

华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资
基金联接基金(原华富中证 A100 指数证
券投资基金)
2025 年第 1 季度报告

2025 年 3 月 31 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 4 月 22 日

§ 1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 4 月 21 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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 03 月 31 日止。

自 2025 年 2 月 18 日起，“华富中证 A100 指数证券投资基金”转型为“华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”。本报告中，华富中证 A100 指数证券投资基金的报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 2 月 17 日止，华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的报告期自 2025 年 2 月 18 日起至 2025 年 3 月 31 日止。如无特殊说明，本报告中“本基金”指华富中证 A100 指数证券投资基金及华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	华富中证 A100ETF 联接
基金主代码	410008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 2 月 18 日
报告期末基金份额总额	220,936,727.66 份
投资目标	主要通过投资于目标 ETF，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 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。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和年平均误差最小化，日均跟踪偏离度的绝对值最大容忍值设定为 0.35%，年平均误差不得超过 4%。本基金的目标 ETF 投资策略、股票投资策略等详见招募说明书等法律文件。
业绩比较基准	中证 A100 指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率（税后）×5%

风险收益特征	本基金为目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本基金的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。	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华富中证 A100ETF 联接 A	华富中证 A100ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	410008	022661
报告期末下属分级基金的份额总额	214,990,232.13 份	5,946,495.53 份

2.1.1 目标基金基本情况（转型后）

基金名称	华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	561880
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 1 月 15 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 1 月 24 日
基金管理人名称	华富基金管理有限公司
基金托管人名称	交通银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明（转型后）

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将运用其他合理的投资方法对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。</p> <p>在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求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%。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上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额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。</p> <p>本基金的债券投资策略、国债期货交易策略、股指期货交易策略、资产支持证券投资策略、参与融资与转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略等详见招募说明书等法律文件。</p>
业绩比较基准	中证 A100 指数收益率
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪</p>

标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	华富中证 A100 指数	
基金主代码	410008	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 12 月 30 日	
报告期末基金份额总额	218,593,330.12 份	
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资约束和数量化风险控制，力争控制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% 和年跟踪误差不超过 4%，以实现中证 A100 指数的有效跟踪。	
投资策略	本基金为被动式指数基金，本基金的标的指数为中证 A100 指数。本基金原则上采用完全复制指数的投资策略，即按照标的指数成份股及其权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，力争净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差最小化。	
业绩比较基准	中证 A100 指数收益率 \times 95% + 一年期银行定期存款收益率（税后） \times 5%	
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。一般情况下，其风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华富中证 A100 指数 A	华富中证 A100 指数 C
下属分级基金的交易代码	410008	022661
报告期末下属分级基金的份额总额	215,851,761.29 份	2,741,568.83 份

注：华富中证 A100 指数证券投资基金系根据华富基金管理有限公司于 2024 年 10 月 25 日发布的《华富基金管理有限公司关于华富中证 100 指数证券投资基金更名的公告》，由华富中证 100 指数证券投资基金更名而来。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2025 年 2 月 18 日-2025 年 3 月 31 日）	
	华富中证 A100ETF 联接 A	华富中证 A100ETF 联接 C
1. 本期已实现收益	4,937,036.13	60,183.10
2. 本期利润	-2,554,593.89	-78,220.53
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0119	-0.0211
4. 期末基金资产净值	258,285,914.87	7,134,179.26

5. 期末基金份额净值	1.2014	1.1997
-------------	--------	--------

注：1、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。

2、所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2025 年 1 月 1 日-2025 年 2 月 17 日）	
	华富中证 A100 指数 A	华富中证 A100 指数 C
1. 本期已实现收益	-761.37	-1,549.99
2. 本期利润	2,555,595.39	36,234.88
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0118	0.0142
4. 期末基金资产净值	261,889,421.46	3,323,192.78
5. 期末基金份额净值	1.2133	1.2122

注：1、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。

2、所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现（转型后）

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

华富中证 A100ETF 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
自基金合同 生效起至今	-0.98%	0.85%	-0.87%	0.87%	-0.11%	-0.02%

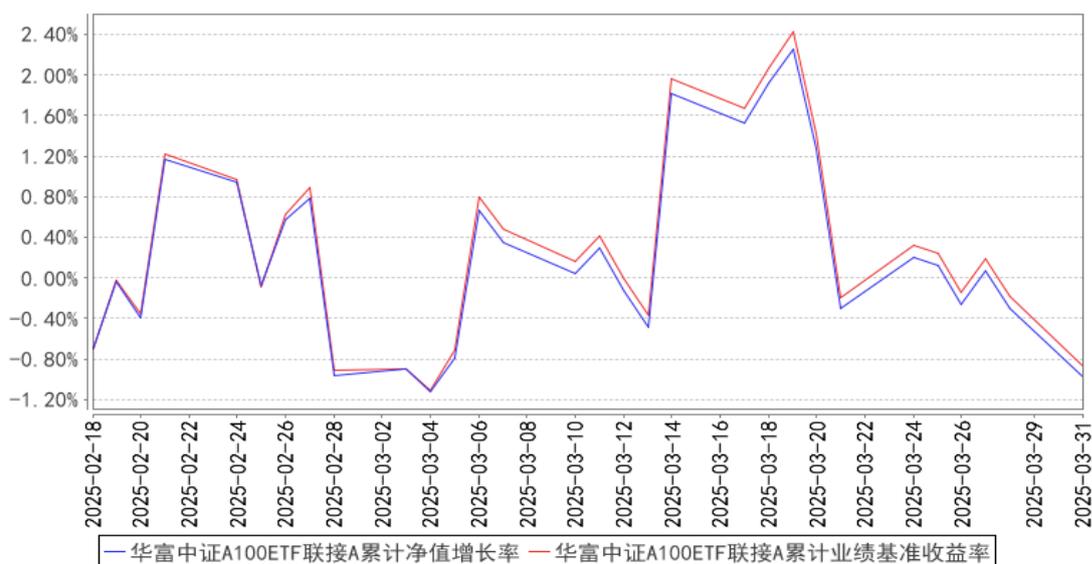
华富中证 A100ETF 联接 C

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
自基金合同 生效起至今	-1.03%	0.85%	-0.87%	0.87%	-0.16%	-0.02%

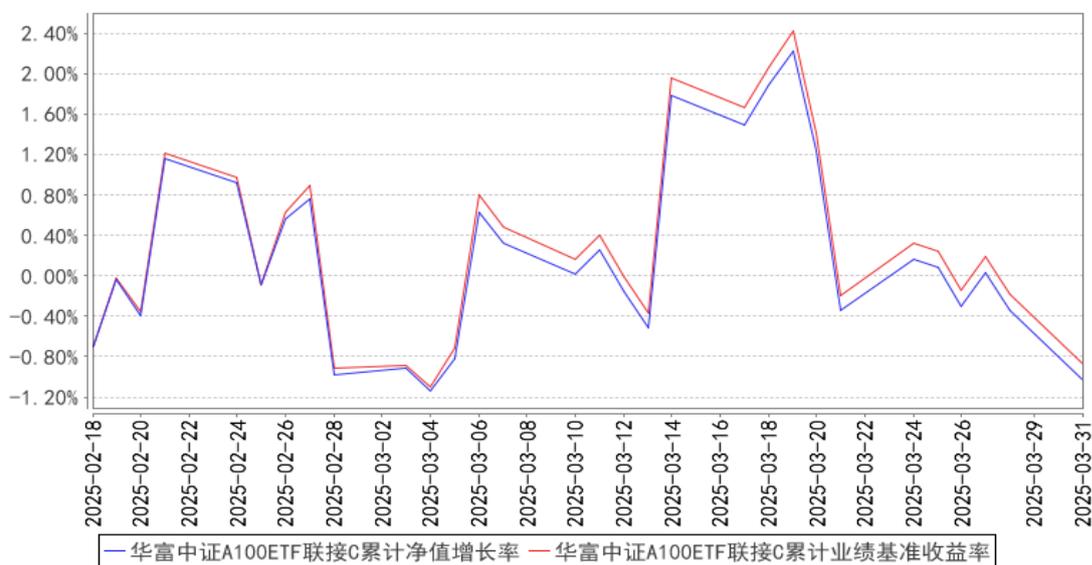
注：本基金业绩比较基准收益率=中证 A100 指数收益率*95%+一年期银行定期存款收益率（税后）*5%

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

华富中证A100ETF联接A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华富中证A100ETF联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金由华富中证 A100 指数证券投资基金 2025 年 2 月 18 日转型而来。本基金基金合同自 2025 年 2 月 18 日起生效，截至本报告期末，本基金转型未满一年。本基金建仓期为 2025 年 2 月 18 日起至 2025 年 8 月 18 日。本报告期内，本基金仍在建仓期。

本报告期内，本基金严格执行了《华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的相关规定。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

华富中证 A100 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	0.99%	0.93%	1.01%	0.93%	-0.02%	0.00%
过去六个月	-2.96%	1.42%	-2.32%	1.48%	-0.64%	-0.06%
过去一年	11.15%	1.26%	11.14%	1.33%	0.01%	-0.07%
过去三年	-4.49%	1.09%	-8.07%	1.11%	3.58%	-0.02%
过去五年	26.54%	1.12%	0.13%	1.15%	26.41%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	86.98%	1.31%	13.38%	1.32%	73.60%	-0.01%

华富中证 A100 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	0.94%	0.93%	1.01%	0.93%	-0.07%	0.00%
自基金合同 生效起至今	-0.21%	0.94%	-0.09%	0.95%	-0.12%	-0.01%

注：本基金业绩比较基准收益率=中证 A100 指数收益率*95%+一年期银行定期存款收益率（税后）*5%

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

华富中证A100指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华富中证A100指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金建仓期为 2009 年 12 月 30 日到 2010 年 6 月 30 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富中证 A100 指数证券投资基金基金合同》的规定。

2、本基金于 2024 年 11 月 21 日起新增 C 类份额，本基金 C 类份额报告期间的起始日为 2024 年 11 月 21 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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		

<p>郜哲</p>	<p>本基金基金经理</p>	<p>2025 年 2 月 18 日</p>	<p>-</p>	<p>十二年</p>	<p>北京大学理学博士，博士研究生学历。历任方正证券股份有限公司博士后研究员、上海同安投资管理有限公司高级研究员。2017 年 4 月加入华富基金管理有限公司，自 2019 年 12 月 24 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 4 月 23 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2022 年 7 月 22 日起任华富消费成长股票型证券投资基金基金经理，自 2022 年 8 月 31 日起任华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金经理，自 2025 年 2 月 18 日起任华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，具有基金从业资格。</p>
<p>李孝华</p>	<p>本基金基金经理、指数投资部权益指数经理</p>	<p>2025 年 2 月 18 日</p>	<p>-</p>	<p>十一年</p>	<p>南开大学经济学硕士、硕士研究生学历。历任金瑞期货研究所贵金属研究员、国泰安信息技术有限公司量化投资平台设计与开发员、华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理助理。2019 年 10 月加入华富基金管理有限公司，曾任基金经理助理，自 2021 年 6 月 28 日起任华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 11 日起任华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 17 日起任华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金基金经理，自 2022 年 9 月 5 日起任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2023 年 3 月 24 日起任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2025 年 1 月 15 日起任华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 2 月 18 日起任华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，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决定确定的解聘日

期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

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		
郜哲	本基金基金经理	2018年02月23日	2025年02月17日	十二年	北京大学理学博士，博士研究生学历。历任方正证券股份有限公司博士后研究员、上海同安投资管理有限公司高级研究员。2017年4月加入华富基金管理有限公司，自2019年12月24日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2020年4月23日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自2022年7月22日起任华富消费成长股票型证券投资基金基金经理，自2022年8月31日起任华富中证科创创业50指数增强型证券投资基金基金经理，自2025年2月18日起任华富中证A100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，具有基金从业资格。
李孝华	本基金基金经理、指数投资部权益指数经理	2021年05月07日	2025年02月17日	十一年	南开大学经济学硕士、硕士研究生学历。历任金瑞期货研究所贵金属研究员、国泰安信息技术有限公司量化投资平台设计与开发员、华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理助理。2019年10月加入华富基金管理有限公司，曾任基金经理助理，自2021年6月28日起任华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年8月11日起任华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年11月17日起任华富中小企业100指数增强型证券投资基金基金经理，自2022年9月5日起任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2023年2月9日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2023年2月9日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自2023年3月24日起任华富永鑫灵活配置混合型

					证券投资基金基金经理，自 2025 年 1 月 15 日起任华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 2 月 18 日起任华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，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决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《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

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，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全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上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。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价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的 5% 的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2025 年一季度 A 股市场整体表现较为平稳，沪深 300、中证 A100 和中证 A500 指数的表现分别为 -1.21%、0.11% 和 0.37%。大盘平稳表现的背后，是随着春节期间 DeepSeek 等一系列中国科技成果的出圈，以人工智能产业链为代表的科技板块表现优异，投资者风险偏好提升，市场呈现出明显的结构化行情。一季度市场风格整体偏成长，沪深 300 成长指数上涨 1.22%，同期沪深 300 价值指数下跌 2.1%；小市值股表现活跃，期间中证 500 和中证 1000 指数分别上涨 2.92% 和

5.07%。不过，成长风格行情的演绎并未完全延续至一季度末，2月下旬过后，随着 DeepSeek 带来的中国科技股价值重估行情告一段落，以人工智能为代表的成长风格出现调整，价值风格重新占优，市场开始出现较为明显的“高切低”现象。与偏暖的市场行情相呼应的是，2025年3月的宏观经济及资本市场政策定调维持2024年9月24日以来的积极取向，并继续保持适度宽松的货币政策，央行提出“适时降准降息”及降低社会融资成本等一系列政策措施。

在目前的市场行情区间以及国际环境不确定性增高的情况下，中证 A100 作为遵循行业均衡理念的宽基指数，有着非常好的配置价值。本基金未来将继续通过投资目标 ETF 基金，紧密跟踪好标的指数，以期为消费者提供合理的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型前，截止 2025 年 2 月 17 日，华富中证 A100 指数 A 份额净值为 1.2133 元，累计份额净值为 1.8833 元；华富中证 A100 指数 C 份额净值为 1.2122 元，累计份额净值为 1.2122 元。2025 年 1 月 1 日至 2025 年 2 月 17 日期间，华富中证 A100 指数 A 份额净值增长率为 0.99%，同期业绩比较基准收益率为 1.01%；华富中证 A100 指数 C 份额净值增长率为 0.94%，同期业绩比较基准收益率为 1.01%。

转型后，截止本期末，华富中证 A100ETF 联接 A 份额净值为 1.2014 元，累计份额净值为 1.8714 元；华富中证 A100ETF 联接 C 份额净值为 1.1997 元，累计份额净值为 1.1997 元。2025 年 2 月 18 日至本期末，华富中证 A100ETF 联接 A 份额净值增长率为-0.98%，同期业绩比较基准收益率为-0.87%；华富中证 A100ETF 联接 C 份额净值增长率为-1.03%，同期业绩比较基准收益率为-0.87%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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	1,351,445.27	0.51
	其中：股票	1,351,445.27	0.51
2	基金投资	246,940,531.96	92.85
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	16,575,670.82	6.23
8	其他资产	1,100,646.74	0.41
9	合计	265,968,294.79	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	114,940.74	0.04
C	制造业	656,795.46	0.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,684.34	0.03
E	建筑业	36,338.00	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	61,439.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	73,457.66	0.03
J	金融业	283,526.43	0.11
K	房地产业	10,391.08	0.00
L	租赁和商务服务业	12,040.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	30,832.56	0.01
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	1,351,445.27	0.51

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无

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	600519	贵州茅台	192	299,712.00	0.11
2	601318	中国平安	1,800	92,934.00	0.04
3	600036	招商银行	2,100	90,909.00	0.03

4	600900	长江电力	2,114	58,790.34	0.02
5	601166	兴业银行	2,500	54,000.00	0.02
6	601899	紫金矿业	2,898	52,511.76	0.02
7	600030	中信证券	1,700	45,084.00	0.02
8	600276	恒瑞医药	800	39,360.00	0.01
9	603259	药明康德	458	30,832.56	0.01
10	688041	海光信息	200	28,260.00	0.01

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。

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

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	华富中证 A100 交易 型开放式 指数证券 投资基金	股票型	交易型开 放式 (ETF)	华富基金 管理有限 公司	246,940,531.96	93.04

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：无

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

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：无

5.11.3 本期国债期货投资评价

无。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中信证券股份有限公司曾出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本报告期内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 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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定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	64,943.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,035,702.97
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,100,646.74

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

5.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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（%）
1	权益投资	250,460,387.26	94.26
	其中：股票	250,460,387.26	94.26
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	14,945,774.14	5.62
8	其他资产	318,091.53	0.12
9	合计	265,724,252.93	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	2,134,546.80	0.80
B	采矿业	13,653,747.46	5.15
C	制造业	146,273,488.21	55.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,218,932.38	3.48
E	建筑业	4,539,507.00	1.71
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,436,048.42	3.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,522,153.87	5.85
J	金融业	39,480,585.52	14.89
K	房地产业	3,063,249.44	1.16
L	租赁和商务服务业	2,618,029.03	0.99
M	科学研究和技术服务业	3,200,630.56	1.21
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	1,319,468.57	0.50
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	250,460,387.26	94.44

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

注：无

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无

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	600519	贵州茅台	12,892	18,972,125.04	7.15
2	300750	宁德时代	54,980	14,811,612.00	5.58
3	601318	中国平安	224,900	11,658,816.00	4.40
4	600036	招商银行	260,600	10,872,232.00	4.10
5	000333	美的集团	102,273	7,367,746.92	2.78
6	600900	长江电力	257,114	7,242,901.38	2.73
7	002594	比亚迪	18,491	6,444,113.50	2.43
8	601166	兴业银行	298,500	6,253,575.00	2.36
9	600030	中信证券	200,900	5,683,461.00	2.14
10	601899	紫金矿业	332,998	5,494,467.00	2.07

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

注：无

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无

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：无

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：无

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：无

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：无

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：无

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

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：无

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中信证券股份有限公司曾出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本报告期内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 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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定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	40,807.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	277,284.15
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	318,091.53

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

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 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	华富中证 A100ETF 联接 A	华富中证 A100ETF 联接 C
基金合同生效日(2025 年 2 月 18 日)基金份额总额	215,851,761.29	2,741,568.83
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,324,772.63	5,636,350.43
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,186,301.79	2,431,423.73
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	214,990,232.13	5,946,495.53

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	华富中证 A100 指数 A	华富中证 A100 指数 C
报告期期初基金份额总额	215,846,748.98	2,486,812.29
报告期期间基金总申购份额	1,334,546.89	445,572.75
减：报告期期间基金总赎回份额	1,329,534.58	190,816.21
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	215,851,761.29	2,741,568.83

§ 7 基金管理人运用固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

单位：份

项目	华富中证 A100ETF 联接 A	华富中证 A100ETF 联接 C
----	-------------------	-------------------

基金合同生效日(2025 年 2 月 18 日)管理人持有的本基金份额	0.00	2,464,268.11
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	0.00	0.00
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00	2,464,268.11
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.00	1.12

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

§ 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

单位：份

项目	华富中证 A100 指数 A	华富中证 A100 指数 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00	2,464,268.11
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00	2,464,268.11
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.00	1.13

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20250101-20250331	56,028,928.93	0.00	0.00	56,028,928.93	25.36
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据本基金管理人于 2025 年 2 月 14 日发布的《华富基金管理有限公司关于华富中证 A100 指数证券投资基金转型为华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、调低管理费率及托管费率、增加侧袋机制相关内容并修改相关法律文件的公告》，自 2025 年 2 月 18 日起，本基金转型为华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，目标 ETF 为华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金，基金简称变更为“华富中证 A100ETF 联接”，各类基金份额代码不变。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、华富中证 A100 指数证券投资基金基金合同
- 2、华富中证 A100 指数证券投资基金托管协议
- 3、华富中证 A100 指数证券投资基金招募说明书
- 4、华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同
- 5、华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议
- 6、华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书
- 7、报告期内华富中证 A100 指数证券投资基金、华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金在指定媒介上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅, 相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2025 年 4 月 22 日