

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

二〇二三年中期报告

2023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：2023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 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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	12
4.1	基金管理人及基金经理情况	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5	托管人报告	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6	中期财务报告（未经审计）	18
6.1	资产负债表	18
6.2	利润表	19
6.3	净资产（基金净值）变动表	20
6.4	报表附注	21
§7	投资组合报告	49
7.1	期末基金资产组合情况	49

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	50
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	68
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	70
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.....	70
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.....	70
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.....	70
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.....	70
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	70
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
7.12	市场中性策略执行情况.....	71
7.13	投资组合报告附注.....	72
§8	基金份额持有人信息.....	74
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
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.....	74
§9	开放式基金份额变动.....	76
§10	重大事件揭示.....	77
10.1	基金份额持有人大会决议.....	77
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.....	77
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	77
10.4	基金投资策略的改变.....	77
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	77
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.....	77
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	77
10.8	其他重大事件.....	80
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	81
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.....	81
§12	备查文件目录.....	82

§ 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	194,202,675.36份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国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
下属分级基金的交易代码	008835	008836
报告期末下属分级基金的份额总额	100,077,510.18份	94,125,165.18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	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 中国银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街1号

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国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(2023年01月01日至2023年06月30日)
本期已实现收益	-4,557,100.47
本期利润	7,719,832.61
加权平均基金份额本期利润	0.0321
本期加权平均净值利润率	3.06%
本期基金份额净值增长率	3.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年06月30日)
期末可供分配利润	7,544,476.88
期末可供分配基金份额利润	0.0754
期末基金资产净值	107,621,987.06
期末基金份额净值	1.0754
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	7.54%

(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(2023年01月01日至2023年06月30日)
本期已实现收益	-2,363,029.90
本期利润	5,823,231.90
加权平均基金份额本期利润	0.0307
本期加权平均净值利润率	2.97%
本期基金份额净值增长率	3.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年06月30日)
期末可供分配利润	5,755,726.79
期末可供分配基金份额利润	0.0611
期末基金资产净值	99,880,891.97
期末基金份额净值	1.0611
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	6.11%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国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	0.50%	0.17%	0.37%	0.01%	0.13%	0.16%
过去三个月	2.29%	0.20%	1.12%	0.01%	1.17%	0.19%
过去六个月	3.68%	0.19%	2.23%	0.02%	1.45%	0.17%
过去一年	2.24%	0.23%	4.50%	0.01%	-2.26%	0.22%
过去三年	6.37%	0.32%	13.49%	0.01%	-7.12%	0.31%
自基金合同生效起至今	7.54%	0.31%	15.06%	0.01%	-7.52%	0.30%

(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
过去一个月	0.47%	0.17%	0.37%	0.01%	0.10%	0.16%
过去三个月	2.19%	0.20%	1.12%	0.01%	1.07%	0.19%
过去六个月	3.47%	0.19%	2.23%	0.02%	1.24%	0.17%
过去一年	1.83%	0.23%	4.50%	0.01%	-2.67%	0.22%
过去三年	5.10%	0.32%	13.49%	0.01%	-8.39%	0.31%
自基金合同生效起至今	6.11%	0.31%	15.06%	0.01%	-8.95%	0.30%

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2023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2023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。

§ 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 2023 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 304 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	—	13	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 21 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

2023 年年初以来，随着主要城市疫情高峰过去，疫情对经济的冲击逐步减小，投资者对 2023 年经济复苏预期变动更加乐观，A 股迎来开门红。进入 3 月，由于两会政府工作报告公布的 GDP 增速目标低于市场预期，市场迎来一轮快速调整。海外方面，美国公布的 2 月通胀数据超预期，加息预期再次升温，全球资本市场迎来调整。4 月以来，尽管 1-2 月工业企业利润下降一度压制市场情绪，但 3 月 PMI 验证经济进一步向好，提振市场信心。在经济弱复苏，流动性宽裕的背景下，人工智能相关板块迎来加速上涨。石油化工、建筑等板块在中特估及一带一路等主题概念的驱动下也迎来靓丽表现。进入 5 月中旬，由于金融、通胀数据均回落，指向经济内生动能不强，复苏斜率放缓压制市场情绪，同时海外银行业危机和债务违约风险持续发酵，引发市场担忧加剧，各板块均迎来快速调整。6 月初，虽然国内方面经济数据维持弱势，但结构性政策开始落地，结合外资巨头接连访华为经济注入新动力，提振市场信心。6 月下旬，随着短期宏观政策兑现，同时部分 TMT 公司涨幅过大，投资者选择获利了结，叠加人民币进一步贬值及节前避险情绪升温，A 股迎来调整。

总体来看，2023 年上半年上证综指上涨 3.65%，沪深 300 下跌 0.75%，创业板指下跌 5.61%，中证 500 指数上涨 2.29%。

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 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值 A 级为 1.0754 元，C 级为 1.0611 元；份额累计净值 A 级为 1.0754 元，C 级为 1.0611 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为 3.68%，C 级为 3.47%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 2.23%，C 级为 2.23%。

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 2023 年下半年，积极因素正进一步累积，悲观预期将逐步修正。首先，外部的扰动将逐步缓解。当前市场已将 7 月美联储会议的加息预期较充分地计入，并且后续 8 月没有美联储议息会议的情况下，市场将阶段性进入鹰派信息的

“空窗期”，来自美债利率上行、汇率贬值等外部压力已在缓和。其次，6月份多项经济数据已经止跌企稳、甚至拐头向上，市场对于经济增长的悲观预期仍有望逐步修正。2季度GDP数据虽略不及预期，但6月经济数据已经边际回暖。生产端，尽管工业增加值、服务业生产指数两年复合增速仍低于疫情前水平，但5-6月已出现持续改善。消费端，边际上居民收入改善，5-6月商品消费加速。投资端，基建、制造业投资维持强势。近期各项经济政策也在密集加码落地，如促进家居消费若干措施、促民营经济、城中村改造等政策密集加码。此外，当前市场本身仍处在一个隐含风险溢价较高、多数行业拥挤度较低的位置，具备整体修复的空间。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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：2023年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2023年06月 30日	上年度末 2022年12月31 日
资 产：		
银行存款	13,541,746.39	59,209,379.88
结算备付金	14,748,419.40	39,337,842.24
存出保证金	18,847,332.61	85,936,309.16
交易性金融资产	160,458,773.43	727,483,988.36
其中：股票投资	160,458,773.43	699,143,515.85
基金投资	—	—
债券投资	—	28,340,472.51
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	381,668.31	126,480.49
应收股利	—	—
应收申购款	330,138.92	11,000,621.39
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	208,308,079.06	923,094,621.52
负债和净资产	本期末 2023年06月 30日	上年度末 2022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	227,883.32	220,792.40
应付管理人报酬	139,367.16	622,576.77
应付托管费	34,841.80	155,644.20
应付销售服务费	32,941.55	118,650.21
应付投资顾问费	—	—
应交税费	—	355,302.47

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	370,166.20	1,110,361.07
负债合计	805,200.03	2,583,327.12
净资产：		
实收基金	194,202,675.36	891,479,301.94
其他综合收益	—	—
未分配利润	13,300,203.67	29,031,992.46
净资产合计	207,502,879.03	920,511,294.40
负债和净资产总计	208,308,079.06	923,094,621.52

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0685 元，基金份额总额 194,202,675.36 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 1.0754 元，份额总额 100,077,510.18 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 1.0611 元，份额总额 94,125,165.18 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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	16,306,166.42	25,451,597.60
1.利息收入	244,479.62	920,324.84
其中：存款利息收入	244,479.62	918,081.79
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	—	2,243.05
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	-4,612,769.06	20,807,736.37
其中：股票投资收益	17,709,047.14	-136,223,375.00
基金投资收益	—	—
债券投资收益	181,856.29	891,614.01
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	-24,292,032.24	147,276,931.90
股利收益	1,788,359.75	8,862,565.46
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）	20,463,194.88	2,974,527.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	211,260.98	749,009.30
减：二、营业总支出	2,763,101.91	7,962,449.39
1. 管理人报酬	1,811,024.78	4,970,741.25
2. 托管费	452,756.25	1,242,685.32
3. 销售服务费	393,027.08	1,012,865.80
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	3,981.39
其中：卖出回购金融资产支出	—	3,981.39
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	0.12	617,644.36
8. 其他费用	106,293.68	114,531.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	13,543,064.51	17,489,148.21
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	13,543,064.51	17,489,148.21
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	13,543,064.51	17,489,148.21

6.3 净资产（基金净值）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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (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（基金净值）	891,479,301.94	29,031,992.46	920,511,294.40
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	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）	-697,276,626.58	15,731,788.79	-713,008,415.37
（一）、综合收益总额	—	13,543,064.51	13,543,064.51
（二）、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）	-697,276,626.58	29,274,853.30	-726,551,479.88
其中：1. 基金申购款	49,310,552.83	2,501,640.85	51,812,193.68
2. 基金赎回款	-746,587,179.41	31,776,494.15	-778,363,673.56
（三）、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)			
(四)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产(基金净值)	194,202,675.36	13,300,203.67	207,502,879.03
项目	上年度可比期间 (2022年01月01日至2022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(基金净值)	1,516,273,365.85	44,202,600.36	1,560,475,966.21
加:会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产(基金净值)	1,516,273,365.85	44,202,600.36	1,560,475,966.21
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-473,608,112.51	6,120,803.83	-467,487,308.68
(一)、综合收益总额	—	17,489,148.21	17,489,148.21
(二)、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)	-473,608,112.51	11,368,344.38	-484,976,456.89
其中:1.基金申购款	460,363,245.29	17,462,273.51	477,825,518.80
2.基金赎回款	-933,971,357.80	28,830,617.89	-962,801,975.69
(三)、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)	—	—	—
(四)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产(基金净值)	1,042,665,253.34	50,323,404.19	1,092,988,657.53

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
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。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。

本基金不受中国证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第三条、第五条第（一）项、第（三）项及第（五）项的限制以及《公开募集证券投资基金参与国债期货交易指引》第三条的限制。待基金参与融资融券和转融通证券出借业务及投资其他品种（包括但不限于：其他基金份额、期权、收益互换等）的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，参与融资融券业务、转融通证券出借业务及投资其他品种，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通证券出借业务及投资其他品种的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事宜按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。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。

本基金业绩比较基准为：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%。

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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 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，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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 (2023年06月30日)
活期存款	13,541,746.39
等于：本金	13,539,822.79
加：应计利息	1,923.60
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	13,541,746.39

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（2023 年 06 月 30 日）			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	163,336,769.28	—	160,458,773.43	—
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	163,336,769.28	—	160,458,773.43	2,877,995.85

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（2023 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	—	—	—	—
	153,178,859.51			
IC2309	-62,893,000.00	—	—	—
IF2307	-58,219,939.51	—	—	—
IF2309	-32,065,920.00	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	—	—	—	—

	153,178,859.51			
--	----------------	--	--	--

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
IF2309	IF2309	-28.00	32,247,600.00	-181,680.00
IF2307	IF2307	-51.00	58,605,120.00	-385,180.49
IC2309	IC2309	-53.00	63,282,000.00	-389,000.00
合计				-955,860.49
减：可抵销期货暂收款				-955,860.49
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（2023年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	17.49
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	233,825.10
其中：交易所市场	233,825.10
银行间市场	—
应付利息	—

预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	76,323.61
合计	370,166.20

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（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	539,900,769.02	539,900,769.02
本期申购	21,455,394.51	21,455,394.51
本期赎回（以“-”号填列）	-461,278,653.35	-461,278,653.35
本期末	100,077,510.18	100,077,510.18

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（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	351,578,532.92	351,578,532.92
本期申购	27,855,158.32	27,855,158.32
本期赎回（以“-”号填列）	-285,308,526.06	-285,308,526.06
本期末	94,125,165.18	94,125,165.18

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
本期期初	51,148,647.64	-	20,078,119.46
本期利润	-4,557,100.47	12,276,933.08	7,719,832.61
本期基金份额交易产生的变动数	-	14,656,490.99	-20,253,475.19
其中：基金申购款	2,066,679.18	-638,301.31	1,428,377.87
基金赎回款	-	15,294,792.30	-21,681,853.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,681,580.99	-4,137,104.11	7,544,476.88

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
本期期初	29,030,277.57	-	8,953,873.00
本期利润	-2,363,029.90	8,186,261.80	5,823,231.90

本期基金份额交易产生的变动数	- 17,047,110.18	8,025,732.07	-9,021,378.11
其中：基金申购款	1,870,620.04	-797,357.06	1,073,262.98
基金赎回款	- 18,917,730.22	8,823,089.13	-10,094,641.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,620,137.49	-3,864,410.70	5,755,726.79

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
活期存款利息收入	43,606.24
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	197,741.10
其他	3,132.28
合计	244,479.62

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
卖出股票成交总额	1,049,609,619.73
减：卖出股票成本总额	1,029,643,730.49
减：交易费用	2,256,842.10
买卖股票差价收入	17,709,047.14

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（2023年01月01日至2023年06月30日）
债券投资收益——利息收入	125,850.28
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	56,006.01
合计	181,856.29

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（2023年01月01日至2023年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	36,284,009.57

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	35,630,611.00
减：应计利息总额	597,380.37
减：交易费用	12.19
债券投资收益-差价收入	56,006.01

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（2023年01月01日至2023年06月30日）
股指期货投资收益	-24,292,032.24

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
股票投资产生的股利收益	1,788,359.75
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	1,788,359.75

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
1. 交易性金融资产	28,673,218.02
股票投资	28,650,167.02
债券投资	23,051.00
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—

2. 衍生工具	-8,210,023.14
权证投资	—
股指期货-套保卖出股指期货	-8,210,023.14
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	20,463,194.88

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
基金赎回费收入	211,069.33
基金转换费收入	191.65
合计	211,260.98

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
审计费用	21,323.61
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	6,370.07
债券账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	106,293.68

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
申万宏源西部证券有限公司	基金管理人的股东控制的子公司、基金代销机构
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	基金管理人的股东控制的子公司

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（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022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	35,805,271.82	2.38	509,925,622.95	15.51
申万宏源	16,342,404.72	1.09	607,202,493.82	18.47

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（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022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	17,912,361.00	56.30

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（2023年01月01日至2023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	25,826.09	2.38	13,706.50	5.86
申万宏源	11,787.95	1.09	4,697.14	2.01
关联方名称	上年度可比期间（2022年01月01日至2022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	556,112.33	18.49	288,517.43	20.86
海通证券	467,403.15	15.54	301,254.41	21.79

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（2023年01月01日至2023年06月30日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	1,811,024.78	4,970,741.25
其中：支付销售机构的客户维护费	235,468.76	443,096.41

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（2023年01月01日至2023年06月30日）	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	452,756.25	1,242,685.32

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（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	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

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（2022年01月01日至2022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	合计
富国基金管理有限公司	—	226,743.50	226,743.50
申万宏源西部证券有限公司	—	48.93	48.93
中国银行股份有限公司	—	29,559.50	29,559.50
合计	—	256,351.93	256,351.93

注：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。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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自有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022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	13,541,746.39	43,606.24	33,841,513.30	123,439.76

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（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

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2022年01月01日至2022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
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	688267	中触媒	IPO网下申购	3,390	142,751.21
海通证券股份有限公司	688062	迈威生物	IPO网下申购	27,002	944,367.95
海通证券股份有限公司	688220	翱捷科技	IPO网下申购	8,184	1,353,328.34

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：本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023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
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股限售	27.93	33.03	87	2,429.91	2,873.61	—
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月	新股限售	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	—
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新股限售	11.88	21.02	736	8,743.68	15,470.72	—
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股限售	18.88	19.60	111	2,095.68	2,175.60	—
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股限售	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	—
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股限售	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	—
001380	华纬科技	2023-05-09	6个月	新股限售	28.84	30.78	98	2,826.32	3,016.44	—
300804	广康生化	2023-06-15	6个月	新股限售	42.45	32.97	197	8,362.65	6,495.09	—
301170	锡南科技	2023-06-16	6个月	新股限售	34.00	34.93	169	5,746.00	5,903.17	—
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内 (含)	新股认购	25.82	25.82	1,844	47,612.08	47,612.08	—
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股限售	25.82	25.82	205	5,293.10	5,293.10	—
301203	国泰环保	2023-03-28	6个月	新股限售	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	—
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	新股限售	35.66	33.26	204	7,274.64	6,785.04	—
301246	宏源药业	2023-03-10	6个月	新股限售	50.00	30.71	645	32,250.00	19,807.95	—
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内 (含)	新股认购	36.90	36.90	1,242	45,829.80	45,829.80	—
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股限售	36.90	36.90	139	5,129.10	5,129.10	—
301262	海看股份	2023-06-13	6个月	新股限售	30.22	25.50	300	9,066.00	7,650.00	—
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	新股限售	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	—
301281	科源制药	2023-05-26	5个月	新股限售_转增	—	25.10	96	—	2,409.60	—
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	新股限售	29.60	71.42	190	5,624.00	13,569.80	—
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	新股限售	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	—
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	新股限售	32.29	51.12	192	6,199.68	9,815.04	—
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	新股限售	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	—
301322	绿通科技	2023-02-27	6个月	新股限售	131.11	53.24	243	31,859.73	12,937.32	—
301322	绿通科技	2023-05-25	4个月	新股限售_转增	—	53.24	121	—	6,442.04	—
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	新股限售	39.06	39.36	123	4,804.38	4,841.28	—
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	新股限售	14.81	13.73	495	7,330.95	6,796.35	—
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	新股限售	32.60	30.37	166	5,411.60	5,041.42	—
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	新股限售	73.45	46.64	209	15,351.05	9,747.76	—
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月	新股限售	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	—

301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	新股限售	23.77	42.89	1,168	27,763.36	50,095.52	—
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	新股限售	24.66	22.51	269	6,633.54	6,055.19	—
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新股限售	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	—
301387	光大同创	2023-04-10	6个月	新股限售	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	—
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内 (含)	新股认购	26.68	26.68	2,532	67,553.76	67,553.76	—
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新股限售	26.68	26.68	282	7,523.76	7,523.76	—
301408	华人健康	2023-02-22	6个月	新股限售	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	—
301429	森泰股份	2023-04-10	6个月	新股限售	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	—
301486	致尚科技	2023-06-30	1个月内 (含)	新股认购	57.66	57.66	1,182	68,154.12	68,154.12	—
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	新股限售	57.66	57.66	132	7,611.12	7,611.12	—
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内 (含)	新股认购	39.78	39.78	1,783	70,927.74	70,927.74	—
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股限售	39.78	39.78	199	7,916.22	7,916.22	—
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股限售	10.36	11.84	511	5,293.96	6,050.24	—
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股限售	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	—
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	新股限售	19.86	18.06	1,099	21,826.14	19,847.94	—
688352	硕中科技	2023-04-11	6个月	新股限售	12.10	12.07	882	10,672.20	10,645.74	—
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	新股限售	23.60	64.67	216	5,097.60	13,968.72	—
688429	时创能源	2023-06-20	6个月	新股限售	19.20	25.53	265	5,088.00	6,765.45	—
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	新股限售	75.00	90.76	71	5,325.00	6,443.96	—
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	新股限售	5.69	5.41	2,229	12,683.01	12,058.89	—
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	新股限售	11.10	17.04	849	9,423.90	14,466.96	—
688479	友车科技	2023-05-04	6个月	新股限售	33.99	29.49	136	4,622.64	4,010.64	—
688484	南芯科技	2023-03-28	6个月	新股限售	39.99	36.71	477	19,075.23	17,510.67	—
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	新股限售	21.86	23.85	304	6,645.44	7,250.40	—
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	新股限售	152.38	135.97	185	28,190.30	25,154.45	—
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	新股限售	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	—
688543	国科军工	2023-06-14	6个月	新股限售	43.67	53.05	147	6,419.49	7,798.35	—
688576	西山科技	2023-05-30	6个月	新股限售	135.80	120.41	75	10,185.00	9,030.75	—
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	新股限售	125.80	118.03	46	5,786.80	5,429.38	—
688593	新相微	2023-05-25	6个月	新股限售	11.18	14.59	568	6,350.24	8,287.12	—
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内 (含)	新股认购	55.00	55.00	1,000	55,000.00	55,000.00	—
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股限售	55.00	55.00	112	6,160.00	6,160.00	—
688623	双元科技	2023-05-31	6个月	新股限售	125.88	86.79	48	6,042.24	4,165.92	—
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月	新股限售	25.28	29.87	184	4,651.52	5,496.08	—

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	停牌	期末估	复牌	复牌	数量	期末	期末	备
------	------	----	----	-----	----	----	----	----	----	---

		日期	原因	值单价	日期	开盘单 价	(单位: 股)	成本总额	估值总额	注
601298	青岛港	2023年06月 28日	重大事项停牌	6.97	2023 年07 月03 日	7.40	800.00	4,432.74	5,576.00	—

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 2023 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 2023 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（2023年06月30日）	上年度末（2022年12月31日）
AAA	—	—
AAA 以下	—	24,000.32
未评级	—	—
合计	—	24,000.32

注：本基金本报告期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（2023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	13,541,746.39	—	—	—	—	—	13,541,746.39
结算备付金	14,748,419.40	—	—	—	—	—	14,748,419.40
存出保证金	351,166.21	—	—	—	—	18,496,166.40	18,847,332.61
交易性金融资产	—	—	—	—	—	160,458,773.43	160,458,773.43
应收清算款	—	—	—	—	—	381,668.31	381,668.31
应收申购款	—	—	—	—	—	330,138.92	330,138.92
资产总计	28,641,332.00	—	—	—	—	179,666,747.06	208,308,079.06
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	227,883.32	227,883.32
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	139,367.16	139,367.16
应付托管费	—	—	—	—	—	34,841.80	34,841.80
应付销售服务费	—	—	—	—	—	32,941.55	32,941.55
其他负债	—	—	—	—	—	370,166.20	370,166.20
负债总计	—	—	—	—	—	805,200.03	805,200.03
利率敏感度缺口	28,641,332.00	—	—	—	—	178,861,547.03	207,502,879.03
上年度末（2022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	59,209,379.88	—	—	—	—	—	59,209,379.88
结算备付金	39,337,842.24	—	—	—	—	—	39,337,842.24

存出保证金	87,340.36	—	—	—	—	85,848,968.80	85,936,309.16
交易性金融资产	8,059,655.75	—	20,280,816.76	—	—	699,143,515.85	727,483,988.36
应收清算款	—	—	—	—	—	126,480.49	126,480.49
应收申购款	—	—	—	—	—	11,000,621.39	11,000,621.39
资产总计	106,694,218.23	—	20,280,816.76	—	—	796,119,586.53	923,094,621.52
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	220,792.40	220,792.40
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	622,576.77	622,576.77
应付托管费	—	—	—	—	—	155,644.20	155,644.20
应付销售服务费	—	—	—	—	—	118,650.21	118,650.21
应交税费	—	—	—	—	—	355,302.47	355,302.47
其他负债	—	—	—	—	—	1,110,361.07	1,110,361.07
负债总计	—	—	—	—	—	2,583,327.12	2,583,327.12
利率敏感度缺口	106,694,218.23	—	20,280,816.76	—	—	793,536,259.41	920,511,294.40

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

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（2023年06月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	1. 基准点利率增加0.1%	—	-6,629.33
	2. 基准点利率减少0.1%	—	6,629.33

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（2023年06月30日）		上年度末（2022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	160,458,773.43	77.33	699,143,515.85	75.95
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	28,340,472.51	3.08
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	160,458,773.43	77.33	727,483,988.36	79.03

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（2023年06月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 市场基准增加1%	55,130.32	510,783.78
	2. 市场基准减少1%	-55,130.32	-510,783.78

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 (2023年06月30日)	上年度末 (2022年12月31日)
第一层次	159,510,686.43	695,905,291.19
第二层次	400,286.80	29,280,447.91
第三层次	547,800.20	2,298,249.26
合计	160,458,773.43	727,483,988.36

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	160,458,773.43	77.03
	其中：股票	160,458,773.43	77.03
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	28,290,165.79	13.58
8	其他各项资产	19,559,139.84	9.39
9	合计	208,308,079.06	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	390,816.00	0.19
B	采矿业	5,264,384.20	2.54
C	制造业	102,950,940.33	49.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,447,700.87	1.18
E	建筑业	2,986,763.80	1.44
F	批发和零售业	2,962,340.24	1.43
G	交通运输、仓储和邮政业	2,505,005.00	1.21
H	住宿和餐饮业	157,461.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,493,690.86	6.02
J	金融业	23,408,616.90	11.28
K	房地产业	892,563.65	0.43
L	租赁和商务服务业	1,105,633.00	0.53
M	科学研究和技术服务业	499,336.18	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	177,325.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	106,932.00	0.05
Q	卫生和社会工作	104,589.40	0.05
R	文化、体育和娱乐业	1,941,227.00	0.94
S	综合	63,448.00	0.03
	合计	160,458,773.43	77.33

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	3,189	5,392,599.00	2.60
2	601318	中国平安	54,571	2,532,094.40	1.22
3	300750	宁德时代	9,000	2,059,110.00	0.99
4	000725	京东方A	493,100	2,016,779.00	0.97
5	600276	恒瑞医药	39,700	1,901,630.00	0.92
6	000338	潍柴动力	141,900	1,768,074.00	0.85
7	000858	五粮液	10,530	1,722,392.10	0.83
8	000538	云南白药	32,160	1,687,756.80	0.81
9	601766	中国中车	250,100	1,625,650.00	0.78
10	000651	格力电器	43,800	1,599,138.00	0.77
11	000333	美的集团	26,778	1,577,759.76	0.76
12	601607	上海医药	69,000	1,546,290.00	0.75
13	300760	迈瑞医疗	4,800	1,439,040.00	0.69
14	600406	国电南瑞	61,800	1,427,580.00	0.69
15	600690	海尔智家	60,592	1,422,700.16	0.69
16	601600	中国铝业	237,600	1,304,424.00	0.63
17	300124	汇川技术	20,000	1,284,200.00	0.62
18	601012	隆基绿能	43,940	1,259,759.80	0.61
19	600104	上汽集团	88,500	1,254,045.00	0.60
20	601319	中国人保	211,000	1,232,240.00	0.59
21	603993	洛阳钼业	220,700	1,176,331.00	0.57
22	002249	大洋电机	204,200	1,163,940.00	0.56
23	601668	中国建筑	191,900	1,101,506.00	0.53
24	601818	光大银行	323,900	994,373.00	0.48
25	600919	江苏银行	135,100	992,985.00	0.48
26	601006	大秦铁路	131,000	973,330.00	0.47
27	002304	洋河股份	7,200	945,720.00	0.46
28	601398	工商银行	194,500	937,490.00	0.45
29	688819	天能股份	25,400	935,736.00	0.45
30	600497	驰宏锌锗	183,800	922,676.00	0.44
31	600036	招商银行	27,900	914,004.00	0.44
32	688009	中国通号	155,189	900,096.20	0.43

33	600887	伊利股份	31,383	888,766.56	0.43
34	600219	南山铝业	294,000	887,880.00	0.43
35	601229	上海银行	153,800	884,350.00	0.43
36	002027	分众传媒	129,500	881,895.00	0.43
37	688981	中芯国际	17,251	871,520.52	0.42
38	600885	宏发股份	27,200	866,320.00	0.42
39	002600	领益智造	123,400	852,694.00	0.41
40	688538	和辉光电	335,000	850,900.00	0.41
41	300003	乐普医疗	37,600	850,136.00	0.41
42	300308	中际旭创	5,600	825,720.00	0.40
43	300059	东方财富	57,880	821,896.00	0.40
44	000559	万向钱潮	148,000	806,600.00	0.39
45	002736	国信证券	92,100	804,033.00	0.39
46	600517	国网英大	137,300	782,610.00	0.38
47	600016	民生银行	208,500	781,875.00	0.38
48	600959	江苏有线	226,400	765,232.00	0.37
49	688396	华润微	14,500	759,945.00	0.37
50	000060	中金岭南	158,700	753,825.00	0.36
51	600582	天地科技	129,000	752,070.00	0.36
52	300433	蓝思科技	63,600	747,936.00	0.36
53	000063	中兴通讯	16,200	737,748.00	0.36
54	002128	电投能源	55,700	736,354.00	0.35
55	600884	杉杉股份	47,200	714,608.00	0.34
56	300661	圣邦股份	8,580	704,675.40	0.34
57	600050	中国联通	143,600	689,280.00	0.33
58	688126	沪硅产业	32,475	678,727.50	0.33
59	600741	华域汽车	36,417	672,257.82	0.32
60	000878	云南铜业	60,800	671,840.00	0.32
61	600380	健康元	52,400	666,004.00	0.32
62	600909	华安证券	142,100	663,607.00	0.32
63	600018	上港集团	126,200	662,550.00	0.32
64	601877	正泰电器	23,900	660,835.00	0.32
65	300136	信维通信	32,600	654,608.00	0.32
66	601618	中国中冶	163,400	648,698.00	0.31
67	600015	华夏银行	118,200	639,462.00	0.31
68	000555	神州信息	51,500	633,450.00	0.31
69	601601	中国太保	24,300	631,314.00	0.30
70	002340	格林美	90,600	626,046.00	0.30
71	600030	中信证券	31,500	623,070.00	0.30
72	002273	水晶光电	51,700	617,298.00	0.30
73	600177	雅戈尔	97,700	616,487.00	0.30

74	600271	航天信息	44,600	610,574.00	0.29
75	300014	亿纬锂能	10,000	605,000.00	0.29
76	300207	欣旺达	37,000	603,840.00	0.29
77	600967	内蒙一机	59,100	596,910.00	0.29
78	601088	中国神华	19,400	596,550.00	0.29
79	002203	海亮股份	49,300	592,093.00	0.29
80	000630	铜陵有色	204,143	589,973.27	0.28
81	300088	长信科技	96,900	584,307.00	0.28
82	600999	招商证券	42,700	579,439.00	0.28
83	000895	双汇发展	23,600	577,964.00	0.28
84	002230	科大讯飞	8,400	570,864.00	0.28
85	002085	万丰奥威	82,200	569,646.00	0.27
86	600309	万华化学	6,400	562,176.00	0.27
87	601728	中国电信	99,600	560,748.00	0.27
88	000513	丽珠集团	14,300	556,413.00	0.27
89	600879	航天电子	65,000	551,850.00	0.27
90	601169	北京银行	119,100	551,433.00	0.27
91	600438	通威股份	15,900	545,529.00	0.26
92	600660	福耀玻璃	15,200	544,920.00	0.26
93	601328	交通银行	93,300	541,140.00	0.26
94	601222	林洋能源	65,400	535,626.00	0.26
95	000623	吉林敖东	32,700	524,508.00	0.25
96	601998	中信银行	87,400	522,652.00	0.25
97	300627	华测导航	15,700	509,779.00	0.25
98	000869	张裕A	16,600	508,956.00	0.25
99	601166	兴业银行	32,400	507,060.00	0.24
100	000750	国海证券	146,900	492,115.00	0.24
101	002422	科伦药业	16,400	486,752.00	0.23
102	601899	紫金矿业	42,700	485,499.00	0.23
103	000563	陕国投A	157,700	480,985.00	0.23
104	002465	海格通信	46,300	478,742.00	0.23
105	600362	江西铜业	24,300	461,214.00	0.22
106	600875	东方电气	24,700	460,655.00	0.22
107	600699	均胜电子	26,100	460,404.00	0.22
108	600941	中国移动	4,900	457,170.00	0.22
109	600998	九州通	43,806	454,706.28	0.22
110	000157	中联重科	66,300	447,525.00	0.22
111	601108	财通证券	61,000	441,640.00	0.21
112	002415	海康威视	13,300	440,363.00	0.21
113	002202	金风科技	40,800	433,296.00	0.21
114	002938	鹏鼎控股	17,500	425,075.00	0.20

115	601216	君正集团	103,300	423,530.00	0.20
116	300450	先导智能	11,700	423,189.00	0.20
117	000156	华数传媒	48,500	421,950.00	0.20
118	601231	环旭电子	28,100	420,376.00	0.20
119	002384	东山精密	16,200	419,580.00	0.20
120	600031	三一重工	24,700	410,761.00	0.20
121	601138	工业富联	16,300	410,760.00	0.20
122	000596	古井贡酒	1,600	395,808.00	0.19
123	601868	中国能建	169,000	395,460.00	0.19
124	600332	白云山	12,300	392,124.00	0.19
125	600580	卧龙电驱	26,700	390,087.00	0.19
126	600905	三峡能源	72,400	388,788.00	0.19
127	002797	第一创业	67,000	383,240.00	0.18
128	601816	京沪高铁	71,800	377,668.00	0.18
129	688598	金博股份	2,186	374,899.00	0.18
130	603096	新经典	18,100	368,516.00	0.18
131	601106	中国一重	109,000	366,240.00	0.18
132	600637	东方明珠	46,500	363,630.00	0.18
133	601869	长飞光纤	9,800	362,698.00	0.17
134	688116	天奈科技	7,851	359,183.25	0.17
135	600820	隧道股份	58,400	350,984.00	0.17
136	601369	陕鼓动力	38,500	350,735.00	0.17
137	300699	光威复材	11,220	346,137.00	0.17
138	000938	紫光股份	10,800	343,980.00	0.17
139	600196	复星医药	10,900	336,810.00	0.16
140	603369	今世缘	6,200	327,360.00	0.16
141	688567	孚能科技	15,111	326,246.49	0.16
142	300395	菲利华	6,600	324,720.00	0.16
143	601658	邮储银行	65,900	322,251.00	0.16
144	688256	寒武纪	1,700	319,600.00	0.15
145	300383	光环新网	29,700	319,275.00	0.15
146	600728	佳都科技	45,500	315,315.00	0.15
147	002391	长青股份	45,800	314,646.00	0.15
148	600570	恒生电子	7,100	314,459.00	0.15
149	601928	凤凰传媒	27,300	311,220.00	0.15
150	688100	威胜信息	10,379	309,397.99	0.15
151	603323	苏农银行	73,400	309,014.00	0.15
152	600155	华创云信	48,500	301,670.00	0.15
153	300751	迈为股份	1,780	301,496.40	0.15
154	600489	中金黄金	28,900	298,537.00	0.14
155	603858	步长制药	14,400	296,496.00	0.14

156	000988	华工科技	7,800	296,478.00	0.14
157	603228	景旺电子	11,400	292,410.00	0.14
158	601168	西部矿业	27,700	291,127.00	0.14
159	002065	东华软件	40,800	288,048.00	0.14
160	002250	联化科技	27,400	286,604.00	0.14
161	601801	皖新传媒	30,500	286,395.00	0.14
162	000997	新大陆	15,100	285,390.00	0.14
163	600161	天坛生物	10,500	285,075.00	0.14
164	601665	齐鲁银行	72,600	284,592.00	0.14
165	000001	平安银行	25,300	284,119.00	0.14
166	688111	金山办公	600	283,332.00	0.14
167	002410	广联达	8,700	282,663.00	0.14
168	300296	利亚德	43,113	281,527.89	0.14
169	002506	协鑫集成	95,600	280,108.00	0.13
170	300999	金龙鱼	7,000	279,930.00	0.13
171	601718	际华集团	94,100	279,477.00	0.13
172	003816	中国广核	89,500	278,345.00	0.13
173	600208	新湖中宝	111,000	275,280.00	0.13
174	000738	航发控制	11,200	273,280.00	0.13
175	600039	四川路桥	27,580	270,559.80	0.13
176	600845	宝信软件	5,280	268,276.80	0.13
177	002594	比亚迪	1,036	267,567.72	0.13
178	002078	太阳纸业	24,700	264,043.00	0.13
179	600352	浙江龙盛	28,200	263,670.00	0.13
180	600623	华谊集团	41,700	259,791.00	0.13
181	002074	国轩高科	9,400	259,628.00	0.13
182	600008	首创环保	88,500	254,880.00	0.12
183	002373	千方科技	18,600	253,704.00	0.12
184	000062	深圳华强	22,200	253,524.00	0.12
185	688599	天合光能	5,807	247,436.27	0.12
186	002180	纳思达	7,200	246,600.00	0.12
187	300142	沃森生物	9,200	243,340.00	0.12
188	600143	金发科技	27,800	242,694.00	0.12
189	600584	长电科技	7,600	236,892.00	0.11
190	603883	老百姓	7,900	235,815.00	0.11
191	688636	智明达	4,274	235,070.00	0.11
192	000100	TCL科技	58,940	232,223.60	0.11
193	600688	上海石化	74,600	232,006.00	0.11
194	300009	安科生物	23,100	231,000.00	0.11
195	002223	鱼跃医疗	6,400	230,336.00	0.11
196	002185	华天科技	24,900	229,080.00	0.11

197	600285	羚锐制药	14,200	228,052.00	0.11
198	600299	安迪苏	28,600	227,942.00	0.11
199	600908	无锡银行	42,000	225,120.00	0.11
200	603515	欧普照明	11,000	223,300.00	0.11
201	601997	贵阳银行	42,900	221,364.00	0.11
202	000027	深圳能源	33,400	220,106.00	0.11
203	300463	迈克生物	14,200	214,704.00	0.10
204	603019	中科曙光	4,200	213,780.00	0.10
205	300850	新强联	5,700	213,066.00	0.10
206	002268	电科网安	7,500	209,025.00	0.10
207	600487	亨通光电	14,200	208,172.00	0.10
208	600028	中国石化	32,700	207,972.00	0.10
209	600893	航发动力	4,900	207,074.00	0.10
210	002446	盛路通信	21,500	203,175.00	0.10
211	603920	世运电路	10,400	203,112.00	0.10
212	600848	上海临港	16,947	202,516.65	0.10
213	300035	中科电气	16,800	201,936.00	0.10
214	601901	方正证券	30,700	200,778.00	0.10
215	688779	长远锂科	17,600	198,352.00	0.10
216	002463	沪电股份	9,400	196,836.00	0.09
217	688777	中控技术	3,131	196,564.18	0.09
218	301090	华润材料	15,400	194,348.00	0.09
219	000425	徐工机械	28,500	192,945.00	0.09
220	002030	达安基因	19,091	190,337.27	0.09
221	600598	北大荒	14,200	189,286.00	0.09
222	688707	振华新材	6,131	188,773.49	0.09
223	300763	锦浪科技	1,800	187,380.00	0.09
224	600011	华能国际	20,100	186,126.00	0.09
225	002215	诺普信	24,700	185,497.00	0.09
226	002555	三七互娱	5,300	184,864.00	0.09
227	601360	三六零	14,300	179,322.00	0.09
228	002624	完美世界	10,600	179,034.00	0.09
229	300058	蓝色光标	18,400	177,928.00	0.09
230	300832	新产业	3,000	177,000.00	0.09
231	601118	海南橡胶	39,000	174,720.00	0.08
232	600988	赤峰黄金	12,900	173,634.00	0.08
233	300012	华测检测	8,900	173,550.00	0.08
234	600547	山东黄金	7,340	172,343.20	0.08
235	600436	片仔癀	600	171,816.00	0.08
236	601615	明阳智能	10,000	168,800.00	0.08
237	603639	海利尔	9,400	168,448.00	0.08

238	601098	中南传媒	14,400	167,040.00	0.08
239	601198	东兴证券	20,800	166,816.00	0.08
240	000977	浪潮信息	3,400	164,900.00	0.08
241	600663	陆家嘴	16,700	164,829.00	0.08
242	601717	郑煤机	13,200	164,340.00	0.08
243	601187	厦门银行	32,000	160,640.00	0.08
244	603301	振德医疗	5,400	159,948.00	0.08
245	000553	安道麦 A	18,900	159,516.00	0.08
246	600066	宇通客车	10,800	159,192.00	0.08
247	002028	思源电气	3,400	158,848.00	0.08
248	603600	永艺股份	16,600	157,866.00	0.08
249	603612	索通发展	9,100	157,703.00	0.08
250	603218	日月股份	8,300	157,617.00	0.08
251	600566	济川药业	5,400	156,816.00	0.08
252	000800	一汽解放	18,600	155,682.00	0.08
253	603599	广信股份	5,700	154,356.00	0.07
254	002563	森马服饰	24,500	152,390.00	0.07
255	600131	国网信通	7,510	151,626.90	0.07
256	601985	中国核电	21,500	151,575.00	0.07
257	002179	中航光电	3,340	151,469.00	0.07
258	603707	健友股份	11,100	149,850.00	0.07
259	300408	三环集团	5,100	149,685.00	0.07
260	688800	瑞可达	2,377	147,730.55	0.07
261	002195	二三四五	51,100	147,679.00	0.07
262	603444	吉比特	300	147,333.00	0.07
263	688002	睿创微纳	3,262	146,137.60	0.07
264	002439	启明星辰	4,900	145,824.00	0.07
265	600901	江苏金租	35,140	145,128.20	0.07
266	002032	苏泊尔	2,900	145,000.00	0.07
267	600718	东软集团	13,600	144,976.00	0.07
268	601608	中信重工	34,400	144,824.00	0.07
269	688008	澜起科技	2,500	143,550.00	0.07
270	600258	首旅酒店	7,500	142,125.00	0.07
271	600089	特变电工	6,300	140,427.00	0.07
272	002625	光启技术	9,200	140,392.00	0.07
273	300719	安达维尔	9,900	139,788.00	0.07
274	002745	木林森	15,000	138,000.00	0.07
275	002500	山西证券	24,700	137,826.00	0.07
276	600563	法拉电子	1,000	137,300.00	0.07
277	601939	建设银行	21,700	135,842.00	0.07
278	002839	张家港行	32,100	135,783.00	0.07

279	300474	景嘉微	1,500	134,985.00	0.07
280	300258	精锻科技	9,200	133,308.00	0.06
281	688267	中触媒	6,300	132,741.00	0.06
282	002241	歌尔股份	7,400	131,350.00	0.06
283	600025	华能水电	18,200	129,766.00	0.06
284	002467	二六三	25,800	128,226.00	0.06
285	688559	海目星	2,711	127,444.11	0.06
286	601288	农业银行	35,600	125,668.00	0.06
287	000598	兴蓉环境	23,100	125,433.00	0.06
288	600064	南京高科	18,800	124,268.00	0.06
289	300628	亿联网络	3,520	123,446.40	0.06
290	300253	卫宁健康	11,400	123,348.00	0.06
291	002049	紫光国微	1,300	121,225.00	0.06
292	002726	龙大美食	14,300	118,547.00	0.06
293	300132	青松股份	20,700	117,369.00	0.06
294	600900	长江电力	5,300	116,918.00	0.06
295	688733	壹石通	3,770	116,719.20	0.06
296	600183	生益科技	8,200	116,440.00	0.06
297	600409	三友化工	21,300	116,085.00	0.06
298	002245	蔚蓝锂芯	10,600	116,070.00	0.06
299	002484	江海股份	5,400	114,966.00	0.06
300	002475	立讯精密	3,428	111,238.60	0.05
301	601009	南京银行	13,900	111,200.00	0.05
302	301039	中集车辆	8,400	111,132.00	0.05
303	688185	康希诺	1,361	110,921.50	0.05
304	688105	诺唯赞	3,582	109,215.18	0.05
305	688521	芯原股份	1,500	107,880.00	0.05
306	002152	广电运通	9,200	107,824.00	0.05
307	603377	东方时尚	13,300	106,932.00	0.05
308	000932	华菱钢铁	22,400	106,848.00	0.05
309	002236	大华股份	5,400	106,650.00	0.05
310	688206	概伦电子	3,800	106,552.00	0.05
311	603160	汇顶科技	2,300	106,375.00	0.05
312	603214	爱婴室	6,500	105,755.00	0.05
313	688187	时代电气	2,500	104,650.00	0.05
314	601016	节能风电	28,320	103,934.40	0.05
315	000682	东方电子	10,600	103,032.00	0.05
316	002390	信邦制药	22,900	101,447.00	0.05
317	603799	华友钴业	2,200	101,002.00	0.05
318	300226	上海钢联	3,100	100,440.00	0.05
319	600346	恒力石化	7,000	100,310.00	0.05

320	002698	博实股份	5,700	99,693.00	0.05
321	688066	航天宏图	1,620	98,658.00	0.05
322	688078	龙软科技	1,900	97,945.00	0.05
323	603659	璞泰来	2,550	97,461.00	0.05
324	603466	风语筑	7,000	97,300.00	0.05
325	002925	盈趣科技	5,000	97,000.00	0.05
326	603989	艾华集团	4,600	96,876.00	0.05
327	600166	福田汽车	28,300	96,220.00	0.05
328	002025	航天电器	1,500	95,700.00	0.05
329	600549	厦门钨业	5,000	95,150.00	0.05
330	601162	天风证券	31,600	94,168.00	0.05
331	688201	信安世纪	2,200	94,028.00	0.05
332	002966	苏州银行	14,200	93,010.00	0.04
333	688299	长阳科技	5,900	92,453.00	0.04
334	000967	盈峰环境	18,300	92,415.00	0.04
335	603859	能科科技	1,800	92,034.00	0.04
336	600038	中直股份	2,300	91,586.00	0.04
337	600926	杭州银行	7,740	90,945.00	0.04
338	600369	西南证券	24,500	89,425.00	0.04
339	600761	安徽合力	4,400	87,692.00	0.04
340	300033	同花顺	500	87,640.00	0.04
341	601991	大唐发电	25,900	85,729.00	0.04
342	603195	公牛集团	888	85,301.28	0.04
343	002518	科士达	2,100	84,021.00	0.04
344	301117	佳缘科技	1,300	84,006.00	0.04
345	002434	万里扬	9,300	83,235.00	0.04
346	300803	指南针	1,700	82,603.00	0.04
347	002673	西部证券	13,000	82,550.00	0.04
348	601567	三星医疗	6,500	82,095.00	0.04
349	600989	宝丰能源	6,500	81,965.00	0.04
350	603158	腾龙股份	10,700	81,962.00	0.04
351	688722	同益中	4,400	81,576.00	0.04
352	002807	江阴银行	22,100	81,549.00	0.04
353	601908	京运通	13,400	81,070.00	0.04
354	601336	新华保险	2,200	80,894.00	0.04
355	300144	宋城演艺	6,500	80,600.00	0.04
356	600956	新天绿能	9,200	80,224.00	0.04
357	603317	天味食品	5,440	79,478.40	0.04
358	301488	豪恩汽电	1,982	78,843.96	0.04
359	300470	中密控股	1,700	78,574.00	0.04
360	601555	东吴证券	11,200	77,728.00	0.04

361	300860	锋尚文化	1,400	77,616.00	0.04
362	600009	上海机场	1,700	77,214.00	0.04
363	603056	德邦股份	5,000	77,100.00	0.04
364	300496	中科创达	800	77,080.00	0.04
365	002782	可立克	5,000	76,450.00	0.04
366	300015	爱尔眼科	4,112	76,277.60	0.04
367	600562	国睿科技	4,700	76,140.00	0.04
368	301486	致尚科技	1,314	75,765.24	0.04
369	600312	平高电气	6,100	75,579.00	0.04
370	301395	仁信新材	2,814	75,077.52	0.04
371	002396	星网锐捷	3,300	74,547.00	0.04
372	300618	寒锐钴业	2,300	74,543.00	0.04
373	300590	移为通信	6,100	74,542.00	0.04
374	300593	新雷能	3,240	74,228.40	0.04
375	002460	赣锋锂业	1,200	73,152.00	0.04
376	601126	四方股份	4,800	72,912.00	0.04
377	600377	宁沪高速	7,400	72,742.00	0.04
378	002081	金螳螂	16,100	72,611.00	0.03
379	688561	奇安信-U	1,400	72,534.00	0.03
380	000728	国元证券	11,100	72,372.00	0.03
381	603383	顶点软件	1,300	72,046.00	0.03
382	600498	烽火通信	3,500	71,295.00	0.03
383	600808	马钢股份	27,300	70,161.00	0.03
384	600927	永安期货	4,300	69,918.00	0.03
385	002926	华西证券	8,400	69,804.00	0.03
386	603309	维力医疗	4,500	69,615.00	0.03
387	603927	中科软	1,800	69,408.00	0.03
388	002859	洁美科技	2,500	69,250.00	0.03
389	600886	国投电力	5,400	68,310.00	0.03
390	002595	豪迈科技	1,900	66,747.00	0.03
391	603601	再升科技	15,600	66,612.00	0.03
392	000830	鲁西化工	6,300	66,528.00	0.03
393	002937	兴瑞科技	2,700	66,420.00	0.03
394	603303	得邦照明	4,800	66,288.00	0.03
395	603298	杭叉集团	2,800	65,940.00	0.03
396	688020	方邦股份	1,300	64,961.00	0.03
397	603290	斯达半导	300	64,560.00	0.03
398	300451	创业慧康	7,700	64,526.00	0.03
399	688208	道通科技	2,114	64,075.34	0.03
400	600673	东阳光	8,800	63,448.00	0.03
401	300767	震安科技	2,500	63,400.00	0.03

402	000568	泸州老窖	301	63,080.57	0.03
403	000876	新希望	5,400	63,072.00	0.03
404	603667	五洲新春	4,200	62,496.00	0.03
405	688180	君实生物	1,616	62,280.64	0.03
406	600372	中航电子	4,100	62,238.00	0.03
407	601228	广州港	19,100	61,693.00	0.03
408	300294	博雅生物	1,700	61,676.00	0.03
409	002421	达实智能	17,400	61,248.00	0.03
410	600376	首开股份	15,700	61,230.00	0.03
411	688603	天承科技	1,112	61,160.00	0.03
412	002056	横店东磁	3,300	60,093.00	0.03
413	002139	拓邦股份	4,600	60,030.00	0.03
414	601611	中国核建	7,100	59,995.00	0.03
415	300352	北信源	11,800	59,472.00	0.03
416	603589	口子窖	1,200	59,220.00	0.03
417	000783	长江证券	10,100	58,580.00	0.03
418	688772	珠海冠宇	2,900	58,435.00	0.03
419	600986	浙文互联	9,100	58,240.00	0.03
420	603306	华懋科技	2,000	58,040.00	0.03
421	300623	捷捷微电	3,200	57,984.00	0.03
422	600536	中国软件	1,230	57,662.40	0.03
423	605111	新洁能	1,320	57,446.40	0.03
424	002156	通富微电	2,500	56,500.00	0.03
425	600378	昊华科技	1,500	56,460.00	0.03
426	600873	梅花生物	6,300	56,259.00	0.03
427	603605	珀莱雅	500	56,200.00	0.03
428	000987	越秀资本	8,700	55,245.00	0.03
429	002990	盛视科技	1,500	55,200.00	0.03
430	688377	迪威尔	2,200	55,110.00	0.03
431	000898	鞍钢股份	19,700	54,766.00	0.03
432	000933	神火股份	4,200	54,600.00	0.03
433	300855	图南股份	1,540	54,392.80	0.03
434	002153	石基信息	3,880	54,320.00	0.03
435	603026	胜华新材	900	53,325.00	0.03
436	300708	聚灿光电	5,400	53,298.00	0.03
437	603986	兆易创新	500	53,125.00	0.03
438	002258	利尔化学	4,100	52,931.00	0.03
439	301202	朗威股份	2,049	52,905.18	0.03
440	002912	中新赛克	1,200	52,812.00	0.03
441	688157	松井股份	1,000	52,600.00	0.03
442	002929	润建股份	1,200	52,092.00	0.03

443	300017	网宿科技	7,300	51,903.00	0.03
444	301261	恒工精密	1,381	50,958.90	0.02
445	601688	华泰证券	3,690	50,811.30	0.02
446	002283	天润工业	7,900	50,718.00	0.02
447	600977	中国电影	3,600	50,580.00	0.02
448	300073	当升科技	1,000	50,330.00	0.02
449	301358	湖南裕能	1,168	50,095.52	0.02
450	600390	五矿资本	9,300	50,034.00	0.02
451	002020	京新药业	3,900	49,998.00	0.02
452	688107	安路科技	900	49,851.00	0.02
453	600210	紫江企业	9,200	48,944.00	0.02
454	600398	海澜之家	7,100	48,848.00	0.02
455	603898	好莱客	5,000	48,600.00	0.02
456	603067	振华股份	4,000	48,600.00	0.02
457	601677	明泰铝业	3,500	48,580.00	0.02
458	688608	恒玄科技	400	48,412.00	0.02
459	603378	亚士创能	5,300	48,283.00	0.02
460	600522	中天科技	3,000	47,730.00	0.02
461	603527	众源新材	3,900	47,658.00	0.02
462	002583	海能达	8,200	47,642.00	0.02
463	601377	兴业证券	7,700	47,124.00	0.02
464	002294	信立泰	1,500	46,785.00	0.02
465	002429	兆驰股份	8,500	46,750.00	0.02
466	600548	深高速	5,200	46,696.00	0.02
467	000825	太钢不锈	12,000	46,440.00	0.02
468	600315	上海家化	1,600	46,416.00	0.02
469	600399	抚顺特钢	4,500	45,900.00	0.02
470	601000	唐山港	12,900	45,537.00	0.02
471	300454	深信服	400	45,300.00	0.02
472	002727	一心堂	1,700	44,880.00	0.02
473	600639	浦东金桥	3,600	44,676.00	0.02
474	605333	沪光股份	2,700	44,658.00	0.02
475	300494	盛天网络	1,800	44,622.00	0.02
476	000739	普洛药业	2,500	44,350.00	0.02
477	000400	许继电气	1,900	43,795.00	0.02
478	300802	矩子科技	1,800	43,326.00	0.02
479	605166	聚合顺	4,600	42,872.00	0.02
480	000928	中钢国际	4,400	42,460.00	0.02
481	600789	鲁抗医药	6,600	42,372.00	0.02
482	688248	南网科技	1,100	42,229.00	0.02
483	600583	海油工程	7,200	42,120.00	0.02

484	688261	东微半导	300	41,961.00	0.02
485	603186	华正新材	1,200	41,280.00	0.02
486	600588	用友网络	2,000	41,000.00	0.02
487	600418	江淮汽车	3,200	40,288.00	0.02
488	688388	嘉元科技	1,489	40,083.88	0.02
489	603171	税友股份	1,000	39,980.00	0.02
490	002158	汉钟精机	1,600	39,936.00	0.02
491	600929	雪天盐业	5,000	39,700.00	0.02
492	603368	柳药集团	1,600	39,536.00	0.02
493	603611	诺力股份	1,500	39,510.00	0.02
494	603348	文灿股份	900	39,429.00	0.02
495	601139	深圳燃气	5,400	39,366.00	0.02
496	688270	臻镭科技	600	38,958.00	0.02
497	000039	中集集团	5,600	38,584.00	0.02
498	002812	恩捷股份	400	38,540.00	0.02
499	002419	天虹股份	6,400	37,440.00	0.02
500	301219	腾远钴业	1,000	37,360.00	0.02
501	000636	风华高科	2,400	36,816.00	0.02
502	002675	东诚药业	2,500	36,775.00	0.02
503	600938	中国海油	2,000	36,240.00	0.02
504	603987	康德莱	2,800	36,176.00	0.02
505	300861	美畅股份	833	36,127.21	0.02
506	300568	星源材质	2,100	36,099.00	0.02
507	002212	天融信	3,700	35,890.00	0.02
508	603757	大元泵业	1,200	35,808.00	0.02
509	300316	晶盛机电	500	35,450.00	0.02
510	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
511	002955	鸿合科技	1,500	35,325.00	0.02
512	300790	宇瞳光学	2,300	35,052.00	0.02
513	002483	润邦股份	6,000	34,800.00	0.02
514	300366	创意信息	2,800	34,608.00	0.02
515	002110	三钢闽光	8,200	34,604.00	0.02
516	300416	苏试试验	1,600	34,496.00	0.02
517	300121	阳谷华泰	3,600	34,380.00	0.02
518	300382	斯莱克	2,600	34,294.00	0.02
519	300130	新国都	1,200	33,996.00	0.02
520	300700	岱勒新材	1,780	33,909.00	0.02
521	600528	中铁工业	3,400	33,592.00	0.02
522	300622	博士眼镜	1,400	33,040.00	0.02
523	300532	今天国际	1,600	32,896.00	0.02
524	603919	金徽酒	1,400	32,872.00	0.02

525	300951	博硕科技	600	32,778.00	0.02
526	002683	广东宏大	1,100	32,384.00	0.02
527	600707	彩虹股份	6,800	32,368.00	0.02
528	600863	内蒙华电	7,600	31,540.00	0.02
529	301099	雅创电子	600	31,236.00	0.02
530	000089	深圳机场	4,400	30,580.00	0.01
531	301011	华立科技	1,300	30,459.00	0.01
532	603456	九洲药业	1,100	30,118.00	0.01
533	688385	复旦微电	600	30,060.00	0.01
534	002601	龙佰集团	1,800	29,700.00	0.01
535	603501	韦尔股份	300	29,412.00	0.01
536	601619	嘉泽新能	6,400	29,120.00	0.01
537	600812	华北制药	5,200	29,068.00	0.01
538	002752	昇兴股份	6,000	28,500.00	0.01
539	600282	南钢股份	8,400	28,308.00	0.01
540	688665	四方光电	300	27,936.00	0.01
541	688123	聚辰股份	520	27,934.40	0.01
542	688192	迪哲医药	800	27,760.00	0.01
543	600138	中青旅	2,200	27,522.00	0.01
544	000712	锦龙股份	2,200	27,456.00	0.01
545	688210	统联精密	1,400	27,328.00	0.01
546	688676	金盘科技	900	27,261.00	0.01
547	688106	金宏气体	1,000	27,200.00	0.01
548	688289	圣湘生物	1,600	26,944.00	0.01
549	300357	我武生物	800	26,904.00	0.01
550	000877	天山股份	3,300	26,862.00	0.01
551	002299	圣农发展	1,400	26,810.00	0.01
552	600995	南网储能	2,400	26,424.00	0.01
553	000875	吉电股份	4,800	25,872.00	0.01
554	300182	捷成股份	4,000	25,240.00	0.01
555	002399	海普瑞	2,200	25,234.00	0.01
556	300332	天壕环境	2,200	25,234.00	0.01
557	688531	日联科技	185	25,154.45	0.01
558	688225	亚信安全	1,200	25,140.00	0.01
559	688246	嘉和美康	600	25,122.00	0.01
560	603579	荣泰健康	1,200	25,104.00	0.01
561	688276	百克生物	400	25,040.00	0.01
562	002129	TCL 中环	750	24,900.00	0.01
563	688798	艾为电子	420	24,843.00	0.01
564	300735	光弘科技	2,300	24,610.00	0.01
565	300203	聚光科技	1,200	24,324.00	0.01

566	000937	冀中能源	3,800	24,244.00	0.01
567	603005	晶方科技	1,200	24,240.00	0.01
568	600655	豫园股份	3,500	24,010.00	0.01
569	688089	嘉必优	800	23,840.00	0.01
570	688006	杭可科技	780	23,766.60	0.01
571	300604	长川科技	500	23,745.00	0.01
572	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.01
573	300681	英搏尔	1,100	23,419.00	0.01
574	600968	海油发展	7,600	23,332.00	0.01
575	300274	阳光电源	200	23,326.00	0.01
576	300871	回盛生物	1,400	23,072.00	0.01
577	605136	丽人丽妆	2,000	23,060.00	0.01
578	600054	黄山旅游	1,800	23,040.00	0.01
579	002950	奥美医疗	2,200	22,836.00	0.01
580	300251	光线传媒	2,800	22,652.00	0.01
581	603098	森特股份	1,100	22,550.00	0.01
582	688308	欧科亿	560	22,400.00	0.01
583	002233	塔牌集团	2,900	22,388.00	0.01
584	603185	弘元绿能	300	22,365.00	0.01
585	301029	怡合达	500	22,340.00	0.01
586	600029	南方航空	3,700	22,311.00	0.01
587	300687	赛意信息	800	22,224.00	0.01
588	688166	博瑞医药	1,000	21,990.00	0.01
589	688132	邦彦技术	800	21,744.00	0.01
590	688005	容百科技	400	21,608.00	0.01
591	601958	金钼股份	1,900	21,185.00	0.01
592	605599	菜百股份	1,600	21,136.00	0.01
593	002466	天齐锂业	300	20,973.00	0.01
594	688518	联赢激光	750	20,895.00	0.01
595	600918	中泰证券	3,000	20,730.00	0.01
596	603939	益丰药房	560	20,720.00	0.01
597	002988	豪美新材	1,200	20,508.00	0.01
598	000581	威孚高科	1,300	20,475.00	0.01
599	600115	中国东航	4,300	20,468.00	0.01
600	688039	当虹科技	560	20,070.40	0.01
601	603826	坤彩科技	400	20,000.00	0.01
602	603219	富佳股份	1,400	19,950.00	0.01
603	688249	晶合集成	1,099	19,847.94	0.01
604	600516	方大炭素	3,200	19,840.00	0.01
605	301246	宏源药业	645	19,807.95	0.01
606	000031	大悦城	5,400	19,764.00	0.01

607	300034	钢研高纳	500	19,695.00	0.01
608	300636	同和药业	1,600	19,616.00	0.01
609	605300	佳禾食品	900	19,566.00	0.01
610	600745	闻泰科技	400	19,560.00	0.01
611	002497	雅化集团	1,100	19,558.00	0.01
612	600511	国药股份	500	19,425.00	0.01
613	301322	绿通科技	364	19,379.36	0.01
614	600529	山东药玻	700	19,054.00	0.01
615	688291	金橙子	600	18,996.00	0.01
616	000703	恒逸石化	2,800	18,984.00	0.01
617	600552	凯盛科技	1,600	18,944.00	0.01
618	605376	博迁新材	600	18,828.00	0.01
619	601919	中远海控	2,000	18,800.00	0.01
620	600867	通化东宝	1,800	18,792.00	0.01
621	601778	晶科科技	3,800	18,772.00	0.01
622	600755	厦门国贸	2,400	18,576.00	0.01
623	300133	华策影视	2,600	18,434.00	0.01
624	605358	立昂微	500	18,365.00	0.01
625	000050	深天马A	2,000	18,360.00	0.01
626	000785	居然之家	4,800	18,288.00	0.01
627	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.01
628	600167	联美控股	2,600	18,122.00	0.01
629	603551	奥普家居	1,400	18,102.00	0.01
630	688028	沃尔德	800	17,920.00	0.01
631	688558	国盛智科	500	17,880.00	0.01
632	600419	天润乳业	1,100	17,842.00	0.01
633	688056	莱伯泰科	400	17,736.00	0.01
634	688484	南芯科技	477	17,510.67	0.01
635	603191	望变电气	900	17,505.00	0.01
636	688711	宏微科技	300	17,502.00	0.01
637	688508	芯朋微	300	17,397.00	0.01
638	002430	杭氧股份	500	17,180.00	0.01
639	605088	冠盛股份	1,000	17,150.00	0.01
640	688202	美迪西	200	17,050.00	0.01
641	605266	健之佳	200	16,766.00	0.01
642	300115	长盈精密	1,400	16,674.00	0.01
643	603330	天洋新材	1,500	16,665.00	0.01
644	601882	海天精工	500	16,650.00	0.01
645	603416	信捷电气	400	16,524.00	0.01
646	002266	浙富控股	4,000	16,520.00	0.01
647	603886	元祖股份	900	16,506.00	0.01

648	688268	华特气体	200	16,146.00	0.01
649	688302	海创药业	300	15,936.00	0.01
650	300887	谱尼测试	400	15,832.00	0.01
651	002034	旺能环境	1,000	15,810.00	0.01
652	688021	奥福环保	600	15,552.00	0.01
653	001287	中电港	736	15,470.72	0.01
654	601007	金陵饭店	1,800	15,336.00	0.01
655	603556	海兴电力	600	15,144.00	0.01
656	301349	信德新材	300	15,042.00	0.01
657	688179	阿拉丁	500	14,930.00	0.01
658	300768	迪普科技	900	14,913.00	0.01
659	301408	华人健康	879	14,899.05	0.01
660	688778	厦钨新能	300	14,850.00	0.01
661	301367	怡和嘉业	100	14,834.00	0.01
662	300143	盈康生命	1,300	14,742.00	0.01
663	688236	春立医疗	600	14,700.00	0.01
664	002155	湖南黄金	1,200	14,640.00	0.01
665	603906	龙蟠科技	800	14,520.00	0.01
666	688472	阿特斯	849	14,466.96	0.01
667	688168	安博通	400	14,240.00	0.01
668	002126	银轮股份	800	14,160.00	0.01
669	002653	海思科	600	14,160.00	0.01
670	002545	东方铁塔	2,000	14,120.00	0.01
671	601827	三峰环境	1,900	14,060.00	0.01
672	688239	航宇科技	200	13,990.00	0.01
673	688361	中科飞测-U	216	13,968.72	0.01
674	301387	光大同创	307	13,925.52	0.01
675	603678	火炬电子	400	13,784.00	0.01
676	002064	华峰化学	2,000	13,720.00	0.01
677	300413	芒果超媒	400	13,684.00	0.01
678	301293	三博脑科	190	13,569.80	0.01
679	300796	贝斯美	1,100	13,233.00	0.01
680	002987	京北方	600	13,152.00	0.01
681	002270	华明装备	1,200	13,140.00	0.01
682	688551	科威尔	200	13,116.00	0.01
683	300806	斯迪克	700	13,104.00	0.01
684	603267	鸿远电子	200	13,060.00	0.01
685	300396	迪瑞医疗	400	12,996.00	0.01
686	601077	渝农商行	3,600	12,924.00	0.01
687	002092	中泰化学	2,000	12,900.00	0.01
688	300955	嘉亨家化	600	12,780.00	0.01

689	600350	山东高速	2,000	12,740.00	0.01
690	600426	华鲁恒升	400	12,252.00	0.01
691	688680	海优新材	100	12,182.00	0.01
692	688469	中芯集成	2,229	12,058.89	0.01
693	600201	生物股份	1,200	11,412.00	0.01
694	600170	上海建工	4,200	11,298.00	0.01
695	603809	豪能股份	1,000	11,230.00	0.01
696	300792	壹网壹创	400	11,028.00	0.01
697	605377	华旺科技	600	10,830.00	0.01
698	688352	颀中科技	882	10,645.74	0.01
699	603855	华荣股份	400	10,640.00	0.01
700	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.01
701	688139	海尔生物	200	10,294.00	0.00
702	002318	久立特材	600	10,218.00	0.00
703	600817	宇通重工	900	10,071.00	0.00
704	301315	威士顿	192	9,815.04	0.00
705	301345	涛涛车业	209	9,747.76	0.00
706	003011	海象新材	300	9,675.00	0.00
707	600985	淮北矿业	800	9,216.00	0.00
708	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
709	300770	新媒股份	200	9,172.00	0.00
710	688576	西山科技	75	9,030.75	0.00
711	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
712	002948	青岛银行	2,800	8,764.00	0.00
713	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
714	301193	家联科技	480	8,414.40	0.00
715	688593	新相微	568	8,287.12	0.00
716	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
717	300481	濮阳惠成	400	8,224.00	0.00
718	688543	国科军工	147	7,798.35	0.00
719	603136	天目湖	300	7,740.00	0.00
720	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
721	301262	海看股份	300	7,650.00	0.00
722	600535	天士力	500	7,255.00	0.00
723	688523	航天环宇	304	7,250.40	0.00
724	603693	江苏新能	500	7,000.00	0.00
725	301332	德尔玛	495	6,796.35	0.00
726	301225	恒勃股份	204	6,785.04	0.00
727	688429	时创能源	265	6,765.45	0.00
728	601117	中国化学	800	6,624.00	0.00
729	300804	广康生化	197	6,495.09	0.00

730	688458	美芯晟	71	6,443.96	0.00
731	301376	致欧科技	269	6,055.19	0.00
732	601065	江盐集团	511	6,050.24	0.00
733	301170	锡南科技	169	5,903.17	0.00
734	601298	青岛港	800	5,576.00	0.00
735	688631	莱斯信息	184	5,496.08	0.00
736	688581	安杰思	46	5,429.38	0.00
737	603355	莱克电气	200	5,082.00	0.00
738	301337	亚华电子	166	5,041.42	0.00
739	301323	新莱福	123	4,841.28	0.00
740	002609	捷顺科技	400	4,664.00	0.00
741	002063	远光软件	500	4,340.00	0.00
742	603489	八方股份	60	4,207.20	0.00
743	688623	二元科技	48	4,165.92	0.00
744	601669	中国电建	700	4,018.00	0.00
745	688479	友车科技	136	4,010.64	0.00
746	002332	仙琚制药	300	3,975.00	0.00
747	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
748	300101	振芯科技	200	3,878.00	0.00
749	600171	上海贝岭	200	3,650.00	0.00
750	001380	华纬科技	98	3,016.44	0.00
751	001282	三联锻造	87	2,873.61	0.00
752	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
753	001324	长青科技	111	2,175.60	0.00
754	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
755	002001	新和成	100	1,540.00	0.00
756	600061	国投资本	200	1,424.00	0.00
757	002176	江特电机	100	1,192.00	0.00
758	600110	诺德股份	100	724.00	0.00
759	000959	首钢股份	200	700.00	0.00
760	600027	华电国际	100	669.00	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	600809	山西汾酒	4,851,113.00	0.53
2	601319	中国人保	4,199,712.00	0.46
3	002049	紫光国微	4,170,648.00	0.45
4	600050	中国联通	4,034,948.00	0.44
5	600406	国电南瑞	3,694,358.00	0.40

6	000333	美的集团	3,638,055.90	0.40
7	000725	京东方A	3,435,944.00	0.37
8	601998	中信银行	3,385,069.00	0.37
9	601766	中国中车	3,204,324.00	0.35
10	000858	五粮液	3,098,625.00	0.34
11	603993	洛阳钼业	2,980,732.00	0.32
12	300124	汇川技术	2,964,606.00	0.32
13	688981	中芯国际	2,849,600.68	0.31
14	002050	三花智控	2,675,065.00	0.29
15	600219	南山铝业	2,599,562.00	0.28
16	600031	三一重工	2,587,736.00	0.28
17	002475	立讯精密	2,493,152.00	0.27
18	300014	亿纬锂能	2,386,806.00	0.26
19	300059	东方财富	2,326,978.00	0.25
20	600039	四川路桥	2,281,936.01	0.25

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	25,064,065.00	2.72
2	002594	比亚迪	12,854,544.00	1.40
3	000568	泸州老窖	11,606,461.00	1.26
4	300750	宁德时代	11,275,108.00	1.22
5	601318	中国平安	10,012,662.00	1.09
6	002304	洋河股份	8,380,431.00	0.91
7	601899	紫金矿业	8,375,524.00	0.91
8	600438	通威股份	7,924,693.00	0.86
9	002129	TCL 中环	7,590,270.00	0.82
10	000858	五粮液	7,466,062.50	0.81
11	601012	隆基绿能	7,356,283.12	0.80
12	601390	中国中铁	7,355,948.00	0.80
13	600489	中金黄金	7,039,617.00	0.76
14	601658	邮储银行	6,678,240.00	0.73
15	688981	中芯国际	6,438,531.28	0.70
16	000651	格力电器	6,318,946.00	0.69
17	600050	中国联通	6,198,485.00	0.67
18	601857	中国石油	6,001,871.00	0.65
19	002050	三花智控	5,935,790.00	0.64
20	002030	达安基因	5,735,392.36	0.62

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	462,308,821.05
卖出股票收入（成交）总额	1,049,609,619.73

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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 160,458,773.43 元，占基金资产净值的比例为 77.33%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 154,134,720.00 元，占基金资产净值的比例为 74.28%，空头合约市值占股票资产的比例为 96.06%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-6,582,985.10 元，公

允价值变动损益为 20,440,143.88 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，中国平安保险(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

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	18,847,332.61
2	应收清算款	381,668.31
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	330,138.92
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	19,559,139.84

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	987	101,395.65	76,323,108.81	76.26	23,754,401.37	23.74
富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C	616	152,800.59	83,400,526.95	88.61	10,724,638.23	11.39
合计	1,603	121,149.52	159,723,635.76	82.25	34,479,039.60	17.75

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	584,861.86	0.5844
	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 C	20.01	0.0000
	合计	584,881.87	0.3012

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	富国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
	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
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	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
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	539,900,769.02	351,578,532.92
本报告期基金总申购份额	21,455,394.51	27,855,158.32
减：本报告期基金总赎回份额	461,278,653.35	285,308,526.06
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	100,077,510.18	94,125,165.18

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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	5,660,321.59	0.38	4,082.72	0.38	—
诚通证券	2	63,285,668.02	4.20	45,647.75	4.20	—
东方证券	2	36,650,257.41	2.44	26,435.80	2.44	—
东吴证券	2	235,697,005.87	15.66	170,009.18	15.66	—

方正证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	2	14,785,706.20	0.98	10,665.12	0.98	—
国盛证券	2	142,220,644.12	9.45	102,584.36	9.45	—
海通证券	2	35,805,271.82	2.38	25,826.09	2.38	—
华泰证券	2	168,933,292.30	11.22	121,847.32	11.22	—
华西证券	2	—	—	—	—	—
民生证券	3	283,283,271.66	18.82	204,328.08	18.82	—
申港证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	2	16,342,404.72	1.09	11,787.95	1.09	—
太平洋证券	2	185,850,509.19	12.35	134,045.67	12.35	—
银河证券	2	222,132,006.17	14.76	160,224.96	14.76	—
浙商证券	2	60,504,103.18	4.02	43,639.87	4.02	—
中金公司	2	33,370,640.20	2.22	24,070.06	2.22	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中信证券	2	528,593.25	0.04	381.28	0.04	—

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。

10.7.2 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	4,418.33	0.02	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	498,920.00	2.06	—	—	—	—
海通证券	7,507,937.04	30.95	—	—	—	—
华泰证券	4,656,256.98	19.19	—	—	—	—
华西证券	—	—	—	—	—	—

民生证券	11,572,176.40	47.70	—	—	—	—
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	21,031.42	0.09	—	—	—	—

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	2023年02月02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	2023年03月25日
3	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金开通定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2023年03月30日
4	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	2023年05月04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	2023-01-10 至 2023-02-19	—	—	—	—	—
	2	2023-01-01 至 2023-03-30	215,309,976.73	—	215,309,976.73	—	—
	3	2023-04-04 至 2023-04-09	44,626,670.35	—	12,253,247.62	32,373,422.73	16.67%
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		