

富国创新企业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

二〇二六年第2季度报告

2026年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2026年07月21日

§ 1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及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责任。

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 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	富国创新企业灵活配置混合（LOF）	
场内简称	富国创新企业 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	
报告期末基金份额总额	254,059,854.12 份	
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。	
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	
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	214,516,484.89 份	39,543,369.23 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 04 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	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
1. 本期已实现收益	122,582,107.63	19,841,697.22
2. 本期利润	243,109,764.62	39,017,759.16
3. 加权平均基金份额本期利润	1.0811	1.0436
4. 期末基金资产净值	783,357,589.71	140,933,680.51
5. 期末基金份额净值	3.6517	3.5640

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。

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	净值增长率 ①	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	41.73%	1.31%	31.85%	1.42%	9.88%	-0.11%
过去六个月	36.96%	1.20%	29.54%	1.32%	7.42%	-0.12%
过去一年	89.66%	1.26%	58.09%	1.23%	31.57%	0.03%
过去三年	104.17%	1.96%	73.92%	1.20%	30.25%	0.76%
过去五年	33.52%	1.93%	72.32%	1.09%	-38.80%	0.84%
过去七年	255.40%	1.91%	171.31%	1.03%	84.09%	0.88%
自基金合同生效 起至今	265.17%	1.91%	182.86%	1.02%	82.31%	0.89%

（2）富国创新企业灵活配置混合（LOF）C

阶段	净值增长率 ①	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	41.52%	1.31%	31.85%	1.42%	9.67%	-0.11%
过去六个月	36.56%	1.20%	29.54%	1.32%	7.02%	-0.12%

过去一年	88.52%	1.26%	58.09%	1.23%	30.43%	0.03%
过去三年	100.51%	1.96%	73.92%	1.20%	26.59%	0.76%
自基金分级生效 日起至今	83.96%	1.96%	94.52%	1.14%	-10.56%	0.82%

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

(1) 富国创新企业灵活配置混合（LOF）A



注：1、截止日期为2026年6月30日。

(2) 富国创新企业灵活配置混合（LOF）C



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

本报告期内公司旗下基金严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 报告期内基金的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。全球 AI 产业发展趋势良好，头部大模型公司的 ARR 保持快速增长，资本开支持续投入。AI 算力主要分为计算、存储、传输三个方向，国内硬科技资产充分享受全球算力的投入。计算环节，国产 GPU 等芯片公司在国内开始放量，市场替代空间大。存储环节，全球存储超级大周期，国内存储公司加大新产能投产，有利于国内的设备材料公司。传输环节，国内在光模块、PCB 领域保持领先的全球竞争力，享受海外市场的发展。大模型方面，国内公司凭借性价比优势开始在全球市场发挥作用，预计也会带来相应的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

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 41.73%，富国创新企业灵活配置混合（LOF）C 为 41.52%；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 31.85%，富国创新企业灵活配置混合（LOF）C 为 31.85%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	391,715,309.71	41.96
	其中：股票	391,715,309.71	41.96
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	521,620,984.60	55.88
7	其他资产	20,184,954.52	2.16
8	合计	933,521,248.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	36,149.82	0.00
C	制造业	322,524,614.98	34.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	388,860.93	0.04
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	68,765,683.98	7.44
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	—	—
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	391,715,309.71	42.38

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	59,100	75,057,000.00	8.12
2	688256	寒武纪	36,137	57,658,390.35	6.24
3	300502	新易盛	67,760	41,130,320.00	4.45
4	002655	共达电声	880,800	40,516,800.00	4.38
5	688361	中科飞测	76,859	33,049,370.00	3.58
6	002384	东山精密	106,100	27,835,335.00	3.01
7	688072	拓荆科技	28,741	23,912,512.00	2.59
8	688808	联讯仪器	8,054	18,583,751.82	2.01
9	300604	长川科技	39,200	13,383,664.00	1.45
10	688536	思瑞浦	30,507	11,107,293.63	1.20

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	310,076.72
2	应收证券清算款	17,280,227.41
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	2,594,650.39
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	20,184,954.52

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	688072	拓荆科技	23,912,512.00	2.59	筹划重大事项
2	688808	联讯仪器	258,245.79	0.03	新股限售

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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
报告期期初基金份额总额	238,153,476.54	36,339,432.89
报告期期间基金总申购份额	30,057,080.95	11,292,329.75
减：报告期期间基金总赎回份额	53,694,072.60	8,088,393.41
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
报告期期末基金份额总额	214,516,484.89	39,543,369.23

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 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

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

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>。

富国基金管理有限公司
2026 年 07 月 21 日