

富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金
二〇二五年年度报告

2025年12月31日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026年03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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 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。

本报告期自 2025 年 5 月 16 日（基金合同生效日）起至 2025 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	18
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	19
§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
§ 7 年度财务报告	22
7.1 资产负债表	22

7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	25
§ 8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	79
8.6 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.....	79
8.7 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.....	79
8.8 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.....	79
8.9 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.....	79
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	79
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	80
8.12 投资组合报告附注	80
§ 9 基金份额持有人信息	82
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	82
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	82
9.3 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.....	82
§ 10 开放式基金份额变动	83
§ 11 重大事件揭示	84
11.1 基金份额持有人大会决议	84
11.2 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.....	84
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	84
11.4 基金投资策略的改变	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	84
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	84
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	86
11.8 其他重大事件	88
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	90
12.1 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	90
§ 13 备查文件目录	91

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金	
基金简称	富国上证科创板综合价格指数增强	
基金主代码	023913	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年05月16日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	63,383,884.14份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国上证科创板综合价格指数增强 A	富国上证科创板综合价格指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023913	023914
报告期末下属分级基金的份额总额	28,298,246.36份	35,085,637.78份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，在力求对上证科创板综合价格指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在复制标的指数的基础上一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。 本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.50%，年化跟踪误差不超过7.75%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。 本基金的股票投资策略、港股通标的股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券（含可分离交易可转债）及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、信用衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	上证科创板综合价格指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（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。本基金为指数基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资港股通标的股票的，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	中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	赵瑛	王小飞
	联系电话	021-20361818	021-6063 7103
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	95105686、4008880688		021-60637228
传真	021-20361616		021-60635778
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层		北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层		北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120		100033
法定代表人	裴长江		张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	富国基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国上证科创板综合价格指数增强 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025年5月16日(基金合同生效日)至 2025年12月31日
本期已实现收益	20,070,658.44
本期利润	23,123,475.73
加权平均基金份额本期利润	0.3259
本期加权平均净值利润率	29.25%
本期基金份额净值增长率	37.81%
3.1.2 期末数据和指标	2025年12月31日
期末可供分配利润	10,699,348.50
期末可供分配基金份额利润	0.3781
期末基金资产净值	38,997,594.86
期末基金份额净值	1.3781
3.1.3 累计期末指标	2025年12月31日
基金份额累计净值增长率	37.81%

(2) 富国上证科创板综合价格指数增强 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025年5月16日(基金合同生效日)至 2025年12月31日
本期已实现收益	24,117,301.52
本期利润	25,340,759.54
加权平均基金份额本期利润	0.2712
本期加权平均净值利润率	24.08%
本期基金份额净值增长率	37.45%
3.1.2 期末数据和指标	2025年12月31日
期末可供分配利润	13,140,116.05
期末可供分配基金份额利润	0.3745
期末基金资产净值	48,225,753.83
期末基金份额净值	1.3745
3.1.3 累计期末指标	2025年12月31日
基金份额累计净值增长率	37.45%

注：本基金于 2025 年 5 月 16 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。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) 富国上证科创板综合价格指数增强 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	-1.98%	1.48%	-4.44%	1.54%	2.46%	-0.06%
过去六个月	30.81%	1.41%	31.09%	1.60%	-0.28%	-0.19%
自基金合同生效起至今	37.81%	1.29%	37.18%	1.49%	0.63%	-0.20%

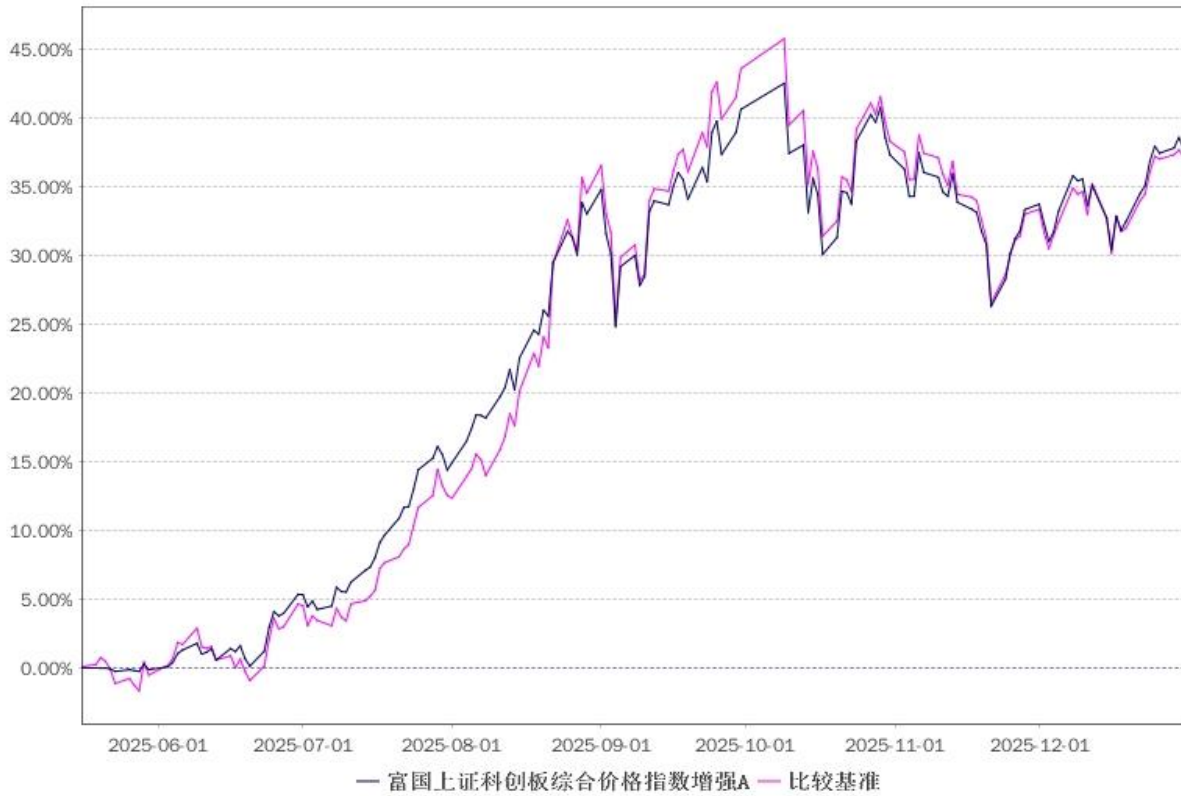
(2) 富国上证科创板综合价格指数增强 C

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	-2.07%	1.48%	-4.44%	1.54%	2.37%	-0.06%
过去六个月	30.54%	1.41%	31.09%	1.60%	-0.55%	-0.19%
自基金合同生效起至今	37.45%	1.29%	37.18%	1.49%	0.27%	-0.20%

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

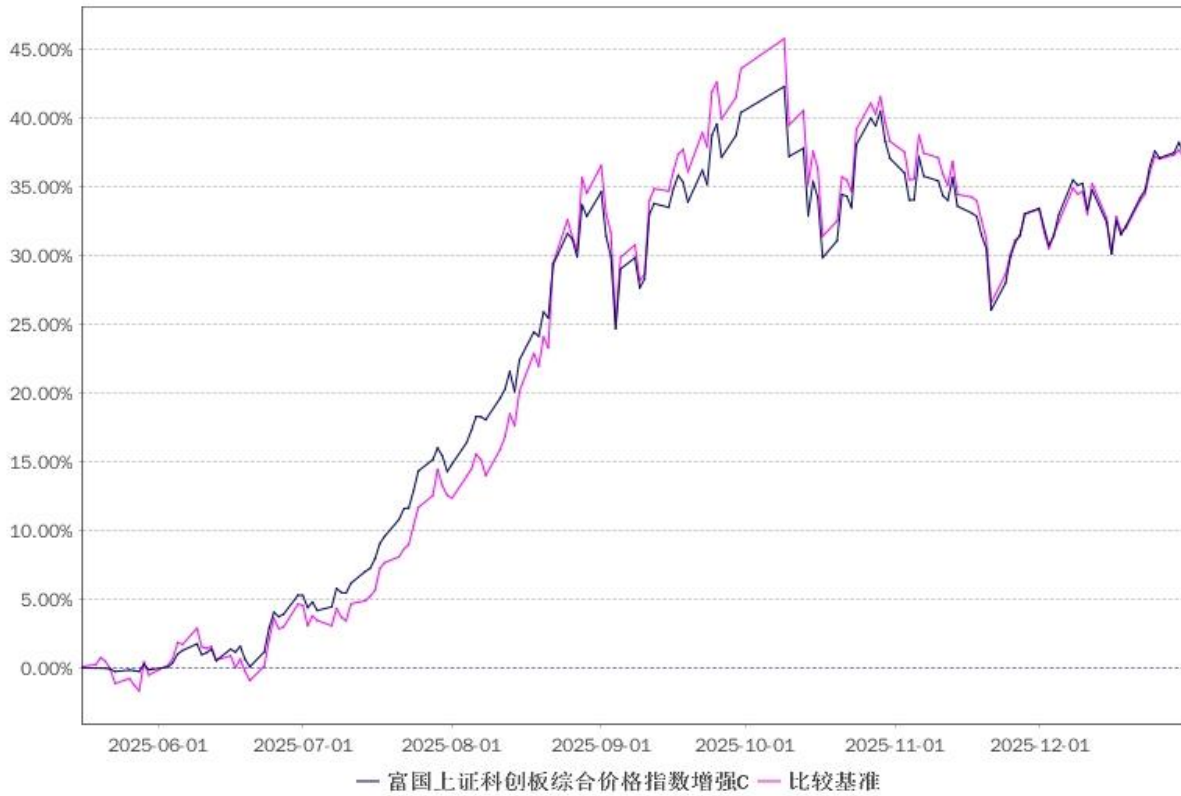
(1) 自基金合同生效以来富国上证科创板综合价格指数增强 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2025 年 5 月 16 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期 6 个月，从 2025 年 5 月 16 日起至 2025 年 11 月 15 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上证科创板综合价格指数增强 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

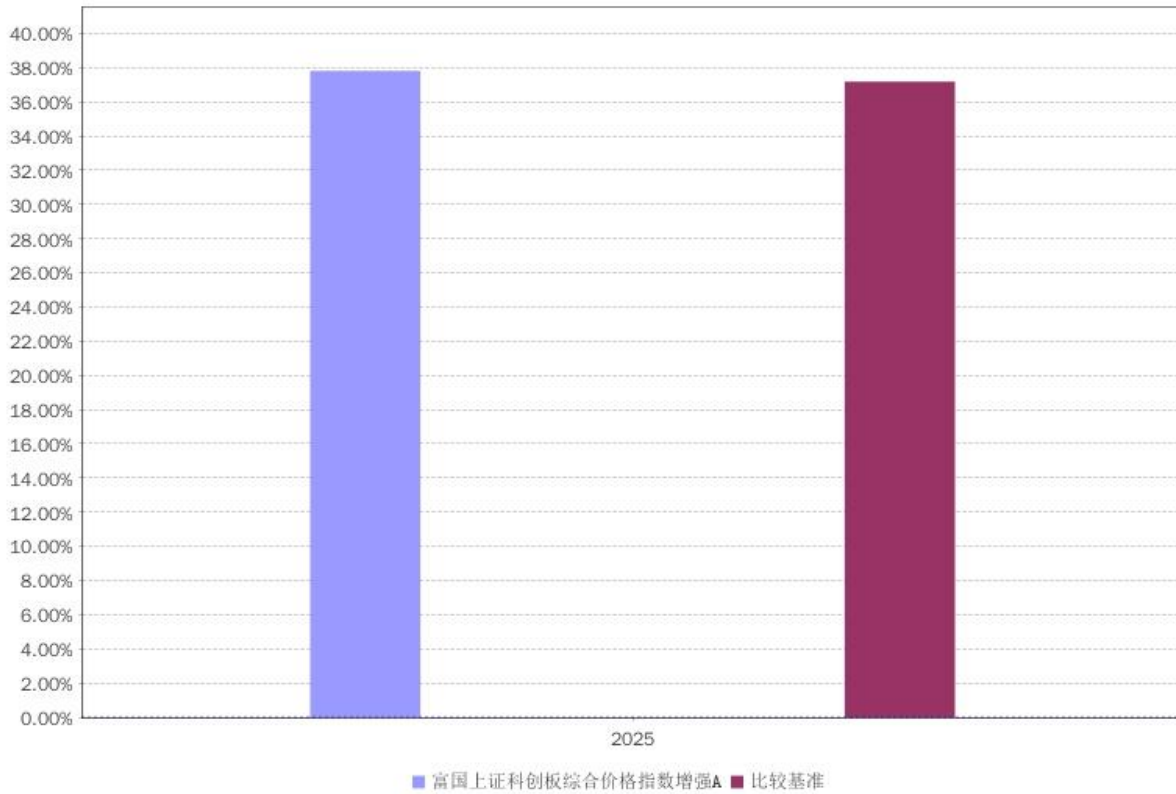


注：1、截止日期为 2025 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2025 年 5 月 16 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期 6 个月，从 2025 年 5 月 16 日起至 2025 年 11 月 15 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

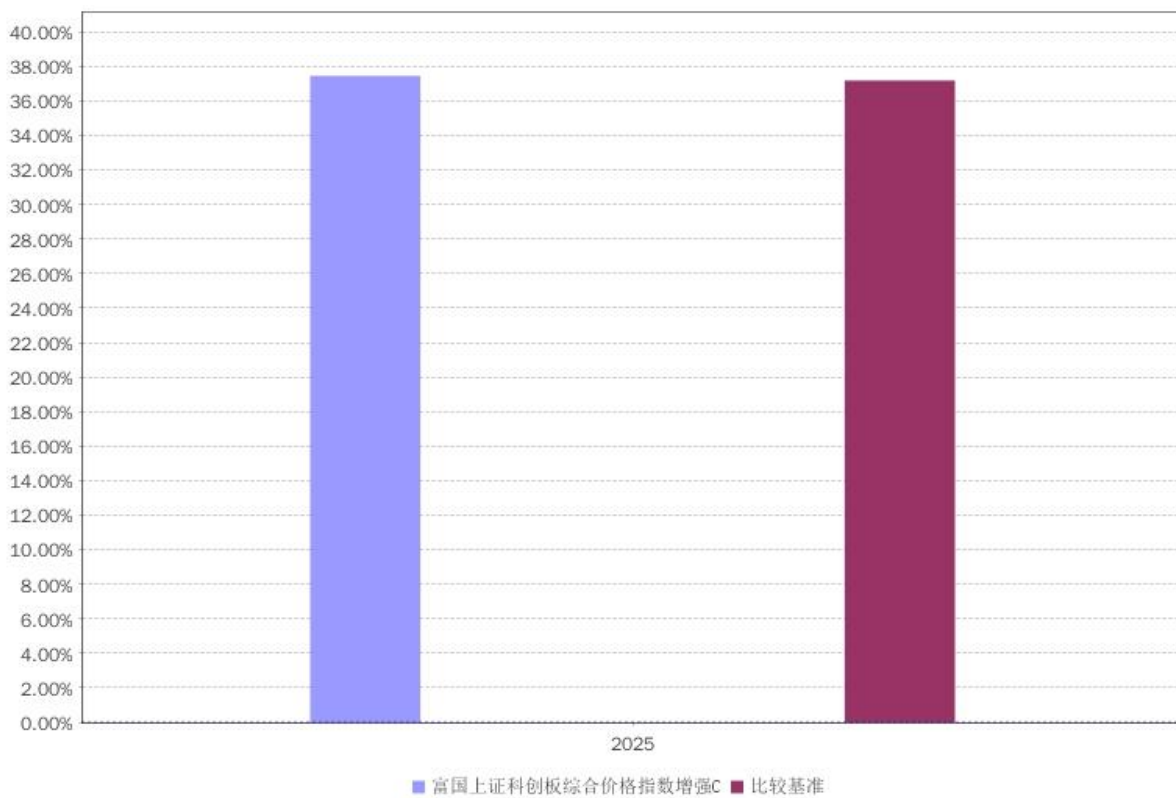
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 自基金合同生效以来富国上证科创板综合价格指数增强 A 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2025 年按实际存续期计算。

(2) 自基金合同生效以来富国上证科创板综合价格指数增强 C 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2025 年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

(1) 富国上证科创板综合价格指数增强 A

注：本基金 2025 年 5 月 16 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日未进行利润分配

(2) 富国上证科创板综合价格指数增强 C

注：本基金 2025 年 5 月 16 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日未进行利润分配

§ 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、深圳设立有分公司，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《国泰君安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 12 月 31 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 422 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方旻	本基金现任基金经理	2025-05-16	—	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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国上证科创板综合价格指数增强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》、《富国上证科创板综合价格指数增强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 公平交易制度和控制方法

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。通过实行事前控制、事中监控、事后评估反馈的流程化管理，对投资管理活动相关的各个环节加强控制，确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待。

一级市场投资通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；二级市场通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。管理人同时关注投资交易过程中组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制、银行间市场交易价格的公允性评估等。管理人对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日反向交易进行监控，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的反向交易；同日同向交易方面，通过交易系统对投资组合间的交易公平性进行自动化处理，并专项评估不同时间窗口下（1日内、3日内、5日内）投资组合间同一投资标同向交易价差的合理性。

管理人定期对涉及公平交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类投资组合间、同一基金经理管理的不同投资组合间的交易行为。若发现异常事项，风险管理部门要求相关当事人做出合理性解释，并及时进行报告。

4.3.2 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。

4.3.3 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 29 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。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，全球资本市场迎来了冲击。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。7 月初，上证指数继续在银行等权重板块带领下，创出 2024 年 10 月 8 日之后的收盘价新高，投资者风险偏好逐步提升。经历 8 月以来的上涨加速和结构分化后，9 月市场震荡整固，科技成长进一步向 AI 和新能源等领域集中。同时，美联储降息预期驱动有色金属走强。进入 11 月，随着三季报、“十五五”等事件落地，海外成为主导 A 股走势的因素。11 月初，美国政府停摆、经济数据缺位、美联储频繁发表鹰派言论带来的全球流动性预期收紧以及“AI 泡沫”叙事扰动下，A 股跟随全球资产迎来回调。12 月中旬起，随着国内中央经济工作会议召开、美联储议息会议鸽派定调、日本央行加息靴子落地，国内外政策验证窗口基本落下帷幕，整体基调好于市场预期，市场开始震荡回升。

总体来看，2025 年全年上证综指上涨 18.41%，沪深 300 上涨 17.66%，中证 500 指数上涨 30.39%，创业板指上涨 49.57%，科创综指上涨 46.3%。

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 12 月 31 日，本基金份额净值富国上证科创板综合价格指数增强 A 为 1.3781 元，富国上证科创板综合价格指数增强 C 为 1.3745 元；份额累计净值富国上证科创板综合价格指数增强 A 为 1.3781 元，富国上证科创板综合价格指数增强 C 为 1.3745 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国上证科创板综合价格指数增强 A 为 37.81%，富国上证科创板综合价格指数增强 C 为 37.45%；同期业绩比较基准收益率情况：富国上证科创板综合价格指数增强 A 为 37.18%，富国上证科创板综合价格指数增强 C 为 37.18%。

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 2026 年，在企业盈利修复、宏观政策支持与市场流动性宽松三者的合力驱动下，市场仍有进一步上行的空间。1) 预计 PPI 将在 2026 年企稳，PPI 回升将直接改善企业定价能力和毛利率，并通过带动补库需求，驱动新一轮利润周期。与此同时，以 AI、半导体、机器人、新能源等为代表的战略性新兴产业和未来产业，在经济中的比重不断增加，其更高的增长速度和利润率正在从结构上改善整体盈利增长的质量与韧性。2) 资本市场改革正引导上市公司重视股东回报，增加分红和回购，这为中长期资金入市提供了土壤。3) 居民资产配置正从存款、债券等低回报资产向权益市场迁移。从横线比较来看，中国资产在全球比较中处于“价值洼地”，这一低估状态是吸引外资流入、驱动市场重估行情的重要基础。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

报告期内，基金管理人始终秉持“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持持有人利益优先原则，持续完善内控机制，强化合规管理，切实防范风险，保障公司各项业务合法合规、稳健有序开展。除积极落实各项监管新规要求外，主要开展以下监察稽核工作：

一、深化合规文化建设与员工行为管理

持续推动合规文化建设，通过多层次、多维度合规培训、考试、谈话及宣导活动进行全员覆盖，着重加强投资研究和基金销售等重点业务领域的合规督导，强化员工主动合规意识。同时，持续强化员工行为管控，通过事前宣导、事中监测、事后检查等措施，落细落实各项监管要求。

二、完善制度流程与系统化建设

持续推进制度流程优化，新增及修订多项内部管理制度，范围涵盖基本管理制度及业务操作细则。推动合规风控系统升级，完成多项系统、平台等信息化工具重构，提升合规风控管理效率。优化多项合规风控业务流程，提升全流程覆盖广度深度与规范化管控质效。

三、强化投资合规与风险管理

加强投资组合合规监控，持续优化关联交易、公平交易及异常交易监测机制。升级风控系统功能，开展多维度专项风险评估，提升事前、事中、事后风险管理能力。

四、落实反洗钱与投资者保护工作要求

积极落实各项反洗钱监管要求，贯彻落实风险为本的工作方法，持续完善洗钱风险管理体系，进一步健全内控制度流程，深入开展反洗钱系统建设与数据治理，优化客户尽职调查与可疑交易监测模型，持续提升洗钱风险管理水平。认真开展投资者适当性、信息披露、宣传推介材料审核等工作，将投资者保护工作落到实处。

五、加强内外部审计与监督

深入开展内部审计，在基础风险点例行检查基础上开展多项专项审计检查，涵盖投研、销售、信息技术等重点领域。配合外部机构完成信息技术全面审计与合规有效性评估等工作。积极落实问题整改，持续提升内控水平。

本基金管理人将一如既往恪守受托责任，勤勉尽责，切实保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本基金托管人按照国家有关规定、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、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70015656_B222 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 5 月 16 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 5 月 16 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。</p> <p>审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反

	<p>映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>王珊珊 赵梓云</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2026年03月27日</p>

§ 7 年度财务报告

7.1 资产负债表

会计主体：富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2025 年 12 月 31 日
资 产：	
货币资金	8,502,263.49
结算备付金	994,789.03
存出保证金	400,740.21
交易性金融资产	79,073,314.83
其中：股票投资	79,050,271.63
基金投资	—
债券投资	23,043.20
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	311,695.54
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	89,282,803.10
	本期末
负债和净资产	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	—
应付清算款	17.91
应付赎回款	1,886,664.41
应付管理人报酬	61,194.76
应付托管费	11,474.02
应付销售服务费	17,478.10
应付投资顾问费	—
应交税费	131.36

应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	82,493.85
负债合计	2,059,454.41
净资产：	
实收基金	63,383,884.14
其他综合收益	—
未分配利润	23,839,464.55
净资产合计	87,223,348.69
负债和净资产总计	89,282,803.10

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3761 元，基金份额总额 63,383,884.14 份。其中：富国上证科创板综合价格指数增强 A 份额净值 1.3781 元，份额总额 28,298,246.36 份；富国上证科创板综合价格指数增强 C 份额净值 1.3745 元，份额总额 35,085,637.78 份。本基金合同生效日 2025 年 05 月 16 日。

7.2 利润表

会计主体：富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 05 月 16 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2025 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入	49,957,393.98
1. 利息收入	267,314.71
其中：存款利息收入	143,989.94
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	123,324.77
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	45,299,284.33
其中：股票投资收益	42,693,675.23
基金投资收益	—
债券投资收益	31,053.68
资产支持证券投资收益	—
贵金属投资收益	—
衍生工具收益	1,115,274.28
股利收益	1,459,281.14
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）	4,276,275.31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	114,519.63
减：二、营业总支出	1,493,158.71
1. 管理人报酬	921,671.34
2. 托管费	172,813.34
3. 销售服务费	264,569.70
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	4,021.78
8. 其他费用	130,082.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	48,464,235.27
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	48,464,235.27
五、其他综合收益的税后净额	—
六、综合收益总额	48,464,235.27

注：本基金合同生效日为2025年5月16日，无上年度同期对比数据。

7.3 净资产变动表

会计主体：富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年05月16日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2025年5月16日(基金合同生效日)至2025年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、本期期初净资产	677,358,242.93	—	677,358,242.93
二、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-613,974,358.79	23,839,464.55	-590,134,894.24
（一）、综合收益总额	—	48,464,235.27	48,464,235.27
（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）	-613,974,358.79	-24,624,770.72	-638,599,129.51
其中：1. 基金申购款	165,597,202.38	36,254,994.89	201,852,197.27
2. 基金赎回款	-779,571,561.17	-60,879,765.61	-840,451,326.78
（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	63,383,884.14	23,839,464.55	87,223,348.69

注：本基金合同生效日为 2025 年 5 月 16 日，无上年度同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金（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〕575号《关于准予富国上证科创板综合价格指数增强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 4 月 21 日至 2025 年 5 月 14 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 00133 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 5 月 16 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 677,170,006.85 元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币 188,236.08 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 677,358,242.93 元，折合 677,358,242.93 份基金份额，其中 A 类基金份额 237,932,034.98 份，C 类基金份额 439,426,207.95 份。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股（均含存托凭证）、港股通标的股票、其他股票（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品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及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：本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 80%（其

中港股通标的股票不超过股票资产的 20%)，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%，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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，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：上证科创板综合价格指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

7.4.2 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 2 号《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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 5 月 16 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2025 年 5 月 16 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人

人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，

并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相

关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的可观察资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的可观察资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入。出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入计入投资收益；

(8) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红；若基金合同生效不满 3 个月，本基金可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对 A 类和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式；

3、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致后经履行适当程序，可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2025 年 12 月 31 日)
活期存款	8,502,263.49
等于：本金	8,501,422.24
加：应计利息	841.25
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	8,502,263.49

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2025 年 12 月 31 日）				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	74,938,678.22	—	79,050,271.63	4,111,593.41	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	16,200.00	1.30	23,043.20	6,841.90
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	16,200.00	1.30	23,043.20	6,841.90
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	74,954,878.22	1.30	79,073,314.83	4,118,435.31	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

金额单位：人民币元

项目	本期末（2025年12月31日）			
	名义金额	公允价值		备注(成本)
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	2,817,760.00	—	—	—
股指期货	2,817,760.00	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	2,817,760.00	—	—	—

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。本基金合同生效日为2025年5月16日。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2603	IM2603	2.00	2,975,600.00	157,840.00
合计				157,840.00
减：可抵销期货暂收款				157,840.00
净额				—

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2025年12月31日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	151.96
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	39,341.89
其中：交易所市场	39,341.89
银行间市场	—
应付利息	—
预提审计费	43,000.00
合计	82,493.85

7.4.7.7 实收基金

富国上证科创板综合价格指数增强 A：

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日 2025 年 5 月 16 日	237,932,034.98	237,932,034.98
本期申购	35,303,833.86	35,303,833.86
本期赎回（以“-”号填列）	-244,937,622.48	-244,937,622.48
本期末	28,298,246.36	28,298,246.36

富国上证科创板综合价格指数增强 C：

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日 2025 年 5 月 16 日	439,426,207.95	439,426,207.95
本期申购	130,293,368.52	130,293,368.52
本期赎回（以“-”号填列）	-534,633,938.69	-534,633,938.69
本期末	35,085,637.78	35,085,637.78

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

富国上证科创板综合价格指数增强 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
基金合同生效日 2025 年 5 月 16 日	—	—	—
本期利润	20,070,658.44	3,052,817.29	23,123,475.73
本期基金份额交易产生的变动数	-8,869,925.37	-3,554,201.86	-12,424,127.23
其中：基金申购款	5,085,005.00	1,596,859.55	6,681,864.55
基金赎回款	-13,954,930.37	-5,151,061.41	-19,105,991.78

本期已分配利润	—	—	—
本期末	11,200,733.07	-501,384.57	10,699,348.50

富国上证科创板综合价格指数增强 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
基金合同生效日 2025 年 5 月 16 日	—	—	—
本期利润	24,117,301.52	1,223,458.02	25,340,759.54
本期基金份额交易产生的变动数	-10,359,068.85	-1,841,574.64	-12,200,643.49
其中：基金申购款	23,210,950.93	6,362,179.41	29,573,130.34
基金赎回款	-33,570,019.78	-8,203,754.05	-41,773,773.83
本期已分配利润	—	—	—
本期末	13,758,232.67	-618,116.62	13,140,116.05

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	136,826.40
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	6,821.54
其他	342.00
合计	143,989.94

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	661,104,691.41
减：卖出股票成本总额	617,809,779.59
减：交易费用	601,236.59
买卖股票差价收入	42,693,675.23

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	7.20
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差	31,046.48

价收入	
合计	31,053.68

7.4.7.11.2 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5月16日(基金合同生效日)至2025年12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	65,855.00
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	34,800.00
减：应计利息总额	5.90
减：交易费用	2.62
买卖债券差价收入	31,046.48

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 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。

7.4.7.12.2 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。

7.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期2025年5月16日(基金合同生效日)至2025年12月31日

股指期货投资收益	1,115,274.28
----------	--------------

注：本基金合同生效日为 2025 年 05 月 16 日，无上年度同期对比数据。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,459,281.14
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,459,281.14

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	4,118,435.31
股票投资	4,111,593.41
债券投资	6,841.90
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	157,840.00
权证投资	—
股指期货	157,840.00
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	4,276,275.31

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	111,146.05
基金转换费收入	3,373.58
合计	114,519.63

7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日
审计费用	43,000.00
信息披露费	80,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	6,336.59
其他	745.96
合计	130,082.55

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
山东省金融资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
加拿大蒙特利尔银行	基金管理人的股东

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)

国泰海通	121,673,499.06	8.99
申万宏源	157,496,003.38	11.64

注：本基金合同生效日为2025年05月16日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为2025年05月16日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2025年5月16日(基金合同生效日)至2025年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
申万宏源	63,482.50	96.40

注：本基金合同生效日为2025年05月16日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2025年5月16日(基金合同生效日)至2025年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
国泰海通	200,000,000.00	49.60

注：本基金合同生效日为2025年05月16日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.1.5 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5月16日(基金合同生效日)至2025年12月31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	16,538.27	8.99	816.32	2.07
申万宏源	21,413.32	11.64	1,661.66	4.22

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。

本基金合同生效日为 2025 年 05 月 16 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	921,671.34
其中：应支付销售机构的客户维护费	450,075.91
应支付基金管理人的净管理费	471,595.43

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

本基金合同生效日为 2025 年 5 月 16 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	172,813.34

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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。

本基金合同生效日为 2025 年 5 月 16 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.2.3 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 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国上证科创板综合价格指数增强 A	富国上证科创板综合价格指数增强 C	合计
富国基金管理有限公司	—	2,742.99	2,742.99
中国建设银行股份有限公司	—	160,392.97	160,392.97
合计	—	163,135.96	163,135.96

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 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

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。

本基金合同生效日为 2025 年 5 月 16 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。本基金合同生效日 2025 年 05 月 16 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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：本基金本报告期末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。

7.4.10.4.2 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：本基金本报告期末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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期内本基金的基金管理人未运用自有资金投资本基金。本基金合同生效日为 2025 年 5 月 16 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.5.2 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未投资本基金。本基金合同生效日为 2025 年 05 月 16 日，无上年度末对比数据。

7.4.10.6 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 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	8,502,263.49	136,826.40

注：本基金合同生效日为 2025 年 05 月 16 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 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
国泰海通证券股份有限公司	603248	锡华科技	IPO 网下申购	860	8,686.00
国泰海通证券股份有限公司	603334	丰倍生物	IPO 网下申购	434	10,628.66
国泰海通证券股份有限公司	603376	大明电子	IPO 网下申购	784	9,839.20
国泰海通证券股份有限公司	603418	友升股份	IPO 网下申购	327	15,159.72
国泰海通证券股份有限公司	688729	屹唐股份	IPO 网下申购	13,250	111,962.50

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.12.1.1 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
601026	道生天合	2025-10-09	6个月	新股限售	5.98	14.28	249	1,489.02	3,555.72	—
603092	德力佳	2025-10-30	6个月	新股限售	46.68	55.66	29	1,353.72	1,614.14	—
603175	超颖电子	2025-10-17	6个月	新股限售	17.08	48.56	78	1,332.24	3,787.68	—
603248	锡华科技	2025-12-16	6个月	新股限售	10.10	16.30	86	868.60	1,401.80	—
603262	技源集团	2025-07-16	6个月	新股限售	10.88	28.10	113	1,229.44	3,175.30	—
603334	丰倍生物	2025-10-29	6个月	新股限售	24.49	32.82	44	1,077.56	1,444.08	—
603370	华新精科	2025-08-27	6个月	新股限售	18.60	46.35	44	818.40	2,039.40	—
603376	大明电子	2025-10-28	6个月	新股限售	12.55	26.21	79	991.45	2,070.59	—
603406	天富龙	2025-07-30	6个月	新股限售	23.60	40.16	50	1,180.00	2,008.00	—
603418	友升股份	2025-09-	6个月	新股限售	46.3	59.06	33	1,529.88	1,948.98	—

		16		售	6					
688727	恒坤新材	2025-11-11	6个月	新股限售	14.99	34.87	154	2,308.46	5,369.98	—
688729	屹唐股份	2025-07-01	6个月	新股限售	8.45	24.28	1,325	11,196.25	32,171.00	—
688759	必贝特	2025-10-21	6个月	新股限售	17.78	25.11	620	11,023.60	15,568.20	—
688783	西安奕材	2025-10-20	9个月	新股限售	8.62	18.39	5,464	47,099.68	100,482.96	—
688790	昂瑞微	2025-12-09	9个月	新股限售	83.06	117.07	261	21,678.66	30,555.27	—
688795	摩尔线程	2025-11-26	9个月	新股限售	114.28	416.02	345	39,426.60	143,526.90	—
688796	百奥赛图	2025-12-02	6个月	新股限售	26.68	42.25	82	2,187.76	3,464.50	—
688805	健信超导	2025-12-17	6个月	新股限售	18.58	32.37	109	2,025.22	3,528.33	—
688807	优迅股份	2025-12-10	6个月	新股限售	51.66	135.56	38	1,963.08	5,151.28	—
688809	强一股份	2025-12-23	6个月	新股限售	85.09	203.31	26	2,212.34	5,286.06	—

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
111024	澳弘转债	2025-12-11	1-6个月 (含)	认购新发证券	100.00	100.01	30	3,000.00	3,000.28	—
118063	金05转债	2025-12-25	1个月内 (含)	认购新发证券	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.02	—

7.4.12.2 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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	--------------	--------	--------	----

688012	中微公司	2025年12月19日	重大事项停牌	272.72	2026年01月05日	278.00	2,959.00	736,651.40	806,978.48	—
--------	------	-------------	--------	--------	-------------	--------	----------	------------	------------	---

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本表主要列示短期融资券和超短期融资券，债券评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券列示超短期融资券。本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的信用债。

7.4.13.2.2 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（2025 年 12 月 31 日）
AAA	—
AAA 以下	23,043.20
未评级	—
合计	23,043.20

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。

7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。此表中资产支持证券的债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有同业存单。本表主要列示同业存单，评级取自第三方评级机构的主体评级。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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7.4.12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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 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，并按照合同约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 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	8,502,263.49	—	—	—	8,502,263.49
结算备付金	994,789.03	—	—	—	994,789.03
存出保证金	43,668.21	—	—	357,072.00	400,740.21
交易性金融资产	23,043.20	—	—	79,050,271.63	79,073,314.83
应收申购款	—	—	—	311,695.54	311,695.54
资产总计	9,563,763.93	—	—	79,719,039.17	89,282,803.10
负债					
应付清算款	—	—	—	17.91	17.91
应付赎回款	—	—	—	1,886,664.41	1,886,664.41
应付管理人报酬	—	—	—	61,194.76	61,194.76
应付托管费	—	—	—	11,474.02	11,474.02
应付销售服务费	—	—	—	17,478.10	17,478.10
应交税费	—	—	—	131.36	131.36
其他负债	—	—	—	82,493.85	82,493.85
负债总计	—	—	—	2,059,454.41	2,059,454.41
利率敏感度缺口	9,563,763.93	—	—	77,659,584.76	87,223,348.69

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。本基金合同生效日为 2025 年 05 月 16 日，无上年度同期对比数据。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末（2025 年 12 月 31 日）	
	公允价值	占基金资产净值比例 （%）
交易性金融资产—股票投资	79,050,271.63	90.63
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	23,043.20	0.03
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	79,073,314.83	90.66

7.4.13.4.3.2 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。基金合同生效日为 2025 年 05

月 16 日。

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 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	732,863.12
	2. 业绩比较基准减少 1%	-732,863.12

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日)
第一层次	77,894,185.88
第二层次	810,978.78
第三层次	368,150.17
合计	79,073,314.83

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 5 月 16 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	—	—	—
当期购买	—	152,991.96	152,991.96
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	—	—
当期利得或损失总额	—	215,158.21	215,158.21
其中：计入损益的利得或损失	—	215,158.21	215,158.21
期末余额	—	368,150.17	368,150.17
期末仍持有的第三层次金融资产 计入本期损益的未实现利得或损失 的变动——公允价值变动损益	—	215,158.21	215,158.21

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

限售股票	368,150.17	平均价格亚式 期权模型	股票在剩余限售期 内的股价的预期年 化波动率	0.1800-3.0323	负相关
------	------------	----------------	------------------------------	---------------	-----

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 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。

7.4.15.2 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	79,050,271.63	88.54
	其中：股票	79,050,271.63	88.54
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	23,043.20	0.03
	其中：债券	23,043.20	0.03
	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	9,497,052.52	10.64
8	其他各项资产	712,435.75	0.80
9	合计	89,282,803.10	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

8.2.1.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	53,217,380.22	61.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,198,437.93	12.84
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—

M	科学研究和技术服务业	2,403,591.39	2.76
N	水利、环境和公共设施管理业	244,319.92	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	67,063,729.46	76.89

8.2.1.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	101,581.00	0.12
B	采矿业	443,910.00	0.51
C	制造业	9,038,300.67	10.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	148,717.00	0.17
E	建筑业	100,855.00	0.12
F	批发和零售业	215,946.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	65,761.00	0.08
H	住宿和餐饮业	13,400.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	708,023.00	0.81
J	金融业	377,224.00	0.43
K	房地产业	41,696.00	0.05
L	租赁和商务服务业	151,146.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	79,962.50	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	154,906.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	345,114.00	0.40
S	综合	—	—
	合计	11,986,542.17	13.74

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688041	海光信息	20,678	4,640,349.98	5.32
2	688256	寒武纪	3,287	4,455,692.85	5.11
3	688981	中芯国际	18,239	2,240,296.37	2.57

4	688521	芯原股份	9,668	1,324,225.96	1.52
5	688008	澜起科技	8,523	1,004,009.40	1.15
6	688506	百利天恒	2,693	870,108.30	1.00
7	688347	华虹公司	7,903	852,496.61	0.98
8	688372	伟测科技	7,621	831,374.89	0.95
9	688775	影石创新	3,455	811,579.50	0.93
10	688012	中微公司	2,959	806,978.48	0.93
11	689009	九号公司	13,380	743,794.20	0.85
12	688127	蓝特光学	16,729	643,899.21	0.74
13	688378	奥来德	22,135	604,285.50	0.69
14	688629	华丰科技	5,702	570,542.12	0.65
15	688772	珠海冠宇	26,361	567,552.33	0.65
16	688591	泰凌微	13,296	565,877.76	0.65
17	688072	拓荆科技	1,666	549,780.00	0.63
18	603019	中科曙光	6,300	539,532.00	0.62
19	688091	上海谊众	11,342	533,074.00	0.61
20	688278	特宝生物	5,859	490,281.12	0.56
21	688111	金山办公	1,592	488,855.44	0.56
22	688297	中无人机	10,018	481,064.36	0.55
23	688469	芯联集成	71,793	480,295.17	0.55
24	688687	凯因科技	19,142	477,018.64	0.55
25	688678	福立旺	19,634	474,750.12	0.54
26	688153	唯捷创芯	12,340	464,477.60	0.53
27	688320	禾川科技	12,085	451,012.20	0.52
28	688036	传音控股	6,684	442,213.44	0.51
29	688166	博瑞医药	8,882	435,750.92	0.50
30	688120	华海清科	2,735	410,468.80	0.47
31	688271	联影医疗	3,211	402,980.50	0.46
32	688280	精进电动	45,536	396,163.20	0.45
33	688136	科兴制药	12,507	396,096.69	0.45
34	688653	康希通信	32,289	392,311.35	0.45
35	688410	山外山	26,132	391,196.04	0.45
36	688002	睿创微纳	3,855	388,584.00	0.45
37	688096	京源环保	48,284	381,443.60	0.44
38	688520	神州细胞	8,795	380,911.45	0.44
39	688488	艾迪药业	23,089	377,043.37	0.43
40	688498	源杰科技	586	376,206.14	0.43
41	688428	诺诚健华	18,164	372,725.28	0.43
42	002600	领益智造	23,700	368,298.00	0.42
43	688169	石头科技	2,367	359,926.02	0.41
44	000831	中国稀土	7,700	357,588.00	0.41

45	688322	奥比中光	3,881	348,009.27	0.40
46	688556	高测股份	29,920	341,686.40	0.39
47	688183	生益电子	3,565	341,134.85	0.39
48	688312	燕麦科技	10,276	340,957.68	0.39
49	688162	巨一科技	11,065	340,802.00	0.39
50	688334	西高院	17,562	340,000.32	0.39
51	688373	盟科药业	55,857	337,376.28	0.39
52	688222	成都先导	14,072	329,988.40	0.38
53	688538	和辉光电	121,033	321,947.78	0.37
54	688388	嘉元科技	7,695	315,341.10	0.36
55	688007	光峰科技	16,612	308,484.84	0.35
56	688799	华纳药厂	6,461	308,189.70	0.35
57	688226	威腾电气	8,222	305,036.20	0.35
58	688369	致远互联	11,944	303,735.92	0.35
59	688439	振华风光	4,621	298,516.60	0.34
60	688088	虹软科技	6,010	297,495.00	0.34
61	688045	必易微	7,656	296,210.64	0.34
62	688258	卓易信息	3,698	283,155.86	0.32
63	688098	申联生物	31,806	282,437.28	0.32
64	688655	迅捷兴	16,251	278,379.63	0.32
65	688302	海创药业	5,546	272,696.82	0.31
66	688006	杭可科技	9,261	271,254.69	0.31
67	688189	南新制药	33,854	269,816.38	0.31
68	688286	敏芯股份	3,400	268,430.00	0.31
69	301052	果麦文化	7,000	267,330.00	0.31
70	688331	荣昌生物	3,427	266,586.33	0.31
71	688049	炬芯科技	5,045	265,367.00	0.30
72	002365	永安药业	17,600	262,592.00	0.30
73	688401	路维光电	5,220	254,788.20	0.29
74	300762	上海瀚讯	6,000	250,080.00	0.29
75	688525	佰维存储	2,164	248,405.56	0.28
76	688608	恒玄科技	1,086	246,456.84	0.28
77	688261	东微半导	2,983	244,635.83	0.28
78	688660	电气风电	14,365	244,348.65	0.28
79	688508	芯朋微	4,011	244,269.90	0.28
80	300308	中际旭创	400	244,000.00	0.28
81	688158	优刻得	8,282	232,641.38	0.27
82	002759	天际股份	5,000	232,150.00	0.27
83	688176	亚虹医药	19,934	229,440.34	0.26
84	688082	盛美上海	1,302	229,217.10	0.26
85	688385	复旦微电	3,089	227,659.30	0.26

86	688126	沪硅产业	10,246	221,723.44	0.25
87	688093	世华科技	5,987	220,620.95	0.25
88	688512	慧智微	19,731	220,197.96	0.25
89	688257	新锐股份	6,276	215,141.28	0.25
90	688819	天能股份	6,362	211,345.64	0.24
91	601777	千里科技	19,100	203,033.00	0.23
92	688518	联赢激光	8,322	202,141.38	0.23
93	688519	南亚新材	2,486	201,017.96	0.23
94	688063	派能科技	3,530	200,574.60	0.23
95	002625	光启技术	4,100	199,916.00	0.23
96	688220	翱捷科技	2,400	198,264.00	0.23
97	688321	微芯生物	6,762	197,585.64	0.23
98	688070	纵横股份	3,545	196,393.00	0.23
99	688617	惠泰医疗	794	193,156.38	0.22
100	688578	艾力斯	1,826	190,177.90	0.22
101	688396	华润微	3,568	188,604.48	0.22
102	688208	道通科技	5,033	185,214.40	0.21
103	688187	时代电气	3,604	184,849.16	0.21
104	688248	南网科技	4,108	183,791.92	0.21
105	688728	格科微	12,258	183,134.52	0.21
106	688141	杰华特	4,208	182,753.44	0.21
107	688484	南芯科技	4,482	182,238.12	0.21
108	688135	利扬芯片	6,510	180,717.60	0.21
109	688536	思瑞浦	1,102	176,187.76	0.20
110	688667	菱电电控	2,501	176,120.42	0.20
111	688585	上纬新材	1,382	176,025.34	0.20
112	688116	天奈科技	3,730	175,869.50	0.20
113	688371	菲沃泰	9,455	174,633.85	0.20
114	688472	阿特斯	11,504	171,524.64	0.20
115	688661	和林微纳	3,280	169,772.80	0.19
116	688510	航亚科技	6,301	169,496.90	0.19
117	688702	盛科通信	1,188	168,327.72	0.19
118	688612	威迈斯	5,079	167,454.63	0.19
119	002602	世纪华通	9,700	165,482.00	0.19
120	688531	日联科技	2,506	165,471.18	0.19
121	688223	晶科能源	29,273	165,099.72	0.19
122	603799	华友钴业	2,400	163,824.00	0.19
123	688123	聚辰股份	1,302	163,505.16	0.19
124	688458	美芯晟	4,114	163,078.96	0.19
125	688798	艾为电子	2,103	160,059.33	0.18
126	688800	瑞可达	1,926	159,858.00	0.18

127	688615	合合信息	700	159,306.00	0.18
128	688609	九联科技	15,371	156,937.91	0.18
129	688266	泽璟制药	1,688	156,477.60	0.18
130	002052	同洲电子	12,200	155,550.00	0.18
131	603486	科沃斯	1,900	153,292.00	0.18
132	688392	骄成超声	1,352	151,694.40	0.17
133	688108	赛诺医疗	7,878	151,572.72	0.17
134	688690	纳微科技	5,818	150,162.58	0.17
135	688600	皖仪科技	5,910	148,045.50	0.17
136	000100	TCL 科技	32,200	146,188.00	0.17
137	688681	科汇股份	8,227	144,630.66	0.17
138	688352	颀中科技	11,448	144,359.28	0.17
139	688668	鼎通科技	1,164	144,336.00	0.17
140	688019	安集科技	662	144,263.04	0.17
141	688383	新益昌	1,837	143,781.99	0.16
142	688636	智明达	3,355	143,728.20	0.16
143	688795	摩尔线程	345	143,526.90	0.16
144	688003	天准科技	2,397	141,183.30	0.16
145	300972	万辰集团	700	140,749.00	0.16
146	688356	键凯科技	1,711	140,644.20	0.16
147	688433	华曙高科	2,094	138,559.98	0.16
148	688009	中国通号	25,301	138,396.47	0.16
149	300438	鹏辉能源	2,600	138,372.00	0.16
150	688318	财富趋势	1,043	138,009.76	0.16
151	688084	晶品特装	1,653	136,868.40	0.16
152	601318	中国平安	2,000	136,800.00	0.16
153	688200	华峰测控	712	135,422.40	0.16
154	688509	正元地信	24,598	135,043.02	0.15
155	688159	有方科技	2,774	134,095.16	0.15
156	688501	青达环保	5,016	132,572.88	0.15
157	688025	杰普特	934	132,226.38	0.15
158	688359	三孚新科	1,955	130,261.65	0.15
159	688571	杭华股份	17,426	129,823.70	0.15
160	688259	创耀科技	3,099	129,538.20	0.15
161	688062	迈威生物	3,362	129,336.14	0.15
162	688789	宏华数科	1,565	127,657.05	0.15
163	688526	科前生物	8,291	126,520.66	0.15
164	688716	中研股份	2,986	126,457.10	0.14
165	688201	信安世纪	8,627	126,213.01	0.14
166	688185	康希诺	1,989	125,008.65	0.14
167	688206	概伦电子	3,584	124,830.72	0.14

168	688265	南模生物	3,037	124,547.37	0.14
169	688303	大全能源	4,627	124,096.14	0.14
170	688319	欧林生物	4,891	124,035.76	0.14
171	300739	明阳电路	6,700	123,146.00	0.14
172	600967	内蒙一机	7,300	122,640.00	0.14
173	688308	欧科亿	3,783	119,694.12	0.14
174	688328	深科达	4,044	118,003.92	0.14
175	300953	震裕科技	700	117,614.00	0.13
176	688181	八亿时空	3,630	117,321.60	0.13
177	688301	奕瑞科技	1,157	116,984.27	0.13
178	688361	中科飞测	757	115,813.43	0.13
179	688131	皓元医药	1,595	114,967.60	0.13
180	688551	科威尔	3,115	114,725.45	0.13
181	688085	三友医疗	6,300	113,526.00	0.13
182	688249	晶合集成	3,392	112,580.48	0.13
183	300146	汤臣倍健	9,300	111,693.00	0.13
184	688623	双元科技	1,189	111,647.10	0.13
185	688172	燕东微	3,853	111,505.82	0.13
186	688047	龙芯中科	840	110,972.40	0.13
187	002716	湖南白银	15,900	110,028.00	0.13
188	300619	金银河	2,500	109,750.00	0.13
189	002537	海联金汇	12,100	109,626.00	0.13
190	688015	交控科技	4,755	108,318.90	0.12
191	688235	百济神州	403	108,245.80	0.12
192	688778	厦钨新能	1,397	108,085.89	0.12
193	688061	灿瑞科技	3,275	106,797.75	0.12
194	688345	博力威	3,388	105,705.60	0.12
195	688597	煜邦电力	12,712	104,365.52	0.12
196	600749	西藏旅游	6,100	104,188.00	0.12
197	688236	春立医疗	4,515	103,303.20	0.12
198	688313	仕佳光子	1,159	102,896.02	0.12
199	688625	呈和科技	2,491	102,629.20	0.12
200	688380	中微半导	3,168	101,851.20	0.12
201	688299	长阳科技	6,019	101,841.48	0.12
202	688279	峰岬科技	500	101,745.00	0.12
203	688567	孚能科技	6,480	101,412.00	0.12
204	688783	西安奕材	5,464	100,482.96	0.12
205	688306	均普智能	8,643	100,258.80	0.11
206	688192	迪哲医药	1,732	99,763.20	0.11
207	600938	中国海油	3,300	99,594.00	0.11
208	688001	华兴源创	3,296	99,473.28	0.11

209	688233	神工股份	1,419	99,372.57	0.11
210	688188	柏楚电子	727	98,792.03	0.11
211	603766	隆鑫通用	6,100	98,271.00	0.11
212	688175	高凌信息	3,045	98,079.45	0.11
213	688157	松井股份	2,707	98,074.61	0.11
214	301507	民生健康	6,300	96,768.00	0.11
215	688021	奥福科技	5,236	96,080.60	0.11
216	601229	上海银行	9,500	95,950.00	0.11
217	688584	上海合晶	4,367	95,811.98	0.11
218	688267	中触媒	3,386	95,383.62	0.11
219	688117	圣诺生物	2,499	94,437.21	0.11
220	002913	奥士康	2,200	94,028.00	0.11
221	603993	洛阳钼业	4,700	94,000.00	0.11
222	301316	慧博云通	2,100	93,828.00	0.11
223	688368	晶丰明源	807	93,152.01	0.11
224	688686	奥普特	749	92,973.37	0.11
225	688033	天宜新材	11,954	92,045.80	0.11
226	002371	北方华创	200	91,816.00	0.11
227	002115	三维通信	7,200	91,728.00	0.11
228	688677	海泰新光	2,086	90,031.76	0.10
229	688110	东芯股份	684	89,843.40	0.10
230	603629	利通电子	3,300	87,945.00	0.10
231	600795	国电电力	17,200	86,688.00	0.10
232	300502	新易盛	200	86,176.00	0.10
233	688191	智洋创新	2,664	85,727.52	0.10
234	688103	国力电子	1,413	85,613.67	0.10
235	603301	振德医疗	1,200	84,600.00	0.10
236	688577	浙海德曼	872	84,461.92	0.10
237	688170	德龙激光	2,684	84,438.64	0.10
238	601857	中国石油	8,000	83,280.00	0.10
239	688573	信宇人	3,653	83,251.87	0.10
240	601899	紫金矿业	2,400	82,728.00	0.09
241	688209	英集芯	4,144	82,631.36	0.09
242	688620	安凯微	6,859	82,582.36	0.09
243	688205	德科立	600	82,488.00	0.09
244	002812	恩捷股份	1,400	79,296.00	0.09
245	688701	卓锦股份	9,622	78,419.30	0.09
246	688329	艾隆科技	3,675	78,240.75	0.09
247	688665	四方光电	1,600	78,032.00	0.09
248	002017	东信和平	3,400	75,820.00	0.09
249	688586	江航装备	5,805	75,697.20	0.09

250	688315	诺禾致源	5,658	75,138.24	0.09
251	688238	和元生物	11,229	74,785.14	0.09
252	688055	龙腾光电	20,712	74,563.20	0.09
253	603367	辰欣药业	4,300	74,476.00	0.09
254	688639	华恒生物	2,285	74,445.30	0.09
255	688132	邦彦技术	4,021	74,066.82	0.08
256	300723	一品红	2,200	73,810.00	0.08
257	688173	希荻微	5,009	73,632.30	0.08
258	688101	三达膜	4,471	73,503.24	0.08
259	688382	益方生物	2,691	73,302.84	0.08
260	300408	三环集团	1,600	73,200.00	0.08
261	688310	迈得医疗	4,767	73,078.11	0.08
262	688210	统联精密	1,315	72,745.80	0.08
263	688528	秦川物联	6,689	72,040.53	0.08
264	688182	灿勤科技	2,419	71,408.88	0.08
265	688018	乐鑫科技	419	71,230.00	0.08
266	688631	莱斯信息	1,041	70,871.28	0.08
267	688326	经纬恒润	600	70,500.00	0.08
268	688403	汇成股份	4,265	69,860.70	0.08
269	688450	光格科技	2,493	68,756.94	0.08
270	688100	威胜信息	1,748	68,696.40	0.08
271	600066	宇通客车	2,100	68,670.00	0.08
272	300274	阳光电源	400	68,416.00	0.08
273	300005	探路者	6,300	68,229.00	0.08
274	688696	极米科技	609	67,891.32	0.08
275	688448	磁谷科技	1,396	67,664.12	0.08
276	688550	瑞联新材	1,481	67,104.11	0.08
277	688557	兰剑智能	1,824	66,448.32	0.08
278	600977	中国电影	4,200	66,024.00	0.08
279	688071	华依科技	1,983	65,776.11	0.08
280	688087	英科再生	2,133	65,739.06	0.08
281	688270	臻镭科技	538	65,673.66	0.08
282	688167	炬光科技	374	65,476.18	0.08
283	300696	爱乐达	2,000	63,820.00	0.07
284	688029	南微医学	773	63,045.88	0.07
285	002163	海南发展	2,600	61,984.00	0.07
286	688613	奥精医疗	3,038	61,701.78	0.07
287	600782	新钢股份	15,700	60,916.00	0.07
288	688505	复旦张江	7,256	60,224.80	0.07
289	003010	若羽臣	1,700	59,449.00	0.07
290	600487	亨通光电	2,400	59,352.00	0.07

291	688429	时创能源	4,524	59,219.16	0.07
292	688295	中复神鹰	1,802	59,123.62	0.07
293	000510	新金路	5,100	59,058.00	0.07
294	688579	地纬智能	5,437	58,610.86	0.07
295	688288	鸿泉技术	2,148	57,587.88	0.07
296	300454	深信服	500	57,580.00	0.07
297	688548	广钢气体	3,954	57,491.16	0.07
298	688246	嘉和美康	2,462	57,241.50	0.07
299	002940	昂利康	1,700	56,984.00	0.07
300	688365	光云科技	3,278	55,299.86	0.06
301	688069	德林海	2,465	55,289.95	0.06
302	688513	苑东生物	895	55,087.25	0.06
303	688138	清溢光电	1,956	55,080.96	0.06
304	688213	思特威	579	55,057.11	0.06
305	002402	和而泰	1,400	54,768.00	0.06
306	688375	国博电子	584	54,376.24	0.06
307	688533	上声电子	1,825	53,363.00	0.06
308	688079	美迪凯	4,669	52,853.08	0.06
309	688067	爱威科技	2,147	52,730.32	0.06
310	300087	荃银高科	4,500	52,560.00	0.06
311	688336	三生国健	881	52,481.17	0.06
312	688013	天臣医疗	1,088	52,311.04	0.06
313	688692	达梦数据	200	52,254.00	0.06
314	301421	波长光电	500	52,075.00	0.06
315	688590	新致软件	2,787	52,005.42	0.06
316	300199	翰宇药业	2,900	51,910.00	0.06
317	600392	盛和资源	2,400	51,672.00	0.06
318	002645	华宏科技	3,500	51,240.00	0.06
319	600610	中毅达	5,100	50,643.00	0.06
320	688073	毕得医药	828	50,549.40	0.06
321	603306	华懋科技	800	50,408.00	0.06
322	688395	正弦电气	2,058	50,050.56	0.06
323	688090	瑞松科技	1,118	49,728.64	0.06
324	688277	天智航	3,271	49,686.49	0.06
325	688689	银河微电	1,734	49,210.92	0.06
326	688113	联测科技	1,231	48,661.43	0.06
327	688553	汇宇制药	2,707	48,157.53	0.06
328	000792	盐湖股份	1,700	47,872.00	0.05
329	688611	杭州柯林	931	47,341.35	0.05
330	688685	迈信林	848	47,047.04	0.05
331	688381	帝奥微	2,062	47,034.22	0.05

332	688202	美迪西	830	46,812.00	0.05
333	688700	东威科技	1,318	46,499.04	0.05
334	688563	航材股份	795	46,467.75	0.05
335	603119	浙江荣泰	400	46,268.00	0.05
336	688561	奇安信	1,300	46,254.00	0.05
337	688768	容知日新	1,060	46,046.40	0.05
338	603767	中马传动	1,900	45,695.00	0.05
339	688377	迪威尔	1,240	45,508.00	0.05
340	688198	佰仁医疗	425	45,479.25	0.05
341	688269	凯立新材	1,128	45,131.28	0.05
342	301086	鸿富瀚	400	44,756.00	0.05
343	002552	宝鼎科技	2,700	44,577.00	0.05
344	688386	泛亚微透	508	44,500.80	0.05
345	688683	莱尔科技	1,384	43,872.80	0.05
346	688610	埃科光电	707	43,699.67	0.05
347	002664	信质集团	1,800	43,128.00	0.05
348	688262	国芯科技	1,415	42,945.25	0.05
349	600183	生益科技	600	42,846.00	0.05
350	688479	友车科技	2,264	42,631.12	0.05
351	603379	三美股份	700	42,504.00	0.05
352	603663	三祥新材	1,200	42,420.00	0.05
353	603444	吉比特	100	42,385.00	0.05
354	000408	藏格矿业	500	42,200.00	0.05
355	688455	科捷智能	2,099	42,168.91	0.05
356	688449	联芸科技	931	42,062.58	0.05
357	002281	光迅科技	600	41,970.00	0.05
358	688065	凯赛生物	838	41,732.40	0.05
359	688478	晶升股份	1,115	41,712.15	0.05
360	688097	博众精工	1,097	41,411.75	0.05
361	002195	岩山科技	5,800	41,122.00	0.05
362	688399	硕世生物	600	41,100.00	0.05
363	688679	通源环境	1,536	40,857.60	0.05
364	301035	润丰股份	600	40,806.00	0.05
365	002946	新乳业	2,200	40,766.00	0.05
366	301571	国科天成	700	40,376.00	0.05
367	688039	当虹科技	900	40,275.00	0.05
368	688293	奥浦迈	820	40,180.00	0.05
369	300911	亿田智能	1,200	39,960.00	0.05
370	002475	立讯精密	700	39,697.00	0.05
371	688425	铁建重工	7,829	39,693.03	0.05
372	688698	伟创电气	400	39,552.00	0.05

373	002222	福晶科技	700	39,438.00	0.05
374	301358	湖南裕能	600	38,796.00	0.04
375	688017	绿的谐波	200	38,420.00	0.04
376	600331	宏达股份	3,000	38,370.00	0.04
377	600309	万华化学	500	38,340.00	0.04
378	600598	北大荒	2,500	37,375.00	0.04
379	301117	佳缘科技	700	37,275.00	0.04
380	601138	工业富联	600	37,230.00	0.04
381	688418	震有科技	851	37,001.48	0.04
382	600111	北方稀土	800	36,896.00	0.04
383	688720	艾森股份	517	36,386.46	0.04
384	688565	力源科技	3,213	35,953.47	0.04
385	688517	金冠电气	2,275	35,467.25	0.04
386	003040	楚天龙	1,700	35,156.00	0.04
387	600050	中国联通	6,800	34,748.00	0.04
388	601963	重庆银行	3,200	34,656.00	0.04
389	688179	阿拉丁	2,757	34,434.93	0.04
390	688048	长光华芯	272	34,095.20	0.04
391	002345	潮宏基	2,700	33,750.00	0.04
392	002882	金龙羽	1,100	33,176.00	0.04
393	688499	利元亨	569	32,842.68	0.04
394	688217	睿昂基因	1,242	32,726.70	0.04
395	688718	唯赛勃	2,499	32,686.92	0.04
396	001389	广合科技	400	32,652.00	0.04
397	688618	三旺通信	1,224	32,631.84	0.04
398	688229	博睿数据	519	32,530.92	0.04
399	688030	山石网科	1,789	32,506.13	0.04
400	688729	屹唐股份	1,325	32,171.00	0.04
401	002373	千方科技	2,700	31,779.00	0.04
402	688052	纳芯微	200	31,636.00	0.04
403	000333	美的集团	400	31,260.00	0.04
404	688216	气派科技	1,400	31,192.00	0.04
405	688156	路德科技	1,948	31,187.48	0.04
406	688500	慧辰股份	504	31,127.04	0.04
407	002028	思源电气	200	30,918.00	0.04
408	688656	浩欧博	200	30,760.00	0.04
409	688503	聚和材料	503	30,683.00	0.04
410	688790	昂瑞微	261	30,555.27	0.04
411	688530	欧莱新材	1,852	30,446.88	0.03
412	688480	赛恩斯	591	30,430.59	0.03
413	300682	朗新科技	2,000	30,420.00	0.03

414	002734	利民股份	1,900	30,286.00	0.03
415	688005	容百科技	852	30,160.80	0.03
416	688035	德邦科技	624	30,108.00	0.03
417	601319	中国人保	3,300	29,535.00	0.03
418	688122	西部超导	395	29,459.10	0.03
419	601601	中国太保	700	29,337.00	0.03
420	688102	斯瑞新材	757	29,326.18	0.03
421	002170	芭田股份	2,400	29,232.00	0.03
422	301095	广立微	400	28,684.00	0.03
423	688456	有研粉材	369	28,671.30	0.03
424	688066	航天宏图	876	28,522.56	0.03
425	688630	芯碁微装	212	28,520.36	0.03
426	000528	柳工	2,400	28,488.00	0.03
427	688177	百奥泰	1,210	27,999.40	0.03
428	603129	春风动力	100	27,868.00	0.03
429	000603	盛达资源	900	27,864.00	0.03
430	688343	云天励飞	365	27,769.20	0.03
431	688669	聚石化学	1,192	27,702.08	0.03
432	688651	盛邦安全	622	27,380.44	0.03
433	688588	凌志软件	1,909	27,317.79	0.03
434	300436	广生堂	300	26,745.00	0.03
435	605499	东鹏饮料	100	26,739.00	0.03
436	688252	天德钰	1,258	26,631.86	0.03
437	605376	博迁新材	400	26,160.00	0.03
438	688118	普元信息	1,021	26,055.92	0.03
439	688522	纳睿雷达	651	25,994.43	0.03
440	688211	中科微至	835	25,718.00	0.03
441	688595	芯海科技	781	25,616.80	0.03
442	688109	品茗科技	200	25,420.00	0.03
443	002428	云南锗业	800	25,400.00	0.03
444	688115	思林杰	387	25,379.46	0.03
445	688285	高铁电气	2,908	25,241.44	0.03
446	688168	安博通	334	25,103.44	0.03
447	688576	西山科技	398	25,058.08	0.03
448	688022	瀚川智能	1,634	25,000.20	0.03
449	603127	昭衍新药	700	24,507.00	0.03
450	688237	超卓航科	500	24,375.00	0.03
451	000975	山金国际	1,000	24,330.00	0.03
452	688568	中科星图	412	24,308.00	0.03
453	688038	中科通达	1,364	24,101.88	0.03
454	688788	科思科技	357	24,040.38	0.03

455	002519	银河电子	3,700	23,976.00	0.03
456	605016	百龙创园	1,100	23,760.00	0.03
457	688276	百克生物	1,255	23,669.30	0.03
458	002436	兴森科技	1,100	23,287.00	0.03
459	000078	海王生物	6,700	23,182.00	0.03
460	601816	京沪高铁	4,500	23,175.00	0.03
461	601689	拓普集团	300	23,154.00	0.03
462	688089	嘉必优	993	23,117.04	0.03
463	002975	博杰股份	300	23,100.00	0.03
464	300866	安克创新	200	22,878.00	0.03
465	688353	华盛锂电	200	22,740.00	0.03
466	688552	航天南湖	625	22,700.00	0.03
467	688676	金盘科技	251	22,675.34	0.03
468	603130	云中马	400	22,660.00	0.03
469	688146	中船特气	555	22,422.00	0.03
470	688077	大地熊	720	21,996.00	0.03
471	600362	江西铜业	400	21,968.00	0.03
472	300303	聚飞光电	3,200	21,888.00	0.03
473	688680	海优新材	572	21,879.00	0.03
474	688389	普门科技	1,667	21,637.66	0.02
475	603986	兆易创新	100	21,425.00	0.02
476	002837	英维克	200	21,378.00	0.02
477	000733	振华科技	400	20,964.00	0.02
478	002164	宁波东力	1,300	20,813.00	0.02
479	600141	兴发集团	600	20,748.00	0.02
480	688589	力合微	903	20,543.25	0.02
481	688020	方邦股份	300	20,406.00	0.02
482	688691	灿芯股份	200	20,396.00	0.02
483	301285	鸿日达	300	20,334.00	0.02
484	300394	天孚通信	100	20,303.00	0.02
485	688570	天玛智控	1,100	20,262.00	0.02
486	688622	禾信仪器	200	20,226.00	0.02
487	688507	索辰科技	200	20,058.00	0.02
488	002669	康达新材	1,300	19,760.00	0.02
489	688558	国盛智科	682	19,730.26	0.02
490	301076	新瀚新材	400	19,724.00	0.02
491	688092	爱科科技	783	19,684.62	0.02
492	688130	晶华微	936	19,599.84	0.02
493	688225	亚信安全	998	19,361.20	0.02
494	688314	康拓医疗	584	19,307.04	0.02
495	000524	岭南控股	1,600	19,184.00	0.02

496	688360	德马科技	900	19,134.00	0.02
497	688161	威高骨科	684	19,097.28	0.02
498	600039	四川路桥	1,900	18,905.00	0.02
499	688151	华强科技	906	18,681.72	0.02
500	688708	佳驰科技	300	18,675.00	0.02
501	002361	神剑股份	1,300	18,642.00	0.02
502	688112	鼎阳科技	495	18,537.75	0.02
503	688165	埃夫特	773	18,366.48	0.02
504	600219	南山铝业	3,400	18,292.00	0.02
505	300378	鼎捷数智	400	18,104.00	0.02
506	002181	粤传媒	2,100	18,102.00	0.02
507	688296	和达科技	1,359	18,006.75	0.02
508	688095	福昕软件	200	17,854.00	0.02
509	603429	集友股份	1,800	17,838.00	0.02
510	688234	天岳先进	200	17,776.00	0.02
511	301338	凯格精机	200	17,622.00	0.02
512	688327	云从科技	1,217	17,488.29	0.02
513	301096	百诚医药	300	17,142.00	0.02
514	688443	智翔金泰	627	17,079.48	0.02
515	688529	豪森智能	920	16,964.80	0.02
516	688207	格灵深瞳	1,114	16,932.80	0.02
517	688060	云涌科技	400	16,932.00	0.02
518	002148	北纬科技	1,900	16,910.00	0.02
519	002595	豪迈科技	200	16,902.00	0.02
520	688059	华锐精密	214	16,841.80	0.02
521	603579	荣泰健康	700	16,667.00	0.02
522	688367	工大高科	538	16,656.48	0.02
523	688707	振华新材	1,190	16,481.50	0.02
524	002514	宝馨科技	2,800	16,464.00	0.02
525	300707	威唐工业	1,000	16,450.00	0.02
526	002899	英派斯	600	16,422.00	0.02
527	688582	芯动联科	248	16,395.28	0.02
528	600009	上海机场	500	16,380.00	0.02
529	002587	奥拓电子	2,400	16,224.00	0.02
530	000014	沙河股份	1,200	16,140.00	0.02
531	002265	建设工业	600	16,092.00	0.02
532	002550	千红制药	2,000	15,720.00	0.02
533	002487	大金重工	300	15,579.00	0.02
534	688759	必贝特	620	15,568.20	0.02
535	688350	富淼科技	600	15,438.00	0.02
536	300806	斯迪克	500	15,370.00	0.02

537	002204	大连重工	2,000	15,300.00	0.02
538	002449	国星光电	1,800	15,228.00	0.02
539	688633	星球石墨	637	15,084.16	0.02
540	002156	通富微电	400	15,080.00	0.02
541	601111	中国国航	1,600	14,992.00	0.02
542	301230	泓博医药	500	14,935.00	0.02
543	002284	亚太股份	1,000	14,930.00	0.02
544	688307	中润光学	344	14,864.24	0.02
545	603179	新泉股份	200	14,776.00	0.02
546	688281	华秦科技	200	14,760.00	0.02
547	605599	菜百股份	900	14,733.00	0.02
548	688777	中控技术	296	14,604.64	0.02
549	688391	钜泉科技	514	14,561.62	0.02
550	600803	新奥股份	700	14,532.00	0.02
551	603950	长源东谷	500	14,475.00	0.02
552	300475	香农芯创	100	14,434.00	0.02
553	000506	招金黄金	1,100	14,366.00	0.02
554	002394	联发股份	900	14,274.00	0.02
555	000901	航天科技	500	14,235.00	0.02
556	603200	上海洗霸	200	14,228.00	0.02
557	000959	首钢股份	2,900	14,210.00	0.02
558	301382	蜂助手	400	14,176.00	0.02
559	000797	中国武夷	3,600	14,148.00	0.02
560	688659	元琛科技	1,481	13,995.45	0.02
561	601336	新华保险	200	13,940.00	0.02
562	600176	中国巨石	800	13,680.00	0.02
563	688311	盟升电子	300	13,680.00	0.02
564	000600	建投能源	1,600	13,648.00	0.02
565	688599	天合光能	817	13,521.35	0.02
566	600258	首旅酒店	800	13,400.00	0.02
567	688387	信科移动	1,035	13,351.50	0.02
568	600150	中国船舶	400	13,304.00	0.02
569	301396	宏景科技	200	13,260.00	0.02
570	000973	佛塑科技	900	13,230.00	0.02
571	688046	药康生物	856	13,148.16	0.02
572	300926	博俊科技	400	13,112.00	0.02
573	600292	电投水电	1,000	13,050.00	0.01
574	001696	宗申动力	600	13,014.00	0.01
575	300779	惠城环保	100	13,011.00	0.01
576	002558	巨人网络	300	12,987.00	0.01
577	688028	沃尔德	200	12,908.00	0.01

578	600313	农发种业	2,000	12,880.00	0.01
579	603173	福斯达	300	12,846.00	0.01
580	600415	小商品城	800	12,760.00	0.01
581	001236	弘业期货	1,200	12,720.00	0.01
582	002215	诺普信	1,200	12,708.00	0.01
583	688282	理工导航	200	12,700.00	0.01
584	000576	甘化科工	1,200	12,636.00	0.01
585	603151	邦基科技	700	12,614.00	0.01
586	605305	中际联合	300	12,498.00	0.01
587	601187	厦门银行	1,700	12,478.00	0.01
588	300850	新强联	300	12,411.00	0.01
589	600478	科力远	1,800	12,402.00	0.01
590	600552	凯盛科技	1,000	12,400.00	0.01
591	688199	久日新材	526	12,397.82	0.01
592	688671	碧兴物联	500	12,385.00	0.01
593	002202	金风科技	600	12,240.00	0.01
594	688114	华大智造	200	12,152.00	0.01
595	688155	先惠技术	200	12,090.00	0.01
596	688309	恒誉环保	500	12,065.00	0.01
597	605118	力鼎光电	400	12,044.00	0.01
598	301607	富特科技	300	12,033.00	0.01
599	301109	军信股份	800	12,000.00	0.01
600	688697	纽威数控	780	11,996.40	0.01
601	688560	明冠新材	837	11,960.73	0.01
602	002736	国信证券	900	11,808.00	0.01
603	000719	中原传媒	1,000	11,760.00	0.01
604	688657	浩辰软件	221	11,759.41	0.01
605	301606	绿联科技	200	11,748.00	0.01
606	000421	南京公用	1,700	11,747.00	0.01
607	002414	高德红外	800	11,736.00	0.01
608	600354	敦煌种业	1,800	11,646.00	0.01
609	002448	中原内配	900	11,637.00	0.01
610	601869	长飞光纤	100	11,636.00	0.01
611	601003	柳钢股份	2,300	11,569.00	0.01
612	000708	中信特钢	700	11,459.00	0.01
613	600323	瀚蓝环境	400	11,440.00	0.01
614	600173	卧龙新能	1,600	11,408.00	0.01
615	688658	悦康药业	498	11,259.78	0.01
616	301031	中熔电气	100	11,219.00	0.01
617	600029	南方航空	1,400	11,214.00	0.01
618	600011	华能国际	1,500	11,190.00	0.01

619	002137	实益达	1,300	11,154.00	0.01
620	000039	中集集团	1,100	11,099.00	0.01
621	688695	中创股份	400	10,972.00	0.01
622	600027	华电国际	2,200	10,912.00	0.01
623	688638	誉辰智能	300	10,899.00	0.01
624	600629	华建集团	500	10,850.00	0.01
625	688726	拉普拉斯	300	10,800.00	0.01
626	000703	恒逸石化	1,000	10,770.00	0.01
627	688566	吉贝尔	359	10,716.15	0.01
628	688549	中巨芯	1,143	10,424.16	0.01
629	688197	首药控股	300	10,422.00	0.01
630	603815	交建股份	1,400	10,416.00	0.01
631	603699	纽威股份	200	10,394.00	0.01
632	002444	巨星科技	300	10,206.00	0.01
633	688426	康为世纪	428	10,199.24	0.01
634	300604	长川科技	100	10,131.00	0.01
635	688616	西力科技	826	10,101.98	0.01
636	688056	莱伯泰科	300	10,083.00	0.01
637	600860	京城股份	800	10,032.00	0.01
638	300395	菲利华	100	10,030.00	0.01
639	000065	北方国际	800	9,968.00	0.01
640	002624	完美世界	600	9,834.00	0.01
641	688419	耐科装备	349	9,768.51	0.01
642	688602	康鹏科技	1,120	9,721.60	0.01
643	603500	祥和实业	800	9,584.00	0.01
644	603929	亚翔集成	100	9,550.00	0.01
645	002020	京新药业	500	9,490.00	0.01
646	600426	华鲁恒升	300	9,429.00	0.01
647	600057	厦门象屿	1,100	9,372.00	0.01
648	600988	赤峰黄金	300	9,372.00	0.01
649	000425	徐工机械	800	9,264.00	0.01
650	002560	通达股份	900	9,072.00	0.01
651	603259	药明康德	100	9,064.00	0.01
652	688710	益诺思	200	8,830.00	0.01
653	688128	中国电研	300	8,724.00	0.01
654	000301	东方盛虹	800	8,712.00	0.01
655	002706	良信股份	800	8,624.00	0.01
656	002434	万里扬	900	8,577.00	0.01
657	688607	康众医疗	200	8,560.00	0.01
658	002337	赛象科技	1,300	8,541.00	0.01
659	688779	五矿新能	1,134	8,493.66	0.01

660	002121	科陆电子	1,100	8,470.00	0.01
661	600403	大有能源	1,200	8,376.00	0.01
662	688619	罗普特	600	8,160.00	0.01
663	688107	安路科技	300	8,154.00	0.01
664	688466	金科环境	500	8,135.00	0.01
665	300824	北鼎股份	700	7,917.00	0.01
666	688362	甬矽电子	200	6,482.00	0.01
667	688727	恒坤新材	154	5,369.98	0.01
668	688809	强一股份	26	5,286.06	0.01
669	688807	优迅股份	38	5,151.28	0.01
670	603175	超颖电子	78	3,787.68	0.00
671	601026	道生天合	249	3,555.72	0.00
672	688805	健信超导	109	3,528.33	0.00
673	688796	百奥赛图	82	3,464.50	0.00
674	603262	技源集团	113	3,175.30	0.00
675	603376	大明电子	79	2,070.59	0.00
676	603370	华新精科	44	2,039.40	0.00
677	603406	天富龙	50	2,008.00	0.00
678	603418	友升股份	33	1,948.98	0.00
679	603092	德力佳	29	1,614.14	0.00
680	603334	丰倍生物	44	1,444.08	0.00
681	603248	锡华科技	86	1,401.80	0.00
682	688593	新相微	26	524.68	0.00
683	688219	会通股份	6	74.52	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688041	海光信息	12,181,547.43	13.97
2	688981	中芯国际	9,655,191.37	11.07
3	688256	寒武纪	9,647,875.82	11.06
4	688008	澜起科技	8,193,447.40	9.39
5	688271	联影医疗	5,132,209.26	5.88
6	688111	金山办公	4,588,798.42	5.26
7	688012	中微公司	4,450,497.69	5.10
8	688469	芯联集成	3,934,363.88	4.51
9	688521	芯原股份	3,552,341.45	4.07
10	688728	格科微	3,360,919.40	3.85
11	688220	翱捷科技	3,305,216.11	3.79

12	688208	道通科技	3,275,825.90	3.76
13	688036	传音控股	3,168,742.12	3.63
14	688343	云天励飞	3,069,014.90	3.52
15	689009	九号公司	2,888,342.97	3.31
16	688334	西高院	2,862,659.23	3.28
17	688188	柏楚电子	2,754,081.98	3.16
18	688328	深科达	2,731,876.88	3.13
19	688009	中国通号	2,692,766.73	3.09
20	688472	阿特斯	2,576,022.31	2.95
21	688367	工大高科	2,564,217.07	2.94
22	688158	优刻得	2,450,764.87	2.81
23	601857	中国石油	2,382,246.00	2.73
24	688396	华润微	2,376,121.91	2.72
25	688347	华虹公司	2,369,278.53	2.72
26	688711	宏微科技	2,326,853.49	2.67
27	688668	鼎通科技	2,317,393.51	2.66
28	688183	生益电子	2,296,984.27	2.63
29	688327	云从科技	2,259,678.31	2.59
30	688126	沪硅产业	2,233,418.41	2.56
31	688122	西部超导	2,213,690.02	2.54
32	688608	恒玄科技	2,183,053.99	2.50
33	688702	盛科通信	2,162,722.83	2.48
34	601288	农业银行	2,152,021.00	2.47
35	000333	美的集团	2,145,798.00	2.46
36	688317	之江生物	2,121,361.61	2.43
37	688067	爱威科技	2,104,304.37	2.41
38	688517	金冠电气	2,094,936.70	2.40
39	688620	安凯微	2,067,879.35	2.37
40	688061	灿瑞科技	2,057,849.08	2.36
41	688800	瑞可达	2,043,020.55	2.34
42	688352	硕中科技	2,041,683.74	2.34
43	601398	工商银行	2,039,704.00	2.34
44	688223	晶科能源	2,037,628.81	2.34
45	688506	百利天恒	2,012,247.34	2.31
46	688484	南芯科技	1,975,826.06	2.27
47	600016	民生银行	1,950,017.00	2.24
48	601988	中国银行	1,934,287.00	2.22
49	688082	盛美上海	1,928,190.03	2.21
50	688739	成大生物	1,900,647.37	2.18
51	688403	汇成股份	1,871,966.89	2.15
52	688525	佰维存储	1,853,290.79	2.12

53	688170	德龙激光	1,769,110.01	2.03
54	688029	南微医学	1,753,577.81	2.01
55	688616	西力科技	1,744,779.13	2.00

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	688041	海光信息	9,903,894.84	11.35
2	688008	澜起科技	8,255,778.41	9.47
3	688256	寒武纪	8,221,751.13	9.43
4	688981	中芯国际	8,113,981.69	9.30
5	688271	联影医疗	4,500,835.61	5.16
6	688111	金山办公	4,113,112.75	4.72
7	688012	中微公司	4,039,480.00	4.63
8	688469	芯联集成	3,837,276.73	4.40
9	688208	道通科技	3,360,462.80	3.85
10	688728	格科微	3,222,873.26	3.69
11	688328	深科达	3,199,663.80	3.67
12	688343	云天励飞	3,149,650.40	3.61
13	688220	翱捷科技	3,074,308.74	3.52
14	688711	宏微科技	2,776,645.95	3.18
15	688668	鼎通科技	2,769,552.63	3.18
16	688367	工大高科	2,714,778.70	3.11
17	688334	西高院	2,687,948.82	3.08
18	688188	柏楚电子	2,620,162.98	3.00
19	688036	传音控股	2,599,952.90	2.98
20	688183	生益电子	2,597,125.15	2.98
21	688472	阿特斯	2,591,564.39	2.97
22	688009	中国通号	2,566,965.34	2.94
23	688158	优刻得	2,472,567.98	2.83
24	688317	之江生物	2,459,480.09	2.82
25	688327	云从科技	2,454,790.16	2.81
26	688067	爱威科技	2,337,528.82	2.68
27	688122	西部超导	2,307,012.24	2.64
28	688702	盛科通信	2,297,669.83	2.63
29	601288	农业银行	2,293,620.00	2.63
30	688396	华润微	2,251,055.40	2.58
31	601857	中国石油	2,239,644.00	2.57
32	688215	瑞晟智能	2,239,581.42	2.57
33	688517	金冠电气	2,160,268.53	2.48

34	688061	灿瑞科技	2,156,815.72	2.47
35	688126	沪硅产业	2,153,435.86	2.47
36	688521	芯原股份	2,150,872.07	2.47
37	688403	汇成股份	2,142,161.41	2.46
38	688585	上纬新材	2,128,836.06	2.44
39	601398	工商银行	2,119,142.00	2.43
40	600016	民生银行	2,092,752.00	2.40
41	688800	瑞可达	2,038,189.46	2.34
42	688620	安凯微	2,033,130.81	2.33
43	688352	颀中科技	2,033,025.87	2.33
44	688170	德龙激光	2,020,577.30	2.32
45	000333	美的集团	2,020,332.00	2.32
46	688347	华虹公司	2,014,392.05	2.31
47	689009	九号公司	2,007,423.68	2.30
48	688029	南微医学	1,987,006.61	2.28
49	688619	罗普特	1,966,728.09	2.25
50	688616	西力科技	1,958,008.83	2.24
51	688082	盛美上海	1,947,259.02	2.23
52	688739	成大生物	1,944,195.24	2.23
53	688484	南芯科技	1,932,659.18	2.22
54	688503	聚和材料	1,920,375.60	2.20
55	601988	中国银行	1,903,541.00	2.18
56	688223	晶科能源	1,890,658.27	2.17
57	688608	恒玄科技	1,865,012.92	2.14
58	688013	天臣医疗	1,855,514.17	2.13
59	688128	中国电研	1,844,416.13	2.11
60	688525	佰维存储	1,831,282.91	2.10
61	688005	容百科技	1,812,695.06	2.08
62	688496	清越科技	1,803,163.49	2.07
63	688689	银河微电	1,756,104.32	2.01
64	688098	申联生物	1,753,271.99	2.01
65	688766	普冉股份	1,747,692.21	2.00

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。

8.4.3 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	692,748,457.81
卖出股票收入（成交）总额	661,104,691.41

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
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）	23,043.20	0.03
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	23,043.20	0.03

8.6 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	118062	天准转债	110	17,302.86	0.02
2	111024	澳弘转债	30	3,000.28	0.00
3	123263	鼎捷转债	12	1,740.04	0.00
4	118063	金05转债	10	1,000.02	0.00

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	400,740.21
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	311,695.54
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	712,435.75

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688012	中微公司	806,978.48	0.93	筹划重大事项

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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(%)
富国上证科创板综合价格指数增强 A	582	48,622.42	—	—	28,298,246.36	100.00
富国上证科创板综合价格指数增强 C	2,373	14,785.35	1,848,041.12	5.27	33,237,596.66	94.73
合计	2,955	21,449.71	1,848,041.12	2.92	61,535,843.02	97.08

9.2 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	富国上证科创板综合价格指数增强 A	—	—
	富国上证科创板综合价格指数增强 C	—	—
	合计	—	—

9.3 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	富国上证科创板综合价格指数增强 A	0
	富国上证科创板综合价格指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富国上证科创板综合价格指数增强 A	0
	富国上证科创板综合价格指数增强 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	富国上证科创板综合价格指数增强 A	富国上证科创板综合价格指数增强 C
基金合同生效日(2025年05月16日)基金份额总额	237,932,034.98	439,426,207.95
基金合同生效日2025年5月16日起至报告期期末基金总申购份额	35,303,833.86	130,293,368.52
减：基金合同生效日2025年5月16日起至报告期期末基金总赎回份额	244,937,622.48	534,633,938.69
基金合同生效日2025年5月16日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	28,298,246.36	35,085,637.78

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，本基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

11.3 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、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 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。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 4.3 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 23 年。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	富国基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 11 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局

受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正
受到调查或处罚等措施的原因	公司治理、合规内控、投资运作、人员管理、其他问题（销售管理、财务管理）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《关于实施〈公开募集证券投资基金管理人监督管理办法〉有关问题的规定》《证券投资基金管理公司管理办法》《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》《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》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券投资基金评价业务管理暂行办法》《证券期货投资者适当性管理办法》《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	截至报告期末，公司已采取包括完善公司相关制度细则、优化相关系统流程、完善合规内控机制在内的一系列整改措施。公司整改成果已经上海证监局验收通过，相关措施已被解除。
其他	—

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 11 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《证券投资基金管理公司管理办法》《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	截至报告期末，公司已采取包括完善公司相关制度细则、优化相关系统流程、完善合规内控机制在内的一系列整改措施。公司整改成果已经上海证监局验收通过，相关措施已被解除。
其他	—
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 2
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 11 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施

受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（销售管理）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券投资基金评价业务管理暂行办法》《证券期货投资者适当性管理办法》《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	截至报告期末，公司已采取包括完善公司相关制度细则、优化相关系统流程、完善合规内控机制在内的一系列整改措施。公司整改成果已经上海证监局验收通过，相关措施已被解除。
其他	—

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长城证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	3	2,837,845.00	0.21	385.88	0.21	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
东财证券	2	—	—	—	—	—
方正证券	2	63,299,857.18	4.68	8,603.75	4.68	—
高盛中国	1	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—
广发证券	2	77,980,471.05	5.76	10,598.46	5.76	—
国海证券	2	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—

国泰海通	4	121,673,499.06	8.99	16,538.27	8.99	—
国投证券	2	—	—	—	—	—
国信证券	2	528,630,322.15	39.06	71,864.46	39.06	—
华泰证券	2	9,912,659.09	0.73	1,347.38	0.73	—
华源证券	2	—	—	—	—	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	157,496,003.38	11.64	21,413.32	11.64	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	—	—	—
西南证券	2	—	—	—	—	—
湘财证券	2	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	1	60,543,804.56	4.47	8,228.45	4.47	—
中航证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	172,675,219.16	12.76	23,468.83	12.76	—
中泰证券	2	—	—	—	—	—
中信建投	2	65,469,696.88	4.84	8,897.48	4.84	—
中信证券	3	92,799,078.78	6.86	12,619.68	6.86	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

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。本基金合同生效日为2025年5月16日，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
长城证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东财证券	—	—	—	—	—	—

方正证券	—	—	—	—	—	—
高盛中国	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰海通	—	—	200,000,000.00	49.60	—	—
国投证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	203,201,000.00	50.40	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
华源证券	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—
上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	63,482.50	96.40	—	—	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	—	—	—	—	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	2,372.50	3.60	—	—	—	—
中航证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
中银证券	—	—	—	—	—	—

11.8 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	富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	规定披露媒介	2025年05月17日
2	富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基	规定披露媒介	2025年05月28

	金开放申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告		日
3	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2025年07月02日
4	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	规定披露媒介	2025年09月03日
5	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	规定披露媒介	2025年09月04日
6	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2025年09月17日
7	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2025年10月29日
8	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2025年10月30日
9	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2025年12月17日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

§ 13 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上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金的文件 2、富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同 3、富国上证科创板综合价格指数增强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、富国上证科创板综合价格指数增强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 。