

富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）	
基金简称	富国新兴成长量化精选混合（LOF）	
场内简称	成长 LOF	
基金主代码	161038	
基金运作方式	契约型，开放式	
基金合同生效日	2017 年 07 月 21 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	134,893,647.14 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2017 年 8 月 18 日	
下属分级基金的基金简称	富国新兴成长量化精选混合（LOF）A	富国新兴成长量化精选混合（LOF）C
下属分级基金场内简称	成长 LOF	—
下属分级基金的交易代码	161038	014171
报告期末下属分级基金的份额总额	65,473,502.53 份	69,420,144.61 份

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资于新兴成长股票，指在中国经济转型升级和产业结构调整的大背景下，具备新技术、新工艺、新材料、新市场需求、新商业模式等新兴要素的成长性产业的股票。本基金通过定量与定性相结合的方法，采用“自上而下”的资产配置方法确定各类资产的配置比例；本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的新兴成长股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报；债券投资方面，本基金将制定久期控制下的资产类属配置策略，具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。本基金的存托凭证投资策略、资产支持证券投资策略、中小企业私募债券投资策略、权证投资策略和其他金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中国战略新兴产业综合指数收益率*90%+中债-国债总全价（1-3 年）指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

注：自 2026 年 6 月 1 日起，本基金业绩比较基准由“中证 500 指数收益率×47.5%+创业板指数收益率×47.5%+银行活期存款利率（税后）×5%”调整为“中国战略新兴产业综合指数收益率×90%+中债-国债总全价（1-3 年）指数收益率×5%+活期存款基准利率×5%”。

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		陈戈	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	证券日报
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 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
注册登记机构	A 类：中国证券登记结算有限责任公司；C 类：富国基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号；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) 富国新兴成长量化精选混合（LOF）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	13,066,781.83
本期利润	17,950,175.56
加权平均基金份额本期利润	0.6290
本期加权平均净值利润率	36.89%
本期基金份额净值增长率	33.41%
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	63,696,725.57
期末可供分配基金份额利润	0.9729
期末基金资产净值	129,170,228.10
期末基金份额净值	1.9729
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	97.29%

(2) 富国新兴成长量化精选混合（LOF）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	5,457,316.58
本期利润	11,878,471.08
加权平均基金份额本期利润	0.9841
本期加权平均净值利润率	56.26%
本期基金份额净值增长率	33.28%
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	66,353,383.01
期末可供分配基金份额利润	0.9558
期末基金资产净值	135,773,527.62
期末基金份额净值	1.9558
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	26.04%

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) 富国新兴成长量化精选混合（LOF）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	28.96%	1.80%	27.84%	1.75%	1.12%	0.05%
过去六个月	33.41%	1.72%	28.87%	1.60%	4.54%	0.12%
过去一年	61.42%	1.47%	74.23%	1.50%	-12.81%	-0.03%
过去三年	60.10%	1.39%	72.20%	1.61%	-12.10%	-0.22%
过去五年	31.26%	1.31%	31.98%	1.46%	-0.72%	-0.15%
过去七年	126.02%	1.30%	129.83%	1.46%	-3.81%	-0.16%
自基金合同生效起至今	97.29%	1.30%	98.50%	1.46%	-1.21%	-0.16%

(2) 富国新兴成长量化精选混合（LOF）C

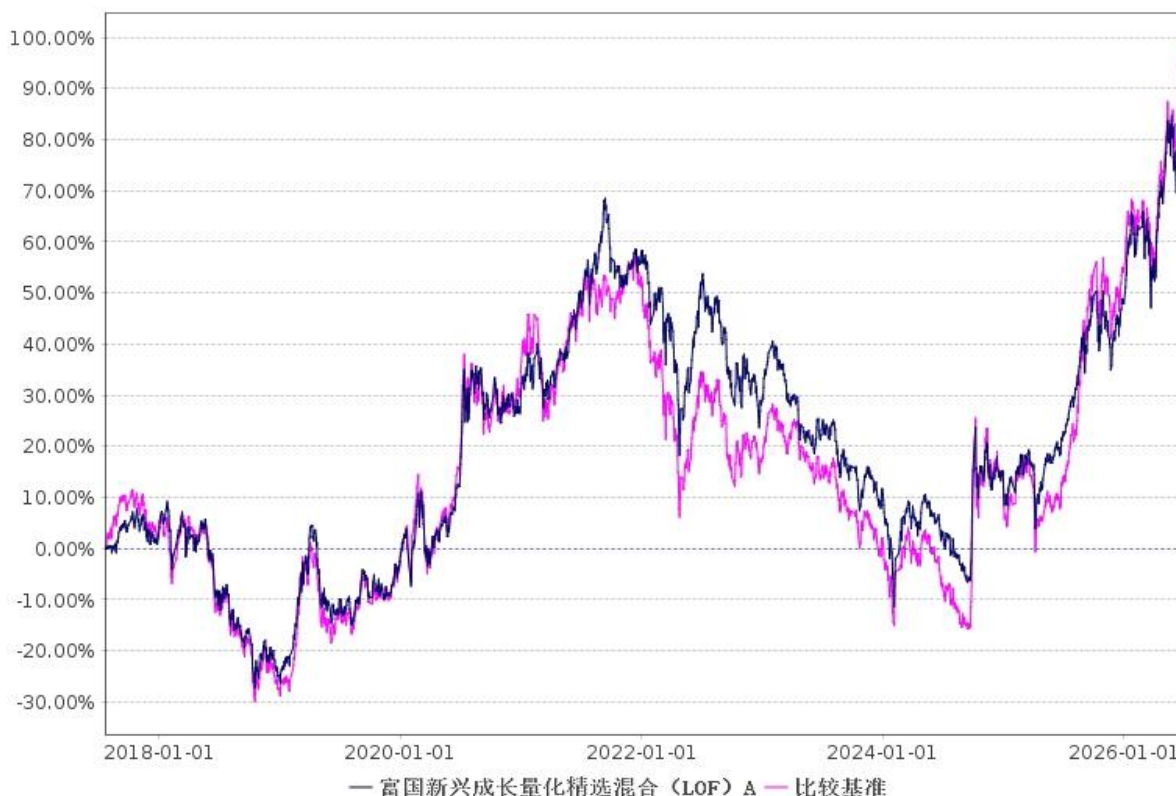
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	28.89%	1.80%	27.84%	1.75%	1.05%	0.05%
过去六个月	33.28%	1.72%	28.87%	1.60%	4.41%	0.12%
过去一年	61.10%	1.47%	74.23%	1.50%	-13.13%	-0.03%
过去三年	59.15%	1.39%	72.20%	1.61%	-13.05%	-0.22%
自基金分级生效日起至今	26.04%	1.34%	30.05%	1.50%	-4.01%	-0.16%

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。

根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定与基金合同的约定，基于本基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等因素，经与基金托管人协商一致，自2026年6月1日起，本基金业绩比较基准由“中证500指数收益率×47.5%+创业板指数收益率×47.5%+银行活期存款利率（税后）×5%”调整为“中国战略新兴产业综合指数收益率×90%+中债-国债总全价（1-3年）指数收益率×5%+活期存款基准利率×5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

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

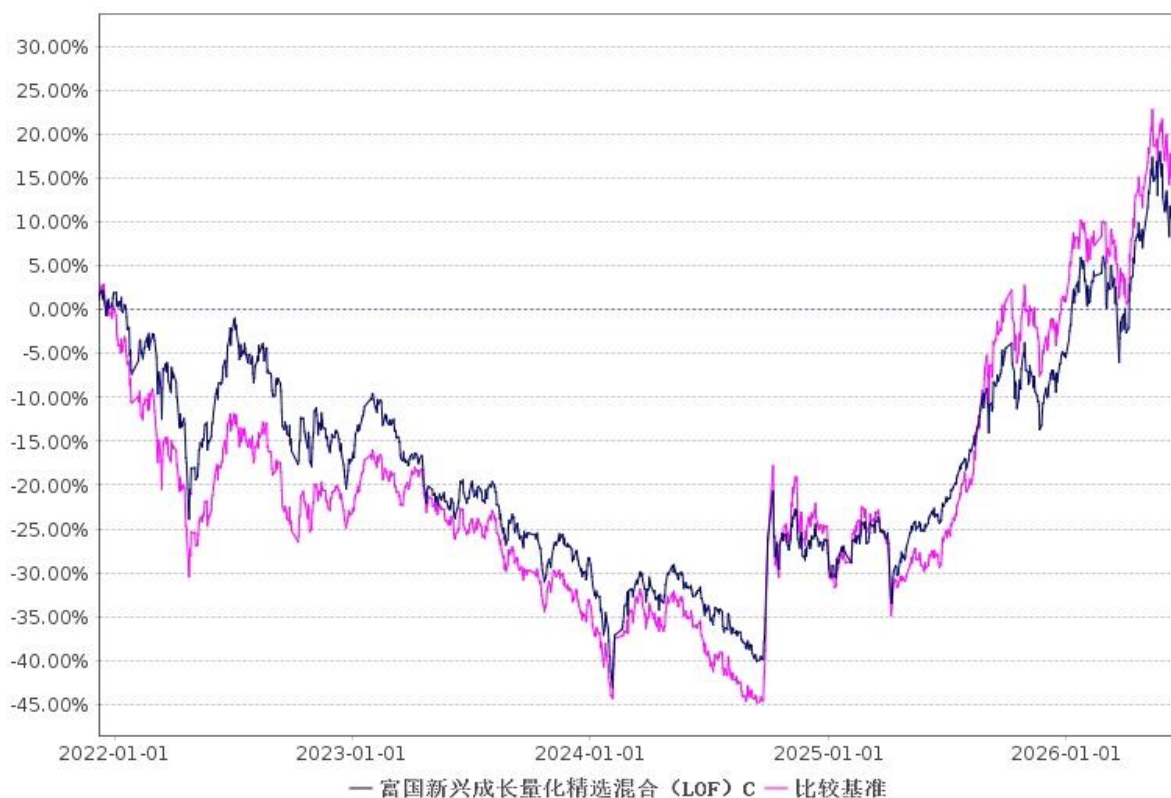
(1) 富国新兴成长量化精选混合（LOF）A



注：1、截止日期为2026年6月30日。

2、根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定与基金合同的约定，基于本基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等因素，经与基金托管人协商一致，自2026年6月1日起，本基金业绩比较基准由“中证500指数收益率×47.5%+创业板指数收益率×47.5%+银行活期存款利率（税后）×5%”调整为“中国战略新兴产业综合指数收益率×90%+中债-国债总全价（1-3年）指数收益率×5%+活期存款基准利率×5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

(2) 富国新兴成长量化精选混合（LOF）C



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2021 年 12 月 7 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

3、根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定与基金合同的约定，基于本基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等因素，经与基金托管人协商一致，自 2026 年 6 月 1 日起，本基金业绩比较基准由“中证 500 指数收益率 $\times$ 47.5%+创业板指数收益率 $\times$ 47.5%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%”调整为“中国战略新兴产业综合指数收益率 $\times$ 90%+中债-国债总全价（1-3 年）指数收益率 $\times$ 5%+活期存款基准利率 $\times$ 5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：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	2020-09-15	—	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。
--	--	--	--	--	---

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)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》、《富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)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 17 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新兴成长量化精选混合（LOF）A 为 1.9729 元，富国新兴成长量化精选混合（LOF）C 为 1.9558 元；份额累计净值富国新兴成长量化精选混合（LOF）A 为 1.9729 元，富国新兴成长量化精选混合（LOF）C 为 1.9558 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国新兴成长量化精选混合（LOF）A 为 33.41%，富国新兴成长量化精选混合（LOF）C 为 33.28%；同期业绩比较基准收益率情况：富国新兴成长量化精选混合（LOF）A 为 28.87%，富国新兴成长量化精选混合（LOF）C 为 28.87%。

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

1、本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2、自 2026 年 1 月 5 日至 2026 年 3 月 17 日，本基金存在资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况。

3、自 2024 年 7 月 1 日起由基金管理人承担本基金项下相关固定费用。

§ 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 半年度财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）

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	11,057,381.90	1,061,687.21
结算备付金	1,757,043.97	224,551.72
存出保证金	42,964.24	6,545.09
交易性金融资产	252,694,702.55	41,762,766.32
其中：股票投资	247,835,286.96	40,344,683.10
基金投资	—	—
债券投资	4,859,415.59	1,418,083.22
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	31,665,085.45	—
应收股利	—	—
应收申购款	1,676,289.56	317,844.75
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	298,893,467.67	43,373,395.09
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	—	—
应付清算款	32,759,823.01	0.07
应付赎回款	640,847.45	196,881.27
应付管理人报酬	113,516.16	27,413.99
应付托管费	25,225.80	6,092.02
应付销售服务费	10,799.61	518.17
应付投资顾问费	—	—
应交税费	147.65	—

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	399,352.27	77,143.48
负债合计	33,949,711.95	308,049.00
净资产：		
实收基金	134,893,647.14	29,138,764.18
未分配利润	130,050,108.58	13,926,581.91
净资产合计	264,943,755.72	43,065,346.09
负债和净资产总计	298,893,467.67	43,373,395.09

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.9641 元，基金份额总额 134,893,647.14 份。其中：富国新兴成长量化精选混合（LOF）A 份额净值 1.9729 元，份额总额 65,473,502.53 份；富国新兴成长量化精选混合（LOF）C 份额净值 1.9558 元，份额总额 69,420,144.61 份。

6.2 利润表

会计主体：富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）

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 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	30,228,780.11	2,243,336.14
1. 利息收入	13,878.35	1,965.23
其中：存款利息收入	13,878.35	1,965.23
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）	18,802,057.84	1,204,602.64
其中：股票投资收益	18,383,493.57	890,846.78
基金投资收益	—	—
债券投资收益	19,078.14	4,515.78
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	10,446.50	—
股利收益	389,039.63	309,240.08
其他投资收益	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	11,304,548.23	1,033,202.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	108,295.69	3,565.29
减：二、营业总支出	400,133.47	142,329.00
1. 管理人报酬	308,608.70	114,549.40

2. 托管费	68,579.73	25,455.42
3. 销售服务费	20,366.41	1,472.96
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	1,416.54	127.67
其中：卖出回购金融资产支出	1,416.54	127.67
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	83.42	—
8. 其他费用	1,078.67	723.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	29,828,646.64	2,101,007.14
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	29,828,646.64	2,101,007.14
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	29,828,646.64	2,101,007.14

6.3 净资产变动表

会计主体：富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）

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	29,138,764.18	13,926,581.91	43,065,346.09
二、本期期初净资产	29,138,764.18	13,926,581.91	43,065,346.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	105,754,882.96	116,123,526.67	221,878,409.63
（一）、综合收益总额	—	29,828,646.64	29,828,646.64
（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）	105,754,882.96	86,294,880.03	192,049,762.99
其中：1. 基金申购款	127,941,695.18	100,195,982.94	228,137,678.12
2. 基金赎回款	-22,186,812.22	-13,901,102.91	-36,087,915.13
（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	134,893,647.14	130,050,108.58	264,943,755.72
项目	上年度可比期间 (2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	22,767,091.95	2,887,076.84	25,654,168.79
二、本期期初净资产	22,767,091.95	2,887,076.84	25,654,168.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-497,785.07	2,047,832.27	1,550,047.20
（一）、综合收益总额	—	2,101,007.14	2,101,007.14
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净	-497,785.07	-53,174.87	-550,959.94

资产减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	2, 441, 869. 47	426, 310. 52	2, 868, 179. 99
2. 基金赎回款	-2, 939, 654. 54	-479, 485. 39	-3, 419, 139. 93
(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	22, 269, 306. 88	4, 934, 909. 11	27, 204, 215. 99

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

富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）（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[2016]2912号《关于准予富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2017年7月21日生效。首次设立募集规模为632,370,666.56份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人于2021年11月30日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加C类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自2021年12月7日起，本基金增加C类份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，A类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，C类基金份额的注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、国家债券、央行票据、地方政府债券、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、中小企业私募债券、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、衍生工具（股指期货、权证等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票及存托凭证资产的投资比例占基金资产的 60-95%；其中投资于新兴成长相关股票及存托凭证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的投资比例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。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业综合指数收益率*90%+中债-国债总全价（1-3 年）指数收益率*5%+活期存款基准利率*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。

6.4.7 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	11,057,381.90
等于：本金	11,055,517.67

加：应计利息	1,864.23
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	11,057,381.90

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末（2026 年 06 月 30 日）			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		235,448,265.89	—	247,835,286.96	12,387,021.07
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	4,807,598.00	28,382.89	4,859,415.59	23,434.70
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	4,807,598.00	28,382.89	4,859,415.59	23,434.70
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		240,255,863.89	28,382.89	252,694,702.55	12,410,455.77

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	336.28
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	399,015.99
其中：交易所市场	399,015.99
银行间市场	—
应付利息	—
合计	399,352.27

6.4.7.7 实收基金

富国新兴成长量化精选混合（LOF）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	26,979,724.29	26,979,724.29
本期申购	51,142,017.94	51,142,017.94
本期赎回（以“-”号填列）	-12,648,239.70	-12,648,239.70
本期末	65,473,502.53	65,473,502.53

富国新兴成长量化精选混合（LOF）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	2,159,039.89	2,159,039.89
本期申购	76,799,677.24	76,799,677.24
本期赎回（以“-”号填列）	-9,538,572.52	-9,538,572.52
本期末	69,420,144.61	69,420,144.61

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

富国新兴成长量化精选混合（LOF）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	15,877,905.27	-2,960,478.10	12,917,427.17
本期期初	15,877,905.27	-2,960,478.10	12,917,427.17
本期利润	13,066,781.83	4,883,393.73	17,950,175.56
本期基金份额交易产生的变动数	37,557,564.54	-4,728,441.70	32,829,122.84
其中：基金申购款	47,205,533.19	-6,113,547.06	41,091,986.13
基金赎回款	-9,647,968.65	1,385,105.36	-8,262,863.29
本期已分配利润	—	—	—
本期末	66,502,251.64	-2,805,526.07	63,696,725.57

富国新兴成长量化精选混合（LOF）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	1,247,597.09	-238,442.35	1,009,154.74
本期期初	1,247,597.09	-238,442.35	1,009,154.74
本期利润	5,457,316.58	6,421,154.50	11,878,471.08
本期基金份额交易产生的变动数	62,714,035.09	-9,248,277.90	53,465,757.19
其中：基金申购款	70,051,645.79	-10,947,648.98	59,103,996.81
基金赎回款	-7,337,610.70	1,699,371.08	-5,638,239.62
本期已分配利润	—	—	—
本期末	69,418,948.76	-3,065,565.75	66,353,383.01

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	6,487.54
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	2,193.29
其他	5,197.52
合计	13,878.35

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	568,476,352.66
减：卖出股票成本总额	549,191,083.72
减：交易费用	901,775.37
买卖股票差价收入	18,383,493.57

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	16,031.46
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,046.68
合计	19,078.14

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	1,421,855.29
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,400,888.00
减：应计利息总额	17,920.46
减：交易费用	0.15
买卖债券差价收入	3,046.68

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	10,446.50
----------	-----------

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	389,039.63
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	389,039.63

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	11,304,548.23
股票投资	11,283,778.43
债券投资	20,769.80
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	—
合计	11,304,548.23

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	55,505.02
基金转换费收入	52,790.67
合计	108,295.69

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	—

信息披露费	—
证券出借违约金	—
银行费用	1,068.03
其他	10.64
合计	1,078.67

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
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构(2025年3月14日前)
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	基金管理人的股东、基金代销机构（自2025年3月14日起）
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中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

注：（1）关联方国泰海通证券股份有限公司（简称“国泰海通”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原关联方海通证券股份有限公司于2025年3月14日合并组建而成。

（2）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01月01日至2025年06月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国泰海通	390,589,802.48	29.73	46,444,411.19	11.96
海通证券	—	—	20,537,411.75	5.29

申万宏源	320,375,015.75	24.38	55,272,756.77	14.24
------	----------------	-------	---------------	-------

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01月01日至2025年06月30日)	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
国泰海通	2,001,037.00	41.64	—	—
申万宏源	401,573.41	8.36	—	—

6.4.10.1.3 债券回购交易

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01月01日至2025年06月30日)	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
国泰海通	1,300,000.00	7.83	—	—
申万宏源	3,100,000.00	18.67	—	—

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	158,544.79	29.73	114,132.30	28.60
申万宏源	130,042.59	24.38	92,919.56	23.29
关联方名称	上年度可比期间(2025年01月01日至2025年06月30日)			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
国泰海通	18,852.61	11.96	18,852.61	21.17
海通证券	8,335.94	5.29	—	—
申万宏源	22,437.69	14.24	12,887.32	14.47

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的管理费	308,608.70	114,549.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	62,080.35	31,429.23
应支付基金管理人的净管理费	246,528.35	83,120.17

注：本基金管理费按前一日基金资产净值的 0.90% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	68,579.73	25,455.42

注：基金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		
	富国新兴成长量化精选混合（LOF）A	富国新兴成长量化精选混合（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	—	14,340.17	14,340.17
国泰海通证券股份有限公司	—	1.28	1.28
合计	—	14,341.45	14,341.45

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01月01日至2025年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国新兴成长量化精选混合（LOF）A	富国新兴成长量化精选混合（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	—	1,429.69	1,429.69
合计	—	1,429.69	1,429.69

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将专门用于本基金C类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

在通常情况下，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.20%年费率计提。销售服务费计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，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

份额单位：份

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01月01日至2025年06月30日）	
	富国新兴成长量化精选混合（LOF）A	富国新兴成长量化精选混合（LOF）C	富国新兴成长量化精选混合（LOF）A	富国新兴成长量化精选混合（LOF）C
报告期初持有的基金份额	4,279,965.75	—	4,279,965.75	—
报告期间申购/买入总份额	26,488,133.08	—	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
报告期末持有的基金份额	30,768,098.83	—	4,279,965.75	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	46.99%	—	20.65%	—

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）		上年度可比期间（2025年01月01日至2025年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	11,057,381.90	6,487.54	654,200.83	1,329.60

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

自2024年7月1日起由基金管理人承担本基金项下相关固定费用。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（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

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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	4,443.00	2,924,988 .68	3,696,576 .00	—

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 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	28,573.78	3,313.03
未评级	—	—
合计	28,573.78	3,313.03

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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

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	11,057,381.90	—	—	—	11,057,381.90
结算备付金	1,757,043.97	—	—	—	1,757,043.97
存出保证金	42,964.24	—	—	—	42,964.24
交易性金融资产	4,859,415.59	—	—	247,835,286.96	252,694,702.55
应收清算款	—	—	—	31,665,085.45	31,665,085.45
应收申购款	—	—	—	1,676,289.56	1,676,289.56
资产总计	17,716,805.70	—	—	281,176,661.97	298,893,467.67
负债					
应付清算款	—	—	—	32,759,823.01	32,759,823.01
应付赎回款	—	—	—	640,847.45	640,847.45
应付管理人报酬	—	—	—	113,516.16	113,516.16
应付托管费	—	—	—	25,225.80	25,225.80
应付销售服务费	—	—	—	10,799.61	10,799.61
应交税费	—	—	—	147.65	147.65
其他负债	—	—	—	399,352.27	399,352.27
负债总计	—	—	—	33,949,711.95	33,949,711.95
利率敏感度缺口	17,716,805.70	—	—	247,226,950.02	264,943,755.72
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	1,061,687.21	—	—	—	1,061,687.21
结算备付金	224,551.72	—	—	—	224,551.72
存出保证金	6,545.09	—	—	—	6,545.09
交易性金融资产	1,418,083.22	—	—	40,344,683.10	41,762,766.32
应收申购款	—	—	—	317,844.75	317,844.75
资产总计	2,710,867.24	—	—	40,662,527.85	43,373,395.09
负债					
应付清算款	—	—	—	0.07	0.07
应付赎回款	—	—	—	196,881.27	196,881.27
应付管理人报酬	—	—	—	27,413.99	27,413.99
应付托管费	—	—	—	6,092.02	6,092.02
应付销售服务费	—	—	—	518.17	518.17
其他负债	—	—	—	77,143.48	77,143.48
负债总计	—	—	—	308,049.00	308,049.00
利率敏感度缺口	2,710,867.24	—	—	40,354,478.85	43,065,346.09

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%	-2,594.85	-256.53
	2. 基准点利率减少0.1%	2,594.85	256.53

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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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	247,835,286.96	93.54	40,344,683.10	93.68
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	4,859,415.59	1.83	1,418,083.22	3.29
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	252,694,702.55	95.38	41,762,766.32	96.98

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%	2,695,323.18	351,642.51
	2. 业绩比较基准减少 1%	-2,695,323.18	-351,642.51

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	244,167,284.74	40,190,593.09
第二层次	8,527,417.81	1,572,173.23
第三层次	—	—

合计	252,694,702.55	41,762,766.32
----	----------------	---------------

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	247,835,286.96	82.92
	其中：股票	247,835,286.96	82.92
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	4,859,415.59	1.63
	其中：债券	4,859,415.59	1.63
	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	12,814,425.87	4.29
8	其他各项资产	33,384,339.25	11.17
9	合计	298,893,467.67	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	2,198,534.40	0.83
B	采矿业	1,728,939.00	0.65
C	制造业	201,567,279.31	76.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	915,488.00	0.35
E	建筑业	561,219.00	0.21
F	批发和零售业	5,818,305.00	2.20
G	交通运输、仓储和邮政业	1,192,848.00	0.45
H	住宿和餐饮业	81,792.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,299,036.27	9.17
J	金融业	2,326,051.00	0.88
K	房地产业	897,840.08	0.34
L	租赁和商务服务业	505,665.80	0.19
M	科学研究和技术服务业	3,252,113.69	1.23
N	水利、环境和公共设施管理业	1,914,222.41	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	235,600.00	0.09

P	教育	223,275.00	0.08
Q	卫生和社会工作	33,726.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	83,352.00	0.03
S	综合	—	—
	合计	247,835,286.96	93.54

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	10,500	13,335,000.00	5.03
2	300750	宁德时代	17,600	6,916,976.00	2.61
3	688498	源杰科技	3,572	6,736,792.00	2.54
4	002384	东山精密	19,000	4,984,650.00	1.88
5	688256	寒武纪	2,948	4,703,681.40	1.78
6	688072	拓荆科技	4,443	3,696,576.00	1.40
7	301308	江波龙	4,800	3,378,240.00	1.28
8	301536	星宸科技	24,000	3,089,040.00	1.17
9	688041	海光信息	8,297	3,072,379.10	1.16
10	688525	佰维存储	5,797	2,867,949.81	1.08
11	300502	新易盛	4,640	2,816,480.00	1.06
12	600487	亨通光电	24,300	2,656,962.00	1.00
13	600150	中国船舶	73,400	2,480,186.00	0.94
14	688002	睿创微纳	15,778	2,440,698.82	0.92
15	688766	普冉股份	2,470	1,893,502.00	0.71
16	688519	南亚新材	4,850	1,843,194.00	0.70
17	688012	中微公司	3,917	1,835,114.50	0.69
18	688627	精智达	2,551	1,823,965.00	0.69
19	300444	双杰电气	146,300	1,786,323.00	0.67
20	688110	东芯股份	8,616	1,755,079.20	0.66
21	688221	前沿生物	74,239	1,662,953.60	0.63
22	300953	震裕科技	12,260	1,639,162.00	0.62
23	300857	协创数据	4,800	1,631,520.00	0.62
24	301511	德福科技	11,200	1,611,120.00	0.61
25	688111	金山办公	7,508	1,599,579.40	0.60
26	300438	鹏辉能源	19,300	1,599,005.00	0.60
27	600183	生益科技	9,200	1,595,280.00	0.60
28	301246	宏源药业	55,300	1,487,570.00	0.56
29	301086	鸿富瀚	7,100	1,485,888.00	0.56
30	301500	飞南资源	55,500	1,445,775.00	0.55
31	688025	杰普特	2,754	1,294,380.00	0.49
32	002738	中矿资源	21,800	1,285,982.00	0.49

33	301150	中一科技	20,040	1,264,724.40	0.48
34	300613	富瀚微	15,500	1,241,240.00	0.47
35	300723	一品红	32,376	1,206,977.28	0.46
36	300475	香农芯创	4,000	1,200,000.00	0.45
37	300590	移为通信	82,900	1,189,615.00	0.45
38	301189	奥尼电子	20,080	1,183,314.40	0.45
39	688090	瑞松科技	11,115	1,183,191.75	0.45
40	300476	胜宏科技	3,400	1,177,862.00	0.44
41	688416	恒烁股份	8,401	1,176,140.00	0.44
42	688008	澜起科技	3,633	1,125,866.70	0.42
43	603083	剑桥科技	4,400	1,121,428.00	0.42
44	301099	雅创电子	11,700	1,117,350.00	0.42
45	300037	新宙邦	11,900	1,104,915.00	0.42
46	688472	阿特斯	101,039	1,093,241.98	0.41
47	300970	华绿生物	58,930	1,077,240.40	0.41
48	002851	麦格米特	6,400	1,069,952.00	0.40
49	301377	鼎泰高科	1,900	1,046,710.00	0.40
50	300223	君正股份	4,200	1,045,380.00	0.39
51	688262	国芯科技	24,013	1,038,081.99	0.39
52	002414	高德红外	78,200	1,036,932.00	0.39
53	603259	药明康德	8,300	1,033,433.00	0.39
54	688378	奥来德	16,315	1,011,530.00	0.38
55	688127	蓝特光学	10,290	1,004,304.00	0.38
56	301526	国际复材	21,300	994,071.00	0.38
57	688045	必易微	12,066	974,691.48	0.37
58	600601	方正科技	69,600	963,264.00	0.36
59	688368	晶丰明源	4,448	963,080.96	0.36
60	300782	卓胜微	8,700	953,346.00	0.36
61	002466	天齐锂业	15,300	938,196.00	0.35
62	002812	恩捷股份	14,000	936,740.00	0.35
63	688209	英集芯	32,199	936,346.92	0.35
64	301210	金杨精密	31,120	933,600.00	0.35
65	300432	富临精工	46,400	932,176.00	0.35
66	688689	银河微电	14,380	930,673.60	0.35
67	301217	铜冠铜箔	5,600	924,392.00	0.35
68	300497	富祥股份	40,500	897,480.00	0.34
69	688173	希荻微	46,405	888,191.70	0.34
70	688049	炬芯科技	18,824	883,033.84	0.33
71	688182	灿勤科技	20,417	879,360.19	0.33
72	688469	芯联集成	81,701	866,847.61	0.33
73	688409	富创精密	2,830	866,687.50	0.33

74	688391	钜泉科技	23,875	856,396.25	0.32
75	300511	雪榕生物	170,200	856,106.00	0.32
76	688309	恒誉科技	14,047	855,181.36	0.32
77	002222	福晶科技	9,100	839,748.00	0.32
78	300408	三环集团	5,000	834,500.00	0.31
79	301216	万凯新材	36,000	827,640.00	0.31
80	601231	环旭电子	25,500	826,200.00	0.31
81	300416	苏试试验	40,500	825,390.00	0.31
82	301631	壹连科技	11,400	819,204.00	0.31
83	002913	奥士康	12,800	818,432.00	0.31
84	002049	紫光国微	9,200	816,500.00	0.31
85	688568	中科星图	19,688	816,461.36	0.31
86	300972	万辰集团	4,600	797,686.00	0.30
87	002281	光迅科技	3,100	796,514.00	0.30
88	300790	宇瞳光学	30,500	796,355.00	0.30
89	603799	华友钴业	16,400	791,464.00	0.30
90	600363	联创光电	22,000	787,160.00	0.30
91	688522	纳睿雷达	38,945	779,678.90	0.29
92	600875	东方电气	27,100	779,667.00	0.29
93	002028	思源电气	4,500	778,500.00	0.29
94	002916	深南电路	1,700	778,430.00	0.29
95	688195	腾景科技	4,038	777,638.04	0.29
96	603920	世运电路	16,100	773,444.00	0.29
97	600989	宝丰能源	37,700	766,441.00	0.29
98	300803	指南针	8,300	760,861.00	0.29
99	001389	广合科技	3,200	759,200.00	0.29
100	300323	华灿光电	37,000	754,800.00	0.28
101	603061	金海通	1,500	753,330.00	0.28
102	688677	海泰新光	7,402	748,564.26	0.28
103	603659	璞泰来	25,700	743,501.00	0.28
104	603986	兆易创新	900	733,500.00	0.28
105	688266	泽璟制药	6,234	727,258.44	0.27
106	688293	奥浦迈	17,444	727,240.36	0.27
107	688580	伟思医疗	13,503	719,304.81	0.27
108	300903	科翔股份	7,100	719,301.00	0.27
109	601985	中国核电	78,700	710,661.00	0.27
110	300865	大宏立	32,200	703,570.00	0.27
111	688388	嘉元科技	15,957	702,108.00	0.27
112	301101	明月镜片	25,600	697,344.00	0.26
113	300394	天孚通信	2,300	696,164.00	0.26
114	002947	恒铭达	9,000	684,450.00	0.26

115	601061	中信金属	60,800	654,816.00	0.25
116	300017	网宿科技	49,900	649,199.00	0.25
117	688156	路德科技	21,268	643,357.00	0.24
118	603290	斯达半导	4,200	642,348.00	0.24
119	600919	江苏银行	59,500	641,410.00	0.24
120	002558	巨人网络	22,900	631,124.00	0.24
121	301358	湖南裕能	8,300	629,721.00	0.24
122	301568	思泰克	5,600	624,960.00	0.24
123	688536	思瑞浦	1,709	622,229.81	0.23
124	301608	博实结	12,208	613,574.08	0.23
125	600418	江淮汽车	23,500	607,005.00	0.23
126	300681	英搏尔	21,100	603,882.00	0.23
127	603538	美诺华	17,700	576,135.00	0.22
128	002266	浙富控股	113,100	572,286.00	0.22
129	000338	潍柴动力	20,800	566,800.00	0.21
130	688353	华盛锂电	4,871	565,376.97	0.21
131	688521	芯原股份	1,497	555,596.58	0.21
132	688059	华锐精密	2,781	555,393.51	0.21
133	688311	盟升电子	21,130	553,394.70	0.21
134	300456	赛微电子	12,900	547,863.00	0.21
135	300821	东岳硅材	26,000	534,560.00	0.20
136	600988	赤峰黄金	20,300	534,296.00	0.20
137	300679	电连技术	8,900	533,911.00	0.20
138	300661	圣邦股份	3,700	530,876.00	0.20
139	600233	圆通速递	33,500	527,625.00	0.20
140	603893	瑞芯微	2,800	527,408.00	0.20
141	002493	荣盛石化	48,100	517,075.00	0.20
142	300442	润泽科技	6,200	515,034.00	0.19
143	688981	中芯国际	3,200	508,224.00	0.19
144	300033	同花顺	2,100	506,100.00	0.19
145	688318	财富趋势	7,044	502,307.64	0.19
146	002517	恺英网络	30,600	497,250.00	0.19
147	605222	起帆电缆	21,300	496,716.00	0.19
148	001309	德明利	500	471,450.00	0.18
149	688578	艾力斯	4,266	465,847.20	0.18
150	300990	同飞股份	4,400	462,308.00	0.17
151	002463	沪电股份	3,000	458,400.00	0.17
152	688779	五矿新能	56,314	456,706.54	0.17
153	688228	开普云	5,878	454,604.52	0.17
154	301606	绿联科技	7,300	445,446.00	0.17
155	300277	汽轮科技	29,300	440,672.00	0.17

156	688795	摩尔线程	614	439,924.86	0.17
157	000973	佛塑科技	30,600	439,110.00	0.17
158	003010	若羽臣	18,000	437,400.00	0.17
159	301200	大族数控	1,200	432,780.00	0.16
160	300602	飞荣达	8,400	430,080.00	0.16
161	002653	海思科	6,400	424,576.00	0.16
162	688396	华润微	4,310	420,440.50	0.16
163	002838	道恩股份	13,700	419,494.00	0.16
164	301662	宏工科技	4,100	415,412.00	0.16
165	300433	蓝思科技	7,700	413,182.00	0.16
166	603124	江南新材	2,200	411,356.00	0.16
167	688400	凌云光	6,183	409,314.60	0.15
168	300823	建科智能	27,900	406,782.00	0.15
169	301329	信音电子	16,700	405,643.00	0.15
170	600498	烽火通信	5,500	404,800.00	0.15
171	300339	润和软件	10,500	404,355.00	0.15
172	601360	三六零	46,400	403,216.00	0.15
173	002284	亚太股份	42,400	402,376.00	0.15
174	688001	华兴源创	4,631	396,876.70	0.15
175	300775	三角防务	18,000	396,720.00	0.15
176	603383	顶点软件	14,900	395,744.00	0.15
177	000629	钒钛股份	117,800	393,452.00	0.15
178	688257	新锐股份	3,851	392,416.90	0.15
179	688700	东威科技	4,380	391,572.00	0.15
180	688226	威腾电气	9,047	387,483.01	0.15
181	301316	慧博云通	9,800	385,924.00	0.15
182	688702	盛科通信	962	375,170.38	0.14
183	600489	中金黄金	20,600	371,830.00	0.14
184	001287	中电港	11,900	370,685.00	0.14
185	688475	萤石网络	13,382	365,997.70	0.14
186	688326	经纬恒润	5,147	364,819.36	0.14
187	300207	欣旺达	19,200	364,608.00	0.14
188	601212	白银有色	71,700	364,236.00	0.14
189	600869	远东股份	10,800	361,476.00	0.14
190	603711	香飘飘	32,100	356,631.00	0.13
191	600790	轻纺城	109,040	356,560.80	0.13
192	688668	鼎通科技	952	355,381.60	0.13
193	301295	美硕科技	8,400	354,312.00	0.13
194	300184	力源信息	20,100	352,755.00	0.13
195	301510	固高科技	11,000	351,230.00	0.13
196	603175	超颖电子	3,900	347,451.00	0.13

197	300916	朗特智能	14,700	343,539.00	0.13
198	002487	大金重工	5,800	336,226.00	0.13
199	605289	罗曼股份	2,300	333,500.00	0.13
200	688802	沐曦股份	400	331,320.00	0.13
201	301391	卡莱特	5,800	331,180.00	0.13
202	688775	影石创新	2,382	330,264.30	0.12
203	600816	建元信托	132,500	323,300.00	0.12
204	600663	陆家嘴	51,136	321,134.08	0.12
205	300400	劲拓股份	8,400	316,260.00	0.12
206	001298	好上好	15,200	315,400.00	0.12
207	688308	欧科亿	1,730	314,531.30	0.12
208	688061	灿瑞科技	6,308	313,318.36	0.12
209	300014	亿纬锂能	4,800	312,144.00	0.12
210	605358	立昂微	4,000	310,400.00	0.12
211	000534	万泽股份	11,300	309,168.00	0.12
212	300568	星源材质	16,500	308,880.00	0.12
213	688220	翱捷科技	2,480	308,313.60	0.12
214	688230	芯导科技	3,868	304,837.08	0.12
215	300921	南凌科技	14,900	302,619.00	0.11
216	688202	美迪西	3,657	295,156.47	0.11
217	603125	常青科技	8,900	291,386.00	0.11
218	002969	嘉美包装	20,600	290,048.00	0.11
219	301479	弘景光电	4,800	288,960.00	0.11
220	301117	ST 佳缘	12,260	286,271.00	0.11
221	688603	天承科技	1,375	285,931.25	0.11
222	688305	科德数控	4,380	285,882.60	0.11
223	688456	有研粉材	2,042	285,063.20	0.11
224	603390	通达电气	27,300	285,012.00	0.11
225	301550	斯菱智驱	3,100	283,433.00	0.11
226	301371	敷尔佳	10,900	283,400.00	0.11
227	002756	永兴材料	5,000	283,200.00	0.11
228	300682	朗新科技	28,600	283,140.00	0.11
229	688328	深科达	2,950	282,315.00	0.11
230	688633	星球石墨	9,492	282,197.16	0.11
231	688515	裕太微	1,109	275,874.84	0.10
232	600201	生物股份	23,600	274,940.00	0.10
233	300604	长川科技	800	273,136.00	0.10
234	300111	向日葵	94,300	271,584.00	0.10
235	600429	三元股份	67,200	271,488.00	0.10
236	688629	华丰科技	1,438	269,639.38	0.10
237	600089	特变电工	11,900	267,750.00	0.10

238	688800	瑞可达	2,768	265,644.96	0.10
239	601118	海南橡胶	53,900	265,188.00	0.10
240	300255	常山药业	11,300	264,646.00	0.10
241	000949	新乡化纤	41,200	261,208.00	0.10
242	688717	艾罗能源	3,163	261,168.91	0.10
243	688125	安达智能	1,596	260,946.00	0.10
244	300658	延江股份	22,800	260,604.00	0.10
245	603638	艾迪精密	11,100	260,295.00	0.10
246	002600	领益智造	14,900	258,366.00	0.10
247	002956	西麦食品	12,400	257,424.00	0.10
248	605299	舒华体育	19,100	254,985.00	0.10
249	001914	招商积余	31,200	254,592.00	0.10
250	688331	荣昌生物	1,952	254,267.52	0.10
251	605189	富春染织	21,100	254,255.00	0.10
252	688530	欧莱新材	2,600	251,940.00	0.10
253	000603	盛达资源	10,900	251,790.00	0.10
254	688018	乐鑫科技	1,943	248,548.56	0.09
255	601111	中国国航	40,400	244,420.00	0.09
256	301285	鸿日达	2,200	242,726.00	0.09
257	300837	浙矿股份	10,100	239,976.00	0.09
258	600316	洪都航空	8,500	237,490.00	0.09
259	002709	天赐材料	4,600	236,578.00	0.09
260	300736	百邦科技	7,600	235,600.00	0.09
261	003031	中瓷电子	1,300	234,390.00	0.09
262	301571	国科天成	3,500	228,130.00	0.09
263	002975	博杰股份	1,600	227,200.00	0.09
264	300049	福瑞医科	5,800	225,504.00	0.09
265	603889	新澳股份	43,940	224,533.40	0.08
266	688410	山外山	15,572	223,613.92	0.08
267	300492	华图山鼎	6,500	223,275.00	0.08
268	688277	天智航	13,016	222,573.60	0.08
269	688003	天准科技	1,742	221,756.60	0.08
270	002716	湖南白银	27,400	221,666.00	0.08
271	300246	宝莱特	15,700	220,899.00	0.08
272	603038	华立股份	14,000	218,400.00	0.08
273	300129	泰胜风能	25,500	218,025.00	0.08
274	688390	固德威	1,994	216,368.94	0.08
275	603122	合富中国	19,700	215,912.00	0.08
276	600577	精达股份	21,800	213,204.00	0.08
277	300236	上海新阳	1,600	210,400.00	0.08
278	300854	中兰环保	11,000	209,880.00	0.08

279	601666	平煤股份	29,300	209,495.00	0.08
280	000059	华锦股份	55,700	208,875.00	0.08
281	603699	纽威股份	4,100	206,230.00	0.08
282	000681	视觉中国	10,300	205,382.00	0.08
283	001339	智微智能	1,990	203,537.20	0.08
284	688615	合合信息	1,799	203,466.90	0.08
285	601512	中新集团	25,700	200,460.00	0.08
286	688095	福昕软件	3,371	200,338.53	0.08
287	002283	天润工业	20,300	195,895.00	0.07
288	301338	凯格精机	1,200	195,468.00	0.07
289	603588	高能环境	10,000	192,000.00	0.07
290	603257	中国瑞林	2,400	187,176.00	0.07
291	300769	德方纳米	2,800	186,200.00	0.07
292	603256	宏和科技	700	185,731.00	0.07
293	301345	涛涛车业	800	184,800.00	0.07
294	001316	润贝航科	5,600	184,688.00	0.07
295	688345	博力威	3,179	184,636.32	0.07
296	300300	海峡创新	23,600	184,316.00	0.07
297	300478	杭州高新	5,000	183,450.00	0.07
298	603507	振江股份	5,500	180,895.00	0.07
299	002780	三夫户外	14,900	180,886.00	0.07
300	688275	万润新能	1,405	179,207.75	0.07
301	600323	瀚蓝环境	6,500	178,490.00	0.07
302	688428	诺诚健华	6,248	177,880.56	0.07
303	603967	中创物流	17,000	175,950.00	0.07
304	688411	海博思创	600	174,720.00	0.07
305	605196	华通线缆	6,400	167,040.00	0.06
306	603317	天味食品	12,800	166,528.00	0.06
307	603216	梦天家居	8,000	164,560.00	0.06
308	601869	长飞光纤	300	163,770.00	0.06
309	688279	峰昭科技	723	162,270.12	0.06
310	688609	九联科技	14,581	160,536.81	0.06
311	301280	珠城科技	3,100	156,767.00	0.06
312	301252	同星科技	3,800	154,014.00	0.06
313	002460	赣锋锂业	2,300	150,420.00	0.06
314	300975	商络电子	2,900	150,075.00	0.06
315	605117	德业股份	1,400	148,652.00	0.06
316	600230	沧州大化	11,400	148,428.00	0.06
317	300054	鼎龙股份	1,400	148,358.00	0.06
318	301369	联动科技	600	147,000.00	0.06
319	002345	潮宏基	16,000	146,720.00	0.06

320	300283	温州宏丰	7,000	143,850.00	0.05
321	000703	恒逸石化	10,500	142,485.00	0.05
322	300504	天邑股份	8,800	141,944.00	0.05
323	300724	捷佳伟创	2,000	141,200.00	0.05
324	000506	招金黄金	12,000	140,640.00	0.05
325	688223	晶科能源	29,280	139,080.00	0.05
326	000408	藏格矿业	2,000	138,640.00	0.05
327	300409	道氏技术	6,900	137,517.00	0.05
328	688170	德龙激光	1,420	136,334.20	0.05
329	603876	鼎胜新材	5,200	135,252.00	0.05
330	002039	黔源电力	7,100	133,622.00	0.05
331	601339	百隆东方	19,700	133,369.00	0.05
332	301396	宏景科技	400	132,640.00	0.05
333	002379	宏桥控股	8,800	129,976.00	0.05
334	688258	卓易信息	1,091	129,327.14	0.05
335	300503	昊志机电	1,400	129,220.00	0.05
336	603345	安井食品	1,600	128,304.00	0.05
337	301055	张小泉	3,000	127,410.00	0.05
338	002429	兆驰股份	12,100	125,719.00	0.05
339	603629	利通电子	700	125,167.00	0.05
340	301486	致尚科技	600	124,992.00	0.05
341	002497	雅化集团	6,100	124,257.00	0.05
342	002077	大港股份	6,400	123,456.00	0.05
343	603115	海星股份	1,000	122,470.00	0.05
344	300551	古鳌科技	12,300	121,032.00	0.05
345	601777	千里科技	14,800	120,768.00	0.05
346	301123	奕东电子	1,000	120,720.00	0.05
347	688167	炬光科技	338	119,722.98	0.05
348	688027	国盾量子	235	118,442.35	0.04
349	605599	菜百股份	8,600	117,820.00	0.04
350	603163	圣晖集成	800	117,200.00	0.04
351	601233	桐昆股份	5,400	116,910.00	0.04
352	601138	工业富联	1,600	115,440.00	0.04
353	000792	盐湖股份	3,800	114,722.00	0.04
354	688130	晶华微	4,002	112,536.24	0.04
355	000415	渤海租赁	27,300	111,111.00	0.04
356	000893	亚钾国际	2,700	110,403.00	0.04
357	600750	华润江中	5,000	110,350.00	0.04
358	002297	博云新材	3,800	110,162.00	0.04
359	600037	歌华有线	17,400	109,098.00	0.04
360	002240	盛新锂能	2,400	107,592.00	0.04

361	601100	恒立液压	1,000	107,560.00	0.04
362	688222	成都先导	3,326	106,797.86	0.04
363	688183	生益电子	803	106,317.20	0.04
364	600499	科达制造	7,600	104,880.00	0.04
365	605118	力鼎光电	3,000	104,670.00	0.04
366	002488	金固股份	11,700	104,247.00	0.04
367	301389	隆扬电子	1,200	104,148.00	0.04
368	002810	山东赫达	4,200	103,740.00	0.04
369	600641	先导基电	2,600	103,636.00	0.04
370	688690	纳微科技	2,348	103,546.80	0.04
371	300139	晓程科技	2,800	102,340.00	0.04
372	002468	申通快递	7,000	101,920.00	0.04
373	000592	平潭发展	14,900	99,681.00	0.04
374	301607	富特科技	1,900	99,275.00	0.04
375	688349	三一重能	6,511	98,836.98	0.04
376	688660	电气风电	11,341	97,759.42	0.04
377	002378	章源钨业	2,900	97,092.00	0.04
378	603093	南华期货	5,200	94,380.00	0.04
379	301069	凯盛新材	4,600	92,184.00	0.03
380	300042	朗科科技	1,200	91,404.00	0.03
381	688109	品茗科技	1,204	91,142.80	0.03
382	000301	东方盛虹	7,500	85,875.00	0.03
383	002132	恒星科技	15,800	85,478.00	0.03
384	300617	安靠智电	1,600	84,784.00	0.03
385	300596	利安隆	1,600	83,968.00	0.03
386	300346	南大光电	900	83,385.00	0.03
387	688141	杰华特	539	82,736.50	0.03
388	688679	通源环境	1,949	82,033.41	0.03
389	605108	同庆楼	7,200	81,792.00	0.03
390	002202	金风科技	3,400	81,260.00	0.03
391	600422	昆药集团	10,400	81,224.00	0.03
392	688035	德邦科技	882	80,967.60	0.03
393	605266	健之佳	5,500	80,520.00	0.03
394	301251	威尔高	1,500	79,920.00	0.03
395	600976	健民集团	3,200	79,712.00	0.03
396	601872	招商轮船	4,500	79,065.00	0.03
397	688699	明微电子	962	78,835.90	0.03
398	688549	中巨芯	2,126	78,258.06	0.03
399	300558	贝达药业	1,200	78,084.00	0.03
400	003022	联泓新科	3,000	77,700.00	0.03
401	603016	新宏泰	2,300	77,648.00	0.03

402	001337	四川黄金	2,100	76,986.00	0.03
403	300153	科泰电源	3,400	76,908.00	0.03
404	688299	长阳科技	4,593	76,749.03	0.03
405	300715	凯伦股份	4,500	74,070.00	0.03
406	688636	智明达	2,043	74,017.89	0.03
407	301323	新莱福	900	73,431.00	0.03
408	688372	伟测科技	393	73,098.00	0.03
409	301292	海科新源	900	71,757.00	0.03
410	002034	旺能环境	4,700	71,205.00	0.03
411	688013	天臣医疗	2,844	70,161.48	0.03
412	300250	初灵信息	4,800	69,984.00	0.03
413	600590	泰豪科技	6,900	69,690.00	0.03
414	603826	坤彩科技	2,700	69,012.00	0.03
415	300638	广和通	3,700	68,487.00	0.03
416	688291	金橙子	1,171	68,480.08	0.03
417	300427	红相股份	10,100	67,771.00	0.03
418	688543	国科军工	1,717	67,735.65	0.03
419	688261	东微半导	645	67,679.85	0.03
420	688658	悦康药业	5,197	66,833.42	0.03
421	600373	中文传媒	9,900	65,637.00	0.02
422	301522	上大股份	2,500	65,425.00	0.02
423	688227	品高股份	627	64,386.63	0.02
424	300940	南极光	4,200	63,336.00	0.02
425	603026	石大胜华	700	62,559.00	0.02
426	688089	ST 嘉必优	5,841	61,973.01	0.02
427	300672	国科微	200	59,000.00	0.02
428	300450	先导智能	1,400	57,008.00	0.02
429	600502	安徽建工	12,900	56,115.00	0.02
430	688513	苑东生物	1,270	55,829.20	0.02
431	688610	埃科光电	209	55,050.60	0.02
432	002957	科瑞技术	1,000	54,840.00	0.02
433	603929	亚翔集成	200	54,404.00	0.02
434	300294	博雅生物	3,800	54,112.00	0.02
435	002079	苏州固锔	3,600	54,108.00	0.02
436	603031	安孚科技	1,000	53,250.00	0.02
437	603881	数据港	2,100	52,500.00	0.02
438	688135	利扬芯片	1,194	50,243.52	0.02
439	301196	唯科科技	400	50,168.00	0.02
440	300756	金马游乐	1,500	49,575.00	0.02
441	601208	东材科技	700	49,553.00	0.02
442	301489	思泉新材	300	49,374.00	0.02

443	300852	四会富仕	700	48,468.00	0.02
444	002518	科士达	900	48,231.00	0.02
445	301265	华新科技	1,700	46,835.00	0.02
446	688301	奕瑞科技	360	44,640.00	0.02
447	002792	通宇通讯	1,200	42,684.00	0.02
448	300491	通合科技	1,100	42,009.00	0.02
449	301248	杰创智能	500	41,965.00	0.02
450	688205	德科立	201	41,846.19	0.02
451	600547	山东黄金	1,800	41,562.00	0.02
452	301556	托普云农	700	40,922.00	0.02
453	300766	每日互动	1,900	40,660.00	0.02
454	002104	恒宝股份	3,900	40,209.00	0.02
455	002407	多氟多	800	40,184.00	0.02
456	002990	盛视科技	500	39,500.00	0.01
457	600026	中远海能	2,200	39,468.00	0.01
458	300620	光库科技	100	37,820.00	0.01
459	300747	锐科激光	700	37,163.00	0.01
460	688313	仕佳光子	200	36,930.00	0.01
461	002195	岩山科技	5,600	36,624.00	0.01
462	603686	福龙马	2,800	36,176.00	0.01
463	301031	中熔电气	300	35,835.00	0.01
464	688719	爱科赛博	459	35,343.00	0.01
465	600714	金瑞矿业	1,700	34,901.00	0.01
466	600686	金龙汽车	3,000	33,870.00	0.01
467	301180	万祥科技	2,700	33,831.00	0.01
468	688158	优刻得	920	33,819.20	0.01
469	301293	三博脑科	700	33,726.00	0.01
470	000922	佳电股份	2,300	32,108.00	0.01
471	000990	诚志股份	3,900	31,902.00	0.01
472	300373	扬杰科技	200	31,446.00	0.01
473	605228	神通科技	2,300	30,889.00	0.01
474	600722	金牛化工	3,600	29,232.00	0.01
475	600176	中国巨石	400	29,152.00	0.01
476	600961	株冶集团	900	29,151.00	0.01
477	301176	逸豪新材	400	27,200.00	0.01
478	300086	康芝药业	4,600	27,140.00	0.01
479	603933	睿能科技	1,200	27,060.00	0.01
480	603400	华之杰	500	27,010.00	0.01
481	300671	富满微	300	25,848.00	0.01
482	300257	开山股份	900	25,812.00	0.01
483	603066	音飞储存	2,500	24,400.00	0.01

484	300663	科蓝软件	3,600	23,976.00	0.01
485	002946	新乳业	1,700	23,936.00	0.01
486	300662	科锐国际	1,400	23,772.00	0.01
487	301577	美信科技	300	23,262.00	0.01
488	688108	赛诺医疗	1,249	23,143.97	0.01
489	603186	华正新材	100	22,530.00	0.01
490	002885	京泉华	500	20,430.00	0.01
491	688720	艾森股份	200	20,200.00	0.01
492	300848	美瑞新材	1,400	19,530.00	0.01
493	001212	中旗新材	400	18,952.00	0.01
494	600773	西藏城投	1,400	18,018.00	0.01
495	000807	云铝股份	800	17,712.00	0.01
496	603327	福蓉科技	1,900	16,112.00	0.01
497	002343	慈文传媒	3,300	14,388.00	0.01
498	000533	顺钠股份	1,500	14,265.00	0.01
499	600113	浙江东日	400	13,272.00	0.01
500	002511	中顺洁柔	1,900	12,635.00	0.00
501	688511	天微电子	411	12,416.31	0.00
502	605020	永和股份	300	12,216.00	0.00
503	688606	奥泰生物	272	11,173.76	0.00
504	000860	顺鑫农业	1,100	10,780.00	0.00
505	301529	福赛科技	100	9,636.00	0.00
506	301548	崇德科技	100	8,877.00	0.00
507	300389	艾比森	600	7,692.00	0.00
508	300863	卡倍亿	100	7,663.00	0.00
509	603333	福华尚纬	800	6,448.00	0.00
510	300051	珪升科技	600	5,256.00	0.00
511	600195	中牧股份	800	4,720.00	0.00
512	603127	昭衍新药	100	3,822.00	0.00
513	300251	光线传媒	300	3,327.00	0.00
514	688556	高测股份	233	3,094.24	0.00
515	000551	创元科技	100	2,063.00	0.00
516	300738	奥飞数据	100	2,022.00	0.00
517	002131	利欧股份	200	950.00	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	300308	中际旭创	15,041,840.00	34.93

2	300750	宁德时代	9,853,267.00	22.88
3	688256	寒武纪	7,545,048.28	17.52
4	688041	海光信息	6,738,023.49	15.65
5	688498	源杰科技	6,469,278.67	15.02
6	002384	东山精密	4,890,587.00	11.36
7	688008	澜起科技	4,531,080.04	10.52
8	301308	江波龙	4,001,936.00	9.29
9	600150	中国船舶	3,832,421.00	8.90
10	301536	星宸科技	3,815,583.12	8.86
11	688525	佰维存储	3,589,430.85	8.33
12	688072	拓荆科技	3,262,015.82	7.57
13	600183	生益科技	3,257,150.00	7.56
14	300502	新易盛	3,080,590.60	7.15
15	688110	东芯股份	3,070,696.44	7.13
16	688012	中微公司	3,048,221.24	7.08
17	688002	睿创微纳	2,992,555.23	6.95
18	600487	亨通光电	2,941,103.00	6.83
19	688111	金山办公	2,929,194.23	6.80
20	300444	双杰电气	2,865,883.00	6.65
21	688469	芯联集成	2,717,828.47	6.31
22	300476	胜宏科技	2,707,873.00	6.29
23	688025	杰普特	2,651,258.99	6.16
24	688221	前沿生物	2,638,234.91	6.13
25	301500	飞南资源	2,584,899.00	6.00
26	301246	宏源药业	2,543,233.00	5.91
27	688472	阿特斯	2,521,678.57	5.86
28	300953	震裕科技	2,502,442.00	5.81
29	688521	芯原股份	2,462,654.64	5.72
30	688536	思瑞浦	2,417,391.43	5.61
31	688519	南亚新材	2,412,820.41	5.60
32	688766	普冉股份	2,405,490.31	5.59
33	300857	协创数据	2,401,666.00	5.58
34	688568	中科星图	2,391,840.24	5.55
35	688257	新锐股份	2,304,430.15	5.35
36	603259	药明康德	2,301,220.00	5.34
37	300613	富瀚微	2,216,914.00	5.15
38	603920	世运电路	2,179,226.00	5.06
39	300970	华绿生物	2,149,274.60	4.99
40	301086	鸿富瀚	2,140,027.00	4.97
41	301358	湖南裕能	2,103,468.00	4.88
42	688981	中芯国际	2,071,670.93	4.81

43	688127	蓝特光学	2,036,516.41	4.73
44	600875	东方电气	2,031,579.00	4.72
45	300274	阳光电源	2,022,455.00	4.70
46	300723	一品红	2,014,436.60	4.68
47	002414	高德红外	1,983,976.00	4.61
48	300438	鹏辉能源	1,958,081.00	4.55
49	301316	慧博云通	1,953,142.00	4.54
50	300590	移为通信	1,952,372.00	4.53
51	300408	三环集团	1,930,637.00	4.48
52	301189	奥尼电子	1,909,853.00	4.43
53	688090	瑞松科技	1,908,830.67	4.43
54	603063	禾望电气	1,901,181.00	4.41
55	688173	希荻微	1,876,328.93	4.36
56	688475	萤石网络	1,862,793.10	4.33
57	300433	蓝思科技	1,838,477.00	4.27
58	688311	盟升电子	1,825,313.04	4.24
59	600563	法拉电子	1,763,464.00	4.09
60	301511	德福科技	1,755,785.00	4.08
61	301280	珠城科技	1,754,961.20	4.08
62	688416	恒烁股份	1,739,097.12	4.04
63	603083	剑桥科技	1,738,814.00	4.04
64	688309	恒誉科技	1,721,935.16	4.00
65	688378	奥来德	1,715,788.72	3.98
66	300037	新宙邦	1,712,955.96	3.98
67	688262	国芯科技	1,712,764.75	3.98
68	688653	康希通信	1,659,022.13	3.85
69	300497	富祥股份	1,657,401.00	3.85
70	002851	麦格米特	1,633,654.00	3.79
71	300223	君正股份	1,627,631.00	3.78
72	688220	翱捷科技	1,611,712.76	3.74
73	688045	必易微	1,611,693.05	3.74
74	688209	英集芯	1,592,115.81	3.70
75	002266	浙富控股	1,590,715.00	3.69
76	688156	路德科技	1,586,875.24	3.68
77	688182	灿勤科技	1,556,880.73	3.62
78	688353	华盛锂电	1,551,998.95	3.60
79	600601	方正科技	1,541,009.00	3.58
80	605111	新洁能	1,530,716.00	3.55
81	688627	精智达	1,511,901.25	3.51
82	688543	国科军工	1,511,520.32	3.51
83	688385	复旦微电	1,496,028.33	3.47

84	688318	财富趋势	1,494,228.63	3.47
85	300782	卓胜微	1,491,872.00	3.46
86	301099	雅创电子	1,475,918.00	3.43
87	688018	乐鑫科技	1,450,215.21	3.37
88	301216	万凯新材	1,447,641.00	3.36
89	300803	指南针	1,442,902.00	3.35
90	600989	宝丰能源	1,436,586.00	3.34
91	603025	大豪科技	1,418,360.50	3.29
92	688486	龙迅股份	1,414,996.51	3.29
93	301150	中一科技	1,411,853.00	3.28
94	601061	中信金属	1,401,836.00	3.26
95	688061	灿瑞科技	1,387,853.78	3.22
96	300661	圣邦股份	1,386,011.00	3.22
97	688789	宏华数科	1,377,457.08	3.20
98	688322	奥比中光	1,372,063.69	3.19
99	002738	中矿资源	1,370,231.00	3.18
100	300475	香农芯创	1,368,973.00	3.18
101	300432	富临精工	1,358,064.00	3.15
102	600363	联创光电	1,354,587.00	3.15
103	300394	天孚通信	1,344,116.00	3.12
104	688776	国光电气	1,341,284.64	3.11
105	001287	中电港	1,341,242.00	3.11
106	688099	晶晨股份	1,339,891.06	3.11
107	300492	华图山鼎	1,323,179.00	3.07
108	300951	博硕科技	1,304,736.00	3.03
109	603290	斯达半导	1,292,144.00	3.00
110	601985	中国核电	1,289,989.00	3.00
111	002463	沪电股份	1,286,776.00	2.99
112	300346	南大光电	1,281,319.00	2.98
113	301101	明月镜片	1,275,549.24	2.96
114	000977	浪潮信息	1,268,315.00	2.95
115	688107	安路科技	1,267,641.25	2.94
116	300865	大宏立	1,265,423.00	2.94
117	688615	合合信息	1,264,203.38	2.94
118	301210	金杨精密	1,253,867.00	2.91
119	603806	福斯特	1,251,905.00	2.91
120	688277	天智航	1,248,247.97	2.90
121	688368	晶丰明源	1,245,357.13	2.89
122	300604	长川科技	1,244,438.00	2.89
123	301510	固高科技	1,237,562.00	2.87
124	600299	安迪苏	1,237,434.00	2.87

125	300169	天晟新材	1, 235, 344. 00	2. 87
126	688253	英诺特	1, 232, 305. 37	2. 86
127	300511	雪榕生物	1, 231, 681. 00	2. 86
128	300972	万辰集团	1, 225, 955. 00	2. 85
129	300001	特锐德	1, 221, 854. 41	2. 84
130	688795	摩尔线程	1, 218, 449. 02	2. 83
131	300681	英搏尔	1, 208, 042. 00	2. 81
132	688639	华恒生物	1, 200, 856. 81	2. 79
133	688802	沐曦股份	1, 180, 672. 64	2. 74
134	301377	鼎泰高科	1, 174, 090. 00	2. 73
135	688522	纳睿雷达	1, 172, 764. 77	2. 72
136	301568	思泰克	1, 164, 621. 00	2. 70
137	688150	莱特光电	1, 163, 419. 39	2. 70
138	688195	腾景科技	1, 151, 779. 68	2. 67
139	688775	影石创新	1, 151, 731. 62	2. 67
140	300634	彩讯股份	1, 138, 111. 00	2. 64
141	688228	开普云	1, 136, 585. 07	2. 64
142	300219	鸿利智汇	1, 131, 942. 00	2. 63
143	688779	五矿新能	1, 131, 899. 97	2. 63
144	002273	水晶光电	1, 118, 927. 00	2. 60
145	688556	高测股份	1, 117, 817. 26	2. 60
146	300560	中富通	1, 117, 330. 00	2. 59
147	688249	晶合集成	1, 116, 561. 48	2. 59
148	300416	苏试试验	1, 114, 834. 00	2. 59
149	600750	华润江中	1, 110, 053. 00	2. 58
150	688396	华润微	1, 098, 514. 47	2. 55
151	600641	先导基电	1, 095, 960. 00	2. 54
152	688700	东威科技	1, 094, 679. 18	2. 54
153	688503	聚和材料	1, 093, 772. 48	2. 54
154	002465	海格通信	1, 090, 998. 00	2. 53
155	002812	恩捷股份	1, 088, 422. 00	2. 53
156	688337	普源精电	1, 084, 334. 02	2. 52
157	688409	富创精密	1, 080, 726. 26	2. 51
158	688258	卓易信息	1, 079, 301. 07	2. 51
159	603538	美诺华	1, 075, 856. 00	2. 50
160	002913	奥士康	1, 069, 536. 00	2. 48
161	603297	永新光学	1, 067, 802. 00	2. 48
162	688516	奥特维	1, 057, 824. 53	2. 46
163	000426	兴业银锡	1, 054, 994. 00	2. 45
164	688677	海泰新光	1, 051, 589. 66	2. 44
165	688580	伟思医疗	1, 050, 177. 95	2. 44

166	688136	科兴制药	1,045,814.55	2.43
167	605058	澳弘电子	1,044,660.00	2.43
168	603986	兆易创新	1,042,754.00	2.42
169	000063	中兴通讯	1,035,683.00	2.40
170	301371	敷尔佳	1,032,590.00	2.40
171	688689	银河微电	1,026,395.59	2.38
172	600816	建元信托	1,022,587.00	2.37
173	301608	博实结	1,020,762.84	2.37
174	688230	芯导科技	1,019,219.75	2.37
175	002838	道恩股份	1,015,140.00	2.36
176	603516	淳中科技	1,005,969.20	2.34
177	002466	天齐锂业	1,004,716.00	2.33
178	000534	万泽股份	1,002,472.00	2.33
179	300124	汇川技术	994,377.00	2.31
180	300389	艾比森	989,460.00	2.30
181	002222	福晶科技	981,664.00	2.28
182	301217	铜冠铜箔	978,256.00	2.27
183	688049	炬芯科技	965,655.33	2.24
184	688153	唯捷创芯	961,979.05	2.23
185	688620	安凯微	960,840.11	2.23
186	688400	凌云光	960,112.84	2.23
187	688313	仕佳光子	958,652.78	2.23
188	002587	奥拓电子	952,522.00	2.21
189	301631	壹连科技	947,571.00	2.20
190	300102	乾照光电	947,554.00	2.20
191	300005	探路者	945,583.00	2.20
192	688046	药康生物	945,493.60	2.20
193	001389	广合科技	945,334.00	2.20
194	688656	浩欧博	940,113.32	2.18
195	688758	赛分科技	939,928.72	2.18
196	301329	信音电子	938,791.00	2.18
197	300913	兆龙互连	931,245.00	2.16
198	688599	天合光能	929,858.17	2.16
199	688122	西部超导	926,562.71	2.15
200	002402	和而泰	924,042.00	2.15
201	002028	思源电气	923,389.00	2.14
202	688109	品茗科技	919,166.00	2.13
203	600418	江淮汽车	918,727.00	2.13
204	688428	诺诚健华	914,179.32	2.12
205	300088	长信科技	911,817.00	2.12
206	600919	江苏银行	908,878.00	2.11

207	300207	欣旺达	904,625.00	2.10
208	002493	荣盛石化	903,692.00	2.10
209	002415	海康威视	902,793.00	2.10
210	603638	艾迪精密	898,659.00	2.09
211	688455	科捷智能	896,550.03	2.08
212	300184	力源信息	894,161.00	2.08
213	603799	华友钴业	891,653.00	2.07
214	002475	立讯精密	885,894.00	2.06
215	688266	泽璟制药	885,467.56	2.06
216	688798	艾为电子	883,570.14	2.05
217	300493	润欣科技	882,885.00	2.05
218	300049	福瑞医科	880,622.00	2.04
219	300679	电连技术	880,146.00	2.04
220	301230	泓博医药	877,041.00	2.04
221	300821	东岳硅材	872,025.00	2.02
222	688800	瑞可达	871,692.09	2.02
223	300790	宇瞳光学	869,045.00	2.02
224	688391	钜泉科技	868,283.09	2.02
225	002916	深南电路	865,160.00	2.01
226	688052	纳芯微	862,980.92	2.00
227	688141	杰华特	861,826.73	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。

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	688041	海光信息	5,235,351.97	12.16
2	688008	澜起科技	4,369,515.52	10.15
3	688256	寒武纪	4,254,298.77	9.88
4	300750	宁德时代	4,027,246.00	9.35
5	300308	中际旭创	3,899,286.00	9.05
6	688521	芯原股份	2,617,063.20	6.08
7	300274	阳光电源	2,407,800.00	5.59
8	688257	新锐股份	2,350,767.79	5.46
9	688525	佰维存储	2,276,061.33	5.29
10	688469	芯联集成	2,181,159.29	5.06
11	688536	思瑞浦	2,150,843.82	4.99
12	600183	生益科技	2,082,020.34	4.83
13	300476	胜宏科技	2,019,905.00	4.69
14	688012	中微公司	1,966,502.30	4.57
15	603063	禾望电气	1,959,321.00	4.55

16	688110	东芯股份	1,943,913.04	4.51
17	600563	法拉电子	1,923,731.00	4.47
18	300502	新易盛	1,813,254.80	4.21
19	688025	杰普特	1,760,304.74	4.09
20	688653	康希通信	1,728,424.25	4.01
21	605111	新洁能	1,723,475.00	4.00
22	603259	药明康德	1,679,542.00	3.90
23	688981	中芯国际	1,660,205.13	3.86
24	301316	慧博云通	1,647,472.00	3.83
25	301280	珠城科技	1,616,105.04	3.75
26	688519	南亚新材	1,610,258.61	3.74
27	688766	普冉股份	1,597,649.44	3.71
28	300433	蓝思科技	1,579,969.00	3.67
29	002463	沪电股份	1,566,779.00	3.64
30	688220	翱捷科技	1,508,707.33	3.50
31	688568	中科星图	1,505,301.60	3.50
32	688322	奥比中光	1,498,566.04	3.48
33	688498	源杰科技	1,493,456.25	3.47
34	688385	复旦微电	1,479,674.43	3.44
35	002475	立讯精密	1,471,140.00	3.42
36	688475	萤石网络	1,431,402.45	3.32
37	688543	国科军工	1,425,928.65	3.31
38	300408	三环集团	1,421,463.00	3.30
39	301358	湖南裕能	1,396,245.00	3.24
40	688486	龙迅股份	1,381,267.43	3.21
41	301536	星宸科技	1,369,547.00	3.18
42	600875	东方电气	1,368,645.00	3.18
43	300001	特锐德	1,365,710.00	3.17
44	688789	宏华数科	1,365,282.96	3.17
45	301308	江波龙	1,357,366.00	3.15
46	300346	南大光电	1,352,777.00	3.14
47	000977	浪潮信息	1,326,888.00	3.08
48	688107	安路科技	1,323,323.78	3.07
49	688111	金山办公	1,319,117.38	3.06
50	603025	大豪科技	1,318,705.00	3.06
51	300613	富瀚微	1,318,393.00	3.06
52	688150	莱特光电	1,316,522.36	3.06
53	603920	世运电路	1,308,085.00	3.04
54	688776	国光电气	1,306,455.52	3.03
55	300219	鸿利智汇	1,292,100.00	3.00
56	300951	博硕科技	1,287,578.00	2.99

57	688099	晶晨股份	1, 287, 543. 69	2. 99
58	601899	紫金矿业	1, 260, 570. 00	2. 93
59	300604	长川科技	1, 258, 105. 00	2. 92
60	688253	英诺特	1, 255, 698. 60	2. 92
61	688018	乐鑫科技	1, 255, 173. 76	2. 91
62	688127	蓝特光学	1, 242, 190. 97	2. 88
63	688311	盟升电子	1, 233, 436. 58	2. 86
64	688249	晶合集成	1, 233, 423. 16	2. 86
65	603806	福斯特	1, 231, 019. 00	2. 86
66	002273	水晶光电	1, 218, 349. 00	2. 83
67	688503	聚和材料	1, 210, 687. 52	2. 81
68	688258	卓易信息	1, 208, 550. 59	2. 81
69	688472	阿特斯	1, 192, 209. 05	2. 77
70	300634	彩讯股份	1, 189, 390. 00	2. 76
71	300169	天晟新材	1, 183, 232. 00	2. 75
72	688061	灿瑞科技	1, 175, 662. 34	2. 73
73	688556	高测股份	1, 174, 532. 14	2. 73
74	688221	前沿生物	1, 161, 256. 55	2. 70
75	688090	瑞松科技	1, 150, 064. 62	2. 67
76	002465	海格通信	1, 146, 688. 00	2. 66
77	600641	先导基电	1, 144, 456. 00	2. 66
78	688353	华盛锂电	1, 143, 074. 72	2. 65
79	000426	兴业银锡	1, 136, 299. 00	2. 64
80	600150	中国船舶	1, 127, 815. 00	2. 62
81	688313	仕佳光子	1, 118, 606. 37	2. 60
82	688337	普源精电	1, 109, 883. 68	2. 58
83	688173	希荻微	1, 101, 869. 78	2. 56
84	300560	中富通	1, 094, 496. 00	2. 54
85	603516	淳中科技	1, 083, 666. 44	2. 52
86	301246	宏源药业	1, 075, 734. 00	2. 50
87	300723	一品红	1, 073, 508. 00	2. 49
88	600299	安迪苏	1, 073, 363. 00	2. 49
89	688378	奥来德	1, 067, 838. 09	2. 48
90	300005	探路者	1, 067, 239. 00	2. 48
91	688639	华恒生物	1, 066, 009. 84	2. 48
92	000063	中兴通讯	1, 062, 363. 00	2. 47
93	688277	天智航	1, 047, 436. 89	2. 43
94	301230	泓博医药	1, 047, 377. 00	2. 43
95	300497	富祥股份	1, 046, 762. 00	2. 43
96	688516	奥特维	1, 039, 836. 55	2. 41
97	301500	飞南资源	1, 033, 883. 00	2. 40

98	688136	科兴制药	1,030,502.00	2.39
99	688416	恒烁股份	1,028,804.61	2.39
100	688156	路德科技	1,026,668.61	2.38
101	300628	亿联网络	1,024,548.00	2.38
102	688615	合合信息	1,023,109.41	2.38
103	002414	高德红外	1,020,702.00	2.37
104	001287	中电港	1,019,039.00	2.37
105	600750	华润江中	1,017,295.00	2.36
106	688318	财富趋势	1,016,787.86	2.36
107	688758	赛分科技	1,001,497.46	2.33
108	300492	华图山鼎	992,153.00	2.30
109	300913	兆龙互连	986,188.00	2.29
110	002266	浙富控股	984,366.00	2.29
111	688455	科捷智能	981,870.44	2.28
112	300124	汇川技术	979,322.00	2.27
113	300661	圣邦股份	978,781.00	2.27
114	300102	乾照光电	977,344.00	2.27
115	603297	永新光学	974,556.00	2.26
116	688122	西部超导	971,602.68	2.26
117	300953	震裕科技	967,408.00	2.25
118	600114	东睦股份	967,035.00	2.25
119	301328	维峰电子	958,834.00	2.23
120	603083	剑桥科技	957,632.00	2.22
121	689009	九号公司	955,577.09	2.22
122	688153	唯捷创芯	951,097.13	2.21
123	688432	有研硅	948,992.12	2.20
124	603283	赛腾股份	944,649.50	2.19
125	000333	美的集团	939,578.00	2.18
126	300857	协创数据	939,389.00	2.18
127	688656	浩欧博	937,353.39	2.18
128	300394	天孚通信	936,236.00	2.17
129	002050	三花智控	933,381.00	2.17
130	600391	航发科技	927,975.00	2.15
131	605058	澳弘电子	927,170.00	2.15
132	000636	风华高科	926,388.00	2.15
133	002402	和而泰	922,146.00	2.14
134	600497	驰宏锌锗	921,054.00	2.14
135	300970	华绿生物	920,485.00	2.14
136	688052	纳芯微	919,404.18	2.13
137	688387	信科移动	918,710.75	2.13
138	300054	鼎龙股份	916,643.00	2.13

139	688428	诺诚健华	916,517.01	2.13
140	300657	弘信电子	915,162.00	2.13
141	688620	安凯微	909,172.11	2.11
142	600176	中国巨石	907,488.00	2.11
143	300389	艾比森	904,917.00	2.10
144	688141	杰华特	904,830.22	2.10
145	002587	奥拓电子	900,909.00	2.09
146	688046	药康生物	891,503.64	2.07
147	688002	睿创微纳	886,416.46	2.06
148	688100	威胜信息	884,965.82	2.05
149	688396	华润微	883,781.82	2.05
150	301029	怡合达	883,550.00	2.05
151	300319	麦捷科技	879,162.00	2.04
152	300037	新宙邦	878,173.00	2.04
153	688599	天合光能	878,041.23	2.04
154	603019	中科曙光	876,112.00	2.03
155	603993	洛阳钼业	875,510.00	2.03
156	688798	艾为电子	873,427.89	2.03
157	688700	东威科技	873,197.38	2.03
158	300088	长信科技	873,135.00	2.03
159	300861	美畅股份	872,218.00	2.03
160	688109	品茗科技	872,040.42	2.02
161	600026	中远海能	870,487.00	2.02
162	688802	沐曦股份	869,267.19	2.02
163	002415	海康威视	868,718.00	2.02
164	300223	君正股份	863,642.00	2.01
165	688082	盛美上海	862,186.61	2.00
166	688199	久日新材	861,643.23	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。

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	745,397,909.15
卖出股票收入（成交）总额	568,476,352.66

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	4,830,841.81	1.82
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）	28,573.78	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	4,859,415.59	1.83

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	019827	26 国债 01	20,000	2,012,963.84	0.76
2	019792	25 国债 19	15,000	1,515,738.49	0.57
3	019835	26 国债 09	13,000	1,302,139.48	0.49
4	123267	珂玛转债	65	28,573.78	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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

本基金根据合同约定，不允许投资国债期货。

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	42,964.24
2	应收清算款	31,665,085.45
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,676,289.56
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	33,384,339.25

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

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	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	--------------	----------

1	688072	拓荆科技	3,696,576.00	1.40	筹划重大事项
---	--------	------	--------------	------	--------

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 (%)
富国新兴成长量化精 选混合 (LOF) A	1,620	40,415.74	44,703,496. 91	68.28	20,770,005 .62	31.72
富国新兴成长量化精 选混合 (LOF) C	180	385,667.47	64,719,837. 35	93.23	4,700,307. 26	6.77
合计	1,800	74,940.92	109,423,334 .26	81.12	25,470,312 .88	18.88

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	92.23%

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	富国新兴成长量化精选混合 (LOF) A	512,334.05	0.7825
	富国新兴成长量化精选混合 (LOF) C	60,730.13	0.0875
	合计	573,064.18	0.4248

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	富国新兴成长量化精选混合 (LOF) A	10~50
	富国新兴成长量化精选混合 (LOF) C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持 有本开放式基金	富国新兴成长量化精选混合 (LOF) A	10~50
	富国新兴成长量化精选混合 (LOF) C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国新兴成长量化精选混合 (LOF) A	富国新兴成长量化精选混合 (LOF) C
基金合同生效日（2017 年 07 月 21 日）基金份额总额	632,370,666.56	—
本报告期期初基金份额总额	26,979,724.29	2,159,039.89
本报告期基金总申购份额	51,142,017.94	76,799,677.24
减：本报告期基金总赎回份额	12,648,239.70	9,538,572.52
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	65,473,502.53	69,420,144.61

§ 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。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及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：本报告期内，本基金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：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。

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（%）	
长城证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	3	—	—	—	—	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
东财证券	2	51,898,379.67	3.95	21,064.79	3.95	—
方正证券	2	—	—	—	—	—
高盛中国	1	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—
广发证券	2	—	—	—	—	—
国海证券	2	126,625,670.32	9.64	51,398.52	9.64	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通	3	390,589,802.48	29.73	158,544.79	29.73	—
国投证券	2	—	—	—	—	—
国信证券	2	73,026,385.47	5.56	29,642.88	5.56	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—
华源证券	2	19,943,884.52	1.52	8,094.96	1.52	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	320,375,015.75	24.38	130,042.59	24.38	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	60,178,616.93	4.58	24,426.88	4.58	—
西南证券	2	—	—	—	—	—
湘财证券	2	—	—	—	—	—

信达证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	1	271,236,506.67	20.64	110,101.41	20.64	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
中航证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
中泰证券	2	—	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中信证券	3	—	—	—	—	—
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。本报告期本基金退租券商交易单元：国泰海通（274902）。

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（%）
长城证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东财证券	400,208.00	8.33	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
高盛中国	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	—	—	3,000,000.00	18.07	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰海通	2,001,037.00	41.64	1,300,000.00	7.83	—	—
国投证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	601,888.88	12.53	6,000,000.00	36.14	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
华源证券	200,246.00	4.17	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—

上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	401,573.41	8.36	3,100,000.00	18.67	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	—	—	200,000.00	1.20	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	1,200,080.00	24.98	3,000,000.00	18.07	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中航证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
中银证券	—	—	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下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05月01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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026-03-20 至 2026-06-09;2026-06-18 至 2026-06-30	4, 279, 965. 75	44, 236, 580. 96	25, 000. 00	48, 491, 546. 71	35. 95%
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

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 6 月 1 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 5 月 1 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新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）的文件	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址： http://www.fullgoal.com.cn 。
2、富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金合同		
3、富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）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、富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）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		