

富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）

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1月1日起至2025年12月31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）	
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	29,138,764.18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	26,979,724.29份	2,159,039.89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%
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。

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	证券日报
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	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、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	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	6,068,735.02	275,185.24	-6,106,138.74
本期利润	7,442,463.42	177,945.70	-3,901,521.26
加权平均基金份额本期利润	0.3477	0.0078	-0.1445
本期加权平均净值利润率	27.22%	0.73%	-11.65%
本期基金份额净值增长率	31.19%	1.00%	-13.30%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	12,917,427.17	2,735,085.39	2,746,017.45
期末可供分配基金份额利润	0.4788	0.1272	0.1160
期末基金资产净值	39,897,151.46	24,243,030.08	26,417,298.66
期末基金份额净值	1.4788	1.1272	1.1160
3.1.3 累计期末指标	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	47.88%	12.72%	11.60%

(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	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	597,807.87	16,767.85	-85,931.01
本期利润	704,917.18	4,690.91	295,065.15
加权平均基金份额本期利润	0.3932	0.0036	0.2244
本期加权平均净值利润率	30.35%	0.35%	17.93%
本期基金份额净值增长率	30.94%	0.80%	-13.49%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	1,009,154.74	151,991.45	144,880.07
期末可供分配基金份额利润	0.4674	0.1207	0.1118
期末基金资产净值	3,168,194.63	1,411,138.71	1,440,333.89
期末基金份额净值	1.4674	1.1207	1.1118
3.1.3 累计期末指标	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	-5.43%	-27.78%	-28.35%

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国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	-1.04%	1.34%	-0.08%	1.44%	-0.96%	-0.10%
过去六个月	20.99%	1.20%	35.20%	1.41%	-14.21%	-0.21%
过去一年	31.19%	1.25%	37.84%	1.45%	-6.65%	-0.20%
过去三年	14.89%	1.25%	31.55%	1.51%	-16.66%	-0.26%
过去五年	13.86%	1.23%	14.37%	1.44%	-0.51%	-0.21%
自基金合同生效起至今	47.88%	1.27%	54.03%	1.46%	-6.15%	-0.19%

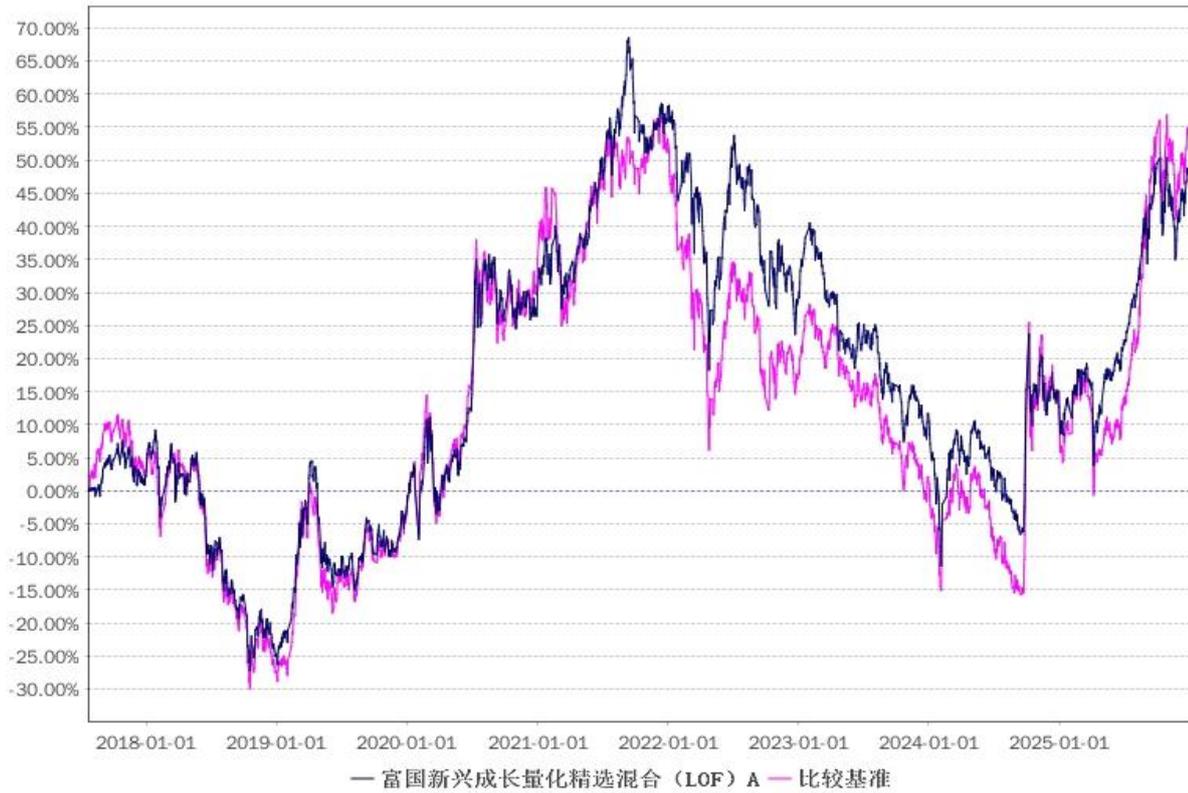
(2) 富国新兴成长量化精选混合（LOF）C

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	-1.09%	1.34%	-0.08%	1.44%	-1.01%	-0.10%
过去六个月	20.87%	1.20%	35.20%	1.41%	-14.33%	-0.21%
过去一年	30.94%	1.25%	37.84%	1.45%	-6.90%	-0.20%
过去三年	14.18%	1.25%	31.55%	1.51%	-17.37%	-0.26%
自基金分级生效日起至今	-5.43%	1.28%	0.92%	1.48%	-6.35%	-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

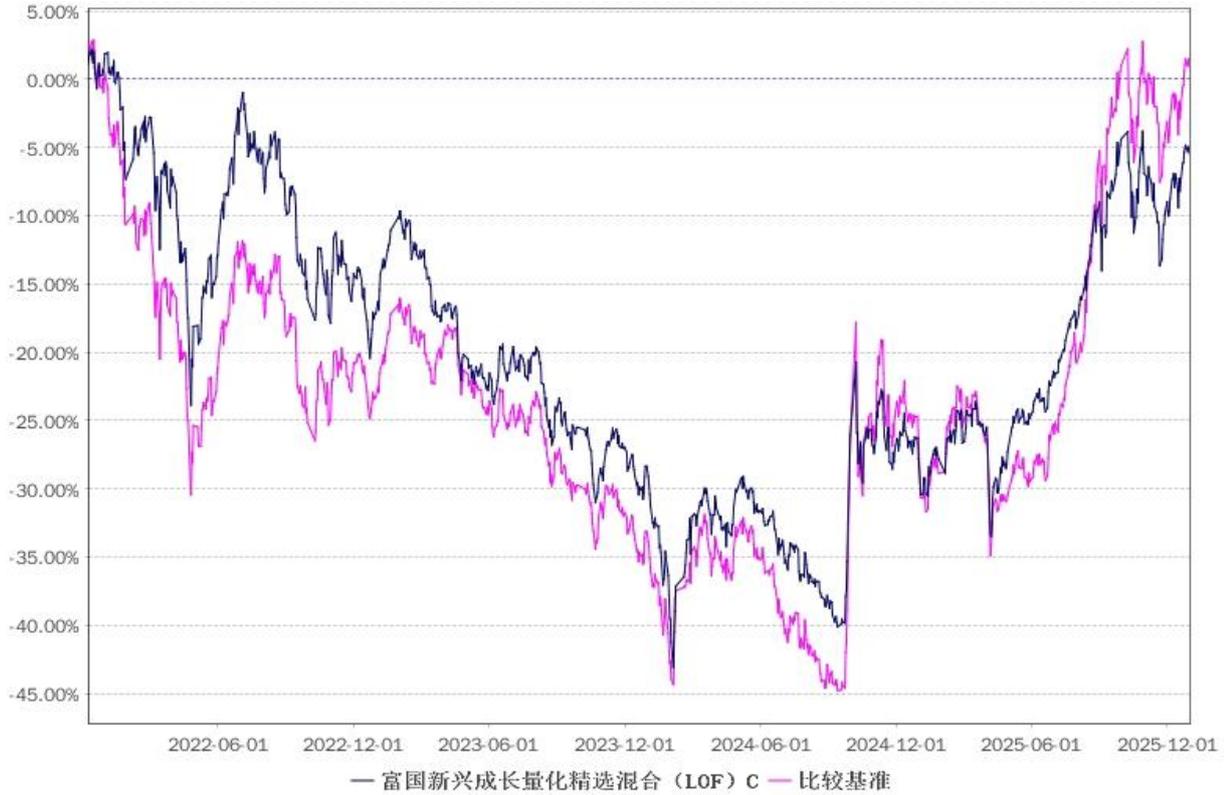
(1) 自基金合同生效以来富国新兴成长量化精选混合（LOF）A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2017 年 7 月 21 日成立，建仓期 6 个月，从 2017 年 7 月 21 日起至 2018 年 1 月 20 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新兴成长量化精选混合 (LOF) 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

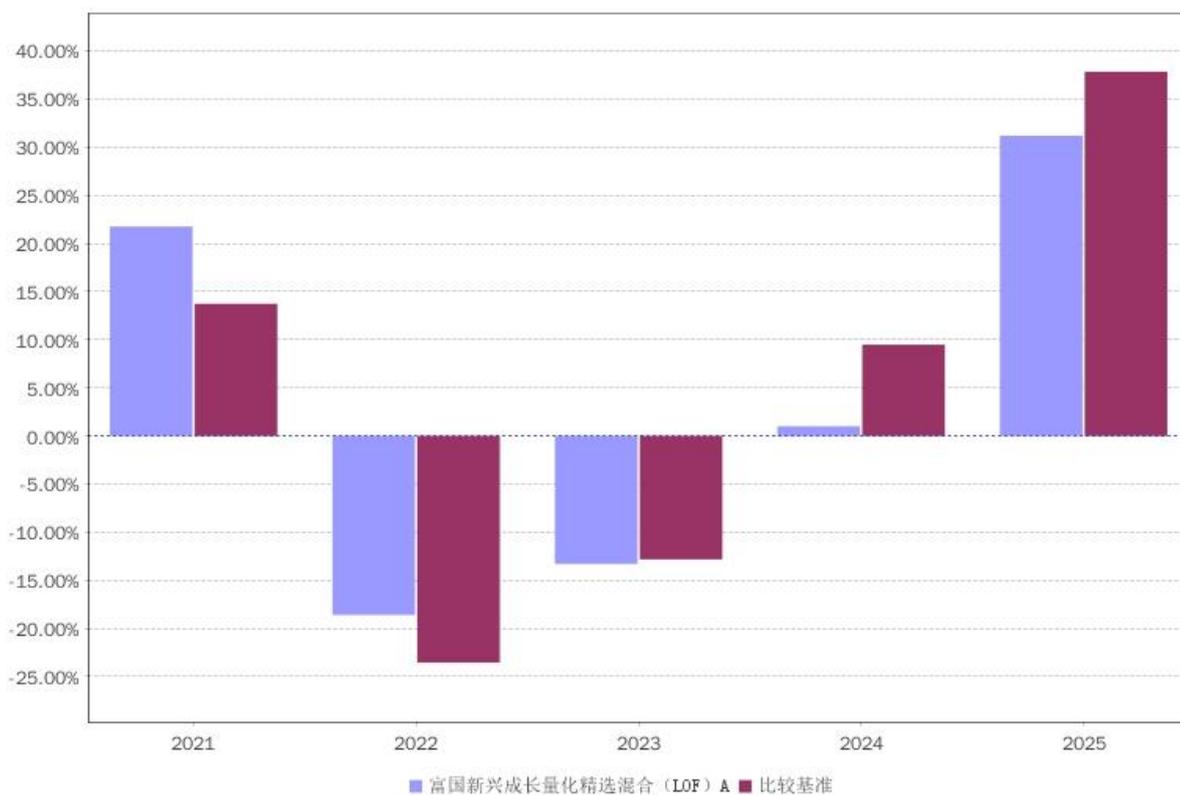


注：1、截止日期为 2025 年 12 月 31 日。

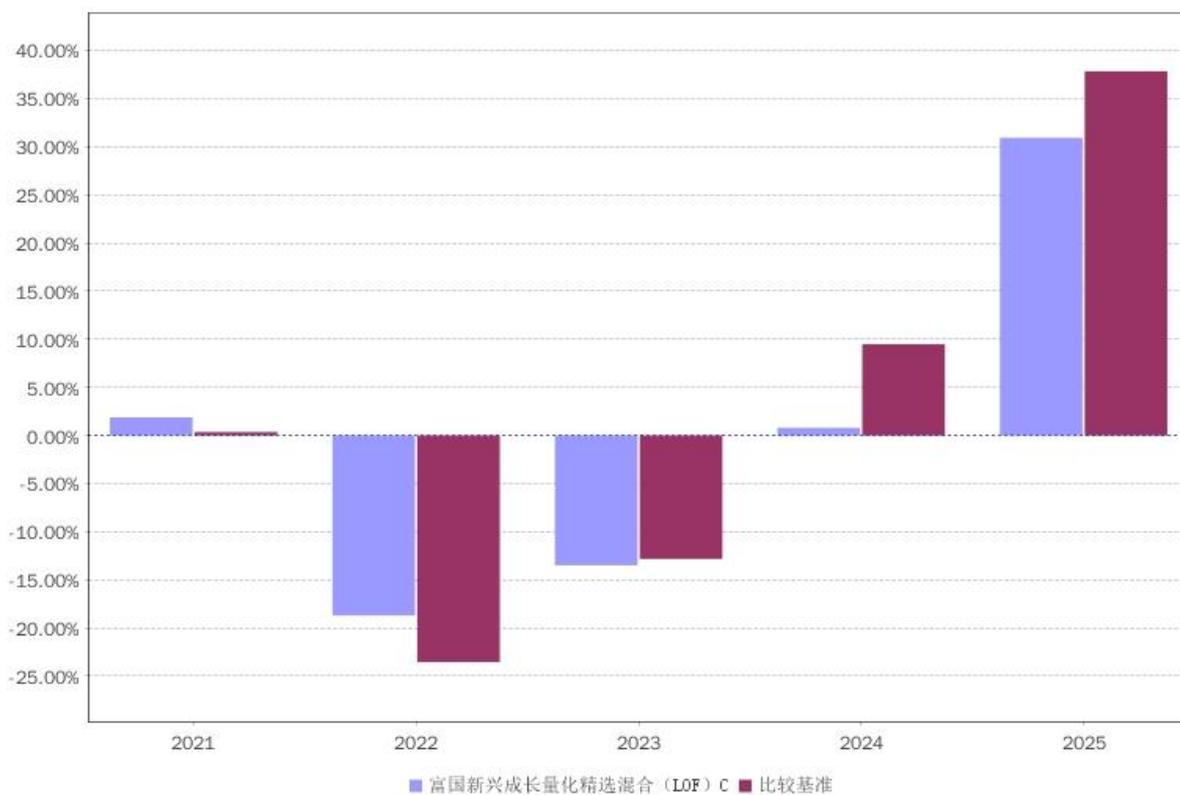
2、本基金自 2021 年 12 月 7 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

3.2.3 过去五年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) 过去五年以来富国新兴成长量化精选混合 (LOF) A 基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



(2) 过去五年以来富国新兴成长量化精选混合 (LOF) 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：C 类份额自 2021 年 12 月 8 日起有基金份额。2021 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) 富国新兴成长量化精选混合（LOF）A

注：过往三年本基金份额未进行利润分配。

(2) 富国新兴成长量化精选混合（LOF）C

注：过往三年本基金份额未进行利润分配。

§ 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《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，存续公司正式更名为“国泰海通证券股份有限公司”。

截至 2025 年 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		
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 62 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，力争获取超额收益率。

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新兴成长量化精选混合（LOF）A 为 1.4788 元，富国新兴成长量化精选混合（LOF）C 为 1.4674 元；份额累计净值富国新兴成长量化精选混合（LOF）A 为 1.4788 元，富国新兴成长量化精选混合（LOF）C 为 1.4674 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 31.19%，富国新兴成长量化精选混合（LOF）C 为 30.94%；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 37.84%，富国新兴成长量化精选混合（LOF）C 为 37.84%。

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

- 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 2025 年 1 月 2 日至 2025 年 12 月 31 日，本基金存在资产净值连续六十个工作日低

于五千万元的情况，基金管理人已向中国证监会报告此情形并将采取适当措施。

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遵规守信情况声明

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遵规守信、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_B301 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	富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）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，公允反映了富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度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，我们独立于富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF），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>富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）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

	<p>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新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)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新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)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,就可能对富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)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新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)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：富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）

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	上年度末 2024年12月31日
资产：		
货币资金	1,061,687.21	1,193,043.96
结算备付金	224,551.72	368,180.64
存出保证金	6,545.09	9,123.44
交易性金融资产	41,762,766.32	24,300,251.48
其中：股票投资	40,344,683.10	23,492,093.23
基金投资	—	—
债券投资	1,418,083.22	808,158.25
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	317,844.75	791.26
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	43,373,395.09	25,871,390.78
负债和净资产	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
负债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	0.07	152.06
应付赎回款	196,881.27	74,826.14
应付管理人报酬	27,413.99	19,949.79
应付托管费	6,092.02	4,433.28
应付销售服务费	518.17	243.94
应付投资顾问费	—	—
应交税费	—	—

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	77,143.48	117,616.78
负债合计	308,049.00	217,221.99
净资产：		
实收基金	29,138,764.18	22,767,091.95
其他综合收益	—	—
未分配利润	13,926,581.91	2,887,076.84
净资产合计	43,065,346.09	25,654,168.79
负债和净资产总计	43,373,395.09	25,871,390.78

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4779 元，基金份额总额 29,138,764.18 份。其中：富国新兴成长量化精选混合（LOF）A 份额净值 1.4788 元，份额总额 26,979,724.29 份；富国新兴成长量化精选混合（LOF）C 份额净值 1.4674 元，份额总额 2,159,039.89 份。

7.2 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：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 (2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日)
一、营业总收入	8,481,153.88	474,546.21
1. 利息收入	6,403.34	8,798.81
其中：存款利息收入	6,403.34	8,798.81
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）	6,958,309.79	571,324.01
其中：股票投资收益	6,171,238.25	89,536.07
基金投资收益	—	—
债券投资收益	14,833.84	3,698.08
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	276,450.72	—
股利收益	495,786.98	478,089.86
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）	1,480,837.71	-109,316.48

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	35,603.04	3,739.87
减：二、营业总支出	333,773.28	291,909.60
1. 管理人报酬	266,648.07	230,578.26
2. 托管费	59,255.15	51,239.62
3. 销售服务费	4,614.61	2,716.10
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	645.73	—
其中：卖出回购金融资产支出	645.73	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	996.12	—
8. 其他费用	1,613.60	7,375.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	8,147,380.60	182,636.61
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	8,147,380.60	182,636.61
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	8,147,380.60	182,636.61

7.3 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：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2025年01月01日至2025年12月31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）	6,371,672.23	11,039,505.07	17,411,177.30
（一）、综合收益总额	—	8,147,380.60	8,147,380.60
（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）	6,371,672.23	2,892,124.47	9,263,796.70
其中：1. 基金申购款	17,291,701.85	6,416,693.20	23,708,395.05
2. 基金赎回款	-10,920,029.62	-3,524,568.73	-14,444,598.35
（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	29,138,764.18	13,926,581.91	43,065,346.09
项目	上年度可比期间 (2024年01月01日至2024年12月31日)		

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	24,966,735.03	2,890,897.52	27,857,632.55
二、本期期初净资产	24,966,735.03	2,890,897.52	27,857,632.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,199,643.08	-3,820.68	-2,203,463.76
（一）、综合收益总额	—	182,636.61	182,636.61
（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）	-2,199,643.08	-186,457.29	-2,386,100.37
其中：1. 基金申购款	1,584,129.84	153,631.38	1,737,761.22
2. 基金赎回款	-3,783,772.92	-340,088.67	-4,123,861.59
（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	22,767,091.95	2,887,076.84	25,654,168.79

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%。

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 1 月 1 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1月1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相同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相同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交易日确认，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交易日确认，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) 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) 本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的A类基金份额和富国基金管理有限公司登记系统下的C类基金份额，持有人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；登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的场内A类基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额在费用收

取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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。

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	上年度末
	(2025年12月31日)	(2024年12月31日)
活期存款	1,061,687.21	1,193,043.96
等于：本金	1,061,536.24	1,192,934.53
加：应计利息	150.97	109.43
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	1,061,687.21	1,193,043.96

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

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	39,241,440.46	—	40,344,683.10	1,103,242.64	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	1,400,888.00	14,530.32	1,418,083.22	2,664.90
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	1,400,888.00	14,530.32	1,418,083.22	2,664.90
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	40,642,328.46	14,530.32	41,762,766.32	1,105,907.54	
项目	上年度末(2024年12月31日)				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	23,866,810.80	—	23,492,093.23	-374,717.57	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	

债券	交易所市场	801,612.60	6,758.25	808,158.25	-212.60
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	801,612.60	6,758.25	808,158.25	-212.60
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		24,668,423.40	6,758.25	24,300,251.48	-374,930.17

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

注：本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

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：本基金本报告期末及上年度末均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：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

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）	上年度末（2024年12月31日）
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	14.62	68.50
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	77,128.86	111,083.64
其中：交易所市场	77,128.86	111,083.64
银行间市场	—	—
应付利息	—	—
预提审计费	—	6,464.64
合计	77,143.48	117,616.78

7.4.7.7 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（2025年01月01日至2025年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,507,944.69	21,507,944.69
本期申购	14,412,483.86	14,412,483.86
本期赎回（以“-”号填列）	-8,940,704.26	-8,940,704.26
本期末	26,979,724.29	26,979,724.29

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（2025年01月01日至2025年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,259,147.26	1,259,147.26
本期申购	2,879,217.99	2,879,217.99
本期赎回（以“-”号填列）	-1,979,325.36	-1,979,325.36
本期末	2,159,039.89	2,159,039.89

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	6,583,537.09	-3,848,451.70	2,735,085.39
本期期初	6,583,537.09	-3,848,451.70	2,735,085.39
本期利润	6,068,735.02	1,373,728.40	7,442,463.42
本期基金份额交易产生的变动数	3,225,633.16	-485,754.80	2,739,878.36
其中：基金申购款	7,207,070.65	-1,607,385.54	5,599,685.11
基金赎回款	-3,981,437.49	1,121,630.74	-2,859,806.75
本期已分配利润	—	—	—
本期末	15,877,905.27	-2,960,478.10	12,917,427.17

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	377,606.13	-225,614.68	151,991.45
本期期初	377,606.13	-225,614.68	151,991.45
本期利润	597,807.87	107,109.31	704,917.18
本期基金份额交易产生的变动数	272,183.09	-119,936.98	152,246.11
其中：基金申购款	1,175,207.52	-358,199.43	817,008.09
基金赎回款	-903,024.43	238,262.45	-664,761.98
本期已分配利润	—	—	—

本期末	1,247,597.09	-238,442.35	1,009,154.74
-----	--------------	-------------	--------------

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年12月31日）
活期存款利息收入	3,843.38	5,551.97
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	2,420.42	3,177.09
其他	139.54	69.75
合计	6,403.34	8,798.81

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年12月31日）
卖出股票成交总额	417,224,420.10	333,413,423.35
减：卖出股票成本总额	410,448,385.48	332,778,940.01
减：交易费用	604,796.37	544,947.27
买卖股票差价收入	6,171,238.25	89,536.07

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01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年12月31日）
债券投资收益——利息收入	10,973.77	2,290.56
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,860.07	1,407.52
合计	14,833.84	3,698.08

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01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年12月31日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,128,017.42	106,607.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	1,109,807.60	104,703.40

本总额		
减：应计利息总额	14,349.22	496.79
减：交易费用	0.53	0.23
买卖债券差价收入	3,860.07	1,407.52

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：本基金本报告期及上年度可比期间均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：本基金本报告期及上年度可比期间均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：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖贵金属交易。

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：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——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01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年12月31日）
股指期货投资收益	276,450.72	—

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年12月31日）
股票投资产生的股利收益	495,786.98	478,089.86
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	495,786.98	478,089.86

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01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年12月31日）
1. 交易性金融资产	1,480,837.71	-109,316.48
股票投资	1,477,960.21	-109,103.88
债券投资	2,877.50	-212.60
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	1,480,837.71	-109,316.48

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年12月31日）
基金赎回费收入	30,293.42	2,828.89
基金转换费收入	5,309.62	910.98
合计	35,603.04	3,739.87

7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年12月31日）
审计费用	—	6,464.64
信息披露费	—	—
证券出借违约金	—	—
银行费用	1,605.00	910.00
其他	8.60	0.98
合计	1,613.60	7,375.62

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

（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。

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01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年12月31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	210,785,704.18	25.01	—	—
海通证券	20,537,411.75	2.44	36,590,851.49	5.51
申万宏源	177,374,642.86	21.04	24,189,875.78	3.65

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

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01月01日至2025年12月31日)		上年度可比期间(2024年01月01日至2024年12月31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	403,276.44	16.71	—	—
海通证券	—	—	300,036.00	29.77
申万宏源	204,175.51	8.46	104,237.71	10.34

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01月01日至2025年12月31日)		上年度可比期间(2024年01月01日至2024年12月31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	1,466,000.00	41.00	—	—
申万宏源	200,000.00	5.59	—	—

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01月01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	85,560.06	25.01	34,704.21	45.00
海通证券	8,335.94	2.44	—	—

申万宏源	71,999.82	21.04	24,314.60	31.52
关联方名称	上年度可比期间（2024年01月01日至2024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（%）
海通证券	16,576.13	4.94	12,731.09	11.46
申万宏源	13,417.78	4.00	5,391.79	4.85

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。

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01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	266,648.07	230,578.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	72,760.55	66,467.76
应支付基金管理人的净管理费	193,887.52	164,110.50

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年12月31日）	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	59,255.15	51,239.62

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 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

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01月01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	—	4,127.23	4,127.23
合计	—	4,127.23	4,127.23

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年12月31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	—	2,647.35	2,647.35
合计	—	2,647.35	2,647.35

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。

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。

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。

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。

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固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期(2025年01月01日至2025年12月31日)		上年度可比期间 (2024年01月01日至2024年12月31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
基金合同生效日(2017年07月21日)持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	4,279,965.75	—	4,279,965.75	—
期间申购/买入总份额	—	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减:期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	4,279,965.75	—	4,279,965.75	—
期末持有的基金份额占基金 总份额比例	15.86%	—	19.90%	—

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。

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及上年度末均未投资本基金。

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01月01日至2025年12月31日）		上年度可比期间（2024年01月01日至2024年12月31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	1,061,687.21	3,843.38	1,193,043.96	5,551.97

7.4.10.7 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。

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

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。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

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

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。

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
002049	紫光国	2025年12	重大事项停	78.81	2026	86.69	1,800.00	142,307.29	141,858.00	—

	微	月 30 日	牌		年 01 月 15 日					
688012	中微公 司	2025 年 12 月 19 日	重大事项停 牌	272.7 2	2026 年 01 月 05 日	278.00	57.00	14,706.57	15,545.04	—

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上市公司发行的证券，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。

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）	上年度末（2024年12月31日）
AAA	—	—
AAA 以下	3,313.03	—
未评级	—	—
合计	3,313.03	—

注：本基金上年度末未持有按长期信用评级列示的信用债。本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

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	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
上年度末(2024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	1,193,043.96	—	—	—	1,193,043.96
结算备付金	368,180.64	—	—	—	368,180.64
存出保证金	9,123.44	—	—	—	9,123.44
交易性金融资产	808,158.25	—	—	23,492,093.23	24,300,251.48
应收申购款	—	—	—	791.26	791.26
资产总计	2,378,506.29	—	—	23,492,884.49	25,871,390.78
负债					
应付清算款	—	—	—	152.06	152.06
应付赎回款	—	—	—	74,826.14	74,826.14
应付管理人报酬	—	—	—	19,949.79	19,949.79
应付托管费	—	—	—	4,433.28	4,433.28
应付销售服务费	—	—	—	243.94	243.94
其他负债	—	—	—	117,616.78	117,616.78
负债总计	—	—	—	217,221.99	217,221.99
利率敏感度缺口	2,378,506.29	—	—	23,275,662.50	25,654,168.79

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。		
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）	上年度末（2024年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-256.53	-353.49
	2. 基准点利率减少0.1%	256.53	353.49

7.4.13.4.2 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。

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）		上年度末（2024年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	40,344,683.10	93.68	23,492,093.23	91.57
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,418,083.22	3.29	808,158.25	3.15
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	41,762,766.32	96.98	24,300,251.48	94.72

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。

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）	上年度末（2024年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加1%	351,642.51	191,630.36
2. 业绩比较基准减少1%	-351,642.51	-191,630.36	

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)	上年度末 (2024年12月31日)
---------------	----------------------	-----------------------

第一层次	40,190,593.09	23,455,205.23
第二层次	1,572,173.23	845,046.25
第三层次	—	—
合计	41,762,766.32	24,300,251.48

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业务等情况，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

项目	本期（2025年01月01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	—	50,551.36	50,551.36
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	50,525.12	50,525.12
当期利得或损失总额	—	-26.24	-26.24
其中：计入损益的利得或损失	—	-26.24	-26.24
期末余额	—	—	—
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	—	—	—
项目	上年度可比期间（2024年01月01日至2024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	—	—	—
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	—	—	—
其中：计入损益的利得或损失	—	—	—
期末余额	—	—	—
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	—	—	—

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。

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	40,344,683.10	93.02
	其中：股票	40,344,683.10	93.02
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,418,083.22	3.27
	其中：债券	1,418,083.22	3.27
	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	1,286,238.93	2.97
8	其他各项资产	324,389.84	0.75
9	合计	43,373,395.09	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

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	99,585.00	0.23
B	采矿业	1,933,678.00	4.49
C	制造业	31,493,190.80	73.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	709,359.00	1.65
E	建筑业	176,232.00	0.41
F	批发和零售业	439,770.00	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	597,819.00	1.39
H	住宿和餐饮业	78,168.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,122,777.10	4.93
J	金融业	1,447,380.00	3.36
K	房地产业	83,859.00	0.19
L	租赁和商务服务业	472,300.00	1.10
M	科学研究和技术服务业	429,870.20	1.00
N	水利、环境和公共设施管理业	95,904.00	0.22

0	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	7,458.00	0.02
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	155,387.00	0.36
S	综合	1,946.00	0.00
	合计	40,344,683.10	93.68

8.3 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	2,100	1,281,000.00	2.97
2	300502	新易盛	2,660	1,146,140.80	2.66
3	300750	宁德时代	2,800	1,028,328.00	2.39
4	601899	紫金矿业	27,100	934,137.00	2.17
5	002475	立讯精密	9,800	555,758.00	1.29
6	002463	沪电股份	7,600	555,332.00	1.29
7	002371	北方华创	1,100	504,988.00	1.17
8	603019	中科曙光	5,600	479,584.00	1.11
9	688041	海光信息	1,873	420,319.93	0.98
10	603993	洛阳钼业	20,600	412,000.00	0.96
11	000333	美的集团	5,200	406,380.00	0.94
12	603799	华友钴业	5,800	395,908.00	0.92
13	000831	中国稀土	7,700	357,588.00	0.83
14	601318	中国平安	5,200	355,680.00	0.83
15	300476	胜宏科技	1,200	345,096.00	0.80
16	601138	工业富联	5,300	328,865.00	0.76
17	000408	藏格矿业	3,700	312,280.00	0.73
18	300394	天孚通信	1,500	304,545.00	0.71
19	002625	光启技术	6,000	292,560.00	0.68
20	000100	TCL 科技	63,400	287,836.00	0.67
21	001389	广合科技	3,400	277,542.00	0.64
22	600415	小商品城	17,400	277,530.00	0.64
23	600519	贵州茅台	200	275,436.00	0.64
24	600795	国电电力	54,100	272,664.00	0.63
25	600183	生益科技	3,700	264,217.00	0.61
26	688235	百济神州	935	251,141.00	0.58
27	603129	春风动力	900	250,812.00	0.58
28	002028	思源电气	1,600	247,344.00	0.57
29	688521	芯原股份	1,804	247,093.88	0.57
30	605499	东鹏饮料	900	240,651.00	0.56
31	300274	阳光电源	1,400	239,456.00	0.56

32	603379	三美股份	3,900	236,808.00	0.55
33	000975	山金国际	9,700	236,001.00	0.55
34	603259	药明康德	2,600	235,664.00	0.55
35	688072	拓荆科技	712	234,960.00	0.55
36	002517	恺英网络	10,600	231,822.00	0.54
37	688278	特宝生物	2,699	225,852.32	0.52
38	002373	千方科技	18,300	215,391.00	0.50
39	002552	宝鼎科技	13,000	214,630.00	0.50
40	603986	兆易创新	1,000	214,250.00	0.50
41	002311	海大集团	3,700	204,906.00	0.48
42	300926	博俊科技	6,200	203,236.00	0.47
43	603699	纽威股份	3,900	202,683.00	0.47
44	301345	涛涛车业	800	201,056.00	0.47
45	601336	新华保险	2,800	195,160.00	0.45
46	000425	徐工机械	16,400	189,912.00	0.44
47	688256	寒武纪	140	189,777.00	0.44
48	600066	宇通客车	5,700	186,390.00	0.43
49	300628	亿联网络	5,200	185,380.00	0.43
50	300723	一品红	5,400	181,170.00	0.42
51	000651	格力电器	4,500	180,990.00	0.42
52	600988	赤峰黄金	5,500	171,820.00	0.40
53	002050	三花智控	3,100	171,461.00	0.40
54	688498	源杰科技	263	168,843.37	0.39
55	002130	沃尔核材	6,400	168,448.00	0.39
56	301031	中熔电气	1,500	168,285.00	0.39
57	688166	博瑞医药	3,337	163,713.22	0.38
58	600309	万华化学	2,100	161,028.00	0.37
59	300972	万辰集团	800	160,856.00	0.37
60	603173	福斯达	3,700	158,434.00	0.37
61	600803	新奥股份	7,600	157,776.00	0.37
62	000157	中联重科	18,100	156,203.00	0.36
63	301285	鸿日达	2,300	155,894.00	0.36
64	688183	生益电子	1,586	151,764.34	0.35
65	688386	泛亚微透	1,715	150,234.00	0.35
66	000528	柳工	12,100	143,627.00	0.33
67	600276	恒瑞医药	2,400	142,968.00	0.33
68	002049	紫光国微	1,800	141,858.00	0.33
69	601156	东航物流	7,700	141,757.00	0.33
70	000301	东方盛虹	12,900	140,481.00	0.33
71	300303	聚飞光电	20,400	139,536.00	0.32
72	603486	科沃斯	1,700	137,156.00	0.32

73	603766	隆鑫通用	8,500	136,935.00	0.32
74	301606	绿联科技	2,300	135,102.00	0.31
75	689009	九号公司	2,425	134,805.75	0.31
76	688008	澜起科技	1,128	132,878.40	0.31
77	600487	亨通光电	5,300	131,069.00	0.30
78	002487	大金重工	2,500	129,825.00	0.30
79	002690	美亚光电	6,200	127,534.00	0.30
80	002468	申通快递	9,300	124,806.00	0.29
81	301310	鑫宏业	2,900	124,555.00	0.29
82	000792	盐湖股份	4,400	123,904.00	0.29
83	600690	海尔智家	4,600	120,014.00	0.28
84	300014	亿纬锂能	1,800	118,368.00	0.27
85	600009	上海机场	3,600	117,936.00	0.27
86	300953	震裕科技	700	117,614.00	0.27
87	688322	奥比中光	1,305	117,019.35	0.27
88	002195	岩山科技	16,300	115,567.00	0.27
89	600989	宝丰能源	5,800	113,854.00	0.26
90	002074	国轩高科	2,900	113,419.00	0.26
91	002281	光迅科技	1,600	111,920.00	0.26
92	688220	翱捷科技	1,344	111,027.84	0.26
93	002384	东山精密	1,300	110,045.00	0.26
94	301007	德迈仕	2,700	109,404.00	0.25
95	600583	海油工程	19,900	109,251.00	0.25
96	603306	华懋科技	1,700	107,117.00	0.25
97	000899	赣能股份	10,600	104,940.00	0.24
98	600750	华润江中	4,500	104,265.00	0.24
99	000415	渤海租赁	25,700	104,085.00	0.24
100	300618	寒锐钴业	2,300	103,983.00	0.24
101	000039	中集集团	10,200	102,918.00	0.24
102	600875	东方电气	4,200	101,976.00	0.24
103	603296	华勤技术	1,100	99,814.00	0.23
104	301052	果麦文化	2,600	99,294.00	0.23
105	002801	微光股份	2,800	99,148.00	0.23
106	688127	蓝特光学	2,555	98,341.95	0.23
107	002402	和而泰	2,500	97,800.00	0.23
108	688002	睿创微纳	964	97,171.20	0.23
109	600036	招商银行	2,300	96,830.00	0.22
110	688257	新锐股份	2,823	96,772.44	0.22
111	603179	新泉股份	1,300	96,044.00	0.22
112	000858	五粮液	900	95,346.00	0.22
113	600598	北大荒	6,300	94,185.00	0.22

114	002163	海南发展	3,900	92,976.00	0.22
115	300454	深信服	800	92,128.00	0.21
116	603118	共进股份	8,000	92,000.00	0.21
117	300566	激智科技	5,000	91,750.00	0.21
118	002008	大族激光	2,200	90,618.00	0.21
119	300438	鹏辉能源	1,700	90,474.00	0.21
120	601777	千里科技	8,500	90,355.00	0.21
121	300806	斯迪克	2,900	89,146.00	0.21
122	601128	常熟银行	12,600	88,704.00	0.21
123	601717	中创智领	3,600	88,380.00	0.21
124	300224	正海磁材	5,700	88,122.00	0.20
125	600967	内蒙一机	5,200	87,360.00	0.20
126	601628	中国人寿	1,900	86,450.00	0.20
127	000901	航天科技	3,000	85,410.00	0.20
128	688372	伟测科技	776	84,653.84	0.20
129	601825	沪农商行	9,100	84,539.00	0.20
130	002202	金风科技	4,100	83,640.00	0.19
131	000423	东阿阿胶	1,700	83,436.00	0.19
132	601229	上海银行	8,200	82,820.00	0.19
133	300054	鼎龙股份	2,200	82,720.00	0.19
134	600392	盛和资源	3,800	81,814.00	0.19
135	002444	巨星科技	2,400	81,648.00	0.19
136	300059	东方财富	3,500	81,130.00	0.19
137	688512	慧智微	7,225	80,631.00	0.19
138	000977	浪潮信息	1,200	79,920.00	0.19
139	688313	仕佳光子	899	79,813.22	0.19
140	600760	中航沈飞	1,400	78,610.00	0.18
141	601698	中国卫通	2,200	78,606.00	0.18
142	603429	集友股份	7,900	78,289.00	0.18
143	603190	亚通精工	2,900	78,213.00	0.18
144	002594	比亚迪	800	78,176.00	0.18
145	300053	航宇微	4,100	77,982.00	0.18
146	600660	福耀玻璃	1,200	77,724.00	0.18
147	688258	卓易信息	1,015	77,718.55	0.18
148	600176	中国巨石	4,500	76,950.00	0.18
149	002170	芭田股份	6,300	76,734.00	0.18
150	688469	芯联集成	11,420	76,399.80	0.18
151	601601	中国太保	1,800	75,438.00	0.18
152	688297	中无人机	1,567	75,247.34	0.17
153	688070	纵横股份	1,351	74,845.40	0.17
154	688678	福立旺	3,094	74,812.92	0.17

155	688536	思瑞浦	465	74,344.20	0.17
156	688159	有方科技	1,537	74,298.58	0.17
157	600497	驰宏锌锗	10,100	73,831.00	0.17
158	300131	英唐智控	5,000	73,300.00	0.17
159	300409	道氏技术	3,200	71,968.00	0.17
160	301165	锐捷网络	800	71,040.00	0.16
161	600258	首旅酒店	4,200	70,350.00	0.16
162	600096	云天化	2,100	70,161.00	0.16
163	688271	联影医疗	558	70,029.00	0.16
164	600111	北方稀土	1,500	69,180.00	0.16
165	688799	华纳药厂	1,448	69,069.60	0.16
166	688025	杰普特	485	68,661.45	0.16
167	000538	云南白药	1,200	68,112.00	0.16
168	002970	锐明技术	1,400	67,900.00	0.16
169	002273	水晶光电	2,700	67,824.00	0.16
170	688519	南亚新材	836	67,598.96	0.16
171	301033	迈普医学	1,000	67,500.00	0.16
172	301086	鸿富瀚	600	67,134.00	0.16
173	688677	海泰新光	1,550	66,898.00	0.16
174	300615	欣天科技	5,000	66,400.00	0.15
175	002204	大连重工	8,500	65,025.00	0.15
176	603131	上海沪工	2,100	63,525.00	0.15
177	605305	中际联合	1,500	62,490.00	0.15
178	600141	兴发集团	1,800	62,244.00	0.14
179	688100	威胜信息	1,581	62,133.30	0.14
180	601689	拓普集团	800	61,744.00	0.14
181	688066	航天宏图	1,889	61,505.84	0.14
182	688111	金山办公	200	61,414.00	0.14
183	600298	安琪酵母	1,400	61,236.00	0.14
184	600926	杭州银行	4,000	61,120.00	0.14
185	688981	中芯国际	496	60,923.68	0.14
186	603950	长源东谷	2,100	60,795.00	0.14
187	688578	艾力斯	579	60,302.85	0.14
188	002997	瑞鹤模具	1,600	59,840.00	0.14
189	603939	益丰药房	2,700	58,644.00	0.14
190	300762	上海瀚讯	1,400	58,352.00	0.14
191	600933	爱柯迪	2,900	58,290.00	0.14
192	000078	海王生物	16,600	57,436.00	0.13
193	002882	金龙羽	1,900	57,304.00	0.13
194	688680	海优新材	1,495	57,183.75	0.13
195	300950	德固特	2,500	57,150.00	0.13

196	002106	莱宝高科	5,200	56,992.00	0.13
197	601186	中国铁建	7,200	55,224.00	0.13
198	600584	长电科技	1,500	55,170.00	0.13
199	300735	光弘科技	2,200	54,692.00	0.13
200	301219	腾远钴业	800	54,624.00	0.13
201	605599	菜百股份	3,300	54,021.00	0.13
202	603056	德邦股份	3,900	53,313.00	0.12
203	603328	依顿电子	4,800	52,608.00	0.12
204	688439	振华风光	804	51,938.40	0.12
205	601319	中国人保	5,800	51,910.00	0.12
206	002946	新乳业	2,800	51,884.00	0.12
207	688173	希荻微	3,517	51,699.90	0.12
208	300957	贝泰妮	1,300	51,493.00	0.12
209	603596	伯特利	1,000	51,270.00	0.12
210	002537	海联金汇	5,600	50,736.00	0.12
211	300604	长川科技	500	50,655.00	0.12
212	300857	协创数据	300	50,604.00	0.12
213	000729	燕京啤酒	4,500	50,535.00	0.12
214	002664	信质集团	2,100	50,316.00	0.12
215	002414	高德红外	3,400	49,878.00	0.12
216	002245	蔚蓝锂芯	2,800	49,840.00	0.12
217	688525	佰维存储	431	49,474.49	0.11
218	002380	科远智慧	1,800	48,960.00	0.11
219	688690	纳微科技	1,873	48,342.13	0.11
220	000988	华工科技	600	47,598.00	0.11
221	301503	智迪科技	1,300	46,878.00	0.11
222	300001	特锐德	1,800	46,224.00	0.11
223	688311	盟升电子	1,013	46,192.80	0.11
224	600331	宏达股份	3,600	46,044.00	0.11
225	600057	厦门象屿	5,400	46,008.00	0.11
226	002340	格林美	5,500	45,980.00	0.11
227	001914	招商积余	4,300	45,924.00	0.11
228	300866	安克创新	400	45,756.00	0.11
229	300146	汤臣倍健	3,800	45,638.00	0.11
230	601066	中信建投	1,700	45,509.00	0.11
231	600478	科力远	6,600	45,474.00	0.11
232	002156	通富微电	1,200	45,240.00	0.11
233	688520	神州细胞	1,037	44,912.47	0.10
234	601100	恒立液压	400	43,964.00	0.10
235	600782	新钢股份	11,300	43,844.00	0.10
236	600389	江山股份	1,700	42,976.00	0.10

237	002913	奥士康	1,000	42,740.00	0.10
238	002296	辉煌科技	3,800	42,560.00	0.10
239	002396	星网锐捷	1,400	42,420.00	0.10
240	603444	吉比特	100	42,385.00	0.10
241	300049	福瑞医科	600	42,246.00	0.10
242	601111	中国国航	4,500	42,165.00	0.10
243	688789	宏华数科	516	42,090.12	0.10
244	688208	道通科技	1,137	41,841.60	0.10
245	600262	北方股份	1,600	41,648.00	0.10
246	688359	三孚新科	623	41,510.49	0.10
247	600050	中国联通	8,100	41,391.00	0.10
248	002428	云南锗业	1,300	41,275.00	0.10
249	600329	达仁堂	900	41,058.00	0.10
250	002899	英派斯	1,500	41,055.00	0.10
251	300407	凯发电气	3,600	40,752.00	0.09
252	603568	伟明环保	1,600	40,608.00	0.09
253	001221	悍高集团	700	40,537.00	0.09
254	688018	乐鑫科技	236	40,120.00	0.09
255	600887	伊利股份	1,400	40,040.00	0.09
256	601339	百隆东方	6,900	39,951.00	0.09
257	000807	云铝股份	1,200	39,408.00	0.09
258	300684	中石科技	800	39,376.00	0.09
259	000708	中信特钢	2,400	39,288.00	0.09
260	600801	华新建材	1,600	39,264.00	0.09
261	688567	孚能科技	2,505	39,203.25	0.09
262	603325	博隆技术	500	38,885.00	0.09
263	688577	浙海德曼	400	38,744.00	0.09
264	600961	株冶集团	2,400	38,640.00	0.09
265	688819	天能股份	1,160	38,535.20	0.09
266	300836	佰奥智能	700	38,430.00	0.09
267	002461	珠江啤酒	4,100	38,089.00	0.09
268	301061	匠心家居	400	37,920.00	0.09
269	000063	中兴通讯	1,000	37,840.00	0.09
270	000600	建投能源	4,400	37,532.00	0.09
271	600210	紫江企业	5,100	37,485.00	0.09
272	301626	苏州天脉	200	37,260.00	0.09
273	603737	三棵树	800	37,016.00	0.09
274	300005	探路者	3,400	36,822.00	0.09
275	002493	荣盛石化	3,100	36,301.00	0.08
276	688508	芯朋微	592	36,052.80	0.08
277	300976	达瑞电子	600	36,042.00	0.08

278	688591	泰凌微	844	35,920.64	0.08
279	601991	大唐发电	10,200	35,598.00	0.08
280	300138	晨光生物	2,800	34,748.00	0.08
281	000725	京东方A	8,200	34,522.00	0.08
282	605117	德业股份	400	34,480.00	0.08
283	300759	康龙化成	1,200	34,116.00	0.08
284	301507	民生健康	2,200	33,792.00	0.08
285	688499	利元亨	582	33,593.04	0.08
286	002734	利民股份	2,100	33,474.00	0.08
287	600150	中国船舶	1,000	33,260.00	0.08
288	600011	华能国际	4,400	32,824.00	0.08
289	688543	国科军工	528	32,772.96	0.08
290	300033	同花顺	100	32,218.00	0.07
291	002645	华宏科技	2,200	32,208.00	0.07
292	300223	北京君正	300	31,812.00	0.07
293	688582	芯动联科	479	31,666.69	0.07
294	002850	科达利	200	31,572.00	0.07
295	600026	中远海能	2,700	31,536.00	0.07
296	600563	法拉电子	300	31,485.00	0.07
297	002284	亚太股份	2,100	31,353.00	0.07
298	300643	万通智控	1,600	31,104.00	0.07
299	603518	锦泓集团	3,200	31,072.00	0.07
300	300341	麦克奥迪	1,900	31,046.00	0.07
301	300457	赢合科技	1,100	30,635.00	0.07
302	000719	中原传媒	2,600	30,576.00	0.07
303	600521	华海药业	1,800	30,546.00	0.07
304	002236	大华股份	1,600	30,304.00	0.07
305	002736	国信证券	2,300	30,176.00	0.07
306	688617	惠泰医疗	124	30,165.48	0.07
307	688248	南网科技	664	29,707.36	0.07
308	600029	南方航空	3,700	29,637.00	0.07
309	301175	中科环保	5,000	29,550.00	0.07
310	603800	洪田股份	600	29,262.00	0.07
311	600027	华电国际	5,800	28,768.00	0.07
312	600378	昊华科技	900	28,764.00	0.07
313	002241	歌尔股份	1,000	28,730.00	0.07
314	002812	恩捷股份	500	28,320.00	0.07
315	002601	龙佰集团	1,400	27,412.00	0.06
316	301035	润丰股份	400	27,204.00	0.06
317	603897	长城科技	1,000	27,200.00	0.06
318	600160	巨化股份	700	26,894.00	0.06

319	301316	慧博云通	600	26,808.00	0.06
320	300007	汉威科技	500	26,800.00	0.06
321	002345	潮宏基	2,100	26,250.00	0.06
322	300207	欣旺达	1,000	26,150.00	0.06
323	603833	欧派家居	500	26,045.00	0.06
324	001696	宗申动力	1,200	26,028.00	0.06
325	002555	三七互娱	1,100	25,960.00	0.06
326	600808	马钢股份	6,100	25,742.00	0.06
327	300316	晶盛机电	700	25,725.00	0.06
328	002460	赣锋锂业	400	25,156.00	0.06
329	688286	敏芯股份	311	24,553.45	0.06
330	301308	江波龙	100	24,484.00	0.06
331	000739	普洛药业	1,500	24,405.00	0.06
332	603701	德宏股份	1,200	24,192.00	0.06
333	301607	富特科技	600	24,066.00	0.06
334	002920	德赛西威	200	24,060.00	0.06
335	688321	微芯生物	817	23,872.74	0.06
336	688049	炬芯科技	444	23,354.40	0.05
337	601728	中国电信	3,700	23,310.00	0.05
338	002448	中原内配	1,800	23,274.00	0.05
339	002916	深南电路	100	23,229.00	0.05
340	688488	艾迪药业	1,422	23,221.26	0.05
341	002318	久立特材	800	23,160.00	0.05
342	300378	鼎捷数智	500	22,630.00	0.05
343	002293	罗莱生活	2,200	22,594.00	0.05
344	688612	威迈斯	684	22,551.48	0.05
345	002654	万润科技	1,600	22,512.00	0.05
346	002409	雅克科技	300	22,230.00	0.05
347	600428	中远海特	3,100	22,010.00	0.05
348	605016	百龙创园	1,000	21,600.00	0.05
349	600435	北方导航	1,400	21,588.00	0.05
350	300824	北鼎股份	1,900	21,489.00	0.05
351	002837	英维克	200	21,378.00	0.05
352	603200	上海洗霸	300	21,342.00	0.05
353	603301	振德医疗	300	21,150.00	0.05
354	688062	迈威生物	546	21,004.62	0.05
355	600549	厦门钨业	500	20,530.00	0.05
356	002052	同洲电子	1,600	20,400.00	0.05
357	300550	和仁科技	1,400	20,314.00	0.05
358	600048	保利发展	3,300	20,130.00	0.05
359	300395	菲利华	200	20,060.00	0.05

360	300835	龙磁科技	300	19,674.00	0.05
361	300909	汇创达	400	19,240.00	0.04
362	000959	首钢股份	3,900	19,110.00	0.04
363	688205	德科立	139	19,109.72	0.04
364	300760	迈瑞医疗	100	19,045.00	0.04
365	688320	禾川科技	506	18,883.92	0.04
366	688375	国博电子	200	18,622.00	0.04
367	300363	博腾股份	800	18,592.00	0.04
368	000603	盛达资源	600	18,576.00	0.04
369	002759	天际股份	400	18,572.00	0.04
370	300666	江丰电子	200	18,400.00	0.04
371	300415	伊之密	700	18,242.00	0.04
372	600570	恒生电子	600	18,090.00	0.04
373	688267	中触媒	642	18,085.14	0.04
374	688676	金盘科技	200	18,068.00	0.04
375	300861	美畅股份	1,200	17,916.00	0.04
376	300436	广生堂	200	17,830.00	0.04
377	002558	巨人网络	400	17,316.00	0.04
378	300802	矩子科技	900	17,226.00	0.04
379	688410	山外山	1,147	17,170.59	0.04
380	002222	福晶科技	300	16,902.00	0.04
381	002155	湖南黄金	800	16,872.00	0.04
382	002152	广电运通	1,200	16,572.00	0.04
383	300850	新强联	400	16,548.00	0.04
384	301589	诺瓦星云	100	16,455.00	0.04
385	002865	钧达股份	300	16,383.00	0.04
386	601179	中国西电	1,800	16,380.00	0.04
387	600930	华电新能	2,600	16,354.00	0.04
388	002897	意华股份	300	16,221.00	0.04
389	603132	金徽股份	1,100	16,137.00	0.04
390	002265	建设工业	600	16,092.00	0.04
391	603629	利通电子	600	15,990.00	0.04
392	300633	开立医疗	600	15,852.00	0.04
393	002440	闰土股份	2,100	15,687.00	0.04
394	300083	创世纪	1,700	15,657.00	0.04
395	603786	科博达	200	15,620.00	0.04
396	688331	荣昌生物	200	15,558.00	0.04
397	688012	中微公司	57	15,545.04	0.04
398	688120	华海清科	103	15,458.24	0.04
399	688249	晶合集成	463	15,366.97	0.04
400	600499	科达制造	1,100	15,257.00	0.04

401	300590	移为通信	1,200	15,216.00	0.04
402	300682	朗新科技	1,000	15,210.00	0.04
403	300662	科锐国际	600	15,198.00	0.04
404	301216	万凯新材	900	15,174.00	0.04
405	605118	力鼎光电	500	15,055.00	0.03
406	300450	先导智能	300	14,994.00	0.03
407	603103	横店影视	900	14,922.00	0.03
408	002484	江海股份	500	14,850.00	0.03
409	603915	国茂股份	800	14,728.00	0.03
410	688036	传音控股	221	14,621.36	0.03
411	300674	宇信科技	600	14,556.00	0.03
412	603500	祥和实业	1,200	14,376.00	0.03
413	300048	合康新能	2,400	14,280.00	0.03
414	300811	铂科新材	200	14,262.00	0.03
415	301360	荣旗科技	200	14,180.00	0.03
416	601688	华泰证券	600	14,154.00	0.03
417	301080	百普赛斯	260	14,040.00	0.03
418	002600	领益智造	900	13,986.00	0.03
419	300373	扬杰科技	200	13,600.00	0.03
420	301413	安培龙	100	13,480.00	0.03
421	688531	日联科技	200	13,206.00	0.03
422	688006	杭可科技	448	13,121.92	0.03
423	300791	仙乐健康	500	12,930.00	0.03
424	003042	中农联合	800	12,848.00	0.03
425	002436	兴森科技	600	12,702.00	0.03
426	300458	全志科技	300	12,609.00	0.03
427	300539	横河精密	300	12,606.00	0.03
428	600426	华鲁恒升	400	12,572.00	0.03
429	688123	聚辰股份	100	12,558.00	0.03
430	601608	中信重工	1,900	12,521.00	0.03
431	600919	江苏银行	1,200	12,480.00	0.03
432	688636	智明达	291	12,466.44	0.03
433	002097	山河智能	1,000	12,410.00	0.03
434	300413	芒果超媒	500	12,210.00	0.03
435	000567	海德股份	1,900	12,198.00	0.03
436	688556	高测股份	1,065	12,162.30	0.03
437	300775	三角防务	400	12,160.00	0.03
438	002007	华兰生物	800	12,104.00	0.03
439	600372	中航机载	900	12,078.00	0.03
440	000680	山推股份	1,000	11,970.00	0.03
441	603606	东方电缆	200	11,950.00	0.03

442	603579	荣泰健康	500	11,905.00	0.03
443	688107	安路科技	437	11,877.66	0.03
444	300515	三德科技	600	11,796.00	0.03
445	000568	泸州老窖	100	11,622.00	0.03
446	000887	中鼎股份	500	11,605.00	0.03
447	603119	浙江荣泰	100	11,567.00	0.03
448	603067	振华股份	400	11,524.00	0.03
449	600233	圆通速递	700	11,494.00	0.03
450	002624	完美世界	700	11,473.00	0.03
451	600860	京城股份	900	11,286.00	0.03
452	301135	瑞德智能	400	11,240.00	0.03
453	002546	新联电子	1,600	11,184.00	0.03
454	603409	汇通控股	300	11,169.00	0.03
455	002137	实益达	1,300	11,154.00	0.03
456	300011	鼎汉技术	1,300	11,154.00	0.03
457	600866	星湖科技	1,600	11,120.00	0.03
458	002466	天齐锂业	200	11,076.00	0.03
459	002545	东方铁塔	600	11,070.00	0.03
460	603697	有友食品	900	11,025.00	0.03
461	603166	福达股份	700	10,990.00	0.03
462	002080	中材科技	300	10,902.00	0.03
463	300012	华测检测	800	10,840.00	0.03
464	300154	瑞凌股份	1,100	10,835.00	0.03
465	601607	上海医药	600	10,716.00	0.02
466	601068	中铝国际	2,000	10,580.00	0.02
467	688099	晶晨股份	121	10,554.83	0.02
468	600877	电科芯片	600	10,530.00	0.02
469	003816	中国广核	2,800	10,528.00	0.02
470	600566	济川药业	400	10,520.00	0.02
471	000733	振华科技	200	10,482.00	0.02
472	002799	环球印务	1,200	10,236.00	0.02
473	000768	中航西飞	400	10,152.00	0.02
474	002701	奥瑞金	1,700	10,115.00	0.02
475	600941	中国移动	100	10,105.00	0.02
476	600418	江淮汽车	200	9,900.00	0.02
477	301021	英诺激光	200	9,730.00	0.02
478	603767	中马传动	400	9,620.00	0.02
479	001326	联域股份	200	9,444.00	0.02
480	002048	宁波华翔	300	9,438.00	0.02
481	688116	天奈科技	200	9,430.00	0.02
482	688091	上海谊众	200	9,400.00	0.02

483	688126	沪硅产业	433	9,370.12	0.02
484	300711	广哈通信	400	9,288.00	0.02
485	300798	锦鸡股份	1,300	9,243.00	0.02
486	688236	春立医疗	400	9,152.00	0.02
487	300408	三环集团	200	9,150.00	0.02
488	688772	珠海冠宇	419	9,021.07	0.02
489	600346	恒力石化	400	9,012.00	0.02
490	002851	麦格米特	100	9,007.00	0.02
491	300593	新雷能	300	8,928.00	0.02
492	603529	爱玛科技	300	8,910.00	0.02
493	002367	康力电梯	1,100	8,866.00	0.02
494	301338	凯格精机	100	8,811.00	0.02
495	300619	金银河	200	8,780.00	0.02
496	601328	交通银行	1,200	8,700.00	0.02
497	002167	东方锆业	700	8,645.00	0.02
498	688153	唯捷创芯	228	8,581.92	0.02
499	002511	中顺洁柔	1,000	8,560.00	0.02
500	300483	首华燃气	600	8,508.00	0.02
501	002979	雷赛智能	200	8,414.00	0.02
502	688259	创耀科技	200	8,360.00	0.02
503	300353	东土科技	400	8,144.00	0.02
504	300452	山河药辅	600	8,028.00	0.02
505	301121	紫建电子	200	7,968.00	0.02
506	601398	工商银行	1,000	7,930.00	0.02
507	300100	双林股份	200	7,924.00	0.02
508	603091	众鑫股份	100	7,921.00	0.02
509	688380	中微半导	244	7,844.60	0.02
510	301073	君亭酒店	300	7,818.00	0.02
511	002056	横店东磁	400	7,800.00	0.02
512	605389	长龄液压	100	7,800.00	0.02
513	688388	嘉元科技	188	7,704.24	0.02
514	002975	博杰股份	100	7,700.00	0.02
515	000617	中油资本	800	7,680.00	0.02
516	002352	顺丰控股	200	7,664.00	0.02
517	002662	峰璟股份	1,900	7,638.00	0.02
518	603900	莱绅通灵	900	7,614.00	0.02
519	600882	妙可蓝多	300	7,542.00	0.02
520	300124	汇川技术	100	7,533.00	0.02
521	688538	和辉光电	2,813	7,482.58	0.02
522	688369	致远互联	294	7,476.42	0.02
523	600480	凌云股份	600	7,374.00	0.02

524	603256	宏和科技	200	7,362.00	0.02
525	002368	太极股份	300	7,347.00	0.02
526	002262	恩华药业	300	7,239.00	0.02
527	603728	鸣志电器	100	7,235.00	0.02
528	301160	翔楼新材	100	7,189.00	0.02
529	300199	翰宇药业	400	7,160.00	0.02
530	603663	三祥新材	200	7,070.00	0.02
531	688206	概伦电子	200	6,966.00	0.02
532	002117	东港股份	500	6,905.00	0.02
533	300687	赛意信息	300	6,891.00	0.02
534	300283	温州宏丰	900	6,777.00	0.02
535	600732	爱旭股份	500	6,700.00	0.02
536	688312	燕麦科技	200	6,636.00	0.02
537	301396	宏景科技	100	6,630.00	0.02
538	000029	深深房A	300	6,606.00	0.02
539	601187	厦门银行	900	6,606.00	0.02
540	600115	中国东航	1,100	6,600.00	0.02
541	002119	康强电子	400	6,588.00	0.02
542	600208	衢州发展	1,700	6,579.00	0.02
543	603391	力聚热能	100	6,547.00	0.02
544	605376	博迁新材	100	6,540.00	0.02
545	301498	乖宝宠物	100	6,515.00	0.02
546	600629	华建集团	300	6,510.00	0.02
547	002062	宏润建设	700	6,475.00	0.02
548	688223	晶科能源	1,146	6,463.44	0.02
549	688252	天德钰	304	6,435.68	0.01
550	300236	上海新阳	100	6,376.00	0.01
551	688082	盛美上海	36	6,337.80	0.01
552	603712	七一二	300	6,231.00	0.01
553	002182	宝武镁业	400	6,120.00	0.01
554	603969	银龙股份	600	6,066.00	0.01
555	300732	设研院	800	6,000.00	0.01
556	301536	星辰科技	100	5,991.00	0.01
557	300790	宇瞳光学	200	5,982.00	0.01
558	688280	精进电动	685	5,959.50	0.01
559	000683	博源化工	800	5,952.00	0.01
560	603815	交建股份	800	5,952.00	0.01
561	002516	旷达科技	900	5,931.00	0.01
562	600335	国机汽车	900	5,859.00	0.01
563	002677	浙江美大	700	5,845.00	0.01
564	000931	中关村	1,200	5,844.00	0.01

565	002452	长高电新	700	5,761.00	0.01
566	300002	神州泰岳	500	5,760.00	0.01
567	688063	派能科技	101	5,738.82	0.01
568	002020	京新药业	300	5,694.00	0.01
569	603338	浙江鼎力	100	5,664.00	0.01
570	002550	千红制药	700	5,502.00	0.01
571	002064	华峰化学	500	5,500.00	0.01
572	000766	通化金马	200	5,498.00	0.01
573	688378	奥来德	200	5,460.00	0.01
574	300302	同有科技	300	5,442.00	0.01
575	600900	长江电力	200	5,438.00	0.01
576	600522	中天科技	300	5,436.00	0.01
577	300623	捷捷微电	200	5,434.00	0.01
578	002246	北化股份	300	5,406.00	0.01
579	603025	大豪科技	300	5,388.00	0.01
580	002134	天津普林	200	5,358.00	0.01
581	300416	苏试试验	300	5,352.00	0.01
582	301275	汉朔科技	100	5,342.00	0.01
583	301117	佳缘科技	100	5,325.00	0.01
584	001322	箭牌家居	600	5,322.00	0.01
585	002768	国恩股份	100	5,268.00	0.01
586	002194	武汉凡谷	400	5,220.00	0.01
587	601377	兴业证券	700	5,194.00	0.01
588	688629	华丰科技	51	5,103.06	0.01
589	301320	豪江智能	300	5,091.00	0.01
590	002938	鹏鼎控股	100	5,058.00	0.01
591	603358	华达科技	100	5,050.00	0.01
592	300634	彩讯股份	200	5,046.00	0.01
593	300979	华利集团	100	5,021.00	0.01
594	601898	中煤能源	400	4,976.00	0.01
595	600577	精达股份	400	4,972.00	0.01
596	300182	捷成股份	900	4,968.00	0.01
597	002995	天地在线	300	4,956.00	0.01
598	002294	信立泰	100	4,955.00	0.01
599	000938	紫光股份	200	4,920.00	0.01
600	600580	卧龙电驱	100	4,910.00	0.01
601	301568	思泰克	100	4,853.00	0.01
602	002823	凯中精密	300	4,818.00	0.01
603	000630	铜陵有色	800	4,808.00	0.01
604	300319	麦捷科技	400	4,676.00	0.01
605	301168	通灵股份	100	4,670.00	0.01

606	300771	智莱科技	300	4,650.00	0.01
607	002709	天赐材料	100	4,633.00	0.01
608	000036	华联控股	700	4,620.00	0.01
609	600315	上海家化	200	4,504.00	0.01
610	300689	澄天伟业	100	4,495.00	0.01
611	600585	海螺水泥	200	4,372.00	0.01
612	603868	飞科电器	100	4,328.00	0.01
613	601019	山东出版	500	4,320.00	0.01
614	300111	向日葵	700	4,291.00	0.01
615	688425	铁建重工	832	4,218.24	0.01
616	605319	无锡振华	200	4,208.00	0.01
617	603806	福斯特	300	4,188.00	0.01
618	605098	行动教育	100	4,176.00	0.01
619	601857	中国石油	400	4,164.00	0.01
620	603967	中创物流	300	4,119.00	0.01
621	002612	朗姿股份	200	4,088.00	0.01
622	300575	中旗股份	700	4,081.00	0.01
623	603590	康辰药业	100	3,975.00	0.01
624	001328	登康口腔	100	3,948.00	0.01
625	603225	新凤鸣	200	3,892.00	0.01
626	603350	安乃达	100	3,809.00	0.01
627	603583	捷昌驱动	100	3,807.00	0.01
628	600226	亨通股份	700	3,731.00	0.01
629	605128	上海沿浦	100	3,686.00	0.01
630	001338	永顺泰	300	3,633.00	0.01
631	300765	新诺威	100	3,607.00	0.01
632	600998	九州通	700	3,584.00	0.01
633	600410	华胜天成	200	3,576.00	0.01
634	002179	中航光电	100	3,544.00	0.01
635	002977	天箭科技	100	3,531.00	0.01
636	601118	海南橡胶	600	3,510.00	0.01
637	003010	若羽臣	100	3,497.00	0.01
638	301397	溯联股份	100	3,483.00	0.01
639	000030	富奥股份	600	3,444.00	0.01
640	300201	海伦哲	500	3,415.00	0.01
641	002940	昂利康	100	3,352.00	0.01
642	003019	宸展光电	100	3,348.00	0.01
643	603982	泉峰汽车	400	3,348.00	0.01
644	300911	亿田智能	100	3,330.00	0.01
645	603660	苏州科达	300	3,309.00	0.01
646	000915	华特达因	100	3,304.00	0.01

647	002185	华天科技	300	3,291.00	0.01
648	600730	中国高科	300	3,282.00	0.01
649	002164	宁波东力	200	3,202.00	0.01
650	300437	清水源	200	3,194.00	0.01
651	002849	威星智能	200	3,180.00	0.01
652	600970	中材国际	300	3,117.00	0.01
653	300455	航天智装	100	3,004.00	0.01
654	002773	康弘药业	100	2,997.00	0.01
655	301230	泓博医药	100	2,987.00	0.01
656	002365	永安药业	200	2,984.00	0.01
657	000973	佛塑科技	200	2,940.00	0.01
658	300279	和晶科技	400	2,888.00	0.01
659	600323	瀚蓝环境	100	2,860.00	0.01
660	300357	我武生物	100	2,835.00	0.01
661	601929	吉视传媒	800	2,752.00	0.01
662	300747	锐科激光	100	2,703.00	0.01
663	002148	北纬科技	300	2,670.00	0.01
664	002337	赛象科技	400	2,628.00	0.01
665	000777	中核科技	100	2,585.00	0.01
666	301379	天山电子	100	2,585.00	0.01
667	601519	大智慧	200	2,574.00	0.01
668	300721	怡达股份	200	2,546.00	0.01
669	301176	逸豪新材	100	2,517.00	0.01
670	688653	康希通信	200	2,430.00	0.01
671	002539	云图控股	200	2,364.00	0.01
672	000510	新金路	200	2,316.00	0.01
673	600739	辽宁成大	200	2,236.00	0.01
674	601083	锦江航运	200	2,232.00	0.01
675	601658	邮储银行	400	2,180.00	0.01
676	300925	法本信息	100	2,124.00	0.00
677	603158	腾龙股份	200	2,120.00	0.00
678	002984	森麒麟	100	2,117.00	0.00
679	002716	湖南白银	300	2,076.00	0.00
680	300853	申昊科技	100	2,072.00	0.00
681	300221	银禧科技	200	2,064.00	0.00
682	600438	通威股份	100	2,052.00	0.00
683	603499	翔港科技	100	2,044.00	0.00
684	603057	紫燕食品	100	2,034.00	0.00
685	600206	有研新材	100	2,033.00	0.00
686	300113	顺网科技	100	2,024.00	0.00
687	600021	上海电力	100	2,002.00	0.00

688	300184	力源信息	200	1,998.00	0.00
689	002176	江特电机	200	1,948.00	0.00
690	000833	粤桂股份	100	1,946.00	0.00
691	603359	东珠生态	200	1,908.00	0.00
692	600108	亚盛集团	600	1,890.00	0.00
693	301376	致欧科技	100	1,807.00	0.00
694	603151	邦基科技	100	1,802.00	0.00
695	002454	松芝股份	200	1,742.00	0.00
696	000555	神州信息	100	1,655.00	0.00
697	300389	艾比森	100	1,623.00	0.00
698	601058	赛轮轮胎	100	1,618.00	0.00
699	002846	英联股份	100	1,614.00	0.00
700	603038	华立股份	100	1,610.00	0.00
701	300323	华灿光电	200	1,596.00	0.00
702	600195	中牧股份	200	1,574.00	0.00
703	300382	斯莱克	100	1,556.00	0.00
704	603588	高能环境	200	1,544.00	0.00
705	601919	中远海控	100	1,518.00	0.00
706	603901	永创智能	100	1,420.00	0.00
707	603309	维力医疗	100	1,359.00	0.00
708	605577	龙版传媒	100	1,307.00	0.00
709	688373	盟科药业	216	1,304.64	0.00
710	600707	彩虹股份	200	1,298.00	0.00
711	002115	三维通信	100	1,274.00	0.00
712	300559	佳发教育	100	1,261.00	0.00
713	002787	华源控股	100	1,245.00	0.00
714	600028	中国石化	200	1,236.00	0.00
715	300245	天玑科技	100	1,209.00	0.00
716	300040	九洲集团	200	1,204.00	0.00
717	002972	科安达	100	1,195.00	0.00
718	002090	金智科技	100	1,180.00	0.00
719	600817	宇通重工	100	1,137.00	0.00
720	601360	三六零	100	1,117.00	0.00
721	600710	苏美达	100	1,081.00	0.00
722	000703	恒逸石化	100	1,077.00	0.00
723	300412	迦南科技	200	1,070.00	0.00
724	002298	中电鑫龙	100	1,044.00	0.00
725	002668	TCL 智家	100	1,038.00	0.00
726	601006	大秦铁路	200	1,032.00	0.00
727	002363	隆基机械	100	1,010.00	0.00
728	002560	通达股份	100	1,008.00	0.00

729	002243	力合科创	100	995.00	0.00
730	600610	中毅达	100	993.00	0.00
731	300933	中辰股份	100	829.00	0.00
732	002406	远东传动	100	794.00	0.00
733	002027	分众传媒	100	737.00	0.00
734	000967	盈峰环境	100	734.00	0.00
735	300219	鸿利智汇	100	721.00	0.00
736	002575	群兴玩具	100	618.00	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	300502	新易盛	2,414,699.00	9.41
2	300750	宁德时代	2,352,087.00	9.17
3	300308	中际旭创	2,338,123.40	9.11
4	601899	紫金矿业	2,217,305.00	8.64
5	002463	沪电股份	1,867,672.00	7.28
6	000333	美的集团	1,754,261.00	6.84
7	600519	贵州茅台	1,479,000.00	5.77
8	002475	立讯精密	1,457,775.00	5.68
9	603259	药明康德	1,436,092.00	5.60
10	002594	比亚迪	1,422,718.00	5.55
11	300476	胜宏科技	1,419,186.00	5.53
12	002371	北方华创	1,380,131.00	5.38
13	002028	思源电气	1,264,591.00	4.93
14	688041	海光信息	1,257,207.44	4.90
15	000408	藏格矿业	1,196,818.00	4.67
16	603019	中科曙光	1,121,026.00	4.37
17	601138	工业富联	1,099,039.00	4.28
18	600660	福耀玻璃	1,094,597.00	4.27
19	600276	恒瑞医药	1,089,398.00	4.25
20	688256	寒武纪	1,080,584.00	4.21
21	601318	中国平安	1,038,640.61	4.05
22	000988	华工科技	1,032,194.00	4.02
23	600031	三一重工	1,003,098.00	3.91
24	603993	洛阳钼业	999,497.00	3.90
25	600415	小商品城	999,355.00	3.90
26	688008	澜起科技	984,924.03	3.84
27	000651	格力电器	983,592.00	3.83

28	605499	东鹏饮料	971,028.00	3.79
29	603799	华友钴业	959,948.00	3.74
30	300394	天孚通信	939,672.00	3.66
31	600066	宇通客车	932,652.00	3.64
32	603129	春风动力	922,209.00	3.59
33	300274	阳光电源	897,500.00	3.50
34	001389	广合科技	896,247.00	3.49
35	002050	三花智控	896,140.00	3.49
36	600989	宝丰能源	888,291.00	3.46
37	601336	新华保险	868,253.00	3.38
38	688183	生益电子	864,723.08	3.37
39	600036	招商银行	864,327.00	3.37
40	688521	芯原股份	851,845.08	3.32
41	300604	长川科技	842,960.00	3.29
42	000425	徐工机械	840,676.00	3.28
43	600183	生益科技	828,729.00	3.23
44	688235	百济神州	793,481.65	3.09
45	300450	先导智能	788,777.00	3.07
46	300001	特锐德	778,704.00	3.04
47	600418	江淮汽车	776,876.00	3.03
48	002920	德赛西威	773,955.00	3.02
49	600329	达仁堂	767,124.00	2.99
50	301165	锐捷网络	757,739.40	2.95
51	300866	安克创新	753,109.00	2.94
52	688278	特宝生物	750,976.33	2.93
53	300972	万辰集团	748,958.00	2.92
54	000063	中兴通讯	748,116.00	2.92
55	601689	拓普集团	746,285.00	2.91
56	603986	兆易创新	735,574.00	2.87
57	002311	海大集团	734,525.00	2.86
58	002384	东山精密	733,888.00	2.86
59	688981	中芯国际	702,068.43	2.74
60	601991	大唐发电	700,988.00	2.73
61	603699	纽威股份	700,718.00	2.73
62	301345	涛涛车业	699,678.00	2.73
63	601717	中创智领	694,447.00	2.71
64	688582	芯动联科	693,463.25	2.70
65	002352	顺丰控股	682,119.00	2.66
66	002001	新和成	675,980.00	2.63
67	600011	华能国际	669,462.00	2.61
68	300926	博俊科技	662,334.00	2.58

69	600795	国电电力	661,354.00	2.58
70	600941	中国移动	656,516.00	2.56
71	000977	浪潮信息	655,511.00	2.56
72	688498	源杰科技	651,217.77	2.54
73	002241	歌尔股份	650,926.00	2.54
74	600298	安琪酵母	650,796.00	2.54
75	002142	宁波银行	649,457.00	2.53
76	000301	东方盛虹	649,396.00	2.53
77	689009	九号公司	648,094.57	2.53
78	600732	爱旭股份	639,802.00	2.49
79	000568	泸州老窖	635,342.00	2.48
80	600926	杭州银行	634,710.00	2.47
81	002625	光启技术	634,548.00	2.47
82	603296	华勤技术	627,850.00	2.45
83	603596	伯特利	627,452.00	2.45
84	601058	赛轮轮胎	627,147.00	2.44
85	000975	山金国际	623,565.00	2.43
86	601319	中国人保	622,967.00	2.43
87	002414	高德红外	620,768.00	2.42
88	600160	巨化股份	619,064.00	2.41
89	600309	万华化学	616,640.00	2.40
90	002517	恺英网络	613,930.00	2.39
91	601128	常熟银行	610,988.00	2.38
92	000100	TCL 科技	608,738.00	2.37
93	000963	华东医药	608,580.00	2.37
94	603379	三美股份	606,945.00	2.37
95	301080	百普赛斯	602,973.40	2.35
96	002472	双环传动	602,474.00	2.35
97	688025	杰普特	601,041.07	2.34
98	300054	鼎龙股份	596,136.00	2.32
99	000719	中原传媒	590,258.00	2.30
100	002947	恒铭达	586,928.00	2.29
101	688800	瑞可达	585,203.93	2.28
102	600096	云天化	584,143.00	2.28
103	002130	沃尔核材	583,825.00	2.28
104	301061	匠心家居	582,545.00	2.27
105	002595	豪迈科技	579,097.00	2.26
106	688392	骄成超声	576,113.07	2.25
107	688372	伟测科技	575,022.59	2.24
108	688578	艾力斯	572,783.89	2.23
109	002487	大金重工	566,284.00	2.21

110	000729	燕京啤酒	564,652.00	2.20
111	000338	潍柴动力	562,616.00	2.19
112	300953	震裕科技	557,947.00	2.17
113	301035	润丰股份	556,662.00	2.17
114	603893	瑞芯微	552,693.00	2.15
115	688472	阿特斯	550,245.90	2.14
116	002273	水晶光电	542,696.00	2.12
117	603173	福斯达	542,373.00	2.11
118	600563	法拉电子	541,314.00	2.11
119	002396	星网锐捷	540,323.00	2.11
120	003021	兆威机电	538,996.00	2.10
121	000792	盐湖股份	538,498.00	2.10
122	600919	江苏银行	538,207.00	2.10
123	600988	赤峰黄金	537,736.00	2.10
124	300857	协创数据	530,986.00	2.07
125	300408	三环集团	530,044.00	2.07
126	300760	迈瑞医疗	527,241.00	2.06
127	000858	五粮液	524,279.00	2.04
128	688696	极米科技	524,265.20	2.04
129	605305	中际联合	522,660.00	2.04
130	002415	海康威视	521,503.00	2.03
131	601061	中信金属	520,861.00	2.03
132	002959	小熊电器	519,182.00	2.02
133	002056	横店东磁	518,732.00	2.02
134	688208	道通科技	517,930.30	2.02
135	601009	南京银行	516,790.00	2.01
136	600690	海尔智家	513,595.00	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	300750	宁德时代	2,440,563.74	9.51
2	300502	新易盛	1,845,345.00	7.19
3	300308	中际旭创	1,795,830.60	7.00
4	002463	沪电股份	1,595,148.00	6.22
5	002594	比亚迪	1,594,459.00	6.22
6	601899	紫金矿业	1,542,293.95	6.01
7	000333	美的集团	1,484,688.00	5.79
8	603259	药明康德	1,253,033.00	4.88
9	688256	寒武纪	1,249,496.48	4.87

10	002475	立讯精密	1,237,866.00	4.83
11	300476	胜宏科技	1,218,246.00	4.75
12	600519	贵州茅台	1,189,546.00	4.64
13	002028	思源电气	1,179,943.00	4.60
14	600660	福耀玻璃	1,098,090.00	4.28
15	000651	格力电器	1,069,695.00	4.17
16	300274	阳光电源	1,051,714.00	4.10
17	000988	华工科技	1,031,387.00	4.02
18	300001	特锐德	1,011,603.00	3.94
19	000408	藏格矿业	1,011,358.00	3.94
20	300866	安克创新	1,003,414.00	3.91
21	600031	三一重工	997,755.00	3.89
22	600276	恒瑞医药	952,211.00	3.71
23	002371	北方华创	949,237.20	3.70
24	002001	新和成	924,399.00	3.60
25	688183	生益电子	919,468.72	3.58
26	688008	澜起科技	900,413.18	3.51
27	605499	东鹏饮料	889,021.00	3.47
28	601138	工业富联	881,690.00	3.44
29	300604	长川科技	879,710.60	3.43
30	688041	海光信息	871,333.19	3.40
31	601058	赛轮轮胎	865,329.00	3.37
32	603893	瑞芯微	851,911.00	3.32
33	002050	三花智控	851,120.00	3.32
34	600066	宇通客车	847,029.00	3.30
35	601991	大唐发电	846,821.00	3.30
36	300394	天孚通信	839,410.20	3.27
37	300450	先导智能	832,822.00	3.25
38	600036	招商银行	783,725.00	3.05
39	002920	德赛西威	766,177.00	2.99
40	688235	百济神州	764,011.08	2.98
41	600941	中国移动	757,581.00	2.95
42	600418	江淮汽车	755,705.00	2.95
43	000425	徐工机械	750,556.00	2.93
44	688578	艾力斯	748,068.27	2.92
45	600096	云天化	746,645.00	2.91
46	600329	达仁堂	744,210.00	2.90
47	600989	宝丰能源	740,716.00	2.89
48	600183	生益科技	730,182.00	2.85
49	000063	中兴通讯	729,721.00	2.84
50	603993	洛阳钼业	719,382.00	2.80

51	603129	春风动力	718,586.00	2.80
52	601318	中国平安	711,086.00	2.77
53	601689	拓普集团	704,430.00	2.75
54	601336	新华保险	698,987.00	2.72
55	002273	水晶光电	694,246.00	2.71
56	603501	豪威集团	692,842.00	2.70
57	603799	华友钴业	689,654.00	2.69
58	000975	山金国际	680,843.00	2.65
59	600732	爱旭股份	679,428.00	2.65
60	301165	锐捷网络	676,851.00	2.64
61	600160	巨化股份	676,784.00	2.64
62	002595	豪迈科技	675,817.00	2.63
63	002352	顺丰控股	673,653.00	2.63
64	002384	东山精密	671,225.00	2.62
65	300972	万辰集团	668,182.00	2.60
66	300433	蓝思科技	657,671.00	2.56
67	600415	小商品城	657,455.00	2.56
68	002414	高德红外	656,387.00	2.56
69	603019	中科曙光	655,301.00	2.55
70	688582	芯动联科	652,228.65	2.54
71	688800	瑞可达	650,502.47	2.54
72	002142	宁波银行	650,232.00	2.53
73	688981	中芯国际	644,898.94	2.51
74	601717	中创智领	640,254.00	2.50
75	002241	歌尔股份	640,035.00	2.49
76	600011	华能国际	639,785.00	2.49
77	601319	中国人保	636,614.00	2.48
78	688392	骄成超声	633,162.65	2.47
79	688521	芯原股份	629,429.40	2.45
80	300408	三环集团	624,220.00	2.43
81	000568	泸州老窖	622,906.00	2.43
82	603986	兆易创新	621,265.00	2.42
83	002947	恒铭达	620,376.00	2.42
84	002472	双环传动	615,762.00	2.40
85	001389	广合科技	607,863.00	2.37
86	000963	华东医药	607,494.00	2.37
87	301080	百普赛斯	606,704.00	2.36
88	600919	江苏银行	605,256.00	2.36
89	688498	源杰科技	603,093.23	2.35
90	600298	安琪酵母	593,837.00	2.31
91	601919	中远海控	590,219.00	2.30

92	600926	杭州银行	588,859.00	2.30
93	688025	杰普特	587,942.28	2.29
94	000977	浪潮信息	586,628.00	2.29
95	301345	涛涛车业	585,727.00	2.28
96	301061	匠心家居	581,731.50	2.27
97	003021	兆威机电	578,662.00	2.26
98	002714	牧原股份	576,910.00	2.25
99	605305	中际联合	574,532.00	2.24
100	601127	赛力斯	571,720.00	2.23
101	688372	伟测科技	566,586.04	2.21
102	000338	潍柴动力	565,593.00	2.20
103	603699	纽威股份	564,177.00	2.20
104	300054	鼎龙股份	563,738.00	2.20
105	002415	海康威视	563,157.00	2.20
106	601061	中信金属	560,713.00	2.19
107	603296	华勤技术	558,519.00	2.18
108	000858	五粮液	555,581.00	2.17
109	688472	阿特斯	553,746.08	2.16
110	000719	中原传媒	552,002.00	2.15
111	601989	中国重工	550,508.36	2.15
112	002311	海大集团	548,703.00	2.14
113	603596	伯特利	546,612.00	2.13
114	301035	润丰股份	544,254.00	2.12
115	600563	法拉电子	544,102.00	2.12
116	000729	燕京啤酒	539,413.00	2.10
117	000792	盐湖股份	535,318.00	2.09
118	605117	德业股份	534,366.00	2.08
119	000725	京东方A	525,830.00	2.05
120	601128	常熟银行	522,905.80	2.04
121	689009	九号公司	520,881.53	2.03
122	002916	深南电路	519,388.00	2.02
123	002353	杰瑞股份	517,692.00	2.02
124	601009	南京银行	517,297.00	2.02
125	600547	山东黄金	515,758.00	2.01
126	600988	赤峰黄金	515,419.00	2.01
127	002056	横店东磁	513,673.00	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	425,823,015.14
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	417,224,420.10
--------------	----------------

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	1,414,770.19	3.29
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）	3,313.03	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,418,083.22	3.29

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	019773	25 国债 08	8,000	808,077.15	1.88
2	019766	25 国债 01	6,000	606,693.04	1.41
3	123263	鼎捷转债	12	1,740.04	0.00
4	118062	天准转债	10	1,572.99	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。

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

本基金根据合同约定,不允许投资国债期货。

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	6,545.09
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	317,844.75
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	324,389.84

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

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

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(%)
富国新兴成长量化精选混合(LOF)A	2,612	10,329.14	4,454,816.84	16.51	22,524,907.45	83.49
富国新兴成长量化精选混合(LOF)C	48	44,980.00	—	—	2,159,039.89	100.00
合计	2,660	10,954.42	4,454,816.84	15.29	24,683,947.34	84.71

9.2 期末上市基金前十名持有人

富国新兴成长量化精选混合(LOF)A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	吴胜	955,533.00	17.31
2	黄文胜	250,925.00	4.55
3	吴秀菁	201,128.00	3.64
4	章兆利	199,128.00	3.61
5	黄文利	193,897.00	3.51
6	王星宇	161,577.00	2.93
7	杭州倍致私募基金管理有限公司	132,752.00	2.41
8	吴璇绚	126,611.00	2.29
9	杨凯	116,823.00	2.12
10	李子熠	92,113.00	1.67

9.3 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	334,065.21	1.2382
	富国新兴成长量化精选混合(LOF)C	—	—
	合计	334,065.21	1.1465

9.4 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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)

本公司高级管理人员、基金投资和研究 部门负责人持有本开放式基金	富国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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	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	—
报告期期初基金份额总额	21,507,944.69	1,259,147.26
本报告期基金总申购份额	14,412,483.86	2,879,217.99
减：本报告期基金总赎回份额	8,940,704.26	1,979,325.36
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	26,979,724.29	2,159,039.89

§ 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0万元人民币，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	—	—	—	—	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
东财证券	2	18,506,546.99	2.20	7,511.75	2.20	—
方正证券	2	7,936,125.00	0.94	3,221.07	0.94	—
高盛中国	1	—	—	—	—	—
光大证券	2	8,770,496.01	1.04	3,560.16	1.04	—
广发证券	2	—	—	—	—	—
国海证券	2	134,499,284.20	15.96	54,595.13	15.96	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—

国泰海通	4	210,785,704.18	25.01	85,560.06	25.01	—
国泰君安	2	23,017,501.13	2.73	9,343.73	2.73	—
国投证券	2	14,086,194.36	1.67	5,717.58	1.67	—
国信证券	2	51,573,229.28	6.12	20,933.64	6.12	—
海通证券	2	20,537,411.75	2.44	8,335.94	2.44	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—
华源证券	2	37,148,823.96	4.41	15,078.85	4.41	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	15,873,260.50	1.88	6,443.62	1.88	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	177,374,642.86	21.04	71,999.82	21.04	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	80,953,254.65	9.60	32,858.56	9.60	—
西南证券	2	—	—	—	—	—
湘财证券	2	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	1	29,705,450.66	3.52	12,058.24	3.52	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
中航证券	2	8,144,930.79	0.97	3,306.24	0.97	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
中泰证券	2	4,033,476.20	0.48	1,637.05	0.48	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中信证券	3	—	—	—	—	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

注：1、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：渤海证券（001193、35676）。本报告期本基金新增券商交易单元：华源证券（019189、63156）。

2、国泰海通证券有限公司（简称“国泰海通”）是由国泰君安证券股份有限公司与海通证券股份有限公司于2025年3月14日合并组建而成。上表显示的国泰海通数据为自2025年3月15日至2025年12月31日通过国泰海通证券席位交易的情况，本期海通证券、国泰君安数据为自2025年1月1日至2025年3月14日通过海通证券、国泰君安席位交易的情况。

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	600,306.00	24.88	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	599,683.00	24.85	1,110,000.00	31.04	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰海通	403,276.44	16.71	1,466,000.00	41.00	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
国投证券	—	—	350,000.00	9.79	—	—
国信证券	3,540.00	0.15	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
华源证券	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—
上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	204,175.51	8.46	200,000.00	5.59	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	102,011.17	4.23	—	—	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	499,762.00	20.71	450,000.00	12.58	—	—
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	—	—	—	—	—	—

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	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	规定披露媒介	2025年01月02日
2	富国基金管理有限公司关于变更主要股东事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告	规定披露媒介	2025年01月21日
3	富国基金管理有限公司关于公司主要股东变更的公告	规定披露媒介	2025年03月18日
4	富国基金管理有限公司关于富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）A类基金份额二级市场交易价格溢价风险提示公告	规定披露媒介	2025年06月13日
5	富国基金管理有限公司关于富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）A类基金份额二级市场交易价格溢价风险提示公告	规定披露媒介	2025年06月16日
6	关于富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）A类基金份额二级市场交易价格溢价风险提示公告	规定披露媒介	2025年12月25日
7	关于富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）A类基金份额二级市场交易价格溢价风险提示公告	规定披露媒介	2025年12月26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

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	2025-07-04 至 2025-08-18	4,279,965.75	1,700,839.47	1,700,839.47	4,279,965.75	14.69%
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§ 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新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）的文件 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	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 。