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	—
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月	新股限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	—
301588	美新科技	2024-03-06	6个月	新股限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	—
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月	新股限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	—
603082	北自科技	2024-01-23	6个月	新股限售	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	—
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内 (含)	新股认购	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	—
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	新股限售	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	—
603344	星德胜	2024-03-13	6个月	新股限售	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	—
603375	盛景微	2024-01-17	6个月	新股限售	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	—
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月	新股限售	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	—
688695	中创股份	2024-03-06	6个月	新股限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	—

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	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
113685	升24转债	2024-06-14	1个月内	认购新发	100.0	100.01	260	26,000.00	26,001.94	—

			(含)	证券	0				
--	--	--	-----	----	---	--	--	--	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
AAA	—	—
AAA 以下	26,001.94	—
未评级	—	—
合计	26,001.94	—

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

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末及上年度末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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

单位：人民币元

本期末（2024年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	31,843,267.91	—	—	—	—	—	31,843,267.91
结算备付金	34,810,240.29	—	—	—	—	—	34,810,240.29
存出保证金	123,089.87	—	—	—	—	41,272,108.80	41,395,198.67
交易性金融资产	6,906,182.47	—	3,182,392.21	—	—	359,591,987.02	369,680,561.70
应收清算款	—	—	—	—	—	1,230,447.35	1,230,447.35
应收申购款	—	—	—	—	—	47,567.48	47,567.48
资产总计	73,682,780.54	—	3,182,392.21	—	—	402,142,110.65	479,007,283.40
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	1,035,482.31	1,035,482.31
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	316,109.65	316,109.65
应付托管费	—	—	—	—	—	79,027.44	79,027.44
应付销售服务费	—	—	—	—	—	39,204.47	39,204.47
其他负债	—	—	—	—	—	693,531.33	693,531.33
负债总计	—	—	—	—	—	2,163,355.20	2,163,355.20
利率敏感度缺口	73,682,780.54	—	3,182,392.21	—	—	399,978,755.45	476,843,928.20
上年度末（2023年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	10,601,899.69	—	—	—	—	—	10,601,899.69
结算备付金	24,891,307.76	—	—	—	—	—	24,891,307.76

存出保证金	40,063.04	—	—	—	—	26,328,794.40	26,368,857.44
交易性金融资产	509,714.52	—	8,559,718.90	—	—	232,309,141.26	241,378,574.68
应收清算款	—	—	—	—	—	151,071.28	151,071.28
应收申购款	—	—	—	—	—	459,653.73	459,653.73
资产总计	36,042,985.01	—	8,559,718.90	—	—	259,248,660.67	303,851,364.58
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	179,963.37	179,963.37
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	203,211.80	203,211.80
应付托管费	—	—	—	—	—	50,802.94	50,802.94
应付销售服务费	—	—	—	—	—	57,460.70	57,460.70
其他负债	—	—	—	—	—	421,946.46	421,946.46
负债总计	—	—	—	—	—	913,385.27	913,385.27
利率敏感度缺口	36,042,985.01	—	8,559,718.90	—	—	258,335,275.40	302,937,979.31

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
分析	1. 基准点利率增加 0.1%	-1,534.62	-4,375.72
	2. 基准点利率减少 0.1%	1,534.62	4,375.72

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大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股票（包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、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、衍生工具(股指期货、国债期货)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的相关规定)。

基金的投资组合比例为:本基金权益类空头头寸的价值与权益类多头头寸的价值的净风险敞口不超过基金资产净值的10%。其中:权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票及存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值;权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票及存托凭证市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。本基金股票及存托凭证资产的投资比例占基金资产的0-95%,其中,投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%。本基金投资于同业存单和银行存款的比例不超过基金资产的20%。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

金额单位:人民币元

项目	本期末(2024年06月30日)		上年度末(2023年12月31日)	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	359,591,987.02	75.41	232,309,141.26	76.69
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	10,088,574.68	2.12	9,069,433.42	2.99
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	369,680,561.70	77.53	241,378,574.68	79.68

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场基准增加1%	292,514.11	30,076.97
2. 市场基准减少1%	-292,514.11	-30,076.97	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 (2024年06月30日)	上年度末 (2023年12月31日)
第一层次	359,446,948.68	231,826,218.49
第二层次	10,122,351.95	9,139,625.42
第三层次	111,261.07	412,730.77
合计	369,680,561.70	241,378,574.68

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	359,591,987.02	75.07
	其中：股票	359,591,987.02	75.07
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	10,088,574.68	2.11
	其中：债券	10,088,574.68	2.11
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	66,653,508.20	13.91
8	其他各项资产	42,673,213.50	8.91
9	合计	479,007,283.40	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	3,276,958.00	0.69
B	采矿业	14,863,773.00	3.12
C	制造业	194,607,398.10	40.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,700,911.00	2.87
E	建筑业	7,786,865.00	1.63
F	批发和零售业	4,316,365.84	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	11,250,923.00	2.36
H	住宿和餐饮业	55,198.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,239,766.60	5.29
J	金融业	72,735,052.07	15.25
K	房地产业	5,191,101.00	1.09
L	租赁和商务服务业	2,559,184.40	0.54
M	科学研究和技术服务业	630,059.01	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	436,519.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	339,599.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	2,530,506.00	0.53
S	综合	71,808.00	0.02
	合计	359,591,987.02	75.41

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	8,389	12,309,934.71	2.58
2	601318	中国平安	154,371	6,384,784.56	1.34
3	300750	宁德时代	30,100	5,418,903.00	1.14
4	601328	交通银行	701,600	5,240,952.00	1.10
5	000725	京东方A	1,240,400	5,073,236.00	1.06
6	601169	北京银行	787,400	4,598,416.00	0.96
7	000651	格力电器	115,100	4,514,222.00	0.95
8	002475	立讯精密	104,700	4,115,757.00	0.86
9	600941	中国移动	37,600	4,042,000.00	0.85
10	601989	中国重工	800,600	3,946,958.00	0.83
11	600050	中国联通	837,000	3,933,900.00	0.82
12	601728	中国电信	627,900	3,861,585.00	0.81
13	600999	招商证券	273,900	3,809,949.00	0.80
14	000100	TCL 科技	874,840	3,779,308.80	0.79
15	300122	智飞生物	134,650	3,774,239.50	0.79
16	600030	中信证券	205,700	3,749,911.00	0.79
17	600989	宝丰能源	204,700	3,547,451.00	0.74
18	300433	蓝思科技	193,800	3,536,850.00	0.74
19	600036	招商银行	98,700	3,374,553.00	0.71
20	600015	华夏银行	511,100	3,271,040.00	0.69
21	002252	上海莱士	413,500	3,233,570.00	0.68
22	601939	建设银行	434,400	3,214,560.00	0.67
23	600900	长江电力	111,000	3,210,120.00	0.67
24	601766	中国中车	427,100	3,207,521.00	0.67
25	601229	上海银行	432,100	3,137,046.00	0.66
26	600018	上港集团	540,200	3,122,356.00	0.65
27	000338	潍柴动力	189,885	3,083,732.40	0.65
28	601166	兴业银行	169,000	2,977,780.00	0.62
29	600406	国电南瑞	118,800	2,965,248.00	0.62
30	300059	东方财富	275,986	2,914,412.16	0.61
31	600887	伊利股份	110,983	2,867,800.72	0.60
32	601319	中国人保	536,900	2,765,035.00	0.58

33	600104	上汽集团	199,001	2,758,153.86	0.58
34	601668	中国建筑	517,300	2,746,863.00	0.58
35	002078	太阳纸业	196,500	2,741,175.00	0.57
36	000568	泸州老窖	19,000	2,726,310.00	0.57
37	600183	生益科技	123,100	2,592,486.00	0.54
38	601012	隆基绿能	184,408	2,585,400.16	0.54
39	601231	环旭电子	160,900	2,582,445.00	0.54
40	600663	陆家嘴	289,400	2,552,508.00	0.54
41	600219	南山铝业	655,800	2,498,598.00	0.52
42	603195	公牛集团	31,965	2,465,140.80	0.52
43	600517	国网英大	557,700	2,414,841.00	0.51
44	000157	中联重科	311,600	2,393,088.00	0.50
45	601985	中国核电	223,900	2,386,774.00	0.50
46	002001	新和成	122,900	2,359,680.00	0.49
47	300498	温氏股份	114,400	2,267,408.00	0.48
48	601600	中国铝业	289,200	2,206,596.00	0.46
49	601607	上海医药	115,000	2,197,650.00	0.46
50	600489	中金黄金	144,500	2,138,600.00	0.45
51	603501	韦尔股份	20,500	2,037,085.00	0.43
52	600380	健康元	180,800	2,019,536.00	0.42
53	002371	北方华创	6,100	1,951,329.00	0.41
54	600901	江苏金租	372,140	1,879,307.00	0.39
55	002128	电投能源	88,000	1,856,800.00	0.39
56	600346	恒力石化	128,700	1,795,365.00	0.38
57	002027	分众传媒	292,600	1,773,156.00	0.37
58	601601	中国太保	63,600	1,771,896.00	0.37
59	600919	江苏银行	234,400	1,741,592.00	0.37
60	601658	邮储银行	337,900	1,713,153.00	0.36
61	600547	山东黄金	61,800	1,692,084.00	0.35
62	000333	美的集团	25,778	1,662,681.00	0.35
63	002594	比亚迪	6,600	1,651,650.00	0.35
64	601669	中国电建	285,300	1,594,827.00	0.33
65	002152	广电运通	150,800	1,577,368.00	0.33
66	601818	光大银行	495,100	1,569,467.00	0.33
67	601816	京沪高铁	268,800	1,443,456.00	0.30
68	002736	国信证券	165,100	1,434,719.00	0.30
69	601398	工商银行	249,600	1,422,720.00	0.30
70	600845	宝信软件	44,340	1,415,776.20	0.30
71	002304	洋河股份	17,500	1,412,950.00	0.30
72	600760	中航沈飞	35,100	1,407,510.00	0.30
73	000513	丽珠集团	35,000	1,302,350.00	0.27

74	002241	歌尔股份	63,600	1,240,836.00	0.26
75	000830	鲁西化工	102,700	1,190,293.00	0.25
76	601899	紫金矿业	67,300	1,182,461.00	0.25
77	000858	五粮液	9,030	1,156,201.20	0.24
78	600875	东方电气	62,400	1,151,280.00	0.24
79	300308	中际旭创	8,300	1,144,404.00	0.24
80	002422	科伦药业	37,200	1,128,276.00	0.24
81	300760	迈瑞医疗	3,800	1,105,458.00	0.23
82	000630	铜陵有色	306,043	1,104,815.23	0.23
83	605499	东鹏饮料	5,100	1,100,325.00	0.23
84	688036	传音控股	14,365	1,099,497.10	0.23
85	600741	华域汽车	66,600	1,090,908.00	0.23
86	600925	苏能股份	215,400	1,087,770.00	0.23
87	600886	国投电力	59,500	1,085,280.00	0.23
88	601058	赛轮轮胎	76,500	1,071,000.00	0.22
89	002938	鹏鼎控股	26,000	1,033,760.00	0.22
90	601077	渝农商行	203,000	1,019,060.00	0.21
91	002601	龙佰集团	54,600	1,013,922.00	0.21
92	600926	杭州银行	76,700	1,000,935.00	0.21
93	600497	驰宏锌锗	187,400	1,000,716.00	0.21
94	000596	古井贡酒	4,700	992,029.00	0.21
95	002273	水晶光电	58,200	988,236.00	0.21
96	688009	中国通号	162,389	974,334.00	0.20
97	600998	九州通	195,628	954,664.64	0.20
98	300017	网宿科技	120,600	952,740.00	0.20
99	002415	海康威视	27,700	856,207.00	0.18
100	601838	成都银行	55,400	841,526.00	0.18
101	300394	天孚通信	9,380	829,379.60	0.17
102	002153	石基信息	144,400	827,412.00	0.17
103	601006	大秦铁路	113,500	812,660.00	0.17
104	300383	光环新网	96,100	812,045.00	0.17
105	002237	恒邦股份	69,900	804,549.00	0.17
106	600350	山东高速	90,600	801,810.00	0.17
107	600809	山西汾酒	3,800	801,344.00	0.17
108	600879	航天电子	102,100	793,317.00	0.17
109	600938	中国海油	23,500	775,500.00	0.16
110	000538	云南白药	15,040	769,296.00	0.16
111	600025	华能水电	70,900	764,302.00	0.16
112	002064	华峰化学	106,400	762,888.00	0.16
113	002498	汉缆股份	231,400	761,306.00	0.16
114	000423	东阿阿胶	12,100	757,460.00	0.16

115	600988	赤峰黄金	46,100	753,274.00	0.16
116	601688	华泰证券	60,790	753,188.10	0.16
117	600028	中国石化	116,000	733,120.00	0.15
118	600348	华阳股份	72,900	726,084.00	0.15
119	601857	中国石油	70,000	722,400.00	0.15
120	601019	山东出版	60,800	718,656.00	0.15
121	600660	福耀玻璃	15,000	718,500.00	0.15
122	600019	宝钢股份	108,000	718,200.00	0.15
123	601311	骆驼股份	89,400	716,988.00	0.15
124	600362	江西铜业	30,000	710,400.00	0.15
125	600096	云天化	36,200	703,004.00	0.15
126	002563	森马服饰	119,100	691,971.00	0.15
127	000786	北新建材	23,200	688,112.00	0.14
128	600089	特变电工	48,890	678,104.30	0.14
129	000887	中鼎股份	55,300	676,872.00	0.14
130	603606	东方电缆	13,800	673,578.00	0.14
131	600299	安迪苏	69,400	673,180.00	0.14
132	600039	四川路桥	84,900	669,861.00	0.14
133	600177	雅戈尔	94,000	669,280.00	0.14
134	601800	中国交建	73,000	652,620.00	0.14
135	603198	迎驾贡酒	11,200	644,000.00	0.14
136	000598	兴蓉环境	83,200	625,664.00	0.13
137	002249	大洋电机	131,330	621,190.90	0.13
138	600377	宁沪高速	49,300	621,180.00	0.13
139	002240	盛新锂能	46,200	620,004.00	0.13
140	600398	海澜之家	67,000	619,080.00	0.13
141	000999	华润三九	14,450	615,281.00	0.13
142	600582	天地科技	89,300	615,277.00	0.13
143	001979	招商蛇口	69,800	613,542.00	0.13
144	002714	牧原股份	14,000	610,400.00	0.13
145	600016	民生银行	160,200	607,158.00	0.13
146	301308	江波龙	6,300	596,862.00	0.13
147	601868	中国能建	279,300	592,116.00	0.12
148	300502	新易盛	5,600	591,080.00	0.12
149	600909	华安证券	139,600	587,716.00	0.12
150	300316	晶盛机电	20,200	580,346.00	0.12
151	601156	东航物流	28,300	575,905.00	0.12
152	001965	招商公路	48,500	575,210.00	0.12
153	688223	晶科能源	81,000	575,100.00	0.12
154	603605	珀莱雅	5,100	566,049.00	0.12
155	603160	汇顶科技	8,200	563,750.00	0.12

156	600642	申能股份	63,300	558,939.00	0.12
157	601009	南京银行	53,500	555,865.00	0.12
158	000902	新洋丰	46,500	551,955.00	0.12
159	688278	特宝生物	10,300	551,565.00	0.12
160	688578	艾力斯	8,600	548,164.00	0.11
161	000050	深天马A	75,100	546,728.00	0.11
162	601990	南京证券	70,800	543,744.00	0.11
163	688516	奥特维	12,880	538,512.80	0.11
164	688506	百利天恒	2,967	538,213.80	0.11
165	601000	唐山港	114,200	536,740.00	0.11
166	600795	国电电力	89,600	536,704.00	0.11
167	300979	华利集团	8,700	529,395.00	0.11
168	603871	嘉友国际	29,900	528,931.00	0.11
169	300724	捷佳伟创	9,700	523,897.00	0.11
170	600521	华海药业	30,200	514,910.00	0.11
171	002385	大北农	133,600	514,360.00	0.11
172	300573	兴齐眼药	3,120	511,680.00	0.11
173	600967	内蒙一机	70,700	509,040.00	0.11
174	688408	中信博	5,500	506,440.00	0.11
175	603596	伯特利	13,000	505,700.00	0.11
176	000617	中油资本	90,700	500,664.00	0.10
177	002223	鱼跃医疗	13,300	500,080.00	0.10
178	000027	深圳能源	67,300	491,290.00	0.10
179	601390	中国中铁	74,400	485,088.00	0.10
180	688235	百济神州	4,163	482,241.92	0.10
181	688981	中芯国际	10,400	479,440.00	0.10
182	002463	沪电股份	13,100	478,150.00	0.10
183	603338	浙江鼎力	7,900	477,318.00	0.10
184	600674	川投能源	25,200	472,500.00	0.10
185	600803	新奥股份	22,500	468,000.00	0.10
186	600256	广汇能源	69,600	466,320.00	0.10
187	000728	国元证券	75,800	459,348.00	0.10
188	601717	郑煤机	30,200	446,960.00	0.09
189	601127	赛力斯	4,900	446,488.00	0.09
190	002532	天山铝业	55,000	446,050.00	0.09
191	000550	江铃汽车	20,400	442,884.00	0.09
192	601877	正泰电器	23,100	440,286.00	0.09
193	002831	裕同科技	17,200	440,148.00	0.09
194	601088	中国神华	9,900	439,263.00	0.09
195	300492	华图山鼎	4,600	433,320.00	0.09
196	603228	景旺电子	13,600	432,480.00	0.09

197	603019	中科曙光	10,270	426,205.00	0.09
198	603583	捷昌驱动	20,600	419,828.00	0.09
199	000563	陕国投A	148,300	407,825.00	0.09
200	002065	东华软件	89,100	402,732.00	0.08
201	600905	三峡能源	92,200	401,992.00	0.08
202	002925	盈趣科技	31,700	401,639.00	0.08
203	603096	新经典	23,700	400,530.00	0.08
204	002847	盐津铺子	9,320	398,616.40	0.08
205	300182	捷成股份	106,500	395,115.00	0.08
206	603688	石英股份	13,200	390,852.00	0.08
207	000559	万向钱潮	85,400	380,884.00	0.08
208	600000	浦发银行	45,400	373,642.00	0.08
209	000998	隆平高科	37,900	372,557.00	0.08
210	600007	中国国贸	16,700	366,732.00	0.08
211	600755	厦门国贸	50,900	364,953.00	0.08
212	300088	长信科技	76,500	359,550.00	0.08
213	000002	万科A	51,300	355,509.00	0.07
214	603258	电魂网络	21,500	347,225.00	0.07
215	600873	梅花生物	33,600	336,672.00	0.07
216	300364	中文在线	15,500	334,490.00	0.07
217	688147	微导纳米	13,200	328,680.00	0.07
218	002138	顺络电子	11,700	321,282.00	0.07
219	600848	上海临港	34,600	315,206.00	0.07
220	600332	白云山	10,700	313,831.00	0.07
221	600522	中天科技	19,800	313,830.00	0.07
222	300142	沃森生物	27,400	311,812.00	0.07
223	688567	孚能科技	32,411	311,145.60	0.07
224	600481	双良节能	66,200	309,154.00	0.06
225	600271	航天信息	42,000	309,120.00	0.06
226	600690	海尔智家	10,868	308,433.84	0.06
227	600959	江苏有线	114,600	302,544.00	0.06
228	601117	中国化学	36,600	301,584.00	0.06
229	600548	深高速	28,100	298,703.00	0.06
230	000683	远兴能源	43,000	297,130.00	0.06
231	600699	均胜电子	20,000	296,400.00	0.06
232	002466	天齐锂业	9,800	293,118.00	0.06
233	601916	浙商银行	105,400	290,904.00	0.06
234	300432	富临精工	45,100	290,444.00	0.06
235	601288	农业银行	66,500	289,940.00	0.06
236	601369	陕鼓动力	36,100	289,522.00	0.06
237	600048	保利发展	32,900	288,204.00	0.06

238	603369	今世缘	6,200	286,440.00	0.06
239	002648	卫星化学	15,800	284,084.00	0.06
240	000800	一汽解放	36,200	283,446.00	0.06
241	601778	晶科科技	124,200	283,176.00	0.06
242	601608	中信重工	74,200	282,702.00	0.06
243	600482	中国动力	14,300	278,564.00	0.06
244	300674	宇信科技	25,100	278,108.00	0.06
245	601186	中国铁建	32,400	277,668.00	0.06
246	300124	汇川技术	5,400	277,020.00	0.06
247	300212	易华录	16,400	276,012.00	0.06
248	300857	协创数据	4,800	273,600.00	0.06
249	600161	天坛生物	11,164	272,401.60	0.06
250	003816	中国广核	58,500	270,855.00	0.06
251	600893	航发动力	7,400	270,470.00	0.06
252	601628	中国人寿	8,500	263,925.00	0.06
253	600580	卧龙电驱	21,600	262,440.00	0.06
254	002048	宁波华翔	20,000	258,800.00	0.05
255	600029	南方航空	43,900	258,571.00	0.05
256	002555	三七互娱	19,800	258,390.00	0.05
257	300896	爱美客	1,500	258,150.00	0.05
258	300296	利亚德	56,613	254,758.50	0.05
259	688348	昱能科技	4,300	253,700.00	0.05
260	001286	陕西能源	22,000	253,660.00	0.05
261	300601	康泰生物	16,200	252,882.00	0.05
262	002697	红旗连锁	54,500	252,335.00	0.05
263	601158	重庆水务	52,500	252,000.00	0.05
264	002550	千红制药	46,700	251,713.00	0.05
265	002487	大金重工	11,000	251,680.00	0.05
266	601216	君正集团	66,800	246,492.00	0.05
267	002493	荣盛石化	25,500	246,330.00	0.05
268	300207	欣旺达	16,000	242,720.00	0.05
269	301011	华立科技	15,600	240,396.00	0.05
270	300170	汉得信息	38,700	237,618.00	0.05
271	300999	金龙鱼	8,600	235,210.00	0.05
272	300166	东方国信	38,000	232,560.00	0.05
273	600820	隧道股份	35,300	230,509.00	0.05
274	000975	山金国际	14,100	229,689.00	0.05
275	601577	长沙银行	27,600	225,768.00	0.05
276	600863	内蒙华电	48,400	224,576.00	0.05
277	600562	国睿科技	16,400	224,024.00	0.05
278	600737	中粮糖业	23,300	223,447.00	0.05

279	000750	国海证券	76,600	222,906.00	0.05
280	600062	华润双鹤	11,300	221,254.00	0.05
281	000661	长春高新	2,400	220,248.00	0.05
282	000810	创维数字	25,600	219,648.00	0.05
283	300378	鼎捷软件	13,500	219,645.00	0.05
284	300408	三环集团	7,500	218,925.00	0.05
285	000543	皖能电力	24,500	216,825.00	0.05
286	002958	青农商行	80,900	216,812.00	0.05
287	002500	山西证券	45,100	211,970.00	0.04
288	600572	康恩贝	47,300	211,431.00	0.04
289	002807	江阴银行	55,800	210,366.00	0.04
290	600309	万华化学	2,600	210,236.00	0.04
291	601898	中煤能源	16,800	209,664.00	0.04
292	000738	航发控制	10,200	204,714.00	0.04
293	002948	青岛银行	60,700	204,559.00	0.04
294	000039	中集集团	22,000	203,720.00	0.04
295	688111	金山办公	895	203,612.50	0.04
296	601155	新城控股	22,900	203,123.00	0.04
297	601187	厦门银行	38,100	203,073.00	0.04
298	600312	平高电气	10,400	202,280.00	0.04
299	688390	固德威	3,600	202,032.00	0.04
300	300136	信维通信	10,300	201,674.00	0.04
301	688819	天能股份	8,400	200,424.00	0.04
302	002446	盛路通信	35,300	199,445.00	0.04
303	688256	寒武纪	1,000	198,670.00	0.04
304	600060	海信视像	8,000	197,920.00	0.04
305	600185	格力地产	46,400	197,200.00	0.04
306	601865	福莱特	9,800	196,980.00	0.04
307	002020	京新药业	18,800	196,836.00	0.04
308	601958	金钼股份	18,900	196,749.00	0.04
309	600600	青岛啤酒	2,700	196,479.00	0.04
310	601100	恒立液压	4,200	195,636.00	0.04
311	688063	派能科技	4,900	194,579.00	0.04
312	600739	辽宁成大	23,100	193,347.00	0.04
313	601098	中南传媒	15,400	191,268.00	0.04
314	002291	遥望科技	44,400	190,920.00	0.04
315	002966	苏州银行	25,000	187,500.00	0.04
316	688276	百克生物	6,500	184,405.00	0.04
317	600008	首创环保	68,800	184,384.00	0.04
318	301239	普瑞眼科	5,200	183,716.00	0.04
319	600717	天津港	43,000	183,610.00	0.04

320	002839	张家港行	45,600	183,312.00	0.04
321	601997	贵阳银行	34,700	182,869.00	0.04
322	601611	中国核建	22,500	182,025.00	0.04
323	600908	无锡银行	34,100	181,412.00	0.04
324	601555	东吴证券	30,400	179,360.00	0.04
325	000541	佛山照明	36,800	179,216.00	0.04
326	001213	中铁特货	45,200	178,540.00	0.04
327	601963	重庆银行	23,000	178,250.00	0.04
328	000088	盐田港	39,100	177,123.00	0.04
329	000776	广发证券	14,500	176,465.00	0.04
330	002332	仙琚制药	15,300	174,573.00	0.04
331	000792	盐湖股份	10,000	174,500.00	0.04
332	603185	弘元绿能	10,100	172,609.00	0.04
333	000883	湖北能源	28,700	172,487.00	0.04
334	300624	万兴科技	3,200	169,824.00	0.04
335	002311	海大集团	3,600	169,380.00	0.04
336	601200	上海环境	19,900	169,150.00	0.04
337	002034	旺能环境	13,000	169,130.00	0.04
338	601298	青岛港	17,500	167,300.00	0.04
339	601108	财通证券	25,300	167,233.00	0.04
340	002276	万马股份	23,100	165,627.00	0.03
341	601568	北元集团	44,600	165,466.00	0.03
342	002706	良信股份	24,100	165,326.00	0.03
343	300001	特锐德	8,200	164,984.00	0.03
344	603883	老百姓	8,970	164,689.20	0.03
345	002019	亿帆医药	13,200	163,152.00	0.03
346	603806	福斯特	11,060	162,582.00	0.03
347	600276	恒瑞医药	4,200	161,532.00	0.03
348	002139	拓邦股份	15,000	159,300.00	0.03
349	600704	物产中大	36,600	158,844.00	0.03
350	603197	保隆科技	5,000	157,500.00	0.03
351	002865	钧达股份	4,100	157,358.00	0.03
352	000066	中国长城	17,800	155,750.00	0.03
353	603290	斯达半导	1,800	154,998.00	0.03
354	688598	金博股份	5,400	152,820.00	0.03
355	600956	新天绿能	18,600	151,962.00	0.03
356	002945	华林证券	15,200	151,696.00	0.03
357	000582	北部湾港	20,200	150,288.00	0.03
358	600233	圆通速递	9,600	150,240.00	0.03
359	603589	口子窖	3,800	148,922.00	0.03
360	600556	天下秀	40,800	148,512.00	0.03

361	002777	久远银海	9,900	148,401.00	0.03
362	600588	用友网络	14,800	148,000.00	0.03
363	002544	普天科技	7,900	147,651.00	0.03
364	300438	鹏辉能源	8,000	146,720.00	0.03
365	002460	赣锋锂业	5,100	146,115.00	0.03
366	000921	海信家电	4,500	145,080.00	0.03
367	601808	中海油服	8,400	144,480.00	0.03
368	000625	长安汽车	10,500	141,015.00	0.03
369	002984	森麒麟	5,800	139,722.00	0.03
370	600529	山东药玻	5,500	139,370.00	0.03
371	002334	英威腾	23,300	139,334.00	0.03
372	603927	中科软	7,600	137,484.00	0.03
373	600458	时代新材	13,600	137,360.00	0.03
374	600061	国投资本	24,300	137,295.00	0.03
375	600874	创业环保	24,300	135,837.00	0.03
376	601336	新华保险	4,500	135,135.00	0.03
377	002465	海格通信	13,000	134,680.00	0.03
378	600143	金发科技	20,300	134,183.00	0.03
379	002646	天佑德酒	13,100	134,013.00	0.03
380	601198	东兴证券	16,700	132,932.00	0.03
381	002261	拓维信息	11,800	130,626.00	0.03
382	000933	神火股份	6,400	129,472.00	0.03
383	688023	安恒信息	3,200	128,032.00	0.03
384	600033	福建高速	38,100	127,635.00	0.03
385	603444	吉比特	700	124,607.00	0.03
386	300773	拉卡拉	9,800	121,814.00	0.03
387	688510	航亚科技	6,600	121,506.00	0.03
388	002183	怡亚通	42,400	120,416.00	0.03
389	601233	桐昆股份	7,500	119,700.00	0.03
390	300451	创业慧康	34,400	119,024.00	0.02
391	688556	高测股份	10,000	118,900.00	0.02
392	600688	上海石化	45,500	118,755.00	0.02
393	000060	中金岭南	27,800	117,872.00	0.02
394	601928	凤凰传媒	10,700	117,272.00	0.02
395	603569	长久物流	17,000	116,620.00	0.02
396	002531	天顺风能	12,900	115,326.00	0.02
397	002032	苏泊尔	2,300	115,230.00	0.02
398	600787	中储股份	23,900	114,959.00	0.02
399	600764	中国海防	5,800	113,854.00	0.02
400	300073	当升科技	3,300	113,223.00	0.02
401	002008	大族激光	5,400	112,320.00	0.02

402	002745	木林森	13,900	112,034.00	0.02
403	000960	锡业股份	7,200	111,528.00	0.02
404	601801	皖新传媒	16,000	110,880.00	0.02
405	600438	通威股份	5,800	110,838.00	0.02
406	002004	华邦健康	29,000	110,200.00	0.02
407	603305	旭升集团	10,300	108,768.00	0.02
408	300850	新强联	7,200	108,144.00	0.02
409	002926	华西证券	16,400	108,076.00	0.02
410	000156	华数传媒	17,200	108,016.00	0.02
411	600511	国药股份	3,500	107,765.00	0.02
412	600703	三安光电	9,100	106,652.00	0.02
413	002533	金杯电工	10,600	105,470.00	0.02
414	601066	中信建投	5,400	103,896.00	0.02
415	600436	片仔癀	500	103,585.00	0.02
416	600958	东方证券	13,500	102,600.00	0.02
417	601881	中国银河	9,300	100,998.00	0.02
418	688048	长光华芯	3,200	99,968.00	0.02
419	600839	四川长虹	22,200	99,678.00	0.02
420	603337	杰克股份	3,700	97,384.00	0.02
421	002609	捷顺科技	12,800	97,024.00	0.02
422	300687	赛意信息	6,900	96,048.00	0.02
423	000801	四川九洲	9,600	96,000.00	0.02
424	603267	鸿远电子	2,800	95,480.00	0.02
425	601225	陕西煤业	3,700	95,349.00	0.02
426	002841	视源股份	3,200	94,496.00	0.02
427	688711	宏微科技	5,867	94,224.02	0.02
428	603000	人民网	4,700	93,953.00	0.02
429	600498	烽火通信	5,900	93,810.00	0.02
430	688779	五矿新能	20,200	93,526.00	0.02
431	600416	湘电股份	9,400	93,436.00	0.02
432	603993	洛阳钼业	10,900	92,650.00	0.02
433	601827	三峰环境	10,900	92,541.00	0.02
434	603728	鸣志电器	2,300	92,529.00	0.02
435	600566	济川药业	2,900	91,959.00	0.02
436	002600	领益智造	12,900	91,848.00	0.02
437	000058	深赛格	17,100	91,827.00	0.02
438	002203	海亮股份	11,400	90,972.00	0.02
439	600155	华创云信	15,000	88,650.00	0.02
440	600885	宏发股份	3,200	88,576.00	0.02
441	600373	中文传媒	5,900	87,556.00	0.02
442	600282	南钢股份	17,300	86,154.00	0.02

443	600031	三一重工	5,200	85,800.00	0.02
444	300085	银之杰	10,500	84,840.00	0.02
445	603568	伟明环保	4,100	84,378.00	0.02
446	688472	阿特斯	8,200	83,476.00	0.02
447	600236	桂冠电力	10,800	82,836.00	0.02
448	000877	天山股份	15,300	82,620.00	0.02
449	300463	迈克生物	7,200	81,936.00	0.02
450	600810	神马股份	13,200	81,840.00	0.02
451	600188	兖矿能源	3,600	81,828.00	0.02
452	601330	绿色动力	14,000	81,480.00	0.02
453	603678	火炬电子	3,300	81,477.00	0.02
454	000895	双汇发展	3,400	80,818.00	0.02
455	300379	东方通	10,000	80,800.00	0.02
456	000682	东方电子	7,300	80,592.00	0.02
457	688007	光峰科技	5,000	80,500.00	0.02
458	300003	乐普医疗	5,400	80,136.00	0.02
459	601238	广汽集团	10,300	79,722.00	0.02
460	600027	华电国际	11,400	79,116.00	0.02
461	601900	南方传媒	6,300	78,309.00	0.02
462	300628	亿联网络	2,100	77,217.00	0.02
463	688167	炬光科技	1,400	77,000.00	0.02
464	000987	越秀资本	15,500	76,880.00	0.02
465	300390	天华新能	4,400	75,592.00	0.02
466	601512	中新集团	9,900	75,438.00	0.02
467	300363	博腾股份	6,300	75,285.00	0.02
468	600535	天士力	5,900	74,222.00	0.02
469	002267	陕天然气	9,800	74,088.00	0.02
470	001270	铖昌科技	2,000	73,440.00	0.02
471	601869	长飞光纤	3,000	72,990.00	0.02
472	600480	凌云股份	7,400	72,742.00	0.02
473	603309	维力医疗	6,600	72,666.00	0.02
474	300033	同花顺	700	72,590.00	0.02
475	000516	国际医学	15,500	72,540.00	0.02
476	002738	中矿资源	2,700	72,360.00	0.02
477	688105	诺唯赞	3,601	72,056.01	0.02
478	600673	东阳光	10,200	71,808.00	0.02
479	002053	云南能投	5,900	71,331.00	0.01
480	603858	步长制药	4,700	71,205.00	0.01
481	000031	大悦城	30,400	71,136.00	0.01
482	300782	卓胜微	900	69,966.00	0.01
483	300274	阳光电源	1,120	69,473.60	0.01

484	002558	巨人网络	7,300	68,912.00	0.01
485	688095	福昕软件	1,500	68,715.00	0.01
486	600125	铁龙物流	11,500	68,655.00	0.01
487	688333	铂力特	1,400	67,830.00	0.01
488	000878	云南铜业	5,400	67,284.00	0.01
489	600549	厦门钨业	3,900	67,275.00	0.01
490	688313	仕佳光子	7,000	66,640.00	0.01
491	603071	物产环能	5,300	66,409.00	0.01
492	600487	亨通光电	4,200	66,234.00	0.01
493	000009	中国宝安	7,700	66,220.00	0.01
494	002056	横店东磁	5,300	66,091.00	0.01
495	605166	聚合顺	6,300	66,087.00	0.01
496	000837	秦川机床	8,900	65,504.00	0.01
497	603323	苏农银行	13,600	65,416.00	0.01
498	000768	中航西飞	2,700	64,881.00	0.01
499	688315	诺禾致源	5,900	64,428.00	0.01
500	688563	航材股份	1,200	63,456.00	0.01
501	600584	长电科技	2,000	63,420.00	0.01
502	600316	洪都航空	3,800	63,194.00	0.01
503	603666	亿嘉和	4,000	63,120.00	0.01
504	688551	科威尔	2,000	63,000.00	0.01
505	688107	安路科技	2,450	62,279.00	0.01
506	603212	赛伍技术	5,500	60,720.00	0.01
507	300765	新诺威	2,400	60,552.00	0.01
508	301018	申菱环境	3,100	60,264.00	0.01
509	600064	南京高科	9,900	60,093.00	0.01
510	600123	兰花科创	6,700	59,965.00	0.01
511	002185	华天科技	7,300	59,495.00	0.01
512	601139	深圳燃气	8,900	59,452.00	0.01
513	300769	德方纳米	2,100	59,220.00	0.01
514	603456	九洲药业	4,300	58,996.00	0.01
515	301316	慧博云通	4,000	58,720.00	0.01
516	600328	中盐化工	8,400	57,624.00	0.01
517	000519	中兵红箭	3,900	57,213.00	0.01
518	002179	中航光电	1,500	57,075.00	0.01
519	301391	卡莱特	1,300	56,914.00	0.01
520	601567	三星医疗	1,600	56,000.00	0.01
521	301260	格力博	4,100	55,842.00	0.01
522	002993	奥海科技	1,500	55,800.00	0.01
523	688303	大全能源	2,703	55,114.17	0.01
524	600329	达仁堂	1,700	55,063.00	0.01

525	002163	海南发展	9,800	53,704.00	0.01
526	000958	电投产融	14,600	53,436.00	0.01
527	601111	中国国航	7,200	53,136.00	0.01
528	600637	东方明珠	8,700	52,896.00	0.01
529	688177	百奥泰	2,500	52,800.00	0.01
530	002317	众生药业	4,600	52,578.00	0.01
531	688369	致远互联	3,300	51,909.00	0.01
532	002230	科大讯飞	1,200	51,540.00	0.01
533	600266	城建发展	13,700	51,238.00	0.01
534	601615	明阳智能	5,400	50,976.00	0.01
535	600927	永安期货	4,500	50,175.00	0.01
536	688091	上海谊众	2,200	49,698.00	0.01
537	000567	海德股份	8,845	49,620.45	0.01
538	301102	兆讯传媒	4,200	49,518.00	0.01
539	603169	兰石重装	11,000	49,500.00	0.01
540	002353	杰瑞股份	1,400	49,112.00	0.01
541	000922	佳电股份	4,100	48,913.00	0.01
542	600732	爱旭股份	5,400	48,870.00	0.01
543	600369	西南证券	13,500	48,330.00	0.01
544	301029	怡合达	2,400	47,184.00	0.01
545	002268	电科网安	3,300	46,959.00	0.01
546	600258	首旅酒店	3,800	46,930.00	0.01
547	605016	百龙创园	2,230	45,425.10	0.01
548	300450	先导智能	2,700	44,901.00	0.01
549	002283	天润工业	10,400	44,616.00	0.01
550	601212	白银有色	15,800	43,924.00	0.01
551	603225	新凤鸣	2,800	43,652.00	0.01
552	000708	中信特钢	3,200	43,424.00	0.01
553	002340	格林美	6,800	43,316.00	0.01
554	002271	东方雨虹	3,500	43,190.00	0.01
555	688680	海优新材	1,498	43,052.52	0.01
556	000016	深康佳A	20,200	43,026.00	0.01
557	601689	拓普集团	800	42,888.00	0.01
558	002739	万达电影	3,500	42,315.00	0.01
559	002595	豪迈科技	1,100	41,987.00	0.01
560	603520	司太立	4,400	41,976.00	0.01
561	601995	中金公司	1,400	41,454.00	0.01
562	603939	益丰药房	1,680	41,244.00	0.01
563	688249	晶合集成	2,800	41,076.00	0.01
564	300595	欧普康视	2,600	40,768.00	0.01
565	002408	齐翔腾达	7,200	40,320.00	0.01

566	300568	星源材质	4,900	40,180.00	0.01
567	600933	爱柯迪	2,700	39,933.00	0.01
568	601998	中信银行	5,900	39,530.00	0.01
569	002756	永兴材料	1,100	39,358.00	0.01
570	600826	兰生股份	7,280	39,166.40	0.01
571	002765	蓝黛科技	8,300	39,010.00	0.01
572	001328	登康口腔	1,500	37,950.00	0.01
573	603108	润达医疗	2,500	37,850.00	0.01
574	000012	南玻A	7,500	37,800.00	0.01
575	002003	伟星股份	3,000	37,650.00	0.01
576	600779	水井坊	1,000	37,630.00	0.01
577	603508	思维列控	2,000	37,500.00	0.01
578	301267	华夏眼科	1,800	37,296.00	0.01
579	605168	三人行	1,400	36,862.00	0.01
580	603303	得邦照明	3,200	36,736.00	0.01
581	600812	华北制药	8,900	36,668.00	0.01
582	600150	中国船舶	900	36,639.00	0.01
583	002212	天融信	7,500	36,525.00	0.01
584	688297	中无人机	1,100	36,333.00	0.01
585	600361	创新新材	9,000	36,270.00	0.01
586	002035	华帝股份	5,800	36,134.00	0.01
587	601168	西部矿业	2,000	35,900.00	0.01
588	002352	顺丰控股	1,000	35,690.00	0.01
589	601919	中远海控	2,300	35,627.00	0.01
590	600557	康缘药业	2,200	34,540.00	0.01
591	002244	滨江集团	4,700	34,122.00	0.01
592	600120	浙江东方	10,200	34,068.00	0.01
593	002643	万润股份	3,400	34,000.00	0.01
594	603809	豪能股份	4,200	33,936.00	0.01
595	688599	天合光能	2,000	33,840.00	0.01
596	601598	中国外运	6,000	33,780.00	0.01
597	601666	平煤股份	3,000	33,600.00	0.01
598	688136	科兴制药	2,000	33,520.00	0.01
599	600352	浙江龙盛	3,900	33,501.00	0.01
600	600395	盘江股份	5,500	33,055.00	0.01
601	002108	沧州明珠	10,800	33,048.00	0.01
602	002192	融捷股份	1,100	33,022.00	0.01
603	002625	光启技术	1,900	32,965.00	0.01
604	300803	指南针	900	32,769.00	0.01
605	603214	爱婴室	2,900	32,741.00	0.01
606	300258	精锻科技	4,000	32,520.00	0.01

607	600761	安徽合力	1,500	32,460.00	0.01
608	688025	杰普特	800	32,312.00	0.01
609	002939	长城证券	4,800	32,160.00	0.01
610	300285	国瓷材料	1,800	32,130.00	0.01
611	600707	彩虹股份	4,700	32,007.00	0.01
612	600415	小商品城	4,300	31,906.00	0.01
613	000703	恒逸石化	4,500	31,905.00	0.01
614	601908	京运通	12,600	31,878.00	0.01
615	002961	瑞达期货	2,900	31,755.00	0.01
616	605186	健麾信息	1,400	31,444.00	0.01
617	300562	乐心医疗	3,500	31,185.00	0.01
618	603093	南华期货	3,600	31,176.00	0.01
619	002380	科远智慧	1,700	31,110.00	0.01
620	688533	上声电子	1,200	31,044.00	0.01
621	600585	海螺水泥	1,300	30,667.00	0.01
622	002410	广联达	3,200	30,656.00	0.01
623	600085	同仁堂	800	30,568.00	0.01
624	600390	五矿资本	7,400	29,970.00	0.01
625	688220	翱捷科技	800	29,968.00	0.01
626	601377	兴业证券	5,800	29,348.00	0.01
627	603408	建霖家居	2,200	29,018.00	0.01
628	000408	藏格矿业	1,200	28,884.00	0.01
629	002044	美年健康	7,600	28,728.00	0.01
630	301327	华宝新能	500	28,650.00	0.01
631	002837	英维克	1,300	27,807.00	0.01
632	605007	五洲特纸	2,200	27,786.00	0.01
633	003031	中瓷电子	600	27,744.00	0.01
634	002653	海思科	900	27,630.00	0.01
635	300369	绿盟科技	5,400	27,594.00	0.01
636	600827	百联股份	3,700	27,306.00	0.01
637	300226	上海钢联	1,600	27,104.00	0.01
638	601211	国泰君安	2,000	27,100.00	0.01
639	600499	科达制造	3,200	26,976.00	0.01
640	600095	湘财股份	4,500	26,820.00	0.01
641	688733	壹石通	1,766	26,401.70	0.01
642	688033	天宜上佳	4,400	26,400.00	0.01
643	603579	荣泰健康	1,700	26,282.00	0.01
644	603123	翠微股份	4,400	26,136.00	0.01
645	688270	臻镭科技	1,000	26,100.00	0.01
646	600918	中泰证券	4,500	25,515.00	0.01
647	688707	振华新材	2,610	25,421.40	0.01

648	603127	昭衍新药	1,900	25,213.00	0.01
649	688232	新点软件	1,255	24,748.60	0.01
650	603529	爱玛科技	900	24,597.00	0.01
651	000927	中国铁物	10,200	24,276.00	0.01
652	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
653	688114	华大智造	500	23,705.00	0.00
654	603919	金徽酒	1,300	23,621.00	0.00
655	601665	齐鲁银行	4,800	23,568.00	0.00
656	603916	苏博特	3,500	23,485.00	0.00
657	600801	华新水泥	1,700	23,375.00	0.00
658	002429	兆驰股份	4,800	23,088.00	0.00
659	002195	岩山科技	9,100	22,841.00	0.00
660	601633	长城汽车	900	22,770.00	0.00
661	603466	风语筑	2,600	22,204.00	0.00
662	300682	朗新集团	2,600	22,126.00	0.00
663	300133	华策影视	3,600	22,104.00	0.00
664	301268	铭利达	1,400	21,770.00	0.00
665	002970	锐明技术	600	21,618.00	0.00
666	600728	佳都科技	5,800	21,518.00	0.00
667	688521	芯原股份	800	21,400.00	0.00
668	002539	云图控股	3,000	21,390.00	0.00
669	601163	三角轮胎	1,400	21,308.00	0.00
670	002518	科士达	1,200	21,240.00	0.00
671	300772	运达股份	2,200	21,120.00	0.00
672	300371	汇中股份	2,500	20,925.00	0.00
673	000553	安道麦 A	4,600	20,884.00	0.00
674	688202	美迪西	800	20,840.00	0.00
675	000429	粤高速 A	2,000	20,820.00	0.00
676	000062	深圳华强	2,300	20,470.00	0.00
677	000811	冰轮环境	2,100	20,265.00	0.00
678	002472	双环传动	900	19,818.00	0.00
679	600399	抚顺特钢	3,500	19,705.00	0.00
680	001311	多利科技	800	19,344.00	0.00
681	001872	招商港口	1,000	19,250.00	0.00
682	600971	恒源煤电	1,600	19,104.00	0.00
683	601860	紫金银行	7,600	19,000.00	0.00
684	300708	聚灿光电	2,100	18,900.00	0.00
685	603489	八方股份	700	18,886.00	0.00
686	603699	纽威股份	1,100	18,832.00	0.00
687	688385	复旦微电	600	18,828.00	0.00
688	002913	奥士康	700	18,767.00	0.00

689	300872	天阳科技	1,400	18,550.00	0.00
690	601228	广州港	6,000	18,300.00	0.00
691	688352	顾中科技	1,600	18,256.00	0.00
692	600066	宇通客车	700	18,060.00	0.00
693	601015	陕西黑猫	6,400	17,920.00	0.00
694	688772	珠海冠宇	1,200	17,880.00	0.00
695	603920	世运电路	900	17,766.00	0.00
696	300143	盈康生命	2,300	17,319.00	0.00
697	603859	能科科技	800	16,816.00	0.00
698	603348	文灿股份	600	16,614.00	0.00
699	300655	晶瑞电材	2,300	16,560.00	0.00
700	600446	金证股份	1,600	15,888.00	0.00
701	688233	神工股份	816	15,724.32	0.00
702	002041	登海种业	1,900	15,352.00	0.00
703	002123	梦网科技	2,100	14,763.00	0.00
704	688387	信科移动	2,900	14,616.00	0.00
705	688133	泰坦科技	900	14,202.00	0.00
706	301236	软通动力	400	14,084.00	0.00
707	000503	国新健康	2,100	14,007.00	0.00
708	603368	柳药集团	800	14,000.00	0.00
709	600483	福能股份	1,200	13,992.00	0.00
710	000400	许继电气	400	13,764.00	0.00
711	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
712	300054	鼎龙股份	600	13,608.00	0.00
713	300080	易成新能	4,700	13,536.00	0.00
714	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
715	000860	顺鑫农业	800	13,392.00	0.00
716	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
717	000937	冀中能源	1,900	12,730.00	0.00
718	688170	德龙激光	569	12,529.38	0.00
719	002206	海利得	3,200	12,224.00	0.00
720	002859	洁美科技	600	12,048.00	0.00
721	603886	元祖股份	800	12,048.00	0.00
722	300014	亿纬锂能	300	11,976.00	0.00
723	300349	金卡智能	1,000	11,920.00	0.00
724	688362	甬矽电子	600	11,676.00	0.00
725	688180	君实生物	400	11,620.00	0.00
726	002497	雅化集团	1,300	11,596.00	0.00
727	600461	洪城环境	1,000	11,580.00	0.00
728	601021	春秋航空	200	11,266.00	0.00
729	600598	北大荒	900	11,241.00	0.00

730	300593	新雷能	1,090	10,834.60	0.00
731	300702	天宇股份	600	10,698.00	0.00
732	601339	百隆东方	2,000	10,420.00	0.00
733	603590	康辰药业	400	10,216.00	0.00
734	600023	浙能电力	1,400	9,954.00	0.00
735	600718	东软集团	1,200	9,924.00	0.00
736	601811	新华文轩	700	9,807.00	0.00
737	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
738	301109	军信股份	600	8,970.00	0.00
739	603708	家家悦	1,100	8,921.00	0.00
740	688071	华依科技	400	8,668.00	0.00
741	000963	华东医药	300	8,343.00	0.00
742	601007	金陵饭店	1,300	8,268.00	0.00
743	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
744	688800	瑞可达	277	7,778.16	0.00
745	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
746	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
747	002444	巨星科技	300	7,410.00	0.00
748	688262	国芯科技	400	7,284.00	0.00
749	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
750	000723	美锦能源	1,500	7,140.00	0.00
751	600641	万业企业	600	7,050.00	0.00
752	600794	保税科技	2,200	6,974.00	0.00
753	603730	岱美股份	700	6,958.00	0.00
754	600118	中国卫星	300	6,669.00	0.00
755	002782	可立克	600	6,648.00	0.00
756	600623	华谊集团	1,100	6,358.00	0.00
757	601222	林洋能源	1,000	6,270.00	0.00
758	605088	冠盛股份	300	6,252.00	0.00
759	601609	金田股份	1,100	6,226.00	0.00
760	688690	纳微科技	355	6,166.35	0.00
761	300134	大富科技	900	6,138.00	0.00
762	002265	建设工业	700	6,041.00	0.00
763	688045	必易微	200	6,014.00	0.00
764	603277	银都股份	200	6,008.00	0.00
765	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
766	600012	皖通高速	400	5,588.00	0.00
767	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
768	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
769	600079	人福医药	300	5,151.00	0.00
770	603997	继峰股份	500	5,115.00	0.00

771	601128	常熟银行	640	4,844.80	0.00
772	688561	奇安信	200	4,724.00	0.00
773	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
774	300735	光弘科技	200	4,320.00	0.00
775	300253	卫宁健康	700	4,130.00	0.00
776	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
777	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
778	300622	博士眼镜	300	3,651.00	0.00
779	603181	皇马科技	400	3,596.00	0.00
780	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
781	603218	日月股份	300	3,081.00	0.00
782	300366	创意信息	400	2,896.00	0.00
783	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
784	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
785	001379	腾达科技	191	2,574.68	0.00
786	300997	欢乐家	200	2,364.00	0.00
787	002384	东山精密	100	2,070.00	0.00
788	002797	第一创业	400	2,036.00	0.00
789	000401	冀东水泥	500	2,030.00	0.00
790	002100	天康生物	200	1,386.00	0.00
791	300323	华灿光电	300	1,305.00	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	600519	贵州茅台	14,195,955.00	4.69
2	300059	东方财富	10,589,865.94	3.50
3	601012	隆基绿能	10,001,673.60	3.30
4	601318	中国平安	7,720,293.00	2.55
5	601989	中国重工	6,971,337.00	2.30
6	600887	伊利股份	6,563,147.00	2.17
7	300750	宁德时代	6,415,072.00	2.12
8	600346	恒力石化	6,297,311.00	2.08
9	002001	新和成	6,130,930.00	2.02
10	688223	晶科能源	6,022,525.15	1.99
11	002152	广电运通	5,999,741.00	1.98
12	600050	中国联通	5,931,144.00	1.96
13	600030	中信证券	5,890,528.00	1.94
14	601328	交通银行	5,733,819.00	1.89
15	300122	智飞生物	5,722,102.00	1.89

16	600089	特变电工	5,633,822.00	1.86
17	300498	温氏股份	5,630,526.00	1.86
18	601728	中国电信	5,567,897.00	1.84
19	601600	中国铝业	5,523,822.00	1.82
20	601166	兴业银行	5,344,752.00	1.76

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	13,097,612.00	4.32
2	603993	洛阳钼业	8,045,519.00	2.66
3	600690	海尔智家	7,319,648.00	2.42
4	300059	东方财富	7,043,512.00	2.33
5	600016	民生银行	6,808,847.00	2.25
6	601012	隆基绿能	6,648,911.24	2.19
7	300750	宁德时代	6,368,293.00	2.10
8	601600	中国铝业	6,352,392.00	2.10
9	601398	工商银行	6,322,670.00	2.09
10	000338	潍柴动力	6,312,922.00	2.08
11	002001	新和成	6,083,589.00	2.01
12	600887	伊利股份	6,028,779.00	1.99
13	000895	双汇发展	5,671,313.00	1.87
14	601816	京沪高铁	5,633,900.00	1.86
15	601328	交通银行	5,537,339.00	1.83
16	600089	特变电工	5,370,270.00	1.77
17	601899	紫金矿业	5,333,816.00	1.76
18	601766	中国中车	5,326,590.00	1.76
19	600346	恒力石化	5,118,829.00	1.69
20	600406	国电南瑞	5,092,084.00	1.68

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	807,235,978.64
卖出股票收入（成交）总额	699,890,239.25

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	10,062,572.74	2.11
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	26,001.94	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	10,088,574.68	2.12

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019709	23 国债 16	68,000	6,906,182.47	1.45
2	019727	23 国债 24	31,000	3,156,390.27	0.66
3	113685	升 24 转债	260	26,001.94	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

1、对冲策略

现阶段本基金将根据对证券市场走势的判断，适时利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险。

原则上本基金绝大多数时间在股票投资策略的基础上，通过构建和股票多头

相匹配的股指期货空头头寸，从而对冲本基金的系统性风险，以获取精选股票的绝对收益。

2、套利策略

本基金主要采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉绝对收益机会。同时，本基金根据市场情况的变化，灵活运用其他对冲套利策略提高资本的利用率，从而提高绝对收益，达到投资策略的多元化以进一步降低本基金收益的波动。

（1）股指期货套利策略

股指期货套利策略是指积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式：

①期现套利

期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

②跨期套利

跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约价差进行获利。

（2）其他套利策略

基金经理会实时关注市场的发展，前瞻性地运用其他套利策略。

3、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、国债期货等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

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

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、国债期货等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 359,591,987.02 元，占基金资产净值的比例为 75.41%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 343,934,240.00 元，占基金资产净值的比例为 72.13%，空头合约市值占股票资产的比例为 95.65%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-4,613,429.96 元，公允价值变动损益为 12,628,220.74 元。

7.13 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，北京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北京监管局的处罚。

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

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

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

7.13.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	41,395,198.67
2	应收清算款	1,230,447.35
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	47,567.48
6	其他应收款	—

7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	42,673,213.50

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	1,478	68,590.46	68,411,260.16	67.48	32,965,444.33	32.52
富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C	1,308	75,860.47	72,908,178.03	73.48	26,317,318.91	26.52
富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E	81	2,803,787.93	223,047,202.10	98.21	4,059,620.23	1.79
合计	2,867	149,183.48	364,366,640.29	85.19	63,342,383.47	14.81

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	608,745.01	0.6005
	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C	50,853.86	0.0513
	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E	15,824.77	0.0070
	合计	675,423.64	0.1579

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	0

	富国量化对冲策略 三个月持有期灵活 配置混合 C	0
	富国量化对冲策略 三个月持有期灵活 配置混合 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富国量化对冲策略 三个月持有期灵活 配置混合 A	10~50
	富国量化对冲策略 三个月持有期灵活 配置混合 C	0
	富国量化对冲策略 三个月持有期灵活 配置混合 E	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 A	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E
基金合同生效日(2020年02月25日)基金份额总额	1,771,147,316.27	1,219,666,060.43	—
报告期期初基金份额总额	118,191,095.29	161,826,924.61	914.41
本报告期基金总申购份额	82,220,899.45	129,810,046.34	286,269,385.71
减：本报告期基金总赎回份额	99,035,290.25	192,411,474.01	59,163,477.79
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	—	—	—
报告期期末基金份额总额	101,376,704.49	99,225,496.94	227,106,822.33

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	3	59,223,422.05	3.93	43,584.28	3.93	—
诚通证券	2	—	—	—	—	—
东方证券	2	67,292,880.66	4.47	49,518.25	4.47	—
东吴证券	2	60,478,816.67	4.01	44,506.20	4.01	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	2	103,138,332.59	6.85	75,899.79	6.85	—
国盛证券	2	281,252,272.09	18.67	206,977.83	18.67	—
海通证券	2	90,837,518.04	6.03	66,846.02	6.03	—
华泰证券	2	145,854,274.60	9.68	107,331.05	9.68	—
华西证券	2	—	—	—	—	—
民生证券	3	496,810,667.54	32.98	365,598.41	32.98	—
申港证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	2	51,913,602.50	3.45	38,202.87	3.45	—
太平洋证券	2	1,227,352.00	0.08	903.28	0.08	—
银河证券	2	22,622,339.36	1.50	16,647.98	1.50	—
浙商证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	30,282,394.28	2.01	22,284.85	2.01	—
中信建投	2	95,419,538.61	6.33	70,218.60	6.33	—
中信证券	2	—	—	—	—	—

注：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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长江证券	—	—	—	—	—	—
诚通证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	3,112,277.00	100.00	—	—	—	—
华西证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
申港证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2024年03月14日
2	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2024年06月14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	2024-01-01 至 2024-01-07	58,264 ,939.6 2	6,645,1 38.98	61,017 ,979.5 0	3,892,099.1 0	0.91%
	2	2024-05-20 至 2024-06-30	—	120,721 ,943.10	—	120,721,943 .10	28.23%
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量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金的文件	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、富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金合同		
3、富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金托管协议		
4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件		
5、富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金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		