富国中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金

二0二六年第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：中信证券股份有限公司

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。

基金托管人中信证券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	富国中证AAA科技创新公司债ETF
场内简称	科创债ETF富国
基金主代码	159200
交易代码	159200
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2025年07月10日
报告期末基金份额总额	153,392,633.00份
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	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟跟踪偏离度和踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。本基金的优化抽样复制策略、替代性策略、其他债券投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、信用衍生品投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证AAA科技创新公司债指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数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	中信证券股份有限公司

§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)
1.本期已实现收益	64,734,391.65
2.本期利润	126,455,166.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.8675
4.期末基金资产净值	15,618,250,787.21
5.期末基金份额净值	101.8188

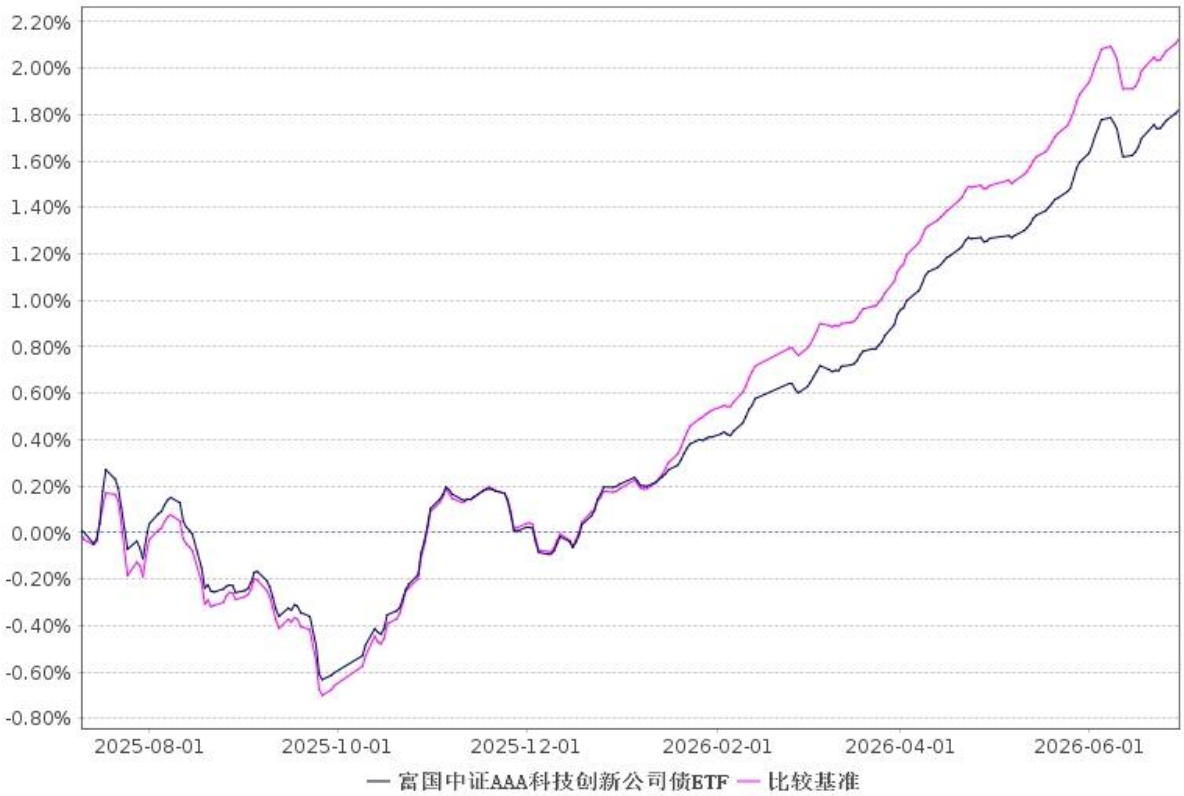
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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	0.87%	0.02%	0.99%	0.02%	-0.12%	0.00%
过去六个月	1.61%	0.02%	1.93%	0.02%	-0.32%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.82%	0.03%	2.12%	0.04%	-0.30%	-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



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2025 年 7 月 10 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§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		
张洋	本基金现任基金经理	2025-07-10	—	15	硕士，曾任招商银行总行交易员，招商银行总行投资经理，平安银行总行投资经理；自 2020 年 3 月加入富国基金管理有限公司，现任富国基金固定收益投资部固定收益基金经理。自 2020 年 08 月起任富国长江经济带纯债债券型证券投资基金基金经理；自 2020 年 09 月起任富国荣利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2020 年 12 月起任富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理；自 2025 年 01 月起任富国两年期理财债券型证券投资基金基金经理；自 2025 年 03 月起任富国安怡 120 天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理；自 2025 年 07 月起任富国中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
李金柳	本基金现任基金经理	2025-07-25	—	10	硕士，曾任海通证券股份有限公司宏观经济分析师，平安养老保险股份有限公司投资经理；自 2021 年 1 月加入富国基金管理有限公司，历任固定收益基金经理助理；现任富国基金固定收益投资部固定收益基金经理。自 2022 年 08 月

					起任富国汇享三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；自 2022 年 08 月起任富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 10 月起任富国汇泽一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 月起任富国颐利纯债债券型证券投资基金基金经理；自 2023 年 04 月起任富国中债 7-10 年政策性金融债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 04 月起任富国中债 7-10 年政策性金融债交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 03 月起任富国泽利纯债债券型证券投资基金基金经理；自 2024 年 04 月起任富国瑞夏纯债债券型证券投资基金基金经理；自 2025 年 03 月起任富国信用债债券型证券投资基金基金经理；自 2025 年 07 月起任富国中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
王仁增	本基金现任基金经理	2026-03-10	—	12	硕士，曾任职于华安基金，自 2021 年起任平安基金基金经理助理、基金经理；自 2024 年 8 月加入富国基金管理有限公司，自 2025 年 2 月起历任固定收益基金经理助理岗、固定收益基金经理助理；现任富国基金固定收益投资部固定收益基金经理。自 2025 年 05 月起

					任富国中债7-10年政策性金融债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助理；自2025年05月起任富国中债7-10年政策性金融债交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理；自2025年05月起任富国中债优选投资级信用债指数发起式证券投资基金基金经理助理；自2026年03月起任富国中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数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中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资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》、《富国中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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《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

2026 年二季度国内经济保持平稳，出口增速维持韧性，物价水平稳步回升。央行采取适度宽松的货币政策基调，注重前瞻性灵活性针对性，季末增加隔夜逆回购操作品种，流动性环境保持充裕，银行间质押式回购加权利率 DR007 一度维持在政策利率下方运行。在充裕的资金环境下，二季度债券收益率呈震荡下行走势。投资操作上，本基金跟踪指数进行配置，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，跟踪误差保持在合理水平。

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为 0.87%；同期业绩比较基准收益率为 0.99%。

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	—	—
	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	14,654,355,779.50	92.50
	其中：债券	14,654,355,779.50	92.50
	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	1,080,000,000.00	6.82
	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	103,346,057.19	0.65
7	其他资产	4,395,502.34	0.03
8	合计	15,842,097,339.03	100.00

注：上表中的债券投资金额含可退替代款估值增值

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

注：本基金本报告期末未持有境内股票资产。

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

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

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（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,782,239,737.01	11.41
	其中：政策性金融债	—	—

4	企业债券	12,820,894,894.62	82.09
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	51,206,027.40	0.33
10	合计	14,654,340,659.03	93.83

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	524672	26CATLK1	2,800,000	282,222,049.31	1.81
2	242757	沪国投 K1	2,380,000	234,508,572.61	1.50
3	524541	25 诚通 K1	2,100,000	219,281,424.66	1.40
4	244135	25 国新 K1	1,800,000	186,227,013.69	1.19
5	524543	25 国券 K1	1,800,000	182,672,383.55	1.17

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。

5.10.2 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

本基金本报告期末未持有股票资产。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,070,977.92
2	应收证券清算款	1,324,524.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,395,502.34

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

报告期期初基金份额总额	134,902,633.00
报告期期间基金总申购份额	35,490,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	17,000,000.00
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	153,392,633.00

§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中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金的文件

2、富国中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金合同

3、富国中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金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