

# 富国创新企业灵活配置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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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

§ 1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§ 2 基金简介 .....	6
2.1 基金基本情况 .....	6
2.2 基金产品说明 .....	6
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	7
2.5 其他相关资料 .....	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	8
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	8
3.2 基金净值表现 .....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	13
§ 4 管理人报告 .....	14
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告 .....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	19
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.....	19
§ 5 托管人报告 .....	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	20
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.....	20
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.....	20
§ 6 审计报告 .....	21
6.1 审计报告基本信息 .....	21
6.2 审计报告的基本内容 .....	21
§ 7 年度财务报告 .....	23
7.1 资产负债表 .....	23

7.2 利润表 .....	24
7.3 净资产变动表 .....	25
7.4 报表附注 .....	26
§ 8 投资组合报告 .....	59
8.1 期末基金资产组合情况 .....	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	59
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.....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	68
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.....	68
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.....	68
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.....	68
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.....	68
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	68
8.12 投资组合报告附注 .....	68
§ 9 基金份额持有人信息 .....	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	70
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	70
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	70
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.....	70
§ 10 开放式基金份额变动 .....	72
§ 11 重大事件揭示 .....	73
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	73
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.....	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	73
11.4 基金投资策略的改变 .....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	73
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	75
11.8 其他重大事件 .....	77
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	78
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 .....	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	78

§ 13 备查文件目录 ..... 79

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国创新企业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）	
基金简称	富国创新企业灵活配置混合（LOF）	
基金主代码	501077	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年06月11日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	344,122,188.61份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2019年10月28日	
下属分级基金的基金简称	富国创新企业灵活配置混合（LOF）A	富国创新企业灵活配置混合（LOF）C
下属分级基金场内简称	富国创新企业LOF	—
下属分级基金的交易代码	501077	015849
报告期末下属分级基金的份额总额	267,837,180.62份	76,285,007.99份

注：本基金于2022年6月13日由富国科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满更名而来，C类份额于同日新增。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于创新主题的上市公司发行的股票，通过精选个股和风险控制，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金界定的创新主题相关证券包括创新主题相关公司发行的股票、存托凭证和债券。本基金采用“自上而下”的资产配置方法确定各类资产的配置比例。本基金投资股票时，将采取子行业配置策略、个股精选策略、科创板股票投资策略等策略；本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资；在债券投资方面，本基金将采用久期控制下的主动性投资策略；本基金的创新主题相关证券的界定、港股通标的股票投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证TMT产业主题指数收益率*60%+中证全债指数收益率*40%
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，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	富国基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛
	联系电话	021-20361818
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn
客户服务电话	95105686、4008880688	400-61-95555
传真	021-20361616	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	裴长江	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

## 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) 富国创新企业灵活配置混合 (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	247,709,621.15	56,835,042.49	-132,169,621.60
本期利润	303,659,640.04	142,914,877.72	-69,630,678.44
加权平均基金份额本期利润	0.8645	0.2833	-0.1248
本期加权平均净值利润率	40.11%	21.39%	-8.00%
本期基金份额净值增长率	50.97%	24.82%	-5.14%
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	314,584,345.46	167,052,799.08	155,549,348.57
期末可供分配基金份额利润	1.1745	0.4677	0.2765
期末基金资产净值	714,113,114.20	630,804,328.80	796,057,729.14
期末基金份额净值	2.6662	1.7661	1.4149
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	166.62%	76.61%	41.49%

##### (2) 富国创新企业灵活配置混合 (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	59,508,185.52	7,288,948.76	-3,195,308.70
本期利润	50,809,454.64	6,344,816.25	-4,541,123.87
加权平均基金份额本期利润	0.5070	0.1943	-0.6088
本期加权平均净值利润率	23.99%	14.81%	-39.38%
本期基金份额净值增长率	50.05%	24.07%	-5.68%
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	85,780,801.56	8,194,737.42	1,575,806.41
期末可供分配基金份额利润	1.1245	0.4434	0.2638
期末基金资产净值	199,098,348.74	32,145,472.72	8,373,615.76
期末基金份额净值	2.6099	1.7394	1.4019
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	34.71%	-10.22%	-27.64%

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) 富国创新企业灵活配置混合（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	3.68%	1.19%	-1.75%	1.15%	5.43%	0.04%
过去六个月	38.48%	1.31%	22.04%	1.15%	16.44%	0.16%
过去一年	50.97%	1.59%	26.37%	1.12%	24.60%	0.47%
过去三年	78.76%	2.08%	54.54%	1.16%	24.22%	0.92%
过去五年	11.65%	1.98%	42.88%	1.06%	-31.23%	0.92%
自基金合同生效起至今	166.62%	1.95%	118.36%	1.00%	48.26%	0.95%

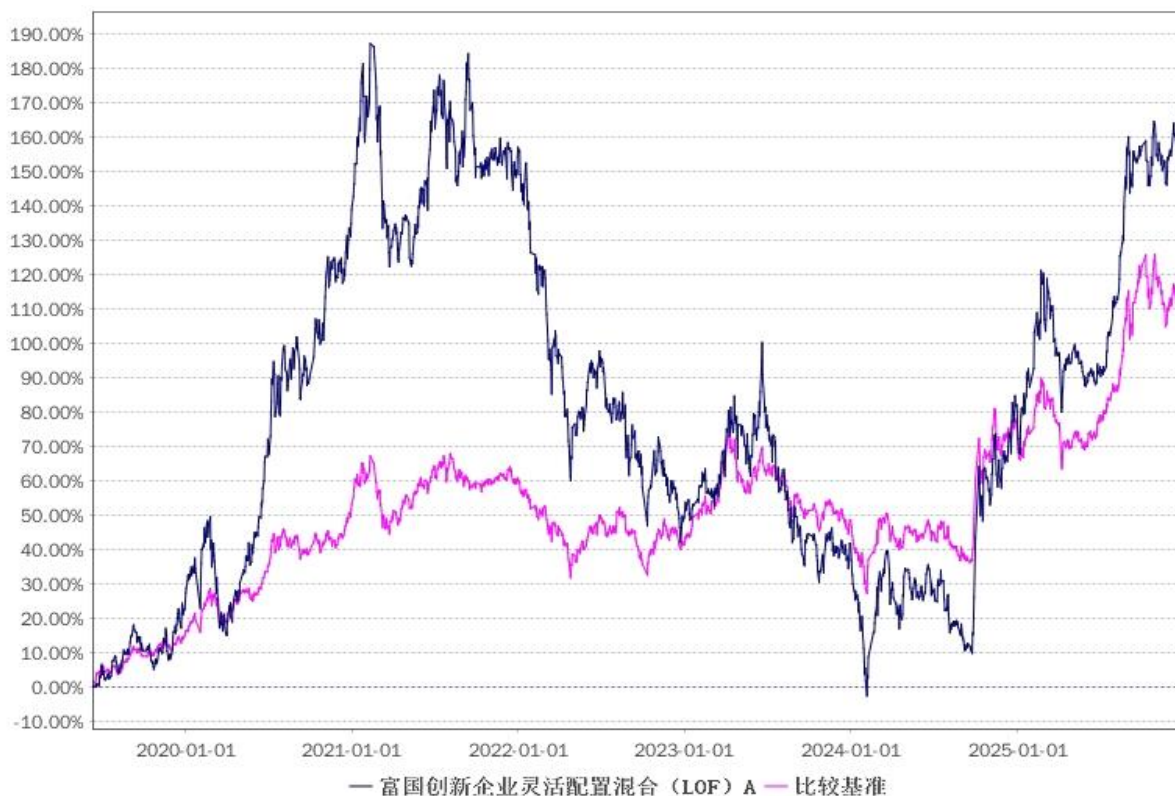
##### (2) 富国创新企业灵活配置混合（LOF）C

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	3.52%	1.19%	-1.75%	1.15%	5.27%	0.04%
过去六个月	38.05%	1.31%	22.04%	1.15%	16.01%	0.16%
过去一年	50.05%	1.59%	26.37%	1.12%	23.68%	0.47%
过去三年	75.59%	2.08%	54.54%	1.16%	21.05%	0.92%
自基金分级生效日起至今	34.71%	2.04%	50.16%	1.11%	-15.45%	0.93%

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

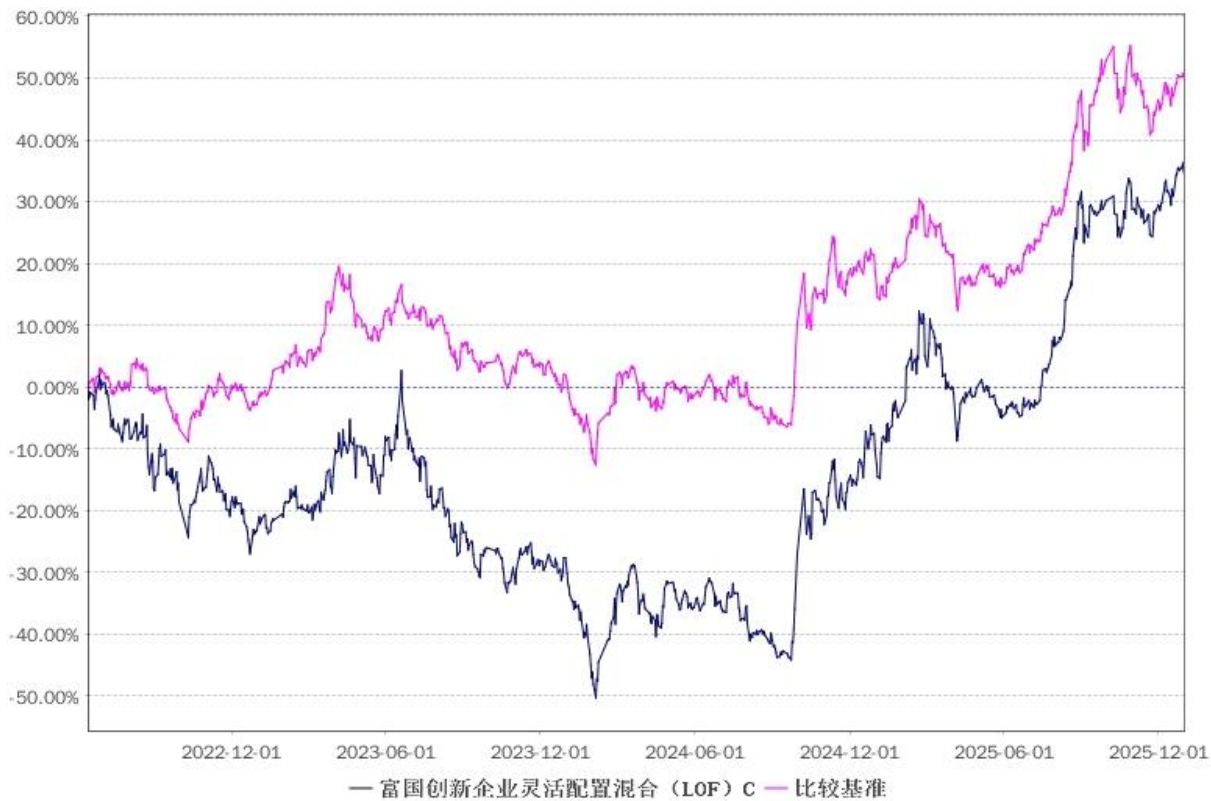
(1) 自基金合同生效以来富国创新企业灵活配置混合（LOF）A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2019 年 6 月 11 日成立，建仓期 6 个月，从 2019 年 6 月 11 日起至 2019 年 12 月 10 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创新企业灵活配置混合 (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

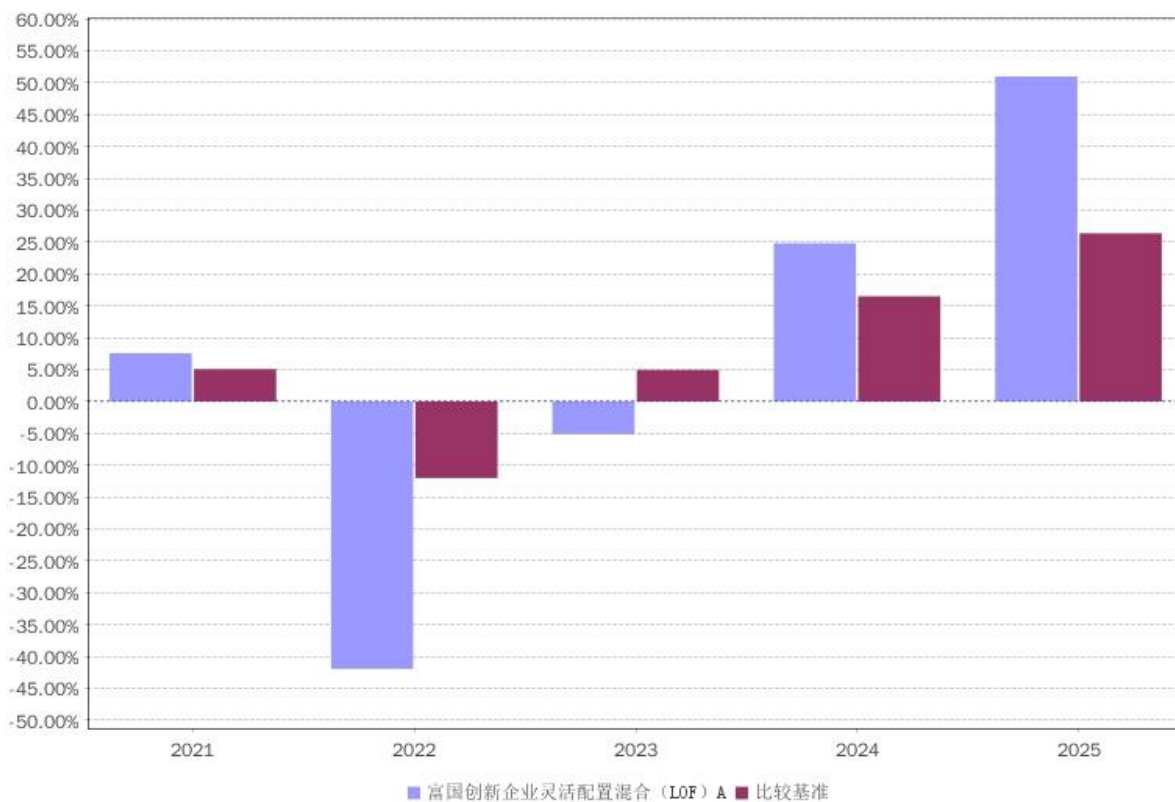


注：1、截止日期为 2025 年 12 月 31 日。

2、本基金自 2022 年 6 月 13 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) 过去五年以来富国创新企业灵活配置混合 (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) 过去五年以来富国创新企业灵活配置混合 (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 2022 年 6 月 14 日起有基金份额。2022 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) 富国创新企业灵活配置混合（LOF）A

注：过往三年本基金份额未进行利润分配。

(2) 富国创新企业灵活配置混合（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《国泰君安证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，存续公司正式更名为“国泰海通证券股份有限公司”。

截至 2025 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 422 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙权	本基金现任基金经理	2022-07-28	—	13	硕士，曾任兴业证券资产管理有限公司研究员；自2015年4月加入富国基金管理有限公司，历任行业研究员、高级行业研究员、权益投资经理助理、权益基金经理；现任富国基金权益投资部高级权益基金经理。自2022年02月起任富国新兴产业股票型证券投资基金基金经理；自2022年07月起任富国创新企业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原富国科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金）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遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国创新企业灵活配置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》、《富国创新企业灵活配置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辦法的要求，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2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

本基金投资目标定位于新兴产业，力争打造一只持续跑赢基准的主动基金，为投资人分享中国新兴产业快速发展的红利。回顾 2025 年，上证指数上涨 18.41%，深证成指上涨 29.87%，创业板指上涨 49.57%。本产品 2025 年净值上涨 50.97%，有显著超额收益，主要投资于人工智能和半导体行业。

### 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创新企业灵活配置混合（LOF）A 为 2.6662 元，富国创新企业灵活配置混合（LOF）C 为 2.6099 元；份额累计净值富国创新企业灵活配置混合（LOF）A 为 2.6662 元，富国创新企业灵活配置混合（LOF）C 为 2.6099 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国创新企业灵活配置混合（LOF）A 为 50.97%，富国创新企业灵活配置混合（LOF）C 为 50.05%；同期业绩比较基准收益率情况：富国创新企业灵活配置混合（LOF）A 为 26.37%，富国创新企业灵活配置混合（LOF）C 为 26.37%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后期，产品将继续专注于人工智能等新兴产业。全球人工智能行业快速发展，海外科技公司的大模型能力不断进步，已经开始产生经济收益，资本开支保持高速增长。国内配套的制造业有显著的全球竞争力，光模块等公司跟随海外产业快速发展，新技术推动算力市场空间大幅增长。全球半导体产业景气度走强，存储供不应求，人工智能相关芯片超预期的拉动晶圆厂等产能，导致其他行业的产能被挤压，芯片进入价格上行周期。存储和晶圆代工加大扩产力度，上游设备和材料也进入上行周期。国内人工智能产业同样进入快速增长期，国产芯片能力提升，填补海外芯片被制裁的空缺。人工智能的应用开始推广，聊天、编程、多模态等软件产品渗透率快速提升，智能硬件终端不断摸索，智能驾驶和机器人不断进步，都将带来相遇的投资机会。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

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

### 一、深化合规文化建设与员工行为管理

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

## 二、完善制度流程与系统化建设

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

## 三、强化投资合规与风险管理

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

## 四、落实反洗钱与投资者保护工作要求

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

## 五、加强内外部审计与监督

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

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

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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_B304 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	富国创新企业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了富国创新企业灵活配置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，后附的富国创新企业灵活配置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，公允反映了富国创新企业灵活配置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，我们独立于富国创新企业灵活配置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>富国创新企业灵活配置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	<p>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创新企业灵活配置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创新企业灵活配置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,就可能对富国创新企业灵活配置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创新企业灵活配置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：富国创新企业灵活配置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
<b>资 产：</b>		
货币资金	537,214,306.86	72,399,186.06
结算备付金	802,248.82	3,232,554.20
存出保证金	464,650.74	417,739.95
交易性金融资产	364,772,754.96	571,637,110.97
其中：股票投资	364,772,754.96	571,637,110.97
基金投资	—	—
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	17,459,253.78	21,957,716.02
应收股利	—	—
应收申购款	1,768,915.53	773,904.88
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	922,482,130.69	670,418,212.08
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>		
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	4.58	756,901.56
应付赎回款	7,482,537.68	4,624,771.89
应付管理人报酬	943,721.04	696,932.40
应付托管费	157,286.85	116,155.40
应付销售服务费	103,702.60	16,665.26
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	583,415.00	1,256,984.05
负债合计	9,270,667.75	7,468,410.56
<b>净资产：</b>		
实收基金	344,122,188.61	375,648,548.98
其他综合收益	—	—
未分配利润	569,089,274.33	287,301,252.54
净资产合计	913,211,462.94	662,949,801.52
负债和净资产总计	922,482,130.69	670,418,212.08

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.6537 元，基金份额总额 344,122,188.61 份。其中：富国创新企业灵活配置混合（LOF）A 份额净值 2.6662 元，份额总额 267,837,180.62 份；富国创新企业灵活配置混合（LOF）C 份额净值 2.6099 元，份额总额 76,285,007.99 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国创新企业灵活配置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)
<b>一、营业总收入</b>	369,446,529.08	159,663,744.16
1. 利息收入	1,408,460.42	385,659.91
其中：存款利息收入	1,408,460.42	385,659.91
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）	318,840,634.08	72,235,483.10
其中：股票投资收益	315,831,454.69	68,687,558.92
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	3,009,179.39	3,547,924.18
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）	47,251,288.01	85,135,702.72

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,946,146.57	1,906,898.43
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>14,977,434.40</b>	<b>10,404,050.19</b>
1. 管理人报酬	11,565,461.77	8,521,965.80
2. 托管费	1,927,576.99	1,420,327.63
3. 销售服务费	1,251,740.75	255,975.80
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	—	—
8. 其他费用	232,654.89	205,780.96
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>354,469,094.68</b>	<b>149,259,693.97</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>354,469,094.68</b>	<b>149,259,693.97</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>	<b>—</b>	<b>—</b>
<b>六、综合收益总额</b>	<b>354,469,094.68</b>	<b>149,259,693.97</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：富国创新企业灵活配置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	375,648,548.98	287,301,252.54	662,949,801.52
二、本期期初净资产	375,648,548.98	287,301,252.54	662,949,801.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-31,526,360.37	281,788,021.79	250,261,661.42
（一）、综合收益总额	—	354,469,094.68	354,469,094.68
（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）	-31,526,360.37	-72,681,072.89	-104,207,433.26
其中：1. 基金申购款	411,220,356.10	464,126,578.46	875,346,934.56
2. 基金赎回款	-442,746,716.47	-536,807,651.35	-979,554,367.82
（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	344,122,188.61	569,089,274.33	913,211,462.94
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	568,591,862.25	235,839,482.65	804,431,344.90
二、本期期初净资产	568,591,862.25	235,839,482.65	804,431,344.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-192,943,313.27	51,461,769.89	-141,481,543.38
（一）、综合收益总额	—	149,259,693.97	149,259,693.97
（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）	-192,943,313.27	-97,797,924.08	-290,741,237.35
其中：1. 基金申购款	349,647,901.59	128,198,819.39	477,846,720.98
2. 基金赎回款	-542,591,214.86	-225,996,743.47	-768,587,958.33
（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	375,648,548.98	287,301,252.54	662,949,801.52

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

富国创新企业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由富国科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金变更而来，富国科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资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[2019]934 号《关于准予富国科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于 2019 年 6 月 11 日生效，首次设立募集规模为 988,526,086.57 份基金份额。根据基金管理人于 2022 年 6 月 8 日发布的《关于富国科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满、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》，本基金的封闭运作期于 2022 年 6 月 12 日届满，本基金自 2022 年 6 月 13 日起自动转为上市开放式基金（LOF），并接受场外、场内申购赎回，基金名称将变更为“富国创新企业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。同时，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规的规定

和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定自 2022 年 6 月 13 日起，对富国科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司（A 类）和富国基金管理有限公司（C 类），基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含科创板、主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、衍生工具（股指期货、国债期货等）、货币市场工具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：封闭运作期内，本基金投资于股票及存托凭证的资产占基金资产的比例为 0-100%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%）。其中，投资于本基金界定的科创主题的证券占非现金基金资产的比例不低于 80%。封闭运作期内，在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

转为上市开放式基金（LOF）后，基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 0%-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%），其中，投资于本基金定义的创新主题相关证券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和国债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，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金业绩比较基准为：中证 TMT 产业主题指数收益率\*60%+中证全债指数收益率\*40%。

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

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

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

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

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

(7) 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) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统下的 A 类基金份额的基金份额持有人和登记在富国基金管理有限公司登记系统下的 C 类基金份额的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。登记在上海证券账户下的 A 类基金份额的基金份额持有人，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上海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) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于该类基金份额面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类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。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在履行适当程序后，可对基金收益分配原则进行调整。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

#### 7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

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

分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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

##### 2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融

债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

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

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

### 3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

### 4 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的

规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 5 个人所得税

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

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

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

#### 6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2025年12月31日)	上年度末 (2024年12月31日)
活期存款	537,214,306.86	72,399,186.06
等于：本金	537,156,478.03	72,388,733.30
加：应计利息	57,828.83	10,452.76
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	537,214,306.86	72,399,186.06

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	202,135,058.76	—	364,772,754.96	162,637,696.20
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	202,135,058.76	—	364,772,754.96	162,637,696.20
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	456,250,702.78	—	571,637,110.97	115,386,408.19
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	456,250,702.78	—	571,637,110.97	115,386,408.19

#### 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	9,567.63	1,345.49
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	530,847.37	1,212,638.56
其中：交易所市场	530,847.37	1,212,638.56
银行间市场	—	—
应付利息	—	—
预提审计费	43,000.00	43,000.00
合计	583,415.00	1,256,984.05

#### 7.4.7.7 实收基金

富国创新企业灵活配置混合（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	357,167,306.99	357,167,306.99
本期申购	176,483,922.46	176,483,922.46
本期赎回（以“-”号填列）	-265,814,048.83	-265,814,048.83
本期末	267,837,180.62	267,837,180.62

富国创新企业灵活配置混合（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	18,481,241.99	18,481,241.99
本期申购	234,736,433.64	234,736,433.64
本期赎回（以“-”号填列）	-176,932,667.64	-176,932,667.64
本期末	76,285,007.99	76,285,007.99

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

富国创新企业灵活配置混合（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	167,052,799.08	106,584,222.73	273,637,021.81
本期期初	167,052,799.08	106,584,222.73	273,637,021.81
本期利润	247,709,621.15	55,950,018.89	303,659,640.04
本期基金份额交易产生的变动数	-100,178,074.77	-30,842,653.50	-131,020,728.27
其中：基金申购款	123,431,694.50	82,979,994.34	206,411,688.84
基金赎回款	-223,609,769.27	-113,822,647.84	-337,432,417.11
本期已分配利润	—	—	—
本期末	314,584,345.46	131,691,588.12	446,275,933.58

富国创新企业灵活配置混合（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	8,194,737.42	5,469,493.31	13,664,230.73
本期期初	8,194,737.42	5,469,493.31	13,664,230.73
本期利润	59,508,185.52	-8,698,730.88	50,809,454.64
本期基金份额交易产生的变动数	18,077,878.62	40,261,776.76	58,339,655.38
其中：基金申购款	149,958,017.12	107,756,872.50	257,714,889.62
基金赎回款	-131,880,138.50	-67,495,095.74	-199,375,234.24
本期已分配利润	—	—	—
本期末	85,780,801.56	37,032,539.19	122,813,340.75

#### 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	1,367,395.09	313,768.75
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	33,764.78	65,020.25
其他	7,300.55	6,870.91
合计	1,408,460.42	385,659.91

#### 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	5,516,037,567.85	3,954,479,630.69
减：卖出股票成本总额	5,190,659,288.69	3,878,591,368.35
减：交易费用	9,546,824.47	7,200,703.42
买卖股票差价收入	315,831,454.69	68,687,558.92

#### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖债券差价收入。

#### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 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	3,009,179.39	3,547,924.18
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	3,009,179.39	3,547,924.18

#### 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	47,251,288.01	85,135,702.72
股票投资	47,251,288.01	85,135,702.72
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
基金投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他	—	—
2. 衍生工具	—	—
权证投资	—	—
3. 其他	—	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—	—
合计	47,251,288.01	85,135,702.72

#### 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	上年度可比期间（2024年01月01日
----	----------------------	---------------------

	12月31日)	至2024年12月31日)
基金赎回费收入	1,846,786.00	1,876,103.48
基金转换费收入	99,360.57	30,794.95
合计	1,946,146.57	1,906,898.43

#### 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	43,000.00	43,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
银行费用	39,321.63	22,155.79
债券账户维护费	18,000.00	18,000.00
其他	12,333.26	2,625.17
合计	232,654.89	205,780.96

#### 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金

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	590,993,280.81	5.66	—	—
申万宏源	199,468,222.74	1.91	294,111,673.54	3.88

###### 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

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债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 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	231,459.35	5.54	3,317.72	0.62
申万宏源	80,964.04	1.94	—	—
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（%）
申万宏源	179,527.42	4.32	45,400.26	3.74

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	11,565,461.77	8,521,965.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,037,151.51	2,543,414.88
应支付基金管理人的净管理费	7,528,310.26	5,978,550.92

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

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

##### 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	1,927,576.99	1,420,327.63
----------------	--------------	--------------

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。

### 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		
	富国创新企业灵活配置混合（LOF）A	富国创新企业灵活配置混合（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	—	441,113.01	441,113.01
国泰海通证券股份有限公司	—	195.43	195.43
合计	—	441,308.44	441,308.44

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		
	富国创新企业灵活配置混合（LOF）A	富国创新企业灵活配置混合（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	—	28,394.95	28,394.95
合计	—	28,394.95	28,394.95

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，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

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

##### 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

富国创新企业灵活配置混合（LOF）C：

份额单位：份

关联方名称	本期末（2025年12月31日）		上期末（2024年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	1,676,864.72	2.20	—	—

#### 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
招商银行股份有限公司	537,214,306.86	1,367,395.09	72,399,186.06	313,768.75

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2025年01月01日至2025年12月31日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰海通证券股份有限公司	688729	屹唐股份	IPO网下申购	35,050	296,172.50

注：本基金上年度可比期间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

本基金无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

#### 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

##### 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301449	天溯计量	2025-12-16	6个月	新股限售	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	—

301638	南网数字	2025-11-11	6个月	新股限售	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	—
301667	纳百川	2025-12-10	6个月	新股限售	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	—
301687	新广益	2025-12-24	6个月	新股限售	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	—
688727	恒坤新材	2025-11-11	6个月	新股限售	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	—
688729	屹唐股份	2025-07-01	6个月	新股限售	8.45	24.28	3,505	29,617.25	85,101.40	—
688759	必贝特	2025-10-21	6个月	新股限售	17.78	25.11	2,789	49,588.42	70,031.79	—
688783	西安奕材	2025-10-20	9个月	新股限售	8.62	18.39	41,988	361,936.56	772,159.32	—
688790	昂瑞微	2025-12-09	9个月	新股限售	83.06	117.07	2,319	192,616.14	271,485.33	—
688795	摩尔线程	2025-11-26	9个月	新股限售	114.28	416.02	3,396	388,094.88	1,412,803.92	—
688796	百奥赛图	2025-12-02	6个月	新股限售	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	—
688802	沐曦股份	2025-12-09	9个月	新股限售	104.66	399.40	2,629	275,151.14	1,050,022.60	—
688805	健信超导	2025-12-17	6个月	新股限售	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	—
688807	优迅股份	2025-12-10	6个月	新股限售	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	—
688809	强一股份	2025-12-23	6个月	新股限售	85.09	203.31	259	22,038.31	52,657.29	—

#### 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	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688012	中微公司	2025年12月19日	重大事项停牌	272.72	2026年01月05日	278.00	33,838.00	9,270,519.23	9,228,299.36	—

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一

家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

#### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本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**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的信用债。

#### **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	537,214,306.86	—	—	—	537,214,306.86
结算备付金	802,248.82	—	—	—	802,248.82
存出保证金	464,650.74	—	—	—	464,650.74
交易性金融资产	—	—	—	364,772,754.96	364,772,754.96
应收清算款	—	—	—	17,459,253.78	17,459,253.78
应收申购款	—	—	—	1,768,915.53	1,768,915.53
资产总计	538,481,206.42	—	—	384,000,924.27	922,482,130.69
负债					
应付清算款	—	—	—	4.58	4.58
应付赎回款	—	—	—	7,482,537.68	7,482,537.68
应付管理人报酬	—	—	—	943,721.04	943,721.04
应付托管费	—	—	—	157,286.85	157,286.85
应付销售服务费	—	—	—	103,702.60	103,702.60
其他负债	—	—	—	583,415.00	583,415.00
负债总计	—	—	—	9,270,667.75	9,270,667.75
利率敏感度缺口	538,481,206.42	—	—	374,730,256.52	913,211,462.94
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	72,399,186.06	—	—	—	72,399,186.06
结算备付金	3,232,554.20	—	—	—	3,232,554.20
存出保证金	417,739.95	—	—	—	417,739.95
交易性金融资产	—	—	—	571,637,110.97	571,637,110.97
应收清算款	—	—	—	21,957,716.02	21,957,716.02
应收申购款	5,162.00	—	—	768,742.88	773,904.88
资产总计	76,054,642.21	—	—	594,363,569.87	670,418,212.08
负债					
应付清算款	—	—	—	756,901.56	756,901.56
应付赎回款	—	—	—	4,624,771.89	4,624,771.89
应付管理人报酬	—	—	—	696,932.40	696,932.40
应付托管费	—	—	—	116,155.40	116,155.40

应付销售服务费	—	—	—	16,665.26	16,665.26
其他负债	—	—	—	1,256,984.05	1,256,984.05
负债总计	—	—	—	7,468,410.56	7,468,410.56
利率敏感度缺口	76,054,642.21	—	—	586,895,159.31	662,949,801.52

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末（2025年12月31日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
交易性金融资产	—	10,414,100.00	—	—	10,414,100.00
资产合计	—	10,414,100.00	—	—	10,414,100.00
以外币计价的负债					
—	—	—	—	—	—
负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	—	10,414,100.00	—	—	10,414,100.00
项目	上年度末（2024年12月31日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
交易性金融资产	—	94,439,395.16	—	—	94,439,395.16
资产合计	—	94,439,395.16	—	—	94,439,395.16
以外币计价的负债					
—	—	—	—	—	—
负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	—	94,439,395.16	—	—	94,439,395.16

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化1%，其他变量不变；(2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口。
----	--

	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）
分析	港币相对人民币贬值1%	-104,141.00	-944,393.95
	港币相对人民币升值1%	104,141.00	944,393.95

#### 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，所面临的最大的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	364,772,754.96	39.94	571,637,110.97	86.23
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	364,772,754.96	39.94	571,637,110.97	86.23

##### 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。
	对资产负债表日基金资产净值的

	相关风险变量的变动	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）
分析	1. 业绩比较基准增加 1%	10,947,470.26	11,573,984.82
	2. 业绩比较基准减少 1%	-10,947,470.26	-11,573,984.82

#### 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	351,706,828.98	571,637,110.97
第二层次	9,228,299.36	—
第三层次	3,837,626.62	—
合计	364,772,754.96	571,637,110.97

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第

一层次,并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次,确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位:人民币元

项目	本期(2025年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	—	1,414,181.76	1,414,181.76
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	178,018.57	178,018.57
当期利得或损失总额	—	2,601,463.43	2,601,463.43
其中:计入损益的利得或损失	—	2,601,463.43	2,601,463.43
期末余额	—	3,837,626.62	3,837,626.62
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	—	2,462,140.49	2,462,140.49
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	—	32,771.75	32,771.75
当期购买	—	—	—
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	27,763.40	27,763.40
当期利得或损失总额	—	-5,008.35	-5,008.35
其中:计入损益的利得或损失	—	-5,008.35	-5,008.35
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	—	—	—

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	3,837,626.62	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2567-2.4833	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
—	—	—	—	—	—

#### 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	364,772,754.96	39.54
	其中：股票	364,772,754.96	39.54
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	538,016,555.68	58.32
8	其他各项资产	19,692,820.05	2.13
9	合计	922,482,130.69	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 10,414,100.00 元，占资产净值比例为 1.14%。

### 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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	257,238,229.21	28.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	96,810,484.26	10.60
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—

M	科学研究和技术服务业	309,941.49	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	354,358,654.96	38.80

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	10,414,100.00	1.14
合计	10,414,100.00	1.14

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

### 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	139,300	84,973,000.00	9.30
2	688256	寒武纪	54,891	74,407,495.05	8.15
3	300502	新易盛	164,100	70,707,408.00	7.74
4	688486	龙迅股份	295,748	21,977,033.88	2.41
5	603228	景旺电子	266,400	19,471,176.00	2.13
6	301611	珂玛科技	188,400	16,151,532.00	1.77
7	301005	超捷股份	91,600	14,222,732.00	1.56
8	002396	星网锐捷	352,300	10,674,690.00	1.17
9	06869	长飞光纤光缆	223,000	10,414,100.00	1.14
10	688012	中微公司	33,838	9,228,299.36	1.01
11	002484	江海股份	304,400	9,040,680.00	0.99
12	002837	英维克	84,100	8,989,449.00	0.98
13	688049	炬芯科技	163,912	8,621,771.20	0.94
14	688795	摩尔线程	3,396	1,412,803.92	0.15
15	688802	沐曦股份	2,629	1,050,022.60	0.11
16	688783	西安奕材	41,988	772,159.32	0.08
17	688809	强一股份	2,584	649,717.29	0.07
18	688790	昂瑞微	3,864	499,805.43	0.05
19	301638	南网数字	23,213	425,955.33	0.05
20	688807	优迅股份	1,303	237,273.96	0.03
21	688796	百奥赛图	4,222	217,699.15	0.02

22	301687	新广益	1,942	135,202.09	0.01
23	301667	纳百川	1,501	116,955.07	0.01
24	688805	健信超导	2,643	108,786.97	0.01
25	301449	天溯计量	1,118	92,242.34	0.01
26	688729	屹唐股份	3,505	85,101.40	0.01
27	688759	必贝特	2,789	70,031.79	0.01
28	688727	恒坤新材	563	19,631.81	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	09988	阿里巴巴-W	145,800,364.06	21.99
2	01810	小米集团-W	120,328,496.58	18.15
3	00700	腾讯控股	92,808,260.66	14.00
4	688256	寒武纪	79,146,818.81	11.94
5	01024	快手-W	76,633,408.67	11.56
6	688041	海光信息	73,738,758.45	11.12
7	01347	华虹半导体	58,273,595.48	8.79
7	688347	华虹公司	9,996,445.97	1.51
8	300502	新易盛	68,068,438.04	10.27
9	300394	天孚通信	63,511,849.20	9.58
10	00981	中芯国际	59,748,442.12	9.01
11	03738	阜博集团	56,264,606.71	8.49
12	603986	兆易创新	55,901,828.80	8.43
13	688486	龙迅股份	54,673,047.01	8.25
14	688668	鼎通科技	54,412,168.61	8.21
15	688123	聚辰股份	50,174,148.08	7.57
16	301489	思泉新材	49,142,023.18	7.41
17	301629	矽电股份	49,004,500.75	7.39
18	688052	纳芯微	47,862,760.79	7.22
19	09992	泡泡玛特	45,482,206.91	6.86
20	688141	杰华特	45,127,385.49	6.81
21	300476	胜宏科技	44,323,786.00	6.69
22	03690	美团-W	41,518,747.76	6.26
23	002463	沪电股份	41,448,873.60	6.25
24	688591	泰凌微	40,050,669.70	6.04
25	603918	金桥信息	39,489,663.00	5.96
26	603228	景旺电子	38,825,571.20	5.86
27	603009	北特科技	38,775,724.00	5.85

28	02498	速腾聚创	38,698,716.24	5.84
29	301161	唯万密封	38,556,174.21	5.82
30	01801	信达生物	38,267,620.36	5.77
31	688095	福昕软件	38,008,463.66	5.73
32	002222	福晶科技	37,415,181.50	5.64
33	002940	昂利康	36,452,903.62	5.50
34	688220	翱捷科技	35,656,342.39	5.38
35	01530	三生制药	34,891,520.79	5.26
36	06869	长飞光纤光缆	34,861,278.99	5.26
37	688475	萤石网络	34,250,078.22	5.17
38	688536	思瑞浦	33,928,835.98	5.12
39	301269	华大九天	33,624,051.00	5.07
40	301191	菲菱科思	32,712,724.00	4.93
41	603809	豪能股份	32,289,994.64	4.87
42	688049	炬芯科技	31,223,345.68	4.71
43	603579	荣泰健康	31,090,656.50	4.69
44	300811	铂科新材	30,738,256.48	4.64
45	603337	杰克科技	30,334,549.50	4.58
46	688519	南亚新材	29,962,885.18	4.52
47	300226	上海钢联	29,833,013.93	4.50
48	002484	江海股份	29,530,097.00	4.45
49	300548	长芯博创	29,192,823.79	4.40
50	300378	鼎捷数智	29,030,556.00	4.38
51	688361	中科飞测	28,830,419.54	4.35
52	01357	美图公司	27,711,337.70	4.18
53	300308	中际旭创	27,599,952.00	4.16
54	300738	奥飞数据	27,590,050.40	4.16
55	688048	长光华芯	27,019,545.97	4.08
56	603596	伯特利	26,598,970.40	4.01
57	603859	能科科技	25,564,745.08	3.86
58	002558	巨人网络	24,824,972.40	3.74
59	603893	瑞芯微	23,860,466.36	3.60
60	300938	信测标准	23,441,434.49	3.54
61	688498	源杰科技	23,041,825.78	3.48
62	300033	同花顺	22,984,458.00	3.47
63	688369	致远互联	22,725,772.51	3.43
64	688630	芯碁微装	22,669,336.34	3.42
65	01316	耐世特	22,568,046.48	3.40
66	600986	浙文互联	22,353,618.60	3.37
67	688010	福光股份	22,334,125.04	3.37
68	688448	磁谷科技	22,322,700.21	3.37

69	300491	通合科技	22,290,859.00	3.36
70	00285	比亚迪电子	22,236,283.82	3.35
71	688658	悦康药业	21,926,794.51	3.31
72	688037	芯源微	21,835,072.04	3.29
73	301379	天山电子	21,786,399.60	3.29
74	09878	汇通达网络	21,600,209.65	3.26
75	300383	光环新网	21,130,761.00	3.19
76	688008	澜起科技	20,713,502.92	3.12
77	688019	安集科技	20,571,810.79	3.10
78	603501	豪威集团	20,523,851.00	3.10
79	603109	神驰机电	20,079,949.00	3.03
80	688318	财富趋势	20,011,094.55	3.02
81	002156	通富微电	19,860,923.00	3.00
82	300010	豆神教育	19,850,899.00	2.99
83	00175	吉利汽车	19,782,876.57	2.98
84	688719	爱科赛博	19,715,647.78	2.97
85	002384	东山精密	19,600,789.00	2.96
86	02410	同源康医药—B	19,599,246.94	2.96
87	02015	理想汽车—W	19,451,262.93	2.93
88	600487	亨通光电	19,330,048.00	2.92
89	02018	瑞声科技	19,249,639.38	2.90
90	301200	大族数控	19,246,516.40	2.90
91	688484	南芯科技	19,184,647.24	2.89
92	688692	达梦数据	19,182,921.44	2.89
93	300475	香农芯创	19,127,841.00	2.89
94	00763	中兴通讯	18,775,629.59	2.83
95	301556	托普云农	18,630,505.00	2.81
96	600521	华海药业	18,628,362.68	2.81
97	300900	广联航空	18,592,817.34	2.80
98	688720	艾森股份	18,498,189.65	2.79
99	688702	盛科通信	18,418,526.59	2.78
100	300204	舒泰神	18,348,752.20	2.77
101	600208	衢州发展	18,166,206.87	2.74
102	603005	晶方科技	17,802,514.80	2.69
103	301308	江波龙	17,672,778.00	2.67
104	601089	福元医药	17,570,668.00	2.65
105	300454	深信服	17,539,035.00	2.65
106	688502	茂莱光学	17,509,633.54	2.64
107	603171	税友股份	16,448,453.89	2.48
108	01057	浙江世宝	15,912,330.05	2.40
109	688314	康拓医疗	15,535,432.64	2.34

110	688103	国力电子	15,476,434.65	2.33
111	688337	普源精电	14,972,544.22	2.26
112	688279	峰昭科技	14,387,550.41	2.17
113	688136	科兴制药	14,355,333.83	2.17
114	000526	学大教育	13,976,173.00	2.11
115	300390	天华新能	13,967,103.50	2.11
116	09636	九方智投控股	13,952,245.54	2.10
117	603728	鸣志电器	13,819,719.00	2.08
118	688716	中研股份	13,800,969.46	2.08
119	02157	乐普生物-B	13,756,490.25	2.08
120	688392	骄成超声	13,755,633.31	2.07
121	300570	太辰光	13,730,300.00	2.07
122	301325	曼恩斯特	13,533,516.00	2.04

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	688256	寒武纪	147,630,328.47	22.27
2	09988	阿里巴巴-W	138,261,405.68	20.86
3	00700	腾讯控股	135,990,602.59	20.51
4	01810	小米集团-W	126,356,569.17	19.06
5	603986	兆易创新	119,394,551.00	18.01
6	688041	海光信息	105,189,047.06	15.87
7	00981	中芯国际	86,410,842.82	13.03
7	688981	中芯国际	17,690,452.62	2.67
8	01024	快手-W	81,228,079.77	12.25
9	688486	龙迅股份	66,652,068.69	10.05
10	01347	华虹半导体	54,212,121.37	8.18
10	688347	华虹公司	12,395,140.31	1.87
11	300394	天孚通信	62,197,215.48	9.38
12	03738	阜博集团	60,653,923.31	9.15
13	688361	中科飞测	57,342,442.33	8.65
14	301489	思泉新材	56,919,924.90	8.59
15	00285	比亚迪电子	55,324,240.94	8.35
16	603893	瑞芯微	54,949,389.29	8.29
17	688668	鼎通科技	50,618,286.76	7.64
18	002463	沪电股份	49,347,977.90	7.44
19	301629	矽电股份	49,059,893.03	7.40
20	688123	聚辰股份	48,552,476.34	7.32
21	688141	杰华特	48,371,062.14	7.30

22	09992	泡泡玛特	48,361,866.02	7.29
23	688052	纳芯微	47,874,963.16	7.22
24	300502	新易盛	47,302,638.80	7.14
25	01357	美图公司	46,552,824.26	7.02
26	300476	胜宏科技	46,413,717.00	7.00
27	688591	泰凌微	46,333,957.39	6.99
28	603918	金桥信息	45,581,368.00	6.88
29	601689	拓普集团	45,383,274.65	6.85
30	01801	信达生物	42,771,924.64	6.45
31	688279	峰昭科技	41,752,628.47	6.30
32	603009	北特科技	40,315,328.00	6.08
33	603579	荣泰健康	39,765,496.32	6.00
34	03690	美团-W	39,010,487.12	5.88
35	688220	翱捷科技	38,851,341.54	5.86
36	002222	福晶科技	37,870,321.80	5.71
37	688095	福昕软件	37,721,822.79	5.69
38	688049	炬芯科技	37,691,332.51	5.69
39	002940	昂利康	36,456,990.02	5.50
40	301161	唯万密封	36,123,358.00	5.45
41	02498	速腾聚创	35,999,306.89	5.43
42	688692	达梦数据	35,907,416.77	5.42
43	300548	长芯博创	35,338,832.25	5.33
44	301269	华大九天	34,699,282.00	5.23
45	01530	三生制药	33,541,516.28	5.06
46	688475	萤石网络	32,702,624.27	4.93
47	688536	思瑞浦	32,397,904.43	4.89
48	688019	安集科技	32,140,301.20	4.85
49	603809	豪能股份	31,066,752.62	4.69
50	002384	东山精密	30,947,693.00	4.67
51	688702	盛科通信	30,583,039.16	4.61
52	301191	菲菱科思	30,549,840.00	4.61
53	300811	铂科新材	30,429,847.00	4.59
54	300378	鼎捷数智	30,320,446.00	4.57
55	600208	衢州发展	29,898,727.86	4.51
56	603596	伯特利	29,564,015.00	4.46
57	300226	上海钢联	29,546,313.00	4.46
58	603337	杰克科技	29,517,471.00	4.45
59	688519	南亚新材	29,156,177.81	4.40
60	603171	税友股份	29,150,959.00	4.40
61	300570	太辰光	28,994,201.00	4.37
62	300204	舒泰神	28,417,898.23	4.29

63	300308	中际旭创	28,273,863.00	4.26
64	688048	长光华芯	28,120,844.79	4.24
65	603859	能科科技	27,284,706.76	4.12
66	300738	奥飞数据	26,041,742.00	3.93
67	06869	长飞光纤光缆	25,580,874.66	3.86
68	002558	巨人网络	25,437,300.07	3.84
69	301626	苏州天脉	24,535,851.76	3.70
70	300491	通合科技	24,157,818.80	3.64
71	002484	江海股份	23,674,053.00	3.57
72	688658	悦康药业	23,659,291.09	3.57
73	300870	欧陆通	23,468,277.00	3.54
74	01316	耐世特	22,882,335.31	3.45
75	688010	福光股份	22,794,981.89	3.44
76	688448	磁谷科技	22,708,791.98	3.43
77	688630	芯碁微装	22,648,345.48	3.42
78	688008	澜起科技	22,612,324.67	3.41
79	300033	同花顺	22,366,181.00	3.37
80	920522	纳科诺尔	22,259,424.65	3.36
81	603501	豪威集团	22,152,968.70	3.34
82	300454	深信服	21,925,850.00	3.31
83	688037	芯源微	21,703,444.61	3.27
84	600487	亨通光电	21,039,927.00	3.17
85	301379	天山电子	20,914,483.20	3.15
86	688369	致远互联	20,707,979.42	3.12
87	600986	浙文互联	20,561,784.30	3.10
88	603228	景旺电子	20,503,113.00	3.09
89	688498	源杰科技	20,469,758.45	3.09
90	688484	南芯科技	20,325,164.71	3.07
91	002156	通富微电	20,260,093.00	3.06
92	688719	爱科赛博	20,025,280.50	3.02
93	688615	合合信息	19,568,907.08	2.95
94	603109	神驰机电	19,495,076.00	2.94
95	301556	托普云农	19,443,320.00	2.93
96	300010	豆神教育	19,312,759.00	2.91
97	688318	财富趋势	19,304,371.27	2.91
98	301200	大族数控	19,278,479.97	2.91
99	603367	辰欣药业	18,724,124.00	2.82
100	688502	茂莱光学	18,644,509.42	2.81
101	688018	乐鑫科技	18,622,437.99	2.81
102	300475	香农芯创	18,489,276.06	2.79
103	02018	瑞声科技	18,424,869.82	2.78

104	603005	晶方科技	18,273,749.00	2.76
105	300900	广联航空	18,232,250.00	2.75
106	300383	光环新网	18,078,036.00	2.73
107	688720	艾森股份	17,962,283.90	2.71
108	02015	理想汽车—W	17,867,444.87	2.70
109	600521	华海药业	17,488,575.42	2.64
110	00763	中兴通讯	17,306,622.05	2.61
111	603728	鸣志电器	17,237,013.00	2.60
112	00175	吉利汽车	16,618,799.94	2.51
113	601089	福元医药	16,444,223.00	2.48
114	02410	同源康医药—B	16,440,076.04	2.48
115	688521	芯原股份	16,390,144.21	2.47
116	688337	普源精电	16,296,935.62	2.46
117	09878	汇通达网络	16,224,255.70	2.45
118	688392	骄成超声	16,027,204.73	2.42
119	688314	康拓医疗	15,539,857.87	2.34
120	688103	国力电子	15,536,134.32	2.34
121	02157	乐普生物—B	15,210,979.41	2.29
122	000526	学大教育	15,160,756.00	2.29
123	688449	联芸科技	14,902,682.31	2.25
124	301308	江波龙	14,653,416.00	2.21
125	300938	信测标准	14,445,244.38	2.18
126	02382	舜宇光学科技	14,370,733.95	2.17
127	01057	浙江世宝	14,181,180.98	2.14
128	301325	曼恩斯特	14,018,014.20	2.11
129	001203	大中矿业	13,977,139.00	2.11
130	688716	中研股份	13,814,783.76	2.08
131	688136	科兴制药	13,789,994.67	2.08
132	301377	鼎泰高科	13,625,415.00	2.06

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	4,936,543,644.67
卖出股票收入（成交）总额	5,516,037,567.85

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

## 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

本基金根据基金合同的约定，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	464,650.74
2	应收清算款	17,459,253.78
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,768,915.53
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	19,692,820.05

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688012	中微公司	9,228,299.36	1.01	筹划重大事项

### 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(%)
富国创新企业灵活配置混合(LOF)A	21,329	12,557.42	1,359,292.28	0.51	266,477,888.34	99.49
富国创新企业灵活配置混合(LOF)C	2,531	30,140.26	59,821,376.99	78.42	16,463,631.00	21.58
合计	23,860	14,422.56	61,180,669.27	17.78	282,941,519.34	82.22

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

富国创新企业灵活配置混合(LOF)A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	孙建生	1,250,029.00	3.01
2	陈桂生	944,424.00	2.27
3	蓝朗力	839,200.00	2.02
4	张德芬	616,900.00	1.48
5	陈灿全	466,500.00	1.12
6	宁德俄	454,456.00	1.09
7	浙江大众进出口有限公司	437,160.00	1.05
8	方银珠	396,300.00	0.95
9	肖慧	385,300.00	0.93
10	廖新东	384,400.00	0.92

### 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	富国创新企业灵活配置混合(LOF)A	1,312,200.02	0.4899
	富国创新企业灵活配置混合(LOF)C	344,265.23	0.4513
	合计	1,656,465.25	0.4814

### 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)
	富国创新企业灵活配置混合(LOF)A	10~50

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	富国创新企业灵活配置混合（LOF）C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	富国创新企业灵活配置混合（LOF）A	0
	富国创新企业灵活配置混合（LOF）C	10~50
	合计	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	富国创新企业灵活配置混合 (LOF) A	富国创新企业灵活配置混合 (LOF) C
基金合同生效日(2019年06月11日)基金份额总额	988,526,086.57	—
报告期期初基金份额总额	357,167,306.99	18,481,241.99
本报告期基金总申购份额	176,483,922.46	234,736,433.64
减：本报告期基金总赎回份额	265,814,048.83	176,932,667.64
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	267,837,180.62	76,285,007.99

## § 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，基金托管人无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 4.3 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 23 年。

### 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	富国基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 11 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正
受到调查或处罚等措施的原因	公司治理、合规内控、投资运作、人员管理、其他问题（销售管理、财务管理）

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

### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

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

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

### 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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

## 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	—	—	—	—	—
东方证券	2	603,453,463.45	5.78	240,714.03	5.77	—
国金证券	2	969,840,421.41	9.28	389,094.34	9.32	—
国盛证券	2	1,633,529,936.40	15.63	644,382.85	15.43	—
国泰海通	1	590,993,280.81	5.66	231,459.35	5.54	—
国泰君安	1	23,021,370.99	0.22	9,344.43	0.22	—
华创证券	1	138,431,272.94	1.32	56,189.03	1.35	—
华泰证券	2	259,736,780.95	2.49	105,425.80	2.53	—
民生证券	1	1,161,005,146.94	11.11	471,253.50	11.29	—
申万宏源	2	199,468,222.74	1.91	80,964.04	1.94	—

信达证券	2	160,083,719.07	1.53	63,940.82	1.53	—
招商证券	2	590,102,060.01	5.65	239,266.40	5.73	—
中金公司	1	783,307,603.96	7.50	317,945.04	7.62	—
中信建投	2	1,808,779,544.44	17.31	731,741.56	17.53	—
中信山东	1	—	—	—	—	—
中信证券	3	1,527,336,662.24	14.62	593,466.11	14.21	—
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：德邦证券（012563），野村证券（009925）。本报告期本基金新增券商交易单元：申万宏源（720194）。

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，本期国泰君安数据为自2025年1月1日至2025年3月14日通过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	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰海通	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—

中信山东	—	—	—	—	—	—
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
2	关于富国创新企业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2025年02月19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旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2025年07月02日
5	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	规定披露媒介	2025年08月04日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

### § 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科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的文件 2、富国创新企业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同 3、富国创新企业灵活配置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、富国创新企业灵活配置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： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。