

富国致享量化选股股票型证券投资基金

二〇二六年中期报告

2026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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2026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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
§ 4	管理人报告	11
4.1	基金管理人及基金经理情况	11
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	13
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6	半年度财务报告（未经审计）	17
6.1	资产负债表	17
6.2	利润表	18
6.3	净资产变动表	19
6.4	报表附注	20
§ 7	投资组合报告	41
7.1	期末基金资产组合情况	41

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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.....	59
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.....	59
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.....	59
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.....	59
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12	投资组合报告附注	60
§ 8	基金份额持有人信息	61
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2	盈利投资者数量占比	61
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.4	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情况.....	61
§ 9	开放式基金份额变动	62
§ 10	重大事件揭示	63
10.1	基金份额持有人大会决议	63
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.....	63
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4	基金投资策略的改变	63
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
10.7	基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	64
10.8	其他重大事件	64
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12	备查文件目录	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国致享量化选股股票型证券投资基金	
基金简称	富国致享量化选股股票	
基金主代码	024046	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 06 月 25 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	46,978,235.16 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国致享量化选股股票 A	富国致享量化选股股票 C
下属分级基金的交易代码	024046	024047
报告期末下属分级基金的份额总额	22,932,627.74 份	24,045,607.42 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、参与融资业务的投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证全指指数收益率×90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%+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。本基金投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	汪小敏
	联系电话	021-20361818	021-31888888
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	wangxm8@spdb.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95528
传真		021-20361616	021-63602540

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	上海市中山东一路 12 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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码	200120	200126
法定代表人	陈戈	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告置备地点	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 上海浦东发展银行股份有限公司 上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋

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) 富国致享量化选股股票 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	5,163,683.62
本期利润	5,279,156.29
加权平均基金份额本期利润	0.1538
本期加权平均净值利润率	12.52%
本期基金份额净值增长率	13.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	7,319,986.35
期末可供分配基金份额利润	0.3192
期末基金资产净值	30,252,614.09
期末基金份额净值	1.3192
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	31.92%

(2) 富国致享量化选股股票 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	4,000,391.11
本期利润	3,455,379.53
加权平均基金份额本期利润	0.1214
本期加权平均净值利润率	9.91%
本期基金份额净值增长率	13.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	7,484,515.89
期末可供分配基金份额利润	0.3113
期末基金资产净值	31,530,123.31
期末基金份额净值	1.3113
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	31.13%

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，开放式基金的申购费

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) 富国致享量化选股股票 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
过去三个月	13.36%	1.46%	10.40%	1.27%	2.96%	0.19%
过去六个月	13.42%	1.38%	8.80%	1.23%	4.62%	0.15%
过去一年	31.95%	1.14%	28.25%	1.07%	3.70%	0.07%
自基金合同生效起至今	31.92%	1.13%	30.26%	1.07%	1.66%	0.06%

(2) 富国致享量化选股股票 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
过去三个月	13.20%	1.46%	10.40%	1.27%	2.80%	0.19%
过去六个月	13.10%	1.38%	8.80%	1.23%	4.30%	0.15%
过去一年	31.17%	1.14%	28.25%	1.07%	2.92%	0.07%
自基金合同生效起至今	31.13%	1.13%	30.26%	1.07%	0.87%	0.06%

注：本基金业绩比较基准根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

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

(1) 富国致享量化选股股票 A



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2) 富国致享量化选股股票 C



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，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。

截至 2026 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 464 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	2025-06-25	—	20	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 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。
方旻	本基金现任基金经理	2025-06-25	—	16	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 2025 年 04 月起任富国致盛量化选股股票型证券投资基金基金经理；自 2025 年 05 月起任富国上证科创板综合价格指数增强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。

4.2 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致享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》、《富国致享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

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

规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 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 39 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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年伊始，国内经济数据回暖、人民币升值等因素助推 A 股快速上行，随后融资保证金上调降温市场，叠加海外关税、美伊地缘反复扰动情绪。进入 2 月，美联储新任主席提名强化紧缩预期，全球迎来鹰派交易。3 月起，美伊冲突主导市场，月初冲突推高油价打压风险偏好；中旬局势僵持加剧滞胀忧虑；下旬美方释放缓和信号，悲观情绪有所修复。4 月地缘扰动降温、流动性预期改善，A 股科技成长维持强势并向低拥挤赛道扩散。海外半导体行情向好，AI 算力需求持续验证；国内资金聚焦产业主线，行情向国产算力、半导体、AIDC 基建延伸。5 月中旬多重催化消退，叠加美国通胀走高、加息预期升温，美债利率上行带来海外流动性压力，市场见顶回落。资金进一步聚焦 AI 硬件，电子、通信虹吸其他板块。6 月市场维持震荡分化，指数依靠少数赛道保持韧性，但个股中位数持续走弱，多数标的承受调整压力。

总体来看，2026 年上半年上证综指上涨 3.16%，沪深 300 上涨 7.55%，中证 500 指数上涨 20.97%，创业板指上涨 35.58%，科创综指上涨 53.99%。

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 2026 年 6 月 30 日，本基金份额净值富国致享量化选股股票 A 为 1.3192 元，富国致享量化选股股票 C 为 1.3113 元；份额累计净值富国致享量化选股股票 A 为 1.3192 元，富国致享量化选股股票 C 为 1.3113 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国致享量化选股股票 A 为 13.42%，富国致享量化选股股票 C 为 13.10%；同期业绩比较基准收益率情况：富国致享量化选股股票 A 为 8.80%，富国致享量化选股股票 C 为 8.80%。

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,随着部分不确定因素逐步明朗,市场或仍以震荡运行为主。从外部环境来看,地缘政治局势仍可能对市场风险偏好产生扰动,油价冲高后有所回落;美国通胀数据环比回落,叠加非农数据走弱,后续美联储加息预期或有所降温,对全球流动性的压制可能相应缓解。国内方面,经济修复态势短期或将延续,内需仍有待进一步修复,后续稳增长政策及相关工程项目的实施效果值得关注。整体来看,受资金博弈等因素影响,市场运行过程中仍可能伴随节奏波动与反复。8月中报密集披露期可能促使市场进一步关注企业盈利表现,市场机会或更多体现为具有业绩支撑品种的估值修复。

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合规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对富国致享量化选股股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对富国致享量化选股股票型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现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

本报告期内，由富国基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国致享量化选股股票型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	4,872,303.61	4,047,211.89
结算备付金	415,654.03	1,016,892.06
存出保证金	—	357,072.00
交易性金融资产	58,499,233.82	64,132,261.76
其中：股票投资	58,386,920.30	64,025,006.62
基金投资	—	—
债券投资	112,313.52	107,255.14
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	4,290.58	9,999,642.09
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	63,791,482.04	79,553,079.80
负债和净资产	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 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	—	50,000.00
应付清算款	—	—
应付赎回款	1,850,404.05	258,413.41
应付管理人报酬	60,430.17	72,021.65
应付托管费	10,071.68	12,003.62
应付销售服务费	15,601.68	14,496.65
应付投资顾问费	—	—
应交税费	3.70	3,095.03

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	72,233.36	78,703.34
负债合计	2,008,744.64	488,733.70
净资产：		
实收基金	46,978,235.16	68,056,029.07
未分配利润	14,804,502.24	11,008,317.03
净资产合计	61,782,737.40	79,064,346.10
负债和净资产总计	63,791,482.04	79,553,079.80

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3151 元，基金份额总额 46,978,235.16 份。其中：富国致享量化选股股票 A 份额净值 1.3192 元，份额总额 22,932,627.74 份；富国致享量化选股股票 C 份额净值 1.3113 元，份额总额 24,045,607.42 份。

6.2 利润表

会计主体：富国致享量化选股股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2025 年 6 月 25 日(基金合同生效日) 至 2025 年 6 月 30 日)
一、营业总收入	9,426,215.46	14,931.56
1. 利息收入	13,908.42	14,931.56
其中：存款利息收入	13,908.42	14,931.56
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）	9,761,220.06	—
其中：股票投资收益	8,964,503.13	—
基金投资收益	—	—
债券投资收益	44,071.35	—
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	385,259.04	—
股利收益	367,386.54	—
其他投资收益	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-429,538.91	—
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	80,625.89	—
减：二、营业总支出	691,679.64	88,693.22
1. 管理人报酬	459,847.29	54,954.59

2. 托管费	76,641.21	9,159.10
3. 销售服务费	103,156.00	13,379.53
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	2.88	—
其中：卖出回购金融资产支出	2.88	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	1,468.36	—
8. 其他费用	50,563.90	11,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	8,734,535.82	-73,761.66
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	8,734,535.82	-73,761.66
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	8,734,535.82	-73,761.66

6.3 净资产变动表

会计主体：富国致享量化选股股票型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2026年01月01日至2026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	68,056,029.07	11,008,317.03	79,064,346.10
二、本期期初净资产	68,056,029.07	11,008,317.03	79,064,346.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,077,793.91	3,796,185.21	-17,281,608.70
（一）、综合收益总额	—	8,734,535.82	8,734,535.82
（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）	-21,077,793.91	-4,938,350.61	-26,016,144.52
其中：1. 基金申购款	35,824,817.97	8,647,058.06	44,471,876.03
2. 基金赎回款	-56,902,611.88	-13,585,408.67	-70,488,020.55
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—
四、本期期末净资产	46,978,235.16	14,804,502.24	61,782,737.40
项目	上年度可比期间（2025年6月25日（基金合同生效日）至 2025年6月30日）		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、本期期初净资产	334,335,801.71	—	334,335,801.71
二、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	—	-73,761.66	-73,761.66
（一）、综合收益总额	—	-73,761.66	-73,761.66
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—

其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	—	—	—
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—
三、本期期末净资产	334,335,801.71	-73,761.66	334,262,040.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈 戈

林志松

徐 慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国致享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〔2025〕737号《关于准予富国致享量化选股股票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自2025年6月9日至2025年6月23日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具德师报(验)字(25)第00194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2025年6月25日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币334,283,927.51元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币51,874.20元，以上实收基金（本息）合计为人民币334,335,801.71元，折合334,335,801.71份基金份额，其中A类基金份额171,534,771.24份，C类基金份额162,801,030.47份。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票）、港股通标的股票、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%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%）；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。

本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率 $\times$ 90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times$ 5%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 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发布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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发布的其他相关规定。

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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 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

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3% 的征收率计算缴纳增值税；

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

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4 企业所得税

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

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

5 个人所得税

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

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

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

6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题,根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税

[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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（2026 年 06 月 30 日）
活期存款	949,944.85
等于：本金	949,852.55
加：应计利息	92.30
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	3,922,358.76
等于：本金	3,922,022.72
加：应计利息	336.04
减：坏账准备	—
合计	4,872,303.61

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（2026 年 06 月 30 日）			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		57,284,482.24	—	58,386,920.30	1,102,438.06
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	108,370.00	979.84	112,313.52	2,963.68
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	108,370.00	979.84	112,313.52	2,963.68
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		57,392,852.24	979.84	58,499,233.82	1,105,401.74

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（2026年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	662.98
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	40,000.00
预提审计费	26,926.92
其他	4,643.46
合计	72,233.36

6.4.7.7 实收基金

富国致享量化选股股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	43,449,975.16	43,449,975.16
本期申购	8,869,812.47	8,869,812.47
本期赎回（以“-”号填列）	-29,387,159.89	-29,387,159.89
本期末	22,932,627.74	22,932,627.74

富国致享量化选股股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,606,053.91	24,606,053.91
本期申购	26,955,005.50	26,955,005.50
本期赎回（以“-”号填列）	-27,515,451.99	-27,515,451.99
本期末	24,045,607.42	24,045,607.42

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

富国致享量化选股股票 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	8,251,337.49	-1,165,997.24	7,085,340.25
本期期初	8,251,337.49	-1,165,997.24	7,085,340.25
本期利润	5,163,683.62	115,472.67	5,279,156.29
本期基金份额交易产生的变动数	-5,203,406.42	158,896.23	-5,044,510.19
其中：基金申购款	2,408,178.41	-316,570.54	2,091,607.87
基金赎回款	-7,611,584.83	475,466.77	-7,136,118.06
本期已分配利润	—	—	—
本期末	8,211,614.69	-891,628.34	7,319,986.35

富国致享量化选股股票 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	4,581,985.40	-659,008.62	3,922,976.78
本期期初	4,581,985.40	-659,008.62	3,922,976.78
本期利润	4,000,391.11	-545,011.58	3,455,379.53
本期基金份额交易产生的变动数	-165,888.36	272,047.94	106,159.58
其中：基金申购款	6,715,658.38	-160,208.19	6,555,450.19
基金赎回款	-6,881,546.74	432,256.13	-6,449,290.61
本期已分配利润	—	—	—
本期末	8,416,488.15	-931,972.26	7,484,515.89

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
活期存款利息收入	2,975.73
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	6,503.41

结算备付金利息收入	3,601.29
其他	827.99
合计	13,908.42

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
卖出股票成交总额	377,032,382.75
减：卖出股票成本总额	367,531,905.06
减：交易费用	535,974.56
买卖股票差价收入	8,964,503.13

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（2026年01月01日至2026年06月30日）
债券投资收益——利息收入	675.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	43,395.72
合计	44,071.35

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（2026年01月01日至2026年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	110,711.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	67,300.00
减：应计利息总额	10.84
减：交易费用	5.33
买卖债券差价收入	43,395.72

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（2026年01月01日至2026年06月30日）
股指期货投资收益	385,259.04

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
股票投资产生的股利收益	367,386.54
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	367,386.54

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
1. 交易性金融资产	-270,152.24
股票投资	-271,725.92
债券投资	1,573.68
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	-159,386.67
权证投资	—
股指期货	-159,386.67
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	-429,538.91

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
基金赎回费收入	72,396.73
基金转换费收入	8,229.16
合计	80,625.89

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（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
审计费用	8,926.92
信息披露费	40,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	1,628.41
其他	8.57
合计	50,563.90

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、关联关系

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
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
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）		上年度可比期间（2025年6月25日（基金合同生效日）至2025年6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（%）
国泰海通	145,397,919.00	19.67	—	—

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）		上年度可比期间（2025年6月25日（基金合同生效日）至2025年6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（%）
国泰海通	22,246.23	20.09	—	—

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2026年01月01日至2026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（%）
国泰海通	59,018.88	19.67	—	—

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。

本基金上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2025 年 6 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日）
当期发生的基金应支付的管理费	459,847.29	54,954.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	145,251.36	27,048.04
应支付基金管理人的净管理费	314,595.93	27,906.55

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（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2025 年 6 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	76,641.21	9,159.10

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	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
--------------	--

名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国致享量化选股股票 A	富国致享量化选股股票 C	合计
富国基金管理有限公司	—	30,295.18	30,295.18
国泰海通证券股份有限公司	—	609.13	609.13
上海浦东发展银行股份有限公司	—	54,222.22	54,222.22
合计	—	85,126.53	85,126.53

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(2025年6月25日(基金合同生效日)至2025年6月30日)		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国致享量化选股股票 A	富国致享量化选股股票 C	合计
国泰海通证券股份有限公司	—	212.91	212.91
富国基金管理有限公司	—	1.25	1.25
上海浦东发展银行股份有限公司	—	10,069.64	10,069.64
合计	—	10,283.80	10,283.80

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该类基金份额资产净值的 0.6% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

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

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（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2025 年 6 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰海通证券股份有限公司	979,956.41	1,274.32	—	—
上海浦东发展银行股份有限公司	949,944.85	2,975.73	17,339,902.42	4,093.19

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本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（2026 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：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	-------	-----	--------	------	--------	----------	--------	--------	----

113704	春风转债	2026-06-10	1个月内(含)	认购新发证券	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.14	—
118072	鼎通转债	2026-06-24	1个月内(含)	认购新发证券	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.06	—

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
688072	拓荆科技	2026年06月29日	重大事项停牌	832.00	2026年07月13日	890.99	200.00	128,034.41	166,400.00	—

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 2026 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 2026 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（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
AAA	—	—
AAA 以下	11,264.29	6,930.24
未评级	—	—
合计	11,264.29	6,930.24

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

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末无重大流动性风险。

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

单位：人民币元

本期末（2026年06月30日）	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,872,303.61	—	—	—	4,872,303.61

结算备付金	415,654.03	—	—	—	415,654.03
交易性金融资产	112,313.52	—	—	58,386,920.30	58,499,233.82
应收申购款	—	—	—	4,290.58	4,290.58
资产总计	5,400,271.16	—	—	58,391,210.88	63,791,482.04
负债					
应付赎回款	—	—	—	1,850,404.05	1,850,404.05
应付管理人报酬	—	—	—	60,430.17	60,430.17
应付托管费	—	—	—	10,071.68	10,071.68
应付销售服务费	—	—	—	15,601.68	15,601.68
应交税费	—	—	—	3.70	3.70
其他负债	—	—	—	72,233.36	72,233.36
负债总计	—	—	—	2,008,744.64	2,008,744.64
利率敏感度缺口	5,400,271.16	—	—	56,382,466.24	61,782,737.40
上年度末（2025年12月31日）	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,047,211.89	—	—	—	4,047,211.89
结算备付金	1,016,892.06	—	—	—	1,016,892.06
存出保证金	—	—	—	357,072.00	357,072.00
交易性金融资产	107,255.14	—	—	64,025,006.62	64,132,261.76
应收申购款	—	—	—	9,999,642.09	9,999,642.09
资产总计	5,171,359.09	—	—	74,381,720.71	79,553,079.80
负债					
卖出回购金融资产款	50,000.00	—	—	—	50,000.00
应付赎回款	—	—	—	258,413.41	258,413.41
应付管理人报酬	—	—	—	72,021.65	72,021.65
应付托管费	—	—	—	12,003.62	12,003.62
应付销售服务费	—	—	—	14,496.65	14,496.65
应交税费	—	—	—	3,095.03	3,095.03
其他负债	—	—	—	78,703.34	78,703.34
负债总计	50,000.00	—	—	438,733.70	488,733.70
利率敏感度缺口	5,121,359.09	—	—	73,942,987.01	79,064,346.10

注：上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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 影响生息资产公允价值其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026年06月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-29.53	-78.33
	2. 基准点利率减少0.1%	29.53	78.33

注：上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。

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

金额单位：人民币元

项目	本期末（2026年06月30日）		上年度末（2025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	58,386,920.30	94.50	64,025,006.62	80.98
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	112,313.52	0.18	107,255.14	0.14
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	58,499,233.82	94.69	64,132,261.76	81.11

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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（2026年06月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加1%	670,217.31	722,803.83
	2. 业绩比较基准减少1%	-670,217.31	-722,803.83

注：本基金管理人运用资本资产定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上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。

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（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
第一层次	58,226,784.39	63,988,585.05
第二层次	272,449.43	141,730.01
第三层次	—	1,946.70
合计	58,499,233.82	64,132,261.76

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业等情况，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	58,386,920.30	91.53
	其中：股票	58,386,920.30	91.53
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	112,313.52	0.18
	其中：债券	112,313.52	0.18
	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	5,287,957.64	8.29
8	其他各项资产	4,290.58	0.01
9	合计	63,791,482.04	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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	362,295.00	0.59
B	采矿业	2,523,021.00	4.08
C	制造业	43,337,948.30	70.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	551,262.00	0.89
E	建筑业	922,567.00	1.49
F	批发和零售业	1,302,839.25	2.11
G	交通运输、仓储和邮政业	887,687.00	1.44
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,695,722.13	7.60
J	金融业	1,002,777.00	1.62
K	房地产业	845,223.00	1.37
L	租赁和商务服务业	362,126.00	0.59
M	科学研究和技术服务业	836,306.34	1.35
N	水利、环境和公共设施管理业	557,447.28	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	34,100.00	0.06
P	教育	51,525.00	0.08

Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	114,074.00	0.18
S	综合	—	—
	合计	58,386,920.30	94.50

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	300308	中际旭创	800	1,016,000.00	1.64
2	688002	睿创微纳	4,080	631,135.20	1.02
3	002466	天齐锂业	9,700	594,804.00	0.96
4	688525	佰维存储	1,104	546,181.92	0.88
5	300953	震裕科技	3,940	526,778.00	0.85
6	301536	星宸科技	4,000	514,840.00	0.83
7	002414	高德红外	35,600	472,056.00	0.76
8	002709	天赐材料	8,900	457,727.00	0.74
9	001389	广合科技	1,900	450,775.00	0.73
10	300438	鹏辉能源	5,300	439,105.00	0.71
11	301308	江波龙	600	422,280.00	0.68
12	002384	东山精密	1,600	419,760.00	0.68
13	688503	聚和材料	3,104	411,900.80	0.67
14	603986	兆易创新	500	407,500.00	0.66
15	688008	澜起科技	1,265	392,023.50	0.63
16	002738	中矿资源	6,600	389,334.00	0.63
17	688390	固德威	3,540	384,125.40	0.62
18	688025	杰普特	816	383,520.00	0.62
19	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.61
20	001309	德明利	400	377,160.00	0.61
21	603799	华友钴业	7,800	376,428.00	0.61
22	300750	宁德时代	900	353,709.00	0.57
23	688521	芯原股份	905	335,881.70	0.54
24	000933	神火股份	15,100	320,120.00	0.52
25	301607	富特科技	6,000	313,500.00	0.51
26	603259	药明康德	2,500	311,275.00	0.50
27	688519	南亚新材	808	307,072.32	0.50
28	688536	思瑞浦	835	304,015.15	0.49
29	002716	湖南白银	36,400	294,476.00	0.48
30	688428	诺诚健华	10,247	291,732.09	0.47
31	000603	盛达资源	11,900	274,890.00	0.44
32	601869	长飞光纤	500	272,950.00	0.44
33	300972	万辰集团	1,500	260,115.00	0.42

34	000975	山金国际	14,900	253,300.00	0.41
35	002379	宏桥控股	17,000	251,090.00	0.41
36	300223	君正股份	1,000	248,900.00	0.40
37	002497	雅化集团	12,200	248,514.00	0.40
38	600547	山东黄金	10,700	247,063.00	0.40
39	600487	亨通光电	2,200	240,548.00	0.39
40	600418	江淮汽车	9,300	240,219.00	0.39
41	002653	海思科	3,600	238,824.00	0.39
42	603538	美诺华	7,300	237,615.00	0.38
43	688578	艾力斯	2,158	235,653.60	0.38
44	300497	富祥股份	10,500	232,680.00	0.38
45	300037	新宙邦	2,500	232,125.00	0.38
46	300661	圣邦股份	1,600	229,568.00	0.37
47	002460	赣锋锂业	3,500	228,900.00	0.37
48	301150	中一科技	3,600	227,196.00	0.37
49	002558	巨人网络	8,100	223,236.00	0.36
50	000415	渤海租赁	54,700	222,629.00	0.36
51	301086	鸿富瀚	1,060	221,836.80	0.36
52	300503	昊志机电	2,400	221,520.00	0.36
53	688090	瑞松科技	2,080	221,416.00	0.36
54	301099	雅创电子	2,300	219,650.00	0.36
55	000810	创维数字	16,500	218,625.00	0.35
56	300857	协创数据	640	217,536.00	0.35
57	002463	沪电股份	1,400	213,920.00	0.35
58	300769	德方纳米	3,200	212,800.00	0.34
59	600663	陆家嘴	33,600	211,008.00	0.34
60	603345	安井食品	2,600	208,494.00	0.34
61	688110	东芯股份	1,023	208,385.10	0.34
62	688221	前沿生物	9,301	208,342.40	0.34
63	300613	富瀚微	2,600	208,208.00	0.34
64	688059	华锐精密	1,040	207,698.40	0.34
65	601083	锦江航运	20,700	205,758.00	0.33
66	300164	通源石油	25,700	205,600.00	0.33
67	001314	亿道信息	3,300	203,940.00	0.33
68	688388	嘉元科技	4,591	202,004.00	0.33
69	688353	华盛锂电	1,736	201,497.52	0.33
70	600502	安徽建工	46,100	200,535.00	0.32
71	002455	百川股份	27,800	200,160.00	0.32
72	002326	永太科技	8,400	198,660.00	0.32
73	688052	纳芯微	686	197,780.66	0.32
74	300724	捷佳伟创	2,800	197,680.00	0.32

75	002293	罗莱生活	19,700	194,833.00	0.32
76	601117	中国化学	26,500	194,775.00	0.32
77	603906	龙蟠科技	7,200	191,016.00	0.31
78	000807	云铝股份	8,600	190,404.00	0.31
79	300723	一品红	5,100	190,128.00	0.31
80	301358	湖南裕能	2,500	189,675.00	0.31
81	300775	三角防务	8,600	189,544.00	0.31
82	002850	科达利	1,000	189,300.00	0.31
83	300620	光库科技	500	189,100.00	0.31
84	301216	万凯新材	8,200	188,518.00	0.31
85	002544	普天科技	10,300	187,666.00	0.30
86	301500	飞南资源	7,200	187,560.00	0.30
87	000059	华锦股份	49,700	186,375.00	0.30
88	688717	艾罗能源	2,246	185,452.22	0.30
89	600773	西藏城投	14,400	185,328.00	0.30
90	600064	南京高科	25,900	184,667.00	0.30
91	300017	网宿科技	14,100	183,441.00	0.30
92	301031	中熔电气	1,532	182,997.40	0.30
93	002134	天津普林	6,000	182,520.00	0.30
94	300475	香农芯创	600	180,000.00	0.29
95	688301	奕瑞科技	1,450	179,800.00	0.29
96	002284	亚太股份	18,800	178,412.00	0.29
97	688266	泽璟制药	1,526	178,023.16	0.29
98	688045	必易微	2,199	177,635.22	0.29
99	002532	天山铝业	16,500	177,045.00	0.29
100	300672	国科微	600	177,000.00	0.29
101	002946	新乳业	12,500	176,000.00	0.28
102	688368	晶丰明源	811	175,597.72	0.28
103	688111	金山办公	820	174,701.00	0.28
104	688700	东威科技	1,945	173,883.00	0.28
105	688331	荣昌生物	1,325	172,594.50	0.28
106	301246	宏源药业	6,400	172,160.00	0.28
107	688472	阿特斯	15,885	171,875.70	0.28
108	300681	英搏尔	6,000	171,720.00	0.28
109	688311	盟升电子	6,510	170,496.90	0.28
110	301189	奥尼电子	2,880	169,718.40	0.27
111	688195	腾景科技	880	169,470.40	0.27
112	001298	好上好	8,135	168,801.25	0.27
113	300444	双杰电气	13,800	168,498.00	0.27
114	300970	华绿生物	9,200	168,176.00	0.27
115	603507	振江股份	5,100	167,739.00	0.27

116	688072	拓荆科技	200	166,400.00	0.27
117	002222	福晶科技	1,800	166,104.00	0.27
118	688279	峰岷科技	740	166,085.60	0.27
119	600577	精达股份	16,900	165,282.00	0.27
120	301377	鼎泰高科	300	165,270.00	0.27
121	600363	联创光电	4,600	164,588.00	0.27
122	600489	中金黄金	9,000	162,450.00	0.26
123	000792	盐湖股份	5,300	160,007.00	0.26
124	002947	恒铭达	2,100	159,705.00	0.26
125	688372	伟测科技	853	158,658.00	0.26
126	002493	荣盛石化	14,700	158,025.00	0.26
127	601699	潞安环能	10,800	154,224.00	0.25
128	601899	紫金矿业	6,100	153,354.00	0.25
129	600331	宏达股份	13,900	152,761.00	0.25
130	002353	杰瑞股份	1,000	152,500.00	0.25
131	000890	法尔胜	18,900	152,334.00	0.25
132	605599	菜百股份	11,100	152,070.00	0.25
133	300511	雪榕生物	29,300	147,379.00	0.24
134	002812	恩捷股份	2,200	147,202.00	0.24
135	002345	潮宏基	16,000	146,720.00	0.24
136	603306	华懋科技	1,400	145,166.00	0.23
137	600233	圆通速递	9,200	144,900.00	0.23
138	002948	青岛银行	28,500	144,780.00	0.23
139	300118	东方日升	11,600	144,420.00	0.23
140	603629	利通电子	800	143,048.00	0.23
141	000426	兴业银锡	4,300	141,728.00	0.23
142	688202	美迪西	1,754	141,565.34	0.23
143	000923	河钢资源	11,300	140,233.00	0.23
144	601688	华泰证券	6,800	140,216.00	0.23
145	603316	诚邦股份	6,800	140,012.00	0.23
146	688099	晶晨股份	1,359	139,841.10	0.23
147	300476	胜宏科技	400	138,572.00	0.22
148	002273	水晶光电	3,900	138,372.00	0.22
149	603929	亚翔集成	500	136,010.00	0.22
150	688041	海光信息	367	135,900.10	0.22
151	603663	三祥新材	1,400	134,820.00	0.22
152	000776	广发证券	5,700	133,380.00	0.22
153	300191	潜能恒信	4,800	132,720.00	0.21
154	002517	恺英网络	8,100	131,625.00	0.21
155	300986	志特新材	7,600	130,340.00	0.21
156	301511	德福科技	900	129,465.00	0.21

157	002975	博杰股份	900	127,800.00	0.21
158	688220	翱捷科技	1,023	127,179.36	0.21
159	600999	招商证券	6,000	126,600.00	0.20
160	003010	若羽臣	5,200	126,360.00	0.20
161	301316	慧博云通	3,200	126,016.00	0.20
162	601360	三六零	14,500	126,005.00	0.20
163	688309	恒誉科技	2,065	125,717.20	0.20
164	688257	新锐股份	1,227	125,031.30	0.20
165	603778	国晟科技	10,100	124,230.00	0.20
166	300757	罗博特科	200	123,800.00	0.20
167	000592	平潭发展	18,500	123,765.00	0.20
168	688416	恒烁股份	869	121,660.00	0.20
169	600299	安迪苏	15,400	120,890.00	0.20
170	300049	福瑞医科	3,100	120,528.00	0.20
171	300865	大宏立	5,500	120,175.00	0.19
172	603619	中曼石油	6,400	119,744.00	0.19
173	603978	深圳新星	3,800	119,434.00	0.19
174	300821	东岳硅材	5,700	117,192.00	0.19
175	600026	中远海能	6,500	116,610.00	0.19
176	600176	中国巨石	1,600	116,608.00	0.19
177	002468	申通快递	8,000	116,480.00	0.19
178	600601	方正科技	8,400	116,256.00	0.19
179	300033	同花顺	480	115,680.00	0.19
180	300590	移为通信	8,000	114,800.00	0.19
181	688568	中科星图	2,755	114,249.85	0.18
182	601872	招商轮船	6,500	114,205.00	0.18
183	001337	四川黄金	3,100	113,646.00	0.18
184	300677	英科医疗	2,900	113,593.00	0.18
185	688156	路德科技	3,745	113,286.25	0.18
186	002747	埃斯顿	3,000	111,990.00	0.18
187	002922	伊戈尔	3,400	111,520.00	0.18
188	688409	富创精密	363	111,168.75	0.18
189	605117	德业股份	1,040	110,427.20	0.18
190	601339	百隆东方	16,300	110,351.00	0.18
191	002506	协鑫集成	34,700	110,346.00	0.18
192	600875	东方电气	3,800	109,326.00	0.18
193	001287	中电港	3,500	109,025.00	0.18
194	002131	利欧股份	22,900	108,775.00	0.18
195	002291	遥望科技	22,500	108,000.00	0.17
196	001914	招商积余	13,200	107,712.00	0.17
197	603290	斯达半导	700	107,058.00	0.17

198	000060	中金岭南	14,100	106,737.00	0.17
199	603063	禾望电气	2,000	105,780.00	0.17
200	600919	江苏银行	9,800	105,644.00	0.17
201	000547	航天发展	5,500	105,325.00	0.17
202	000657	中钨高新	1,100	105,292.00	0.17
203	600392	盛和资源	3,500	104,195.00	0.17
204	300014	亿纬锂能	1,600	104,048.00	0.17
205	600183	生益科技	600	104,040.00	0.17
206	002545	东方铁塔	6,400	103,808.00	0.17
207	002028	思源电气	600	103,800.00	0.17
208	300959	线上线下	700	103,467.00	0.17
209	600410	华胜天成	6,500	102,895.00	0.17
210	688556	高测股份	7,717	102,481.76	0.17
211	300139	晓程科技	2,800	102,340.00	0.17
212	688235	百济神州	401	102,098.61	0.17
213	300416	苏试试验	5,000	101,900.00	0.16
214	002297	博云新材	3,500	101,465.00	0.16
215	601139	深圳燃气	17,900	101,314.00	0.16
216	002271	东方雨虹	8,500	100,895.00	0.16
217	000969	安泰科技	4,100	100,614.00	0.16
218	002171	楚江新材	7,400	100,418.00	0.16
219	688048	长光华芯	200	100,400.00	0.16
220	600177	雅戈尔	13,300	100,149.00	0.16
221	600323	瀚蓝环境	3,600	98,856.00	0.16
222	600330	天通股份	3,200	98,688.00	0.16
223	300842	帝科股份	1,100	98,087.00	0.16
224	600988	赤峰黄金	3,700	97,384.00	0.16
225	603308	应流股份	1,600	96,640.00	0.16
226	605299	舒华体育	7,100	94,785.00	0.15
227	002429	兆驰股份	9,000	93,510.00	0.15
228	000301	东方盛虹	8,100	92,745.00	0.15
229	002266	浙富控股	18,300	92,598.00	0.15
230	002039	黔源电力	4,900	92,218.00	0.15
231	300903	科翔股份	900	91,179.00	0.15
232	600166	福田汽车	31,200	90,792.00	0.15
233	000733	振华科技	1,600	90,624.00	0.15
234	600429	三元股份	22,400	90,496.00	0.15
235	002803	吉宏股份	3,500	90,440.00	0.15
236	301210	金杨精密	3,000	90,000.00	0.15
237	300490	华自科技	6,800	89,964.00	0.15
238	300766	每日互动	4,200	89,880.00	0.15

239	688262	国芯科技	2,070	89,486.10	0.14
240	301510	固高科技	2,800	89,404.00	0.14
241	300777	中简科技	3,400	89,352.00	0.14
242	603057	紫燕食品	4,000	89,200.00	0.14
243	301002	崧盛股份	2,300	88,780.00	0.14
244	301338	凯格精机	540	87,960.60	0.14
245	603163	圣晖集成	600	87,900.00	0.14
246	300693	盛弘股份	1,800	87,750.00	0.14
247	300867	圣元环保	4,800	86,976.00	0.14
248	601778	晶科科技	20,200	86,860.00	0.14
249	001203	大中矿业	2,900	86,855.00	0.14
250	601512	中新集团	11,100	86,580.00	0.14
251	605358	立昂微	1,100	85,360.00	0.14
252	002240	盛新锂能	1,900	85,177.00	0.14
253	002064	华峰化学	8,900	84,461.00	0.14
254	688313	仕佳光子	455	84,015.75	0.14
255	605222	起帆电缆	3,600	83,952.00	0.14
256	300551	古鳌科技	8,500	83,640.00	0.14
257	688668	鼎通科技	224	83,619.20	0.14
258	600350	山东高速	7,500	83,475.00	0.14
259	002838	道恩股份	2,700	82,674.00	0.13
260	688308	欧科亿	447	81,269.07	0.13
261	600015	华夏银行	12,600	80,514.00	0.13
262	688173	希荻微	4,197	80,330.58	0.13
263	603127	昭衍新药	2,100	80,262.00	0.13
264	300274	阳光电源	500	79,510.00	0.13
265	688516	奥特维	1,378	79,083.42	0.13
266	688681	科汇股份	5,649	78,973.02	0.13
267	600801	华新建材	5,000	78,000.00	0.13
268	601231	环旭电子	2,400	77,760.00	0.13
269	600566	济川药业	3,500	77,665.00	0.13
270	002402	和而泰	3,000	77,490.00	0.13
271	301248	杰创智能	900	75,537.00	0.12
272	002163	海南发展	9,000	75,060.00	0.12
273	300257	开山股份	2,600	74,568.00	0.12
274	300129	泰胜风能	8,700	74,385.00	0.12
275	002079	苏州固锝	4,900	73,647.00	0.12
276	301606	绿联科技	1,200	73,224.00	0.12
277	600741	华域汽车	4,700	72,944.00	0.12
278	300102	乾照光电	2,800	72,912.00	0.12
279	002339	积成电子	10,400	72,072.00	0.12

280	603216	梦天家居	3,500	71,995.00	0.12
281	002768	国恩股份	1,372	71,426.32	0.12
282	688345	博力威	1,218	70,741.44	0.11
283	002913	奥士康	1,100	70,334.00	0.11
284	002034	旺能环境	4,600	69,690.00	0.11
285	300870	欧陆通	200	69,138.00	0.11
286	300699	光威复材	2,400	68,760.00	0.11
287	300432	富临精工	3,400	68,306.00	0.11
288	000719	中原传媒	5,900	67,437.00	0.11
289	688228	开普云	869	67,208.46	0.11
290	301396	宏景科技	200	66,320.00	0.11
291	600885	宏发股份	1,900	65,531.00	0.11
292	000990	诚志股份	8,000	65,440.00	0.11
293	002342	巨力索具	6,200	65,162.00	0.11
294	688337	普源精电	869	65,114.17	0.11
295	300491	通合科技	1,700	64,923.00	0.11
296	002821	凯莱英	400	64,800.00	0.10
297	300700	岱勒新材	3,000	63,840.00	0.10
298	002475	立讯精密	900	63,360.00	0.10
299	688660	电气风电	7,346	63,322.52	0.10
300	000534	万泽股份	2,300	62,928.00	0.10
301	000429	粤高速A	4,600	62,790.00	0.10
302	301117	ST 佳缘	2,600	60,710.00	0.10
303	003022	联泓新科	2,300	59,570.00	0.10
304	000533	顺钠股份	6,200	58,962.00	0.10
305	600037	歌华有线	9,400	58,938.00	0.10
306	603276	恒兴新材	3,839	58,775.09	0.10
307	300926	博俊科技	3,300	58,575.00	0.09
308	000572	海马汽车	15,600	57,720.00	0.09
309	002643	万润股份	2,700	56,565.00	0.09
310	300576	容大感光	1,100	56,342.00	0.09
311	601233	桐昆股份	2,600	56,290.00	0.09
312	002250	联化科技	4,100	56,047.00	0.09
313	301326	捷邦科技	400	55,748.00	0.09
314	002837	英维克	700	55,692.00	0.09
315	301487	盟固利	2,900	55,535.00	0.09
316	301285	鸿日达	500	55,165.00	0.09
317	300782	卓胜微	500	54,790.00	0.09
318	688196	卓越新能	1,519	54,532.10	0.09
319	688226	威腾电气	1,266	54,222.78	0.09
320	600150	中国船舶	1,600	54,064.00	0.09

321	300984	金沃股份	1,000	53,730.00	0.09
322	300850	新强联	2,000	53,600.00	0.09
323	688253	英诺特	887	53,468.36	0.09
324	603703	盛洋科技	4,800	53,280.00	0.09
325	688223	晶科能源	11,190	53,152.50	0.09
326	603256	宏和科技	200	53,066.00	0.09
327	688208	道通科技	2,078	52,344.82	0.08
328	002487	大金重工	900	52,173.00	0.08
329	300492	华图山鼎	1,500	51,525.00	0.08
330	300183	东软载波	4,900	51,205.00	0.08
331	603083	剑桥科技	200	50,974.00	0.08
332	002969	嘉美包装	3,600	50,688.00	0.08
333	002104	恒宝股份	4,900	50,519.00	0.08
334	688518	联赢激光	1,620	50,058.00	0.08
335	300151	昌红科技	2,000	49,900.00	0.08
336	300837	浙矿股份	2,100	49,896.00	0.08
337	603190	亚通精工	2,200	49,764.00	0.08
338	300696	爱乐达	1,900	49,457.00	0.08
339	300715	凯伦股份	3,000	49,380.00	0.08
340	300074	华平股份	14,400	48,960.00	0.08
341	601777	千里科技	6,000	48,960.00	0.08
342	600989	宝丰能源	2,400	48,792.00	0.08
343	002824	和胜股份	1,400	48,412.00	0.08
344	002324	普利特	4,000	48,280.00	0.08
345	301529	福赛科技	500	48,180.00	0.08
346	300740	水羊股份	2,600	47,866.00	0.08
347	688258	卓易信息	400	47,416.00	0.08
348	300596	利安隆	900	47,232.00	0.08
349	600208	衢州发展	16,600	46,978.00	0.08
350	002478	常宝股份	7,600	46,968.00	0.08
351	001301	尚太科技	500	46,755.00	0.08
352	601118	海南橡胶	9,500	46,740.00	0.08
353	603267	鸿远电子	600	46,488.00	0.08
354	688095	福昕软件	780	46,355.40	0.08
355	300602	飞荣达	900	46,080.00	0.07
356	688049	炬芯科技	979	45,924.89	0.07
357	002805	丰元股份	1,600	45,744.00	0.07
358	301259	艾布鲁	1,740	45,675.00	0.07
359	688209	英集芯	1,551	45,103.08	0.07
360	300055	万邦达	7,000	45,010.00	0.07
361	002077	大港股份	2,300	44,367.00	0.07

362	300222	科大智能	3,200	44,320.00	0.07
363	300417	南华仪器	4,300	44,118.00	0.07
364	603185	弘元绿能	2,600	43,394.00	0.07
365	688107	安路科技	949	43,274.40	0.07
366	300824	北鼎股份	6,000	43,080.00	0.07
367	603936	博敏电子	1,600	42,736.00	0.07
368	688396	华润微	438	42,726.90	0.07
369	300923	研奥股份	1,900	42,332.00	0.07
370	603931	格林达	700	41,580.00	0.07
371	001896	豫能控股	2,500	41,525.00	0.07
372	300400	劲拓股份	1,100	41,415.00	0.07
373	300112	万讯自控	6,600	40,854.00	0.07
374	301093	华兰股份	300	40,689.00	0.07
375	603679	华体科技	2,000	40,360.00	0.07
376	300270	中威电子	3,100	40,331.00	0.07
377	605365	立达信	2,800	40,264.00	0.07
378	300632	光莆股份	1,400	39,970.00	0.06
379	301359	东南电子	2,500	39,700.00	0.06
380	301291	明阳电气	1,100	39,589.00	0.06
381	300051	璩升科技	4,500	39,420.00	0.06
382	000811	冰轮环境	700	39,354.00	0.06
383	600985	淮北矿业	2,800	39,340.00	0.06
384	601997	贵阳银行	7,600	38,988.00	0.06
385	603889	新澳股份	7,620	38,938.20	0.06
386	688261	东微半导	367	38,509.31	0.06
387	601168	西部矿业	1,400	37,996.00	0.06
388	300774	倍杰特	3,500	37,625.00	0.06
389	603122	合富中国	3,400	37,264.00	0.06
390	603016	新宏泰	1,100	37,136.00	0.06
391	002899	英派斯	1,700	37,060.00	0.06
392	601009	南京银行	3,700	36,593.00	0.06
393	300619	金银河	1,170	36,398.70	0.06
394	688455	科捷智能	1,948	36,349.68	0.06
395	688628	优利德	367	36,310.98	0.06
396	600023	浙能电力	6,900	36,294.00	0.06
397	301200	大族数控	100	36,065.00	0.06
398	300991	创益通	1,000	35,210.00	0.06
399	002683	广东宏大	1,200	35,148.00	0.06
400	300689	澄天伟业	500	35,090.00	0.06
401	300157	新锦动力	9,500	35,055.00	0.06
402	688068	热景生物	400	34,640.00	0.06

403	601567	三星电气	2,300	34,362.00	0.06
404	300658	延江股份	3,000	34,290.00	0.06
405	300736	百邦科技	1,100	34,100.00	0.06
406	002851	麦格米特	200	33,436.00	0.05
407	300461	田中精机	900	33,336.00	0.05
408	600722	金牛化工	4,100	33,292.00	0.05
409	688191	智洋创新	901	32,165.70	0.05
410	300277	汽轮科技	2,100	31,584.00	0.05
411	301006	迈拓股份	2,500	31,375.00	0.05
412	301037	保立佳	2,600	31,200.00	0.05
413	301373	凌玮科技	200	31,100.00	0.05
414	301328	维峰电子	435	30,972.00	0.05
415	600893	航发动力	800	30,672.00	0.05
416	300250	初灵信息	2,100	30,618.00	0.05
417	688296	和达科技	2,660	30,430.40	0.05
418	002494	华斯股份	6,800	30,192.00	0.05
419	001316	润贝航科	900	29,682.00	0.05
420	002780	三夫户外	2,400	29,136.00	0.05
421	605289	罗曼股份	200	29,000.00	0.05
422	601939	建设银行	3,000	28,890.00	0.05
423	301603	乔锋智能	200	28,760.00	0.05
424	605196	华通线缆	1,100	28,710.00	0.05
425	002338	奥普光电	500	28,600.00	0.05
426	002796	世嘉科技	700	28,546.00	0.05
427	003035	南网能源	4,900	28,518.00	0.05
428	002911	佛燃能源	3,000	28,470.00	0.05
429	300132	诺斯贝尔	5,000	28,400.00	0.05
430	603067	振华股份	600	27,774.00	0.04
431	300101	振芯科技	1,700	27,489.00	0.04
432	002195	岩山科技	4,200	27,468.00	0.04
433	002083	孚日股份	2,600	27,274.00	0.04
434	688199	久日新材	789	27,244.17	0.04
435	300153	科泰电源	1,200	27,144.00	0.04
436	688312	燕麦科技	322	27,044.78	0.04
437	300943	春晖智控	600	26,970.00	0.04
438	605122	四方新材	2,500	26,950.00	0.04
439	600693	东百集团	3,400	26,656.00	0.04
440	301251	威尔高	500	26,640.00	0.04
441	300988	津荣天宇	1,700	26,571.00	0.04
442	002943	宇晶股份	600	26,538.00	0.04
443	600750	华润江中	1,200	26,484.00	0.04

444	002180	奔图科技	1,600	26,176.00	0.04
445	300255	常山药业	1,100	25,762.00	0.04
446	300478	杭州高新	700	25,683.00	0.04
447	603826	坤彩科技	1,000	25,560.00	0.04
448	300393	中来股份	3,500	25,515.00	0.04
449	300201	海伦哲	1,200	25,284.00	0.04
450	301196	唯科科技	200	25,084.00	0.04
451	002955	鸿合科技	700	25,025.00	0.04
452	002792	通宇通讯	700	24,899.00	0.04
453	688378	奥来德	400	24,800.00	0.04
454	688469	芯联集成	2,299	24,392.39	0.04
455	300713	英可瑞	1,900	24,206.00	0.04
456	603706	东方环宇	1,400	24,206.00	0.04
457	300121	阳谷华泰	1,900	23,940.00	0.04
458	688326	经纬恒润	335	23,744.80	0.04
459	002990	盛视科技	300	23,700.00	0.04
460	002624	完美世界	1,900	23,598.00	0.04
461	002757	南兴股份	1,300	23,465.00	0.04
462	300440	运达科技	1,100	23,463.00	0.04
463	603876	鼎胜新材	900	23,409.00	0.04
464	688486	龙迅股份	367	23,333.86	0.04
465	603319	美湖股份	700	23,247.00	0.04
466	600590	泰豪科技	2,300	23,230.00	0.04
467	301345	涛涛车业	100	23,100.00	0.04
468	600666	奥瑞德	5,800	23,026.00	0.04
469	688058	宝兰德	1,100	23,012.00	0.04
470	688678	福立旺	937	22,647.29	0.04
471	605318	法狮龙	200	22,572.00	0.04
472	688776	国光电气	367	22,511.78	0.04
473	301280	珠城科技	440	22,250.80	0.04
474	600230	沧州大化	1,700	22,134.00	0.04
475	301321	翰博高新	500	22,075.00	0.04
476	002718	友邦吊顶	200	22,050.00	0.04
477	601133	柏诚股份	500	22,020.00	0.04
478	300609	汇纳科技	700	21,994.00	0.04
479	002736	国信证券	2,200	21,978.00	0.04
480	688299	长阳科技	1,296	21,656.16	0.04
481	000593	德龙汇能	1,000	21,380.00	0.03
482	688063	派能科技	400	21,308.00	0.03
483	688277	天智航	1,245	21,289.50	0.03
484	300364	中文在线	900	21,231.00	0.03

485	300469	信息发展	400	21,044.00	0.03
486	000935	四川双马	800	20,872.00	0.03
487	605287	德才股份	500	20,745.00	0.03
488	688484	南芯科技	367	20,731.83	0.03
489	600903	贵州燃气	3,100	20,584.00	0.03
490	600769	祥龙电业	1,000	20,510.00	0.03
491	605189	富春染织	1,700	20,485.00	0.03
492	301252	同星科技	500	20,265.00	0.03
493	300409	道氏技术	1,000	19,930.00	0.03
494	603615	茶花股份	1,200	19,380.00	0.03
495	002997	瑞鹄模具	700	19,292.00	0.03
496	001965	招商公路	2,100	19,236.00	0.03
497	603588	高能环境	1,000	19,200.00	0.03
498	002043	兔宝宝	1,700	18,836.00	0.03
499	600714	金瑞矿业	900	18,477.00	0.03
500	300684	中石科技	300	18,300.00	0.03
501	300552	万集科技	800	18,280.00	0.03
502	300663	科蓝软件	2,700	17,982.00	0.03
503	002701	奥瑞金	4,200	17,892.00	0.03
504	603026	石大胜华	200	17,874.00	0.03
505	002142	宁波银行	600	17,814.00	0.03
506	002049	紫光国微	200	17,750.00	0.03
507	300269	联建光电	3,200	17,632.00	0.03
508	301061	匠心家居	500	17,535.00	0.03
509	300919	中伟新材	400	17,500.00	0.03
510	603200	上海洗霸	400	17,344.00	0.03
511	600012	皖通高速	1,100	17,336.00	0.03
512	002348	高乐股份	1,600	16,864.00	0.03
513	300324	旋极信息	4,500	16,740.00	0.03
514	688153	唯捷创芯	520	16,702.40	0.03
515	300442	润泽科技	200	16,614.00	0.03
516	600113	浙江东日	500	16,590.00	0.03
517	300621	维业股份	2,600	16,510.00	0.03
518	301219	腾远钴业	300	16,440.00	0.03
519	300541	先进数通	1,700	16,405.00	0.03
520	688690	纳微科技	367	16,184.70	0.03
521	688155	先惠技术	200	16,178.00	0.03
522	600683	京投发展	1,400	16,100.00	0.03
523	600757	长江传媒	2,200	16,082.00	0.03
524	002151	北斗星通	500	15,875.00	0.03
525	688182	灿勤科技	367	15,806.69	0.03

526	600075	新疆天业	3,900	15,756.00	0.03
527	301371	敷尔佳	600	15,600.00	0.03
528	688679	通源环境	367	15,447.03	0.03
529	300951	博硕科技	300	15,150.00	0.02
530	603806	福斯特	900	15,111.00	0.02
531	600378	昊华科技	200	15,076.00	0.02
532	002008	大族激光	100	15,011.00	0.02
533	002534	西子洁能	800	14,840.00	0.02
534	300929	华骐环保	1,400	14,756.00	0.02
535	002956	西麦食品	700	14,532.00	0.02
536	603228	景旺电子	200	14,482.00	0.02
537	603150	万朗磁塑	200	14,160.00	0.02
538	301169	零点有数	200	14,132.00	0.02
539	300500	启迪设计	1,600	14,128.00	0.02
540	301567	贝隆精密	400	13,844.00	0.02
541	603519	立霸股份	900	13,770.00	0.02
542	301113	雅艺科技	920	13,717.20	0.02
543	002972	科安达	700	13,692.00	0.02
544	301226	祥明智能	400	13,276.00	0.02
545	688391	钜泉科技	368	13,200.16	0.02
546	601069	西部黄金	600	13,200.00	0.02
547	605255	天普股份	200	13,158.00	0.02
548	300933	中辰股份	2,100	12,768.00	0.02
549	605198	安德利	200	12,672.00	0.02
550	301268	铭利达	900	12,582.00	0.02
551	301429	森泰股份	800	12,536.00	0.02
552	601127	赛力斯	200	12,250.00	0.02
553	688510	航亚科技	503	12,011.64	0.02
554	001288	运机集团	500	11,895.00	0.02
555	301152	天力锂能	500	11,835.00	0.02
556	603979	金诚信	200	11,806.00	0.02
557	000783	长江证券	1,200	11,700.00	0.02
558	300916	朗特智能	500	11,685.00	0.02
559	688653	康希通信	669	11,627.22	0.02
560	301057	汇隆新材	500	11,500.00	0.02
561	002203	海亮股份	500	11,425.00	0.02
562	300709	精研科技	200	11,250.00	0.02
563	300971	博亚精工	600	11,196.00	0.02
564	300765	石药创新	400	10,892.00	0.02
565	300513	恒实科技	1,500	10,860.00	0.02
566	002218	拓日新能	2,800	10,752.00	0.02

567	300995	奇德新材	400	10,724.00	0.02
568	301172	君逸数码	400	10,380.00	0.02
569	603897	长城科技	300	9,738.00	0.02
570	688418	震有科技	200	9,616.00	0.02
571	605208	永茂泰	600	9,570.00	0.02
572	603025	大豪科技	700	9,548.00	0.02
573	300854	中兰环保	500	9,540.00	0.02
574	300644	南京聚隆	400	9,352.00	0.02
575	301526	国际复材	200	9,334.00	0.02
576	000892	欢瑞世纪	2,800	9,324.00	0.02
577	300680	隆盛科技	400	9,088.00	0.01
578	301555	惠柏新材	200	9,082.00	0.01
579	603610	麒盛科技	500	8,980.00	0.01
580	001360	南矿集团	500	8,845.00	0.01
581	603926	铁流股份	500	8,845.00	0.01
582	688593	新相微	227	8,834.84	0.01
583	603960	克来机电	500	8,705.00	0.01
584	002734	利民股份	500	8,585.00	0.01
585	002685	华东重机	1,300	8,398.00	0.01
586	002368	太极股份	600	8,394.00	0.01
587	003816	中国广核	2,100	8,211.00	0.01
588	000039	中集集团	1,000	8,110.00	0.01
589	001311	多利科技	500	8,065.00	0.01
590	600595	中孚实业	1,400	7,868.00	0.01
591	300249	依米康	500	7,700.00	0.01
592	002531	天顺风能	900	7,587.00	0.01
593	300407	凯发电气	700	7,560.00	0.01
594	002912	中新赛克	400	7,376.00	0.01
595	603311	金海高科	200	7,330.00	0.01
596	605058	澳弘电子	200	7,232.00	0.01
597	002319	乐通股份	700	7,224.00	0.01
598	300686	智动力	400	7,204.00	0.01
599	002248	华东数控	800	7,200.00	0.01
600	301631	壹连科技	100	7,186.00	0.01
601	002320	海峡股份	1,100	6,897.00	0.01
602	600515	海南机场	2,500	6,850.00	0.01
603	301081	严牌股份	500	6,840.00	0.01
604	603867	新化股份	200	6,698.00	0.01
605	600391	航发科技	200	6,690.00	0.01
606	300053	航宇微	400	6,580.00	0.01
607	603829	洛凯股份	400	6,548.00	0.01

608	002394	联发股份	700	6,244.00	0.01
609	002264	新华都	1,100	6,204.00	0.01
610	002733	雄韬股份	200	6,196.00	0.01
611	001230	劲旅环境	400	6,144.00	0.01
612	603833	欧派家居	200	6,022.00	0.01
613	688512	慧智微	367	5,860.99	0.01
614	301159	三维天地	200	5,820.00	0.01
615	002674	兴业科技	200	5,706.00	0.01
616	605060	联德股份	100	5,674.00	0.01
617	300115	长盈精密	200	5,588.00	0.01
618	300521	爱司凯	200	5,520.00	0.01
619	301503	智迪科技	200	5,502.00	0.01
620	000703	恒逸石化	400	5,428.00	0.01
621	301029	怡合达	200	5,402.00	0.01
622	301221	光庭信息	180	5,311.80	0.01
623	603355	莱克电气	200	5,276.00	0.01
624	688517	金冠电气	301	5,261.48	0.01
625	002407	多氟多	100	5,023.00	0.01
626	002247	聚力文化	500	1,055.00	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	300750	宁德时代	2,214,202.00	2.80
2	002475	立讯精密	2,160,004.00	2.73
3	601899	紫金矿业	1,608,350.00	2.03
4	300274	阳光电源	1,567,634.00	1.98
5	603259	药明康德	1,386,967.00	1.75
6	300476	胜宏科技	1,384,581.00	1.75
7	603986	兆易创新	1,359,510.00	1.72
8	300308	中际旭创	1,352,326.00	1.71
9	000977	浪潮信息	1,334,402.00	1.69
10	600926	杭州银行	1,306,766.00	1.65
11	002402	和而泰	1,300,076.00	1.64
12	000333	美的集团	1,282,995.00	1.62
13	002414	高德红外	1,266,303.00	1.60
14	600919	江苏银行	1,254,890.00	1.59
15	601198	东兴证券	1,252,289.00	1.58
16	300502	新易盛	1,233,114.00	1.56

17	002415	海康威视	1,231,130.00	1.56
18	000572	海马汽车	1,225,031.00	1.55
19	002948	青岛银行	1,215,119.00	1.54
20	300058	蓝色光标	1,210,307.00	1.53

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	002475	立讯精密	2,615,636.00	3.31
2	601899	紫金矿业	2,581,432.00	3.26
3	300750	宁德时代	2,436,908.00	3.08
4	300502	新易盛	2,179,237.40	2.76
5	300308	中际旭创	2,112,672.00	2.67
6	000333	美的集团	2,012,597.00	2.55
7	603993	洛阳钼业	2,003,362.00	2.53
8	600487	亨通光电	1,908,112.65	2.41
9	600938	中国海油	1,898,138.00	2.40
10	600926	杭州银行	1,886,201.00	2.39
11	000157	中联重科	1,820,622.00	2.30
12	300476	胜宏科技	1,775,629.00	2.25
13	300274	阳光电源	1,642,708.00	2.08
14	002463	沪电股份	1,606,275.00	2.03
15	002625	光启技术	1,573,862.00	1.99
16	600309	万华化学	1,483,538.00	1.88
17	601318	中国平安	1,476,687.00	1.87
18	603986	兆易创新	1,418,740.00	1.79
19	601138	工业富联	1,400,108.00	1.77
20	601058	赛轮轮胎	1,354,692.00	1.71

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	362,165,544.66
卖出股票收入（成交）总额	377,032,382.75

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	101,049.23	0.16
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	11,264.29	0.02
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	112,313.52	0.18

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019792	25 国债 19	1,000	101,049.23	0.16
2	123271	通合转债	32	6,264.09	0.01
3	113704	春风转债	30	3,000.14	0.00
4	118072	鼎通转债	20	2,000.06	0.00

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

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

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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	4,290.58
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,290.58

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 (%)
富国致享量化选股股票 A	309	74,215.62	3,418,393.66	14.91	19,514,234.08	85.09
富国致享量化选股股票 C	1,361	17,667.60	8,710,314.92	36.22	15,335,292.50	63.78
合计	1,670	28,130.68	12,128,708.58	25.82	34,849,526.58	74.18

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	91.16%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数，该指标计算时剔除持有期限不满 7 个自然日的交易，剔除场内基金账户（如有）产生的盈亏。

8.3 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	富国致享量化选股股票 A	3,932,818.63	17.1494
	富国致享量化选股股票 C	29,142.26	0.1212
	合计	3,961,960.89	8.4336

8.4 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	富国致享量化选股股票 A	10~50
	富国致享量化选股股票 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	富国致享量化选股股票 A	>100
	富国致享量化选股股票 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国致享量化选股股票 A	富国致享量化选股股票 C
基金合同生效日（2025 年 06 月 25 日）基金份额总额	171,534,771.24	162,801,030.47
本报告期期初基金份额总额	43,449,975.16	24,606,053.91
本报告期基金总申购份额	8,869,812.47	26,955,005.50
减：本报告期基金总赎回份额	29,387,159.89	27,515,451.99
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	22,932,627.74	24,045,607.42

§ 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，本基金基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布公告，王苏龙先生自 2026 年 6 月 26 日起担任公司董事长，同日起裴长江先生不再担任公司董事长。

报告期内，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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

报告期内，无涉及本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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内，托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内，托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	3	593,800,008.41	80.33	241,044.49	80.33	—
国泰海通	3	145,397,919.00	19.67	59,018.88	19.67	—

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

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
东方证券	88,465.66	79.91	—	—	—	—
国泰海通	22,246.23	20.09	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	规定披露媒介	2026年06月27日
2	富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定披露媒介	2026年06月27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

一、本报告期内，根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定，为更好地反映基金投资风格，提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，经与基金托管人协商一致，本基金管理人决定自 2026 年 7 月 27 日起调整本基金的业绩比较基准并对基金合同等法律文件有关条款进行修订。具体可参见基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》及修订后的基金法律文件。

二、本报告期内，经基金管理人董事会第七届十四次会议审议通过，王苏龙先生自 2026 年 6 月 26 日起担任公司董事长，同日起裴长江先生不再担任公司董事长。具体可参见基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布的《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

§ 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享量化选股股票型证券投资基金的文件 2、富国致享量化选股股票型证券投资基金基金合同 3、富国致享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、富国致享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 。