

富国致航量化选股股票型证券投资基金

二〇二五年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中信建投证券股份有限公司

送出日期： 2025 年 08 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	6
2.1	基金基本情况	6
2.2	基金产品说明	6
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	9
§ 4	管理人报告	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	14
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	16
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	17
§ 5	托管人报告	18
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	18
§ 6	中期财务报告（未经审计）	19
6.1	资产负债表	19
6.2	利润表	20
6.3	净资产变动表	21
6.4	报表附注	22
§ 7	投资组合报告	48

7.1	期末基金资产组合情况.....	48
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	49
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
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.....	64
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..	64
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..	64
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.....	64
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	64
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.12	投资组合报告附注.....	65
§ 8	基金份额持有人信息	67
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
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.....	67
§ 9	开放式基金份额变动	68
§ 10	重大事件揭示.....	69
10.1	基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4	基金投资策略的改变.....	69
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
10.8	其他重大事件.....	71
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	72
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	72
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	72
§ 12	备查文件目录.....	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国致航量化选股股票型证券投资基金	
基金简称	富国致航量化选股股票	
基金主代码	019561	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 12 月 05 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	51,720,029.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国致航量化选股股票 A	富国致航量化选股股票 C
下属分级基金的交易代码	019561	019562
报告期末下属分级基金的份额总额	19,472,835.52 份	32,247,194.32 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、公司价值评估以及组合风险管理全过程中。在股票投资方面，本基金通过定性和定量分析相结合的方法对上市公司基本面、估值、成长性等进行深入分析，并根据市场状况及变化，不定期对策略权重进行优化调整，力求获得超越业绩比较基准的投资回报；本基金投资存托凭证将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断进行投资；在债券投资方面，本基金将采用久期控制下的主动性投资策略；本基金的股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、信用衍生品的投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	朱志明
	联系电话	021-20361818	4008-888-108
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	service@csc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95587
传真		021-20361616	010-56162085

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	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
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	北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 8 层/18 层, 北京市朝阳区光华路 10 号院中信大厦 82 层
邮政编码	200120	100010
法定代表人	裴长江	刘成

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 中信建投证券股份有限公司 北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 8 层/18 层, 北京市朝阳区光华路 10 号院中信大厦 82 层

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) 富国致航量化选股股票 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	476,771.43
本期利润	1,445,119.19
加权平均基金份额本期利润	0.0531
本期加权平均净值利润率	5.17%
本期基金份额净值增长率	5.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	1,402,850.66
期末可供分配基金份额利润	0.0720
期末基金资产净值	20,875,686.18
期末基金份额净值	1.0720
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	7.20%

(2) 富国致航量化选股股票 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	654,019.85
本期利润	2,167,450.40
加权平均基金份额本期利润	0.0450
本期加权平均净值利润率	4.42%
本期基金份额净值增长率	4.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	1,997,095.18
期末可供分配基金份额利润	0.0619
期末基金资产净值	34,244,289.50
期末基金份额净值	1.0619
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	6.19%

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) 富国致航量化选股股票 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	3.04%	0.54%	4.09%	0.75%	-1.05%	-0.21%
过去三个月	3.82%	1.29%	0.97%	1.43%	2.85%	-0.14%
过去六个月	5.10%	1.19%	3.21%	1.29%	1.89%	-0.10%
过去一年	19.07%	1.53%	18.83%	1.64%	0.24%	-0.11%
自基金合同生效起至今	7.20%	1.42%	6.37%	1.57%	0.83%	-0.15%

(2) 富国致航量化选股股票 C

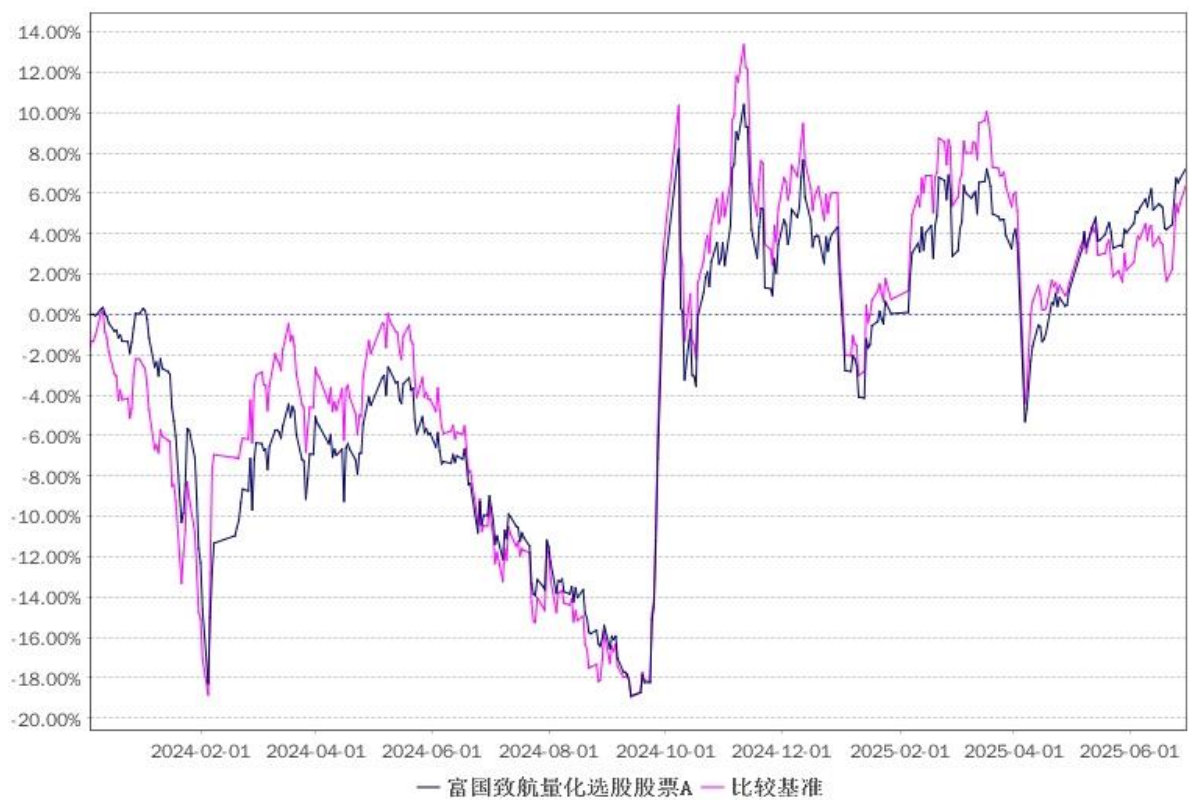
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	2.98%	0.54%	4.09%	0.75%	-1.11%	-0.21%
过去三个月	3.66%	1.29%	0.97%	1.43%	2.69%	-0.14%
过去六个月	4.79%	1.19%	3.21%	1.29%	1.58%	-0.10%
过去一年	18.36%	1.53%	18.83%	1.64%	-0.47%	-0.11%
自基金合同生效起至今	6.19%	1.42%	6.37%	1.57%	-0.18%	-0.15%

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致航量化选股股票 A 基金累计净值增长率变动及

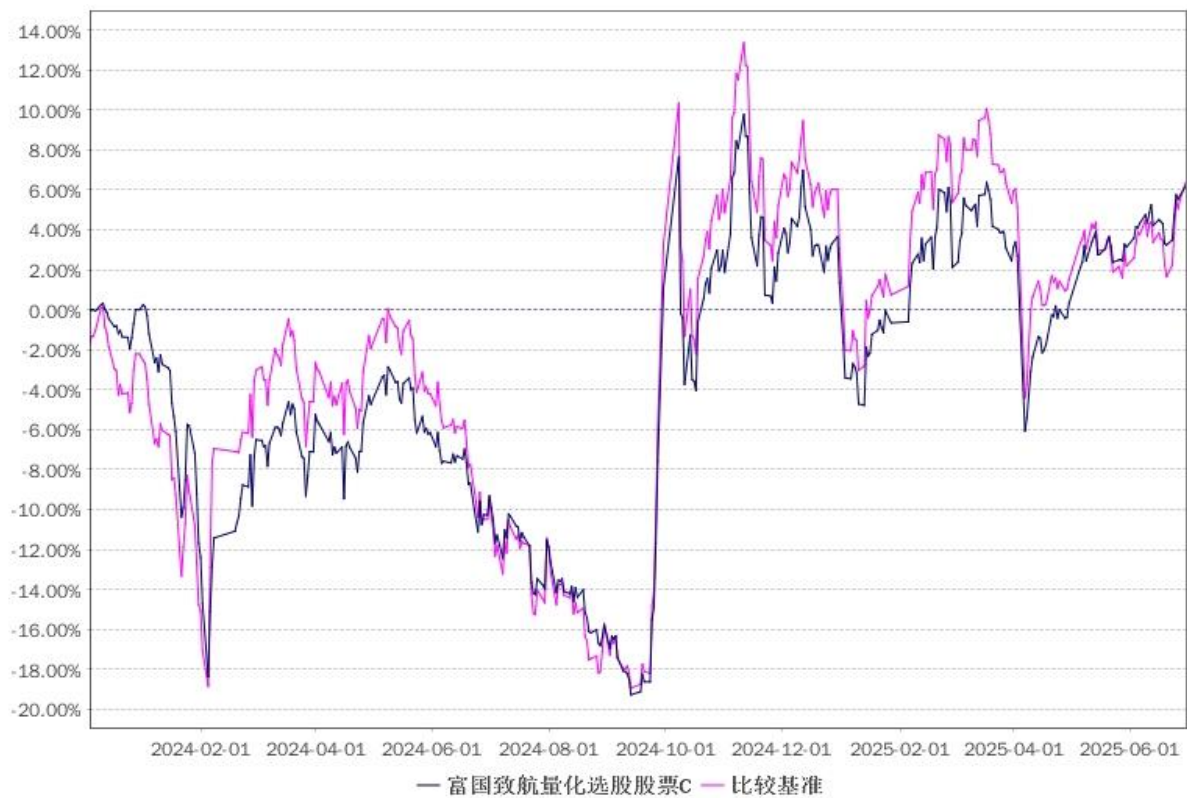
其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2023 年 12 月 5 日成立，建仓期 6 个月，从 2023 年 12 月 5 日起至 2024 年 6 月 4 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

（2）自基金合同生效以来富国致航量化选股股票 C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2023 年 12 月 5 日成立，建仓期 6 个月，从 2023 年 12 月 5 日起至 2024 年 6 月 4 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安（以下简称“存续公司”）承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持本公司股权亦归属于存续公司，即存续公司成为本公司的主要股东。根据 2025 年 4 月 4 日《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，存续公司正式更名为“国泰海通证券股份有限公司”。

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、

富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 391 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王保合	本基金现任基金经理	2023-12-05	—	19	博士，自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监、量化与海外投资部量化投资总监、量化投资部总经理；现任富国基金总经理助理，兼任富国基金量化投资部总经理、资深定量基金经理。自 2011 年 03 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2011 年 03 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 04 月起任富国中证国有企业改革指数型证券投资基金(原富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金)基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证全指证券公司指数型证券投资基金(原富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金)基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证银行指数型证券投资基金(原富国中证银行指数分级证券投资基金)基金经理；自 2020 年 09 月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2022 年 10 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 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国创业板增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 09 月起任富国致弘量化选股股票型证券投资基金基金经理；自 2023 年 12 月起任富国致航量化选股股票型证

					券投资基金基金经理；自 2025 年 06 月起任富国致享量化选股股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
王保合	公募基金	12	10,758,411,510.56	2011-03-03
	私募资产管理计划	2	57,379,849.61	2025-05-21
	其他组合	1	485,921,174.95	2025-06-27
	合计	15	11,301,712,535.12	

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和相关法规要求，制定了《证券投资公平交易管理办法》，保证公司旗下不同投资组合在系统控制、日常操作层面享有公平的交易机会，并保持各投资组合的独立投资决策权。

本报告期内公司旗下基金严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间，出现 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，为投资组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平对待投资组合或利益输送等情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年初，外部关税担忧给全球风险资产带来扰动，市场迎来快速调整。春节后，国内大模型的出现，缩小了市场对于中美 AI 发展前景的认知差异，市场以 AI 为核心开启了新一轮上行，内外资共振流入重估中国资产。随着两会积极的政策定调、以及一系列更加聚焦需求侧、民生侧的政策密集落地，市场由前期 AI 板块的“一枝独秀”，逐步扩散至消费、金融、周期等低位顺周期板块。4 月初，由于美国对全球加征不合理关税，中国随后进行反制，中美关税摩擦逐步升级，中美进入“不可贸易”状态。美国滥施关税给全球资本市场带来大规模冲击。4 月 8 日，中央汇金发布公告，通过增持 ETF 进入市场，同时中央部门、地方政府与上市公司合力维护市场稳定，指数稳步上行。国内方面，5 月 7 日国内推出一揽子金融支持政策，包含全面降准降息、维护股市楼市。海外方面，中美在关税问题上达成共识，缓解贸易摩擦该阶段市场普涨。5 月中旬起，由于海外关税存在反复，美债及日债拍卖利率跳升，对全球市场流动性存在扰动，同时伊朗与以色列冲突加剧全球避险情绪，市场整体振幅加大。6 月下旬，随着伊朗与以色列阶段性停火，鲍威尔表态偏鸽、美联储 7 月降息的可能性提升，市场开始反弹。

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

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极获取超额收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金份额净值富国致航量化选股股票 A 为 1.072 元，富国致航量化选股股票 C 为 1.0619 元；份额累计净值富国致航量化选股股票 A 为 1.072 元，富国致航量化选股股票 C 为 1.0619 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国致航量化选股股票 A 为 5.10%，富国致航量化选股股票 C 为 4.79%；同期业绩比较基准收益率情况：富国致航量化选股股票 A 为 3.21%，富国致航量化选股股票 C 为 3.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人在托管本基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关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真实、准确和完整发表意见

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§ 6 中期财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国致航量化选股股票型证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	5,511,460.59	7,404,633.35
结算备付金	—	—
存出保证金	—	—
交易性金融资产	50,366,653.94	93,520,325.69
其中：股票投资	50,366,653.94	93,520,325.69
基金投资	—	—
债券投资	—	—
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	—	—
应收股利	—	—
应收申购款	10,211.99	412.26
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	55,888,326.52	100,925,371.30
负债和净资产	本期末	上年度末
	2025 年 06 月 30 日	2024 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	—	—
应付赎回款	448,542.25	640,258.15
应付管理人报酬	57,531.52	114,492.79
应付托管费	9,588.61	19,082.11
应付销售服务费	17,843.01	34,967.78
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	234,845.45	168,781.05
负债合计	768,350.84	977,581.88
净资产：		
实收基金	51,720,029.84	98,388,412.37
其他综合收益	—	—
未分配利润	3,399,945.84	1,559,377.05
净资产合计	55,119,975.68	99,947,789.42
负债和净资产总计	55,888,326.52	100,925,371.30

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0657 元，基金份额总额 51,720,029.84 份。其中：富国致航量化选股股票 A 份额净值 1.0720 元，份额总额 19,472,835.52 份；富国致航量化选股股票 C 份额净值 1.0619 元，份额总额 32,247,194.32 份。

6.2 利润表

会计主体：富国致航量化选股股票型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	4,363,829.15	-38,376,534.95
1. 利息收入	19,303.12	74,200.31
其中：存款利息收入	19,303.12	74,200.31
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）	1,848,977.31	-24,712,333.76
其中：股票投资收益	992,668.77	-28,303,269.07
基金投资收益	—	—
债券投资收益	996.55	—
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	855,311.99	3,590,935.31
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）	2,481,778.31	-13,927,027.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	13,770.41	188,626.33
减：二、营业总支出	751,259.56	2,696,492.30
1. 管理人报酬	461,165.58	1,755,212.69
2. 托管费	76,860.93	292,535.48
3. 销售服务费	146,856.40	569,847.07
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	—	—
8. 其他费用	66,376.65	78,897.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	3,612,569.59	-41,073,027.25
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	3,612,569.59	-41,073,027.25
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	3,612,569.59	-41,073,027.25

6.3 净资产变动表

会计主体：富国致航量化选股股票型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2025年01月01日至2025年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	98,388,412.37	1,559,377.05	99,947,789.42
二、本期期初净资产	98,388,412.37	1,559,377.05	99,947,789.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	—	1,840,568.79	—
46,668,382.53			44,827,813.74
（一）、综合收益总额	—	3,612,569.59	3,612,569.59
（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）	—	-1,772,000.80	—
46,668,382.53			48,440,383.33
其中：1. 基金申购款	632,508.05	18,472.12	650,980.17
2. 基金赎回款	—	-1,790,472.92	—
47,300,890.58			49,091,363.50
（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	51,720,029.84	3,399,945.84	55,119,975.68
项目	上年度可比期间 (2024年01月01日至2024年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	450,330,869.72	-1,141.66	450,329,728.06
二、本期期初净资产	450,330,869.72	-1,141.66	450,329,728.06
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	199,783,880.97	25,475,206.40	225,259,087.37
(一)、综合收益总额	—	41,073,027.25	41,073,027.25
(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)	199,783,880.97	15,597,820.85	184,186,060.12
其中: 1. 基金申购款	21,860,392.67	-1,279,266.50	20,581,126.17
2. 基金赎回款	221,644,273.64	16,877,087.35	204,767,186.29
(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	250,546,988.75	-25,476,348.06	225,070,640.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国致航量化选股股票型证券投资基金(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[2023]2066号文《关于准予富国致航量化选股股票型证券投资基金注册的批复》准予公开募集注册。由基金管理人富国基金管理有限公司自2023年11月20日至2023年12月1日止

期间向社会公开发行人募集，募集期结束经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具德师报（验）字（23）第 00290 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2023 年 12 月 05 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。富国致航量化选股股票型证券投资基金收到的净有效认购金额为人民币 450,186,903.10 元，其中归属于 A 类基金份额为人民币 144,249,085.16 元，归属于 C 类基金份额为人民币 305,937,817.94 元。经基金注册登记机构计算并确认的认购资金利息计人民币 143,966.62 元，其中归属于 A 类基金份额为 51,682.72 元，归属于 C 类基金份额 92,283.90 元。合计为人民币 450,330,869.72 元，折算基金份额计 450,330,869.72 份。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司，中信建投证券股份有限公司担任基金托管人。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、可转换债券、分离交易可转换债券、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）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股指期货、信用衍生品、国债期货、股票期权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）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。在未来条件许可的情况下，本基金可根据相关法律法规，在履行适当程序后，参与融券业务和转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为：本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权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。

如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

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

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

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

务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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

2 增值税

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

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

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

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

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

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4 企业所得税

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

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

5 个人所得税

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2025 年 06 月 30 日)
活期存款	2,382,164.33
等于：本金	2,381,238.87
加：应计利息	925.46
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	3,129,296.26
等于：本金	3,129,045.66
加：应计利息	250.60
减：坏账准备	—
合计	5,511,460.59

注：本基金本报告期末未持有定期存款。其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 (2025 年 06 月 30 日)			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		49,135,958.78	—	50,366,653.94	1,230,695.16
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		49,135,958.78	—	50,366,653.94	1,230,695.16

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2025 年 06 月 30 日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	481.24
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	180,000.00
预提审计费	54,364.21
合计	234,845.45

6.4.7.7 实收基金

富国致航量化选股股票 A：

金额单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,872,677.43	35,872,677.43
本期申购	188,205.82	188,205.82
本期赎回（以“-”号填列）	-16,588,047.73	-16,588,047.73
本期末	19,472,835.52	19,472,835.52

富国致航量化选股股票 C：

金额单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	62,515,734.94	62,515,734.94
本期申购	444,302.23	444,302.23
本期赎回（以“-”号填列）	-30,712,842.85	-30,712,842.85
本期末	32,247,194.32	32,247,194.32

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

富国致航量化选股股票 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	3,589,450.37	2,870,501.87	718,948.50
本期期初	3,589,450.37	2,870,501.87	718,948.50
本期利润	476,771.43	968,347.76	1,445,119.19
本期基金份额交易产生的变动数	1,657,526.43	896,309.40	-761,217.03
其中：基金申购款	21,655.22	-14,366.65	7,288.57
基金赎回款	1,679,181.65	910,676.05	-768,505.60
本期已分配利润	—	—	—
本期末	2,408,695.37	1,005,844.71	1,402,850.66

富国致航量化选股股票 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	5,808,408.39	4,967,979.84	840,428.55
本期期初	5,808,408.39	4,967,979.84	840,428.55
本期利润	654,019.85	1,513,430.55	2,167,450.40
本期基金份额交易产生的	—	1,798,809.0	-1,010,783.77

变动数	2,809,592.78	1	
其中：基金申购款	44,134.06	-32,950.51	11,183.55
基金赎回款	2,853,726.84	1,831,759.52	-1,021,967.32
本期已分配利润	—	—	—
本期末	3,652,835.46	1,655,740.28	1,997,095.18

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
活期存款利息收入	14,020.66
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	5,277.45
结算备付金利息收入	—
其他	5.01
合计	19,303.12

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
卖出股票成交总额	399,045,121.61
减：卖出股票成本总额	397,627,597.43
减：交易费用	424,855.41
买卖股票差价收入	992,668.77

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
债券投资收益——利息收入	1.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	995.22
合计	996.55

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（2025年01月01日至2025年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,396.84
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,400.00
减：应计利息总额	1.33
减：交易费用	0.29
买卖债券差价收入	995.22

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
股票投资产生的股利收益	855,311.99
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	855,311.99

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
1. 交易性金融资产	2,481,778.31
股票投资	2,481,778.31
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	2,481,778.31

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
基金赎回费收入	13,451.64
基金转换费收入	318.77
合计	13,770.41

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
审计费用	16,364.21
信息披露费	50,000.00
证券出借违约金	—
其他	12.44
合计	66,376.65

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰海通证券股份有限公司（由国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 4 月变更名称而来，以下简称“国泰海通”）承继及承接海通证券股份有限公司的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持本公司股权亦归属于国泰海通，即国泰海通成为本公司的主要股东。变更后，本公司的股东为国泰海通证券股份有限公司，出资比例为 27.775%；申万宏源证券有限公司，出资比例为 27.775%；加拿大蒙特利尔银行，出资比例为 27.775%；山东省金融资产管理股份有限公司，出资比例为 16.675%。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构（2025 年 3 月 14 日前）
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	基金管理人的股东、基金代销机构（自 2025 年 3 月 14 日起）
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中信建投证券股份有限公司（“中信建投”）	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。关联方国泰海通证券有限公司（简称“国泰海通”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原关联方海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
中信建投	403,822,385.30	53.77	1,324,739,503.12	56.68

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	成交金额	占当期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（%）
中信建投	6,582.95	89.00	—	—

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元				
关联方名称	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
中信建投	95,285.03	53.77	—	—
关联方名称	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
中信建投	312,485.60	56.68	—	—

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的管理费	461,165.58	1,755,212.69
其中：应支付销售机构的客户维护 费	203,479.80	768,622.79
应支付基金管理人的净 管理费	257,685.78	986,589.90

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%\div \text{当年天数}$$

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	76,860.93	292,535.48

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国致航量化选股股票 A	富国致航量化选股股票 C	合计
富国基金管理有限公司	—	10.95	10.95
中信建投证券股份有限公司	—	65,692.81	65,692.81
合计	—	65,703.76	65,703.76

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国致航量化选股股票 A	富国致航量化选股股票 C	合计
中信建投证券股份有限公司	—	304,900.42	304,900.42
合计	—	304,900.42	304,900.42

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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

C 类基金份额的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

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情
况

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
-------	--	---

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信建投证券股份有限公司	2,046,065.60	2,452.31	6,448,664.01	18,295.40

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

上年度可比期间（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	5,188	61,633.44

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股限售	12.30	54.45	89	1,094.70	4,846.05	—
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	新股限售	11.68	26.95	282	3,293.76	7,599.90	—

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025 年 06 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 07	39.98	2,281.00	69,437.77	86,792.05	—

					月 11 日					
--	--	--	--	--	-----------	--	--	--	--	--

6.4.12.3**期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

6.4.12.3.1**银行间市场债券正回购**

注：截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2**交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4**期末参与转融通证券出借业务的证券**

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13**金融工具风险及管理**

6.4.13.1**风险管理政策和组织架构**

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

6.4.13.2**信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的信用债。

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。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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

单位：人民币元

本期末（2025 年 06 月 30 日）	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	5,511,460.59	—	—	—	—	—	5,511,460.59
交易性金融资产	—	—	—	—	—	50,366,653.94	50,366,653.94
应收申购款	—	—	—	—	—	10,211.99	10,211.99
资产总计	5,511,460.59	—	—	—	—	50,376,865.93	55,888,326.52
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	448,542.25	448,542.25
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	57,531.52	57,531.52
应付托管费	—	—	—	—	—	9,588.61	9,588.61
应付销售服务费	—	—	—	—	—	17,843.01	17,843.01
其他负债	—	—	—	—	—	234,845.45	234,845.45
负债总计	—	—	—	—	—	768,350.84	768,350.84
利率敏感度缺口	5,511,460.59	—	—	—	—	49,608,515.09	55,119,975.68
上年度末（2024 年 12 月 31 日）	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	7,404,633.35	—	—	—	—	—	7,404,633.35
交易性金融资产	—	—	—	—	—	93,520,325.69	93,520,325.69
应收申购款	—	—	—	—	—	412.26	412.26
资产总计	7,404,633.35	—	—	—	—	93,520,737.95	100,925,371.30
负债							

应付赎回款	—	—	—	—	—	640,258.15	640,258.15
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	114,492.79	114,492.79
应付托管费	—	—	—	—	—	19,082.11	19,082.11
应付销售服务费	—	—	—	—	—	34,967.78	34,967.78
其他负债	—	—	—	—	—	168,781.05	168,781.05
负债总计	—	—	—	—	—	977,581.88	977,581.88
利率敏感度缺口	7,404,633.35	—	—	—	—	92,543,156.07	99,947,789.42

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、可转换债券、分离交易可转换债券、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）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股指期货、信用衍生品、国债期货、股票期权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）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。在未来条件许可的情况下，本基金可根据相关法律法规，在履行适当程序后，参与融券业务和转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例为80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权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。如果法律

法规或监管机构对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

项目	金额单位：人民币元			
	本期末 (2025 年 06 月 30 日)		上年度末 (2024 年 12 月 31 日)	
	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	50,366,653.94	91.38	93,520,325.69	93.57
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	50,366,653.94	91.38	93,520,325.69	93.57

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 (2025年06月30日)	上年度末 (2024年12月31日)
	1. 业绩比较基准增加 1%	499,807.96	876,300.26
	2. 业绩比较基准减少 1%	-499,807.96	-876,300.26

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果 所属的层次	本期末 (2025 年 06 月 30 日)	上年度末 (2024 年 12 月 31 日)
第一层次	50,267,415.94	93,056,826.87
第二层次	86,792.05	280,995.00
第三层次	12,445.95	182,503.82
合计	50,366,653.94	93,520,325.69

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	50,366,653.94	90.12
	其中：股票	50,366,653.94	90.12
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	5,511,460.59	9.86
8	其他各项资产	10,211.99	0.02
9	合计	55,888,326.52	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	174,608.00	0.32
B	采矿业	2,792,794.00	5.07
C	制造业	24,705,253.70	44.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,894,656.00	5.25
E	建筑业	582,921.00	1.06
F	批发和零售业	1,863,256.00	3.38
G	交通运输、仓储和邮政业	1,190,468.00	2.16
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,313,517.20	4.20
J	金融业	10,893,867.72	19.76
K	房地产业	136,465.00	0.25
L	租赁和商务服务业	662,592.80	1.20
M	科学研究和技术服务业	452,400.80	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	301,647.72	0.55

O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	146,574.00	0.27
Q	卫生和社会工作	100,554.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	1,155,078.00	2.10
S	综合	—	—
	合计	50,366,653.94	91.38

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	000988	华工科技	12,100	568,821.00	1.03
2	601555	东吴证券	58,300	510,125.00	0.93
3	601577	长沙银行	47,800	475,132.00	0.86
4	688538	和辉光电	202,786	474,519.24	0.86
5	601997	贵阳银行	75,904	473,640.96	0.86
6	000050	深天马A	55,200	470,304.00	0.85
7	000426	兴业银锡	29,000	458,200.00	0.83
8	600704	物产中大	85,000	447,950.00	0.81
9	600956	新天绿能	56,500	436,180.00	0.79
10	300140	节能环保	69,900	431,283.00	0.78
11	002080	中材科技	21,400	417,300.00	0.76
12	601717	中创智领	25,000	415,500.00	0.75
13	000783	长江证券	59,400	411,642.00	0.75
14	002966	苏州银行	46,677	409,824.06	0.74
15	002926	华西证券	44,400	396,936.00	0.72
16	688122	西部超导	7,512	389,722.56	0.71
17	601958	金钼股份	35,200	385,088.00	0.70
18	601128	常熟银行	51,860	382,208.20	0.69
19	002203	海亮股份	37,000	381,840.00	0.69
20	600977	中国电影	35,400	379,488.00	0.69
21	002958	青农商行	103,600	373,996.00	0.68
22	002595	豪迈科技	6,200	367,164.00	0.67
23	601568	北元集团	87,800	364,370.00	0.66
24	300383	光环新网	25,300	361,790.00	0.66
25	600909	华安证券	60,800	354,464.00	0.64
26	600901	江苏金租	57,900	350,874.00	0.64
27	002414	高德红外	33,432	342,678.00	0.62
28	600118	中国卫星	11,600	331,412.00	0.60
29	600329	达仁堂	9,900	330,264.00	0.60

30	600925	苏能股份	61,900	323,737.00	0.59
31	600578	京能电力	69,000	309,810.00	0.56
32	603187	海容冷链	26,200	308,112.00	0.56
33	000623	吉林敖东	18,130	307,303.50	0.56
34	601991	大唐发电	96,700	306,539.00	0.56
35	600153	建发股份	28,800	298,656.00	0.54
36	001203	大中矿业	31,000	292,950.00	0.53
37	688563	航材股份	5,123	290,115.49	0.53
38	601857	中国石油	33,000	282,150.00	0.51
39	002939	长城证券	33,600	281,568.00	0.51
40	000598	兴蓉环境	38,700	279,027.00	0.51
41	601921	浙版传媒	34,300	276,458.00	0.50
42	601061	中信金属	34,700	274,477.00	0.50
43	002821	凯莱英	3,100	273,575.00	0.50
44	002223	鱼跃医疗	7,600	270,560.00	0.49
45	000937	冀中能源	46,100	265,075.00	0.48
46	600486	扬农化工	4,500	261,000.00	0.47
47	600535	天士力	16,600	259,790.00	0.47
48	600298	安琪酵母	7,300	256,741.00	0.47
49	600016	民生银行	54,000	256,500.00	0.47
50	603868	飞科电器	6,900	247,503.00	0.45
51	600908	无锡银行	39,100	246,721.00	0.45
52	000027	深圳能源	38,300	244,354.00	0.44
53	601988	中国银行	43,400	243,908.00	0.44
54	300496	中科创达	4,200	240,324.00	0.44
55	600928	西安银行	61,300	240,296.00	0.44
56	603323	苏农银行	42,650	239,266.50	0.43
57	003022	联泓新科	14,900	235,867.00	0.43
58	603087	甘李药业	4,200	230,076.00	0.42
59	601939	建设银行	24,100	227,504.00	0.41
60	600499	科达制造	23,200	227,360.00	0.41
61	603858	步长制药	14,000	227,360.00	0.41
62	000893	亚钾国际	7,400	223,036.00	0.40
63	300115	长盈精密	10,300	220,420.00	0.40
64	600739	辽宁成大	20,000	220,000.00	0.40
65	600098	广州发展	34,400	215,000.00	0.39
66	600096	云天化	9,600	210,912.00	0.38
67	600166	福田汽车	75,700	205,147.00	0.37
68	000009	中国宝安	22,900	203,352.00	0.37
69	002739	万达电影	17,700	202,311.00	0.37
70	000825	太钢不锈	55,600	199,604.00	0.36

71	601398	工商银行	26,100	198,099.00	0.36
72	300373	扬杰科技	3,800	197,220.00	0.36
73	600352	浙江龙盛	19,400	197,104.00	0.36
74	600056	中国医药	18,900	195,426.00	0.35
75	000060	中金岭南	42,600	195,108.00	0.35
76	600295	鄂尔多斯	22,300	194,233.00	0.35
77	002138	顺络电子	6,800	191,216.00	0.35
78	601919	中远海控	12,700	191,008.00	0.35
79	600517	国网英大	37,000	188,700.00	0.34
80	000089	深圳机场	27,300	188,370.00	0.34
81	002807	江阴银行	39,600	188,100.00	0.34
82	688387	信科移动	32,801	185,325.65	0.34
83	600380	健康元	16,800	185,304.00	0.34
84	601318	中国平安	3,300	183,084.00	0.33
85	600004	白云机场	20,100	182,910.00	0.33
86	002839	张家港行	39,900	179,550.00	0.33
87	601169	北京银行	26,000	177,580.00	0.32
88	000034	神州数码	4,700	176,908.00	0.32
89	600879	航天电子	16,800	175,896.00	0.32
90	003031	中瓷电子	3,300	175,593.00	0.32
91	600057	厦门象屿	24,400	171,532.00	0.31
92	601328	交通银行	21,400	171,200.00	0.31
93	002608	江苏国信	23,300	170,789.00	0.31
94	002014	永新股份	13,900	168,468.00	0.31
95	002487	大金重工	5,100	167,790.00	0.30
96	600109	国金证券	19,000	166,630.00	0.30
97	300017	网宿科技	15,300	164,016.00	0.30
98	688469	芯联集成	34,145	162,871.65	0.30
99	601528	瑞丰银行	28,000	162,120.00	0.29
100	688220	翱捷科技	2,046	160,201.80	0.29
101	601838	成都银行	7,800	156,780.00	0.28
102	600867	通化东宝	19,000	155,800.00	0.28
103	000636	风华高科	11,300	155,262.00	0.28
104	603071	物产环能	12,100	154,033.00	0.28
105	300699	光威复材	4,800	152,016.00	0.28
106	603601	再升科技	37,400	151,844.00	0.28
107	600873	梅花生物	14,120	150,942.80	0.27
108	601168	西部矿业	9,000	149,670.00	0.27
109	600316	洪都航空	3,900	147,030.00	0.27
110	600582	天地科技	24,500	146,755.00	0.27
111	000959	首钢股份	43,100	146,540.00	0.27

112	000563	陕国投A	41,000	146,370.00	0.27
113	601916	浙商银行	42,600	144,414.00	0.26
114	600549	厦门钨业	6,900	144,348.00	0.26
115	600959	江苏有线	41,700	143,448.00	0.26
116	601158	重庆水务	30,800	142,912.00	0.26
117	601336	新华保险	2,400	140,400.00	0.25
118	600998	九州通	27,200	139,808.00	0.25
119	002273	水晶光电	6,900	137,793.00	0.25
120	000001	平安银行	11,400	137,598.00	0.25
121	603909	建发合诚	14,100	137,334.00	0.25
122	688114	华大智造	2,111	136,856.13	0.25
123	002142	宁波银行	5,000	136,800.00	0.25
124	300595	欧普康视	8,800	134,376.00	0.24
125	002353	杰瑞股份	3,800	133,000.00	0.24
126	300024	机器人	7,700	132,286.00	0.24
127	600906	财达证券	19,300	131,626.00	0.24
128	000960	锡业股份	8,600	131,580.00	0.24
129	688819	天能股份	4,724	131,138.24	0.24
130	600036	招商银行	2,800	128,660.00	0.23
131	688777	中控技术	2,864	128,622.24	0.23
132	601658	邮储银行	23,500	128,545.00	0.23
133	600021	上海电力	14,500	127,455.00	0.23
134	603000	人民网	6,300	127,323.00	0.23
135	601818	光大银行	30,500	126,575.00	0.23
136	603259	药明康德	1,800	125,190.00	0.23
137	600926	杭州银行	7,300	122,786.00	0.22
138	000333	美的集团	1,700	122,740.00	0.22
139	601928	凤凰传媒	10,900	121,753.00	0.22
140	300476	胜宏科技	900	120,942.00	0.22
141	600498	烽火通信	5,700	119,871.00	0.22
142	002500	山西证券	20,400	119,136.00	0.22
143	601688	华泰证券	6,600	117,546.00	0.21
144	300474	景嘉微	1,600	116,800.00	0.21
145	600000	浦发银行	8,400	116,592.00	0.21
146	000878	云南铜业	8,900	113,208.00	0.21
147	603309	维力医疗	8,900	113,208.00	0.21
148	603885	吉祥航空	8,400	113,148.00	0.21
149	002202	金风科技	11,000	112,750.00	0.20
150	002607	中公教育	36,700	112,302.00	0.20
151	002352	顺丰控股	2,300	112,148.00	0.20
152	300627	华测导航	3,200	112,000.00	0.20

153	301332	德尔玛	10,900	111,616.00	0.20
154	601668	中国建筑	19,300	111,361.00	0.20
155	000021	深科技	5,900	110,566.00	0.20
156	000987	越秀资本	15,700	107,702.00	0.20
157	300070	碧水源	23,700	106,650.00	0.19
158	600688	上海石化	37,400	106,590.00	0.19
159	002384	东山精密	2,800	105,756.00	0.19
160	601019	山东出版	11,000	104,170.00	0.19
161	601665	齐鲁银行	16,200	102,384.00	0.19
162	600039	四川路桥	10,300	101,970.00	0.18
163	000726	鲁泰A	16,000	101,440.00	0.18
164	600160	巨化股份	3,500	100,380.00	0.18
165	600015	华夏银行	12,600	99,666.00	0.18
166	600028	中国石化	17,600	99,264.00	0.18
167	601728	中国电信	12,800	99,200.00	0.18
168	300058	蓝色光标	15,080	98,924.80	0.18
169	000776	广发证券	5,800	97,498.00	0.18
170	002128	电投能源	4,900	96,922.00	0.18
171	603298	杭叉集团	4,600	96,370.00	0.17
172	002603	以岭药业	6,800	95,880.00	0.17
173	601009	南京银行	8,100	94,122.00	0.17
174	002624	完美世界	6,200	94,054.00	0.17
175	601118	海南橡胶	19,800	93,456.00	0.17
176	600900	长江电力	3,100	93,434.00	0.17
177	688778	厦钨新能	1,659	92,771.28	0.17
178	688425	铁建重工	22,650	92,412.00	0.17
179	603160	汇顶科技	1,300	92,339.00	0.17
180	002056	横店东磁	6,500	91,975.00	0.17
181	688668	鼎通科技	1,471	91,878.66	0.17
182	600884	杉杉股份	9,700	91,762.00	0.17
183	601166	兴业银行	3,900	91,026.00	0.17
184	603444	吉比特	300	90,585.00	0.16
185	601006	大秦铁路	13,700	90,420.00	0.16
186	603848	好太太	5,800	89,320.00	0.16
187	002371	北方华创	200	88,442.00	0.16
188	002683	广东宏大	2,600	88,244.00	0.16
189	002233	塔牌集团	11,800	87,320.00	0.16
190	600348	华阳股份	13,100	87,246.00	0.16
191	600685	中船防务	3,200	87,008.00	0.16
192	688766	普冉股份	1,376	86,963.20	0.16
193	688313	仕佳光子	2,281	86,792.05	0.16

194	603816	顾家家居	3,400	86,768.00	0.16
195	601311	骆驼股份	9,500	85,785.00	0.16
196	688188	柏楚电子	649	85,447.34	0.16
197	600637	东方明珠	11,400	85,158.00	0.15
198	600655	豫园股份	15,000	83,250.00	0.15
199	688728	格科微	5,386	82,944.40	0.15
200	600863	内蒙华电	20,100	82,611.00	0.15
201	002756	永兴材料	2,600	82,550.00	0.15
202	600760	中航沈飞	1,400	82,068.00	0.15
203	688697	纽威数控	6,139	81,894.26	0.15
204	600808	马钢股份	23,600	81,420.00	0.15
205	000063	中兴通讯	2,500	81,225.00	0.15
206	000408	藏格矿业	1,900	81,073.00	0.15
207	300207	欣旺达	4,000	80,240.00	0.15
208	601899	紫金矿业	4,100	79,950.00	0.15
209	000032	深桑达A	3,900	78,897.00	0.14
210	600862	中航高科	3,000	78,240.00	0.14
211	002206	海利得	15,300	78,183.00	0.14
212	000538	云南白药	1,400	78,106.00	0.14
213	601016	节能风电	26,900	77,741.00	0.14
214	300041	回天新材	8,200	77,244.00	0.14
215	600167	联美控股	13,600	76,432.00	0.14
216	600350	山东高速	7,100	75,686.00	0.14
217	603728	鸣志电器	1,300	74,711.00	0.14
218	688037	芯源微	693	74,289.60	0.13
219	600126	杭钢股份	8,200	73,800.00	0.13
220	688172	燕东微	3,745	73,626.70	0.13
221	603808	歌力思	8,800	73,040.00	0.13
222	300679	电连技术	1,600	72,608.00	0.13
223	300803	指南针	900	72,594.00	0.13
224	600177	雅戈尔	9,900	72,270.00	0.13
225	600418	江淮汽车	1,800	72,162.00	0.13
226	688008	澜起科技	878	71,996.00	0.13
227	600820	隧道股份	11,800	71,980.00	0.13
228	600482	中国动力	3,100	71,517.00	0.13
229	600839	四川长虹	7,300	70,956.00	0.13
230	000709	河钢股份	32,400	69,984.00	0.13
231	002643	万润股份	6,000	69,060.00	0.13
232	002539	云图控股	7,200	67,536.00	0.12
233	301328	维峰电子	1,600	67,440.00	0.12
234	002402	和而泰	2,900	67,193.00	0.12

235	002373	千方科技	7,200	66,960.00	0.12
236	000498	山东路桥	11,300	66,444.00	0.12
237	600763	通策医疗	1,600	66,048.00	0.12
238	600271	航天信息	7,100	65,604.00	0.12
239	000728	国元证券	8,300	65,487.00	0.12
240	300212	易华录	3,000	65,280.00	0.12
241	600737	中粮糖业	6,900	65,205.00	0.12
242	603129	春风动力	300	64,950.00	0.12
243	600663	陆家嘴	7,300	64,678.00	0.12
244	000415	渤海租赁	19,200	63,936.00	0.12
245	603997	继峰股份	4,900	63,896.00	0.12
246	002517	恺英网络	3,300	63,723.00	0.12
247	605499	东鹏饮料	200	62,810.00	0.11
248	603916	苏博特	6,900	62,514.00	0.11
249	002461	珠江啤酒	5,500	62,095.00	0.11
250	601155	新城控股	4,500	61,560.00	0.11
251	000963	华东医药	1,500	60,540.00	0.11
252	002266	浙富控股	19,600	60,368.00	0.11
253	688677	海泰新光	1,509	58,866.09	0.11
254	601108	财通证券	7,400	58,534.00	0.11
255	000750	国海证券	14,200	58,504.00	0.11
256	601319	中国人保	6,700	58,357.00	0.11
257	688630	芯碁微装	733	58,178.21	0.11
258	600566	济川药业	2,200	57,926.00	0.11
259	601611	中国核建	6,200	56,978.00	0.10
260	688525	佰维存储	843	56,818.20	0.10
261	600008	首创环保	18,800	56,776.00	0.10
262	601601	中国太保	1,500	56,265.00	0.10
263	300146	汤臣倍健	5,000	56,200.00	0.10
264	002318	久立特材	2,400	56,136.00	0.10
265	600062	华润双鹤	3,000	55,980.00	0.10
266	688046	药康生物	3,715	55,873.60	0.10
267	000657	中钨高新	4,700	55,742.00	0.10
268	605589	圣泉集团	2,000	55,500.00	0.10
269	301165	锐捷网络	900	55,314.00	0.10
270	688027	国盾量子	200	55,002.00	0.10
271	601208	东材科技	5,800	54,984.00	0.10
272	688029	南微医学	804	54,310.20	0.10
273	301061	匠心家居	700	54,278.00	0.10
274	603881	数据港	2,100	53,655.00	0.10
275	603379	三美股份	1,100	52,932.00	0.10

276	600919	江苏银行	4,400	52,536.00	0.10
277	603565	中谷物流	5,500	52,525.00	0.10
278	002340	格林美	8,200	52,070.00	0.09
279	002294	信立泰	1,100	52,063.00	0.09
280	600236	桂冠电力	8,200	51,414.00	0.09
281	002734	利民股份	2,800	51,240.00	0.09
282	605183	确成股份	2,900	50,750.00	0.09
283	300750	宁德时代	200	50,444.00	0.09
284	002673	西部证券	6,400	50,432.00	0.09
285	002714	牧原股份	1,200	50,412.00	0.09
286	600475	华光环能	4,800	50,016.00	0.09
287	002532	天山铝业	6,000	49,860.00	0.09
288	603515	欧普照明	2,700	48,573.00	0.09
289	600369	西南证券	11,100	48,285.00	0.09
290	600795	国电电力	9,900	47,916.00	0.09
291	600968	海油发展	11,700	47,736.00	0.09
292	601827	三峰环境	5,600	47,040.00	0.09
293	002120	韵达股份	7,000	46,900.00	0.09
294	603699	纽威股份	1,500	46,755.00	0.08
295	600219	南山铝业	12,200	46,726.00	0.08
296	000932	华菱钢铁	10,600	46,640.00	0.08
297	001288	运机集团	2,200	45,826.00	0.08
298	605016	百龙创园	2,220	45,798.60	0.08
299	002407	多氟多	3,700	45,103.00	0.08
300	688025	杰普特	630	45,045.00	0.08
301	600563	法拉电子	400	43,636.00	0.08
302	300850	新强联	1,200	42,984.00	0.08
303	600487	亨通光电	2,800	42,840.00	0.08
304	002001	新 和 成	2,000	42,540.00	0.08
305	603303	得邦照明	3,500	42,245.00	0.08
306	300751	迈为股份	600	41,736.00	0.08
307	300416	苏试试验	2,900	41,557.00	0.08
308	600521	华海药业	2,200	40,986.00	0.07
309	600764	中国海防	1,200	40,800.00	0.07
310	601598	中国外运	8,200	40,426.00	0.07
311	000062	深圳华强	1,500	40,290.00	0.07
312	300735	光弘科技	1,600	40,160.00	0.07
313	000537	中绿电	4,800	40,128.00	0.07
314	688032	禾迈股份	400	39,944.00	0.07
315	601231	环旭电子	2,700	39,501.00	0.07
316	600132	重庆啤酒	700	38,570.00	0.07

317	600392	盛和资源	2,900	38,193.00	0.07
318	301338	凯格精机	800	38,168.00	0.07
319	601390	中国中铁	6,800	38,148.00	0.07
320	601881	中国银河	2,200	37,730.00	0.07
321	002155	湖南黄金	2,080	37,128.00	0.07
322	688248	南网科技	1,175	36,965.50	0.07
323	300972	万辰集团	200	36,048.00	0.07
324	603766	隆鑫通用	2,800	35,728.00	0.06
325	000997	新大陆	1,100	35,618.00	0.06
326	000977	浪潮信息	700	35,616.00	0.06
327	300990	同飞股份	700	34,930.00	0.06
328	603121	华培动力	1,500	34,905.00	0.06
329	600699	均胜电子	2,000	34,880.00	0.06
330	300824	北鼎股份	2,900	34,597.00	0.06
331	301267	华夏眼科	1,800	34,506.00	0.06
332	601766	中国中车	4,900	34,496.00	0.06
333	601083	锦江航运	3,100	34,441.00	0.06
334	002659	凯文教育	6,800	34,272.00	0.06
335	000629	钒钛股份	13,300	34,048.00	0.06
336	688232	新点软件	1,089	32,713.56	0.06
337	600988	赤峰黄金	1,300	32,344.00	0.06
338	301195	北路智控	900	32,220.00	0.06
339	603650	彤程新材	1,000	32,150.00	0.06
340	301031	中熔电气	400	31,860.00	0.06
341	600483	福能股份	3,300	31,812.00	0.06
342	688551	科威尔	1,072	31,506.08	0.06
343	688153	唯捷创芯	1,012	31,382.12	0.06
344	603466	风语筑	3,100	31,279.00	0.06
345	605296	神农集团	1,000	30,740.00	0.06
346	600155	华创云信	4,400	30,624.00	0.06
347	002597	金禾实业	1,300	30,615.00	0.06
348	603057	紫燕食品	1,400	30,604.00	0.06
349	688308	欧科亿	1,654	30,516.30	0.06
350	002153	石基信息	3,500	30,310.00	0.05
351	000975	山金国际	1,600	30,304.00	0.05
352	600299	安迪苏	3,100	29,915.00	0.05
353	601990	南京证券	3,700	29,896.00	0.05
354	002658	雪迪龙	3,800	29,754.00	0.05
355	300142	沃森生物	2,700	29,700.00	0.05
356	600186	莲花控股	4,900	29,400.00	0.05
357	603166	福达股份	1,900	29,393.00	0.05

358	688281	华秦科技	480	29,044.80	0.05
359	001339	智微智能	600	28,998.00	0.05
360	600104	上汽集团	1,800	28,890.00	0.05
361	300001	特锐德	1,200	28,764.00	0.05
362	688349	三一重能	1,151	28,705.94	0.05
363	688208	道通科技	935	28,611.00	0.05
364	300037	新宙邦	800	28,160.00	0.05
365	300657	弘信电子	1,000	27,890.00	0.05
366	002543	万和电气	2,500	27,775.00	0.05
367	600633	浙数文化	2,000	27,680.00	0.05
368	603877	太平鸟	1,900	27,550.00	0.05
369	600528	中铁工业	3,700	27,306.00	0.05
370	000778	新兴铸管	7,300	27,156.00	0.05
371	002410	广联达	2,000	26,820.00	0.05
372	300623	捷捷微电	900	26,820.00	0.05
373	603667	五洲新春	800	26,808.00	0.05
374	002600	领益智造	3,100	26,629.00	0.05
375	601233	桐昆股份	2,500	26,500.00	0.05
376	002913	奥士康	900	26,469.00	0.05
377	000685	中山公用	3,000	26,340.00	0.05
378	688484	南芯科技	665	26,300.75	0.05
379	001286	陕西能源	3,000	26,100.00	0.05
380	601139	深圳燃气	4,100	26,076.00	0.05
381	688396	华润微	551	25,985.16	0.05
382	601918	新集能源	4,000	25,840.00	0.05
383	605090	九丰能源	1,000	25,810.00	0.05
384	300737	科顺股份	5,300	25,546.00	0.05
385	688100	威胜信息	689	25,527.45	0.05
386	601369	陕鼓动力	2,900	25,433.00	0.05
387	601901	方正证券	3,200	25,312.00	0.05
388	688073	毕得医药	435	25,238.70	0.05
389	000039	中集集团	3,200	25,152.00	0.05
390	300755	华致酒行	1,300	25,090.00	0.05
391	002007	华兰生物	1,600	25,072.00	0.05
392	605305	中际联合	900	25,002.00	0.05
393	601799	星宇股份	200	25,000.00	0.05
394	688017	绿的谐波	200	24,978.00	0.05
395	600970	中材国际	2,900	24,882.00	0.05
396	601965	中国汽研	1,400	24,850.00	0.05
397	688327	云从科技	1,799	24,808.21	0.05
398	688702	盛科通信	400	24,432.00	0.04

399	605077	华康股份	1,500	24,270.00	0.04
400	002670	国盛金控	1,600	24,080.00	0.04
401	000725	京东方A	6,000	23,940.00	0.04
402	000559	万向钱潮	3,100	23,715.00	0.04
403	000719	中原传媒	1,900	23,579.00	0.04
404	300418	昆仑万维	700	23,541.00	0.04
405	300100	双林股份	500	23,540.00	0.04
406	002865	钧达股份	600	23,400.00	0.04
407	002945	华林证券	1,600	22,992.00	0.04
408	688696	极米科技	200	22,872.00	0.04
409	000739	普洛药业	1,600	22,400.00	0.04
410	000703	恒逸石化	3,800	22,344.00	0.04
411	600361	创新新材	5,600	22,344.00	0.04
412	601058	赛轮轮胎	1,700	22,304.00	0.04
413	003006	百亚股份	800	21,904.00	0.04
414	301345	涛涛车业	200	21,620.00	0.04
415	002463	沪电股份	500	21,290.00	0.04
416	688501	青达环保	757	21,082.45	0.04
417	002831	裕同科技	900	21,078.00	0.04
418	601686	友发集团	3,700	21,016.00	0.04
419	605358	立昂微	900	20,970.00	0.04
420	603755	日辰股份	800	20,896.00	0.04
421	688358	祥生医疗	701	20,784.65	0.04
422	603659	璞泰来	1,100	20,658.00	0.04
423	603529	爱玛科技	600	20,640.00	0.04
424	600733	北汽蓝谷	2,800	20,636.00	0.04
425	601111	中国国航	2,600	20,514.00	0.04
426	603341	龙旗科技	500	20,315.00	0.04
427	603899	晨光股份	700	20,293.00	0.04
428	600050	中国联通	3,800	20,292.00	0.04
429	002472	双环传动	600	20,094.00	0.04
430	002637	赞宇科技	2,000	19,960.00	0.04
431	600497	驰宏锌锗	3,600	19,044.00	0.03
432	300604	长川科技	400	17,964.00	0.03
433	002139	拓邦股份	1,300	17,953.00	0.03
434	002156	通富微电	700	17,934.00	0.03
435	002507	涪陵榨菜	1,400	17,906.00	0.03
436	300662	科锐国际	600	17,826.00	0.03
437	600282	南钢股份	4,200	17,640.00	0.03
438	688162	巨一科技	639	17,406.36	0.03
439	000885	城发环境	1,300	17,316.00	0.03

440	300763	锦浪科技	300	17,217.00	0.03
441	002797	第一创业	2,400	16,992.00	0.03
442	600115	中国东航	4,200	16,926.00	0.03
443	600875	东方电气	1,000	16,740.00	0.03
444	002429	兆驰股份	3,700	16,206.00	0.03
445	300893	松原安全	660	16,183.20	0.03
446	300788	中信出版	500	16,040.00	0.03
447	601156	东航物流	1,200	15,708.00	0.03
448	300136	信维通信	700	15,680.00	0.03
449	000723	美锦能源	3,600	15,552.00	0.03
450	600707	彩虹股份	2,400	15,504.00	0.03
451	605376	博迁新材	400	15,332.00	0.03
452	002876	三利谱	600	15,114.00	0.03
453	002896	中大力德	260	15,056.60	0.03
454	300738	奥飞数据	700	14,651.00	0.03
455	301261	恒工精密	200	14,578.00	0.03
456	301377	鼎泰高科	400	14,384.00	0.03
457	001322	箭牌家居	1,700	14,365.00	0.03
458	603277	银都股份	870	13,920.00	0.03
459	300223	北京君正	200	13,840.00	0.03
460	603063	禾望电气	400	13,544.00	0.02
461	688110	东芯股份	436	13,367.76	0.02
462	601099	太平洋	3,400	13,362.00	0.02
463	601636	旗滨集团	2,600	13,026.00	0.02
464	603662	柯力传感	200	12,786.00	0.02
465	603156	养元饮品	600	12,696.00	0.02
466	603228	景旺电子	300	12,552.00	0.02
467	301368	丰立智能	200	12,366.00	0.02
468	600602	云赛智联	600	12,102.00	0.02
469	300748	金力永磁	500	11,920.00	0.02
470	601212	白银有色	3,800	11,894.00	0.02
471	600580	卧龙电驱	600	11,862.00	0.02
472	001309	德明利	100	11,834.00	0.02
473	300002	神州泰岳	1,000	11,800.00	0.02
474	601696	中银证券	1,100	11,759.00	0.02
475	688561	奇安信	345	11,723.10	0.02
476	002010	传化智联	2,100	11,718.00	0.02
477	002368	太极股份	500	11,710.00	0.02
478	000100	TCL 科技	2,700	11,691.00	0.02
479	002241	歌尔股份	500	11,660.00	0.02
480	600885	宏发股份	520	11,601.20	0.02

481	300059	东方财富	500	11,565.00	0.02
482	601615	明阳智能	1,000	11,490.00	0.02
483	600502	安徽建工	2,400	11,280.00	0.02
484	002185	华天科技	1,100	11,110.00	0.02
485	603737	三棵树	300	11,055.00	0.02
486	600595	中孚实业	2,500	10,950.00	0.02
487	603993	洛阳钼业	1,300	10,946.00	0.02
488	001283	豪鹏科技	200	10,890.00	0.02
489	605598	上海港湾	500	10,685.00	0.02
490	002050	三花智控	400	10,552.00	0.02
491	002351	漫步者	800	10,496.00	0.02
492	002841	视源股份	300	10,380.00	0.02
493	002061	浙江交科	2,600	10,296.00	0.02
494	600325	华发股份	2,100	10,227.00	0.02
495	688522	纳睿雷达	192	9,834.24	0.02
496	688258	卓易信息	200	9,686.00	0.02
497	601000	唐山港	2,300	9,338.00	0.02
498	688408	中信博	200	9,336.00	0.02
499	601456	国联民生	900	9,315.00	0.02
500	688300	联瑞新材	200	9,310.00	0.02
501	600143	金发科技	900	9,279.00	0.02
502	300590	移为通信	700	9,107.00	0.02
503	002925	盈趣科技	500	8,990.00	0.02
504	301550	斯菱股份	100	8,929.00	0.02
505	601216	君正集团	1,600	8,832.00	0.02
506	000887	中鼎股份	500	8,795.00	0.02
507	300073	当升科技	200	8,774.00	0.02
508	300857	协创数据	100	8,606.00	0.02
509	002335	科华数据	200	8,536.00	0.02
510	605189	富春染织	650	8,073.00	0.01
511	688545	兴福电子	282	7,599.90	0.01
512	600323	瀚蓝环境	300	7,305.00	0.01
513	002790	瑞尔特	1,000	7,270.00	0.01
514	689009	九号公司	119	7,041.23	0.01
515	688156	路德环境	392	6,628.72	0.01
516	603233	大参林	400	6,520.00	0.01
517	601033	永兴股份	400	6,324.00	0.01
518	688428	诺诚健华	251	6,131.93	0.01
519	002701	奥瑞金	1,000	5,950.00	0.01
520	688150	莱特光电	240	5,932.80	0.01
521	603826	坤彩科技	300	5,871.00	0.01

522	002508	老板电器	300	5,703.00	0.01
523	002949	华阳国际	400	5,392.00	0.01
524	002078	太阳纸业	400	5,384.00	0.01
525	000423	东阿阿胶	100	5,230.00	0.01
526	603072	天和磁材	89	4,846.05	0.01
527	300993	玉马科技	300	4,548.00	0.01
528	603009	北特科技	100	4,170.00	0.01
529	300888	稳健医疗	100	4,110.00	0.01
530	601608	中信重工	900	3,933.00	0.01
531	002837	英维克	130	3,862.30	0.01
532	600511	国药股份	100	2,916.00	0.01
533	688249	晶合集成	123	2,493.21	0.00
534	688550	瑞联新材	46	1,978.46	0.00
535	002065	东华软件	200	1,920.00	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	002273	水晶光电	1,670,129.00	1.67
2	000988	华工科技	1,639,503.00	1.64
3	002625	光启技术	1,574,572.00	1.58
4	603893	瑞芯微	1,499,891.00	1.50
5	000050	深天马 A	1,450,204.00	1.45
6	600535	天士力	1,406,830.00	1.41
7	002152	广电运通	1,386,919.00	1.39
8	688777	中控技术	1,324,445.23	1.33
9	601168	西部矿业	1,306,841.00	1.31
10	002414	高德红外	1,269,483.28	1.27
11	600096	云天化	1,268,693.00	1.27
12	002797	第一创业	1,267,584.00	1.27
13	002008	大族激光	1,239,291.00	1.24
14	600988	赤峰黄金	1,228,740.00	1.23
15	002065	东华软件	1,215,396.00	1.22
16	688538	和辉光电	1,199,161.14	1.20
17	000032	深桑达 A	1,188,236.00	1.19
18	600699	均胜电子	1,174,815.00	1.18
19	000060	中金岭南	1,165,300.00	1.17
20	000423	东阿阿胶	1,161,086.00	1.16

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	002625	光启技术	2,543,401.00	2.54
2	601577	长沙银行	2,444,920.00	2.45
3	603893	瑞芯微	2,227,433.96	2.23
4	002414	高德红外	1,867,645.00	1.87
5	000988	华工科技	1,809,642.00	1.81
6	600143	金发科技	1,781,642.00	1.78
7	600352	浙江龙盛	1,735,377.00	1.74
8	002273	水晶光电	1,668,709.00	1.67
9	601555	东吴证券	1,602,357.06	1.60
10	600096	云天化	1,602,242.00	1.60
11	002261	拓维信息	1,574,564.00	1.58
12	300001	特锐德	1,554,512.00	1.56
13	600988	赤峰黄金	1,476,999.00	1.48
14	600901	江苏金租	1,441,956.00	1.44
15	688777	中控技术	1,431,877.68	1.43
16	300142	沃森生物	1,418,575.00	1.42
17	002065	东华软件	1,407,756.00	1.41
18	000060	中金岭南	1,405,857.00	1.41
19	002517	恺英网络	1,359,693.00	1.36
20	002008	大族激光	1,357,322.00	1.36

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	351,992,147.37
卖出股票收入（成交）总额	399,045,121.61

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，降低投资组合的整体风险。

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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，东吴证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，贵阳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贵州监管局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，长沙银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行湖南省分行的处罚。

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

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

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—

5	应收申购款	10,211.99
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	10,211.99

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
富国致航量化选股股票 A	570	34,162.87	29,659.12	0.15	19,443,176.40	99.85
富国致航量化选股股票 C	942	34,232.69	—	—	32,247,194.32	100.00
合计	1,512	34,206.37	29,659.12	0.06	51,690,370.72	99.94

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	富国致航量化选股股票 A	107,507.44	0.5521
	富国致航量化选股股票 C	2.71	0.0000
	合计	107,510.15	0.2079

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	富国致航量化选股股票 A	10~50
	富国致航量化选股股票 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	富国致航量化选股股票 A	10~50
	富国致航量化选股股票 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国致航量化选股股票 A	富国致航量化选股股票 C
基金合同生效日(2023 年 12 月 05 日)基金份额总额	144,300,767.88	306,030,101.84
报告期期初基金份额总额	35,872,677.43	62,515,734.94
本报告期基金总申购份额	188,205.82	444,302.23
减：本报告期基金总赎回份额	16,588,047.73	30,712,842.85
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	19,472,835.52	32,247,194.32

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	2	346,194,309.90	46.10	81,677.45	46.09	—

国信证券	2	987,682.90	0.13	232.88	0.13	—
中信建投	3	403,822,385.30	53.77	95,285.03	53.77	—

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（%）
广发证券	813.89	11.00	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	6,582.95	89.00	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	规定披露媒介	2025年01月02日
2	富国基金管理有限公司关于变更主要股东事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告	规定披露媒介	2025年01月21日
3	富国基金管理有限公司关于公司主要股东变更的公告	规定披露媒介	2025年03月18日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，根据中国证券监督管理委员会于 2025 年 1 月 17 日出具的《关于同意国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司并募集配套资金注册、核准国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司、海富通基金管理有限公司变更主要股东及实际控制人、富国基金管理有限公司变更主要股东、海通期货股份有限公司变更主要股东及实际控制人的批复》，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司，并依法承接富国基金管理有限公司 14,443 万元出资（占注册资本比例 27.775%）。自吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安成为基金管理人的主要股东。具体可参见基金管理人于 2025 年 1 月 21 日发布的《富国基金管理有限公司关于变更主要股东事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告》、2025 年 3 月 18 日发布的《富国基金管理有限公司关于公司主要股东变更的公告》。根据国泰海通证券股份有限公司于 2025 年 4 月 4 日发布的相关公告，国泰君安的公司名称变更为国泰海通证券股份有限公司。

§ 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致航量化选股股票型证券投资基金的文件 2、富国致航量化选股股票型证券投资基金基金合同 3、富国致航量化选股股票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、富国致航量化选股股票型证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	中国(上海)自由贸易试验区 世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话:95105686、4008880688 (全国统一,免长途话费)公司网 址 : http://www.fullgoal.com.cn 。