

富国创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

二〇二四年第1季度报告

2024年03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

报告送出日期：2024年04月22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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 月 18 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况转型后

基金简称	富国创业板 ETF 联接	
基金主代码	161022	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 01 月 31 日	
报告期末基金份额总额	3, 104, 390, 740. 28 份	
投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。	
投资策略	<p>本基金以目标 ETF 为主要投资标的，方便投资者通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。本基金的资产配置策略、目标 ETF 投资策略、成份股、备选成份股（均含存托凭证）投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券（含分离交易可转债）及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略详见法律文件。</p>	
业绩比较基准	创业板指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。	
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	
下属分级基金的基金简称	富国创业板 ETF 联接 A	富国创业板 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	161022	013277
报告期末下属分级基金的份额总额	1, 395, 010, 777. 12 份	1, 709, 379, 963. 16 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	富国创业板交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159971
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2019年06月11日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019年07月02日
基金管理人名称	富国基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	富国创业板交易型开放式指数证券投资基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。富国创业板交易型开放式指数证券投资基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.20%，年跟踪误差不超过 2%。组合复制策略方面，富国创业板交易型开放式指数证券投资基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。富国创业板交易型开放式指数证券投资基金的组合复制策略、替代性策略、存托凭证投资策略、衍生品投资策略、参与转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	创业板指数收益率
风险收益特征	富国创业板交易型开放式指数证券投资基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。富国创业板交易型开放式指数证券投资基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.1 基金基本情况转型前

基金简称	富国创业板指数
场内简称	创业板指数 LOF
基金主代码	161022
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2013年09月12日	
报告期末基金份额总额	3,248,432,339.57份	
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪创业板指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。	
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资,依托富国量化投资平台,利用长期稳定的风险模型和交易成本模型,按照成份股在创业板指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪创业板指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。本基金的资产配置策略、股票投资组合构建策略、存托凭证投资策略、债券、金融衍生工具投资策略详见法律文件。	
业绩比较基准	95%×创业板指数收益率 + 5%×银行人民币活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。	
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	
下属分级基金的基金简称	富国创业板指数 A	富国创业板指数 C
下属分级基金场内简称	创业板指数 LOF	—
下属分级基金的交易代码	161022	013277
报告期末下属分级基金的份额总额	1,369,701,264.38份	1,878,731,075.19份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现转型后

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024年01月31日-2024年03月31日）	
	富国创业板ETF联接A	富国创业板ETF联接C
1. 本期已实现收益	-163,523,318.47	-217,400,973.10
2. 本期利润	108,298,627.67	146,350,405.96
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0795	0.0831
4. 期末基金资产净值	926,484,497.70	1,129,908,990.52
5. 期末基金份额净值	0.6641	0.6610

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) 富国创业板ETF联接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
自基金转型日起至今	13.91%	1.77%	14.05%	1.79%	-0.14%	-0.02%

(2) 富国创业板ETF联接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
自基金转型日起至今	13.77%	1.77%	14.05%	1.79%	-0.28%	-0.02%

3.2.2 自基金转型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率变动的比较

(1) 自基金转型以来富国创业板 ETF 联接 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2024年3月31日。

2、本基金于2024年1月31日转型，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月，从2024年1月31日起至2024年7月30日，本期末建仓期还未结束。

(2) 自基金转型以来富国创业板 ETF 联接 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 2024 年 3 月 31 日。

2、本基金于 2024 年 1 月 31 日转型，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期 6 个月，从 2024 年 1 月 31 日起至 2024 年 7 月 30 日，本期末建仓期还未结束。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现转型前

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024年01月01日-2024年01月30日）	
	富国创业板指数 A	富国创业板指数 C
1. 本期已实现收益	-6,610,762.20	-9,606,533.07
2. 本期利润	-143,185,121.21	-206,432,643.27
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1071	-0.1066
4. 期末基金资产净值	798,608,242.89	1,090,619,860.00
5. 期末基金份额净值	0.5830	0.5810

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) 富国创业板指数 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	-15.51%	1.54%	-15.50%	1.55%	-0.01%	-0.01%
过去六个月	-19.68%	1.28%	-20.00%	1.31%	0.32%	-0.03%
过去一年	-31.97%	1.14%	-32.55%	1.15%	0.58%	-0.01%
过去三年	-40.53%	1.43%	-40.72%	1.44%	0.19%	-0.01%
过去五年	-3.41%	1.56%	-5.36%	1.57%	1.95%	-0.01%
自基金合同生效起至今	10.36%	1.78%	31.10%	1.79%	-20.74%	-0.01%

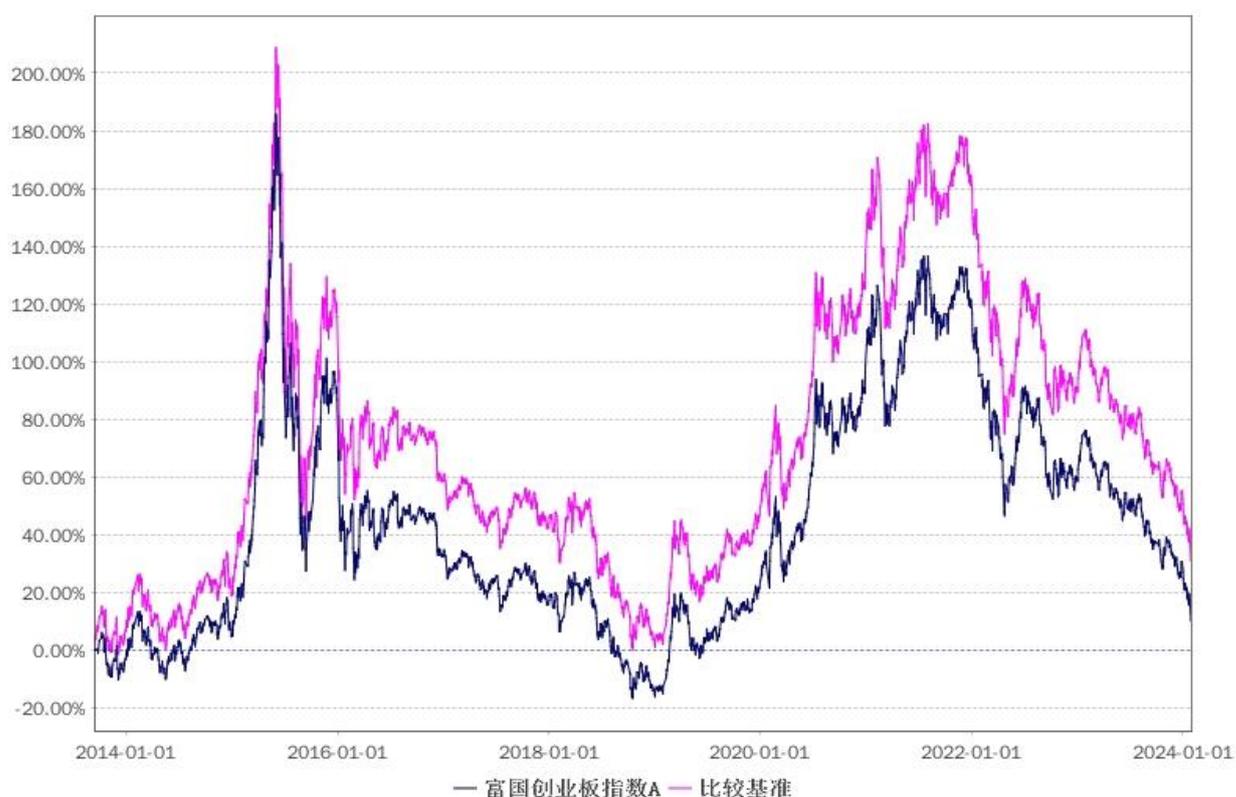
(2) 富国创业板指数 C

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	-15.43%	1.54%	-15.50%	1.55%	0.07%	-0.01%
过去六个月	-19.62%	1.28%	-20.00%	1.31%	0.38%	-0.03%

过去一年	-32.09%	1.13%	-32.55%	1.15%	0.46%	-0.02%
自基金分级 生效日起至 今	-48.90%	1.38%	-48.92%	1.39%	0.02%	-0.01%

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 收益率变动的比较

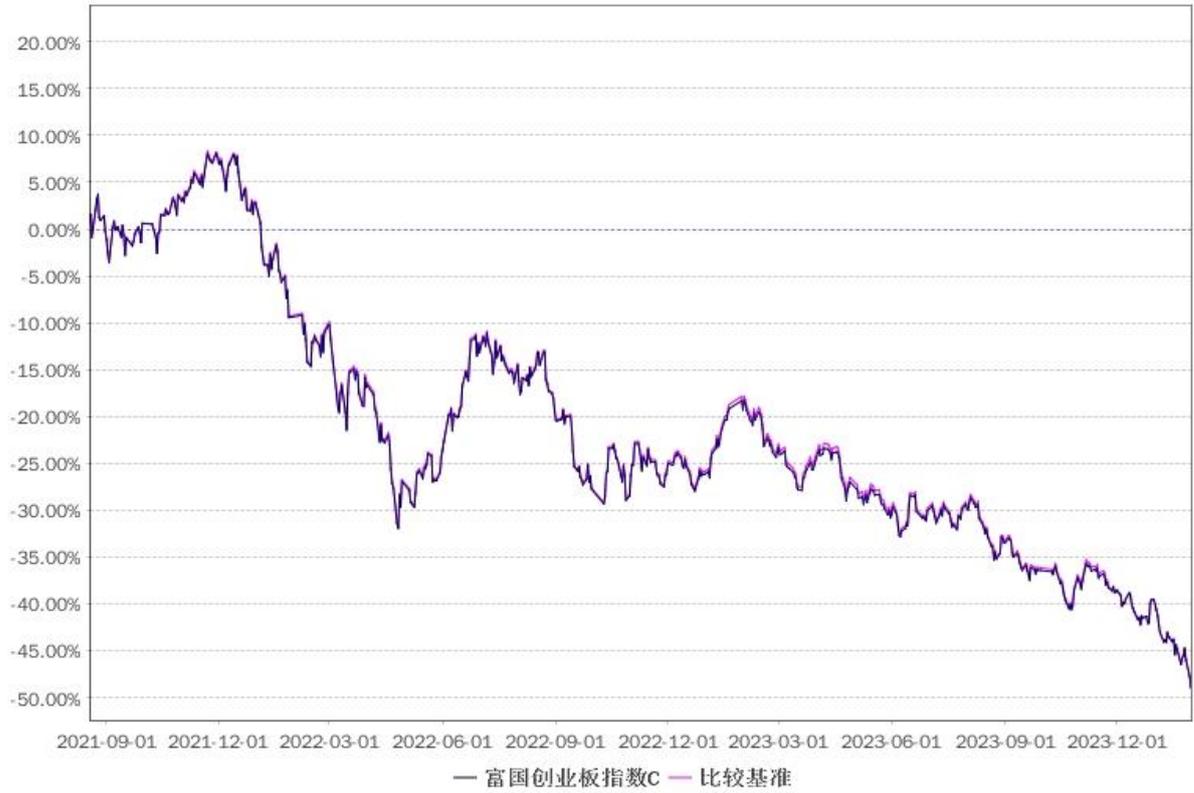
(1) 自基金合同生效以来富国创业板指数 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2024 年 1 月 30 日。

2、本基金于 2013 年 9 月 12 日成立，建仓期 6 个月，从 2013 年 9 月 12 日起至 2014 年 3 月 11 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业板指数 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2024年1月30日。

2、本基金自2021年8月17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		
曹璐迪	本基金现任基金经理	2024-02-18	—	8	硕士，自 2016 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、定量研究员；现任富国基金量化投资部定量基金经理。自 2020 年 05 月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2020 年 05 月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2020 年 08 月起任富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2021 年 03 月起任富国中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2021 年 06 月起任富国中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2021 年 07 月起任富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2021 年 08 月起任富国中证科创创业 50 交易型开

					<p>放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2021 年 08 月起任富国中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 06 月起任富国中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2023 年 09 月起任富国国证信息技术创新主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 12 月起任富国国证信息技术创新主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2023 年 12 月起任富国中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2024 年 02 月起任富国创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(原富国创业板指数型证券投资基金)基金经理；具有基金从业资格。</p>
王保合	本基金前任基金经理	2013-09-12	2024-02-18	18	<p>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</p>

				<p>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；现任富国基金量化投资部总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。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 2019 年 11 月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2019 年 12 月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金</p>
--	--	--	--	---

				<p>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 10 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；自 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；具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	---

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创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，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；2、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。事中监控主要包括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。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性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，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，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。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与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

2024 年开年以来，国内悲观预期加速释放，海外修正抢跑的降息预期。一方面，在 1 月中旬降息预期落空后，市场对国内基本面以及政策力度的中长期担忧在短期集中释放，资金和情绪的负反馈导致市场调整加速；另一方面，美国 12 月物价、非农等多项数据超预期，海外修正抢跑的降息预期，美联储 3 月降息的概率不足 50%，美元美债再次反弹。尽管月末超预期降准、地产政策优化以及资本市场政策密集出台使得权重股带领市场短暂反弹，但雪球敲入、私募强制平仓等消息面和资金面负反馈仍在持续，中小盘股票继续探底，TMT、军工、医药等成长板块跌幅居前。2 月，随着国内经济与政策预期得到重新修正，风险偏好改善驱动市场快速反弹。2 月初资金面负反馈加剧，市场出现恐慌性下跌。汇金等机构借道 ETF 加大入市力度，同时入市品种扩大至中证 500、中证 1000、中证 2000 为代表的中小盘 ETF。流动性风险解除、筹码压力显著缓解，市场迎来技术性反弹。节后在春节消费数据超预期、1 月金融数据“开门红”，海外 AI 技术迎来突破等信息刺激下，A 股迎来大幅反弹，月末沪指成功站上 3000 点。3 月，市场重新进入以景气和政策为驱动的修复期，指数围绕关键点位震荡。一方面，两会定调全年政策思路，虽然狭义赤字率并未如超市场预期，但增长目标定在 5%左右、广义财政扩张、新质生产力及大规模设备更新等产业端政策具备想象空间，有效稳定资本市场预期，驱动市场在三月中上旬延续修复；另一方面，1-2 月国内经济仍呈现结构性复苏，工业生产、制造业投资、消费、CPI 等超预期修复。经过前期大幅上涨后，投资者关注点重回现实，市场在三月下旬做多动能减弱，沪指一度下挫至 3000 点以下，但月末在政策预期催化下回到 3000 点上。

总体来看，2024 年 1 季度上证综指上涨 2.23%，沪深 300 上涨 3.1%，创业板指下跌 3.87%，中证 500 指数下跌 2.64%。

在投资管理上，本基金采取完全复制的被动式指数基金管理策略，采用量化和人工管理相结合的方法，处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型后报告期，本基金份额净值增长率 A 级为 13.91%，C 级为 13.77%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 14.05%，C 级为 14.05%；转型前报告期，本基金份额净值增长率 A 级为-15.51%，C 级为-15.43%，同期业绩比较基准收益率 A 级

为-15.50%，C级为-15.50%。

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 投资组合报告转型后

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	117,710.40	0.01
	其中：股票	117,710.40	0.01
2	基金投资	1,936,473,943.68	93.62
3	固定收益投资	95,660,821.92	4.62
	其中：债券	95,660,821.92	4.62
	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	30,440,792.04	1.47
8	其他资产	5,772,956.75	0.28
9	合计	2,068,466,224.79	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	富国创业板ETF	股票型	交易型开放式	富国基金管理有限公司	1,936,473,943.68	94.17

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 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	—	—
C	制造业	101,960.19	0.00
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	—	—
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	15,750.21	0.00
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	117,710.40	0.01

5.4 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

5.4.1 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	301508	中机认检	419	15,750.21	0.00
2	301516	中远通	604	11,765.92	0.00
3	301489	思泉新材	128	10,291.20	0.00
4	301517	陕西华达	185	9,782.80	0.00
5	301413	安培龙	164	8,636.24	0.00
6	301566	达利凯普	576	7,672.32	0.00
7	301538	骏鼎达	107	7,440.78	0.00
8	301555	惠柏新材	224	6,856.64	0.00
9	301578	辰奕智能	118	5,666.36	0.00
10	001378	德冠新材	205	5,557.55	0.00

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	95,660,821.92	4.65
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）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	95,660,821.92	4.65

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五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019727	23 国债 24	944,000	95,660,821.92	4.65

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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标

的指数。

5.11.2 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。

5.11.3 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 申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。

5.12.2 申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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	758,327.37
2	应收证券清算款	713,337.44
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	4,301,291.94
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	5,772,956.75

5.12.4 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。

5.12.5 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	301508	中机认检	15,750.21	0.00	新股限售
2	301516	中远通	11,765.92	0.00	新股限售
3	301489	思泉新材	10,291.20	0.00	新股限售
4	301517	陕西华达	9,782.80	0.00	新股限售
5	301413	安培龙	8,636.24	0.00	新股限售
6	301566	达利凯普	7,672.32	0.00	新股限售
7	301538	骏鼎达	7,440.78	0.00	新股限售
8	301555	惠柏新材	6,856.64	0.00	新股限售
9	301578	辰奕智能	5,666.36	0.00	新股限售
10	001378	德冠新材	5,557.55	0.00	新股限售

5.12.6 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。

§ 5 投资组合报告转型前

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（%）
10	权益投资	1,761,552,716.34	92.86
	其中：股票	1,761,552,716.34	92.86
11	固定收益投资	4,440,371.51	0.23
	其中：债券	4,440,371.51	0.23
	资产支持证券	—	—
12	贵金属投资	—	—
13	金融衍生品投资	—	—
14	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
15	银行存款和结算备付金合计	121,230,609.84	6.39
16	其他资产	9,791,104.41	0.52
17	合计	1,897,014,802.10	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	78,375,521.28	4.15
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,292,514,746.14	68.41
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	107,517,281.31	5.69
J	金融业	148,232,794.65	7.85
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	53,167,441.43	2.81
N	水利、环境和公共设施管理业	7,407,967.58	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	53,879,288.40	2.85
R	文化、体育和娱乐业	20,047,765.48	1.06
S	综合	—	—
	合计	1,761,142,806.27	93.22

5.2.2 报告期末积极投资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	—	—
C	制造业	373,880.14	0.02
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	—	—
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	27,935.69	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	8,094.24	0.00
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	409,910.07	0.02

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 报告期末指数投资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	300750	宁德时代	1,927,338	271,272,823.50	14.36

2	300059	东方财富	9,649,097	121,192,658.32	6.41
3	300760	迈瑞医疗	405,715	108,638,305.55	5.75
4	300124	汇川技术	1,475,197	80,309,724.68	4.25
5	300498	温氏股份	4,155,648	78,375,521.28	4.15
6	300274	阳光电源	771,806	61,736,761.94	3.27
7	300308	中际旭创	482,485	48,827,482.00	2.58
8	300015	爱尔眼科	3,295,137	43,495,808.40	2.30
9	300122	智飞生物	871,832	40,174,018.56	2.13
10	300014	亿纬锂能	968,766	33,713,056.80	1.78

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	001379	腾达科技	2,128	48,781.82	0.00
2	301502	华阳智能	1,375	38,513.75	0.00
3	301511	德福科技	982	22,114.64	0.00
4	301348	蓝箭电子	613	21,215.93	0.00
5	301498	乖宝宠物	554	20,664.20	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
11	国家债券	4,440,371.51	0.24
12	央行票据	—	—
13	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
14	企业债券	—	—
15	企业短期融资券	—	—
16	中期票据	—	—
17	可转债（可交换债）	—	—
18	同业存单	—	—
19	其他	—	—
20	合计	4,440,371.51	0.24

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019727	23 国债 24	44,000	4,440,371.51	0.24

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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

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 申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 申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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
9	存出保证金	337,611.25
10	应收证券清算款	—
11	应收股利	—
12	应收利息	—
13	应收申购款	9,453,493.16
14	其他应收款	—
15	其他	—
16	合计	9,791,104.41

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

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	301502	华阳智能	34,648.37	0.00	新股认购
1	301502	华阳智能	3,865.38	0.00	新股限售
2	301511	德福科技	22,114.64	0.00	新股限售
3	301348	蓝箭电子	21,215.93	0.00	新股限售
4	301498	乖宝宠物	20,664.20	0.00	新股限售
5	001379	腾达科技	4,449.57	0.00	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转型后

单位：份

项目	富国创业板 ETF 联接 A	富国创业板 ETF 联接 C
基金合同生效日 2024 年 01 月 31 日基金份额总额	1,369,701,264.38	1,878,731,075.19
本报告期(2024 年 1 月 31 日(基金合同生效日)至 2024 年 3 月 31 日)基金总申购份额	147,192,623.80	180,666,154.77
本报告期(2024 年 1 月 31 日(基金合同生效日)至 2024 年 3 月 31 日)基金总赎回份额	121,883,111.06	350,017,266.80
本报告期(2024 年 1 月 31 日(基金合同生效日)至 2024 年 3 月 31 日)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	1,395,010,777.12	1,709,379,963.16

§ 6 开放式基金份额变动转型前

单位：份

项目	富国创业板指数 A	富国创业板指数 C
报告期期初基金份额总额	1,304,550,631.73	2,096,153,161.80
报告期期间基金总申购份额	89,448,492.78	97,588,128.92
报告期期间基金总赎回份额	24,297,860.13	315,010,215.53
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	1,369,701,264.38	1,878,731,075.19

§ 7 基金管理人运用自有资金投资本基金情况转型后

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 基金管理人运用自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自有资金申赎及买卖本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况转型前

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转型后

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

一、本报告期内，依据《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》、《富国创业板指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于富国创业板指数型证券投资基金终止上市并变更为富国创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案》。在基金托管人的监督下，本基金管理人对本次大会表决进行了计票，上海市通力律师事务所对计票过程进行了见证，上海市东方公证处对计票过程及结果进行了公证。根据 2024 年 1 月 23 日的计票结果，本次会议议案获得通过，本次大会决议自 2024 年 1 月 23 日起生效。具体可参见基金管理人于 2024 年 1 月 24 日发布的《富国创业板指数型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》及相关提示性公告。

二、本报告期内，本基金通过基金份额持有人大会方式审议通过《关于富国创业板指数型证券投资基金终止上市并变更为富国创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案》，决定将富国创业板指数型证券投资基金变更为富国创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并终止 A 类基金份额上市。2024 年 1 月 30 日日终，投资者未赎回或未卖出的富国创业板指数型证券投资基金的 A 类基金份额和 C 类基金份额将变更登记为富国创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的对应类别的基金份额，同时本基金于 A 类基金份额终止上市日 2024 年 1 月 31 日变更为“富国创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金”。具体可参见基金管理人于 2024 年 1 月 26 日发布的《关于富国创业板指数型证券投资基金 A 类基金份额终止上市的公告》及《关于富国创业板指数型证券投资基金变更为富国创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、基金名称简称变更、降低费率并修订基金合同和托管协议的公告》、于 2024 年 1 月 30 日发布的《关于富国创业板指数型证券投资基金 A 类基金份额终止上市的提示性公告》。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息转型前

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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准富国创业板指数分级证券投资基金募集的文件
- 2、《富国创业板指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《富国创业板指数分级证券投资基金托管协议》
- 4、《富国创业板指数型证券投资基金基金合同》
- 5、《富国创业板指数型证券投资基金托管协议》
- 6、《富国创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
- 7、《富国创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》
- 8、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 9、富国创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金财务报表及报表附注
- 10、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
2024 年 04 月 22 日