富安达沪深300指数增强型证券投资基金

2025年第4季度报告

2025年12月31日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:苏州银行股份有限公司

报告送出日期:2026年01月21日

目录

§1 重要提示 3
§2 基金产品概况 3
§3 主要财务指标和基金净值表现 4
3.1 主要财务指标 4
3.2 基金净值表现 4
§4 管理人报告 6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 7
4.3 公平交易专项说明 7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 8
4.5 报告期内基金的业绩表现 8
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 8
§5 投资组合报告 8
5.1 报告期末基金资产组合情况 8
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 9
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 11
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 11
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 11
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 11
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 12
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 12
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 12
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 12
5.11 投资组合报告附注 12
§6 开放式基金份额变动 13
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 13
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 13
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 13
§8 影响投资者决策的其他重要信息 13
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 13
8.2 影响投资者决策的其他重要信息 14
§9 备查文件目录 14
9.1 备查文件目录 14
9.2 存放地点 15
9.3 查阅方式 15

§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。基金托管人苏州银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年1月20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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达沪深300指数增强
基金主代码	022090
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年11月26日
报告期末基金份额总额	30,118,988.40份
投资目标	本基金通过量化投资的方式进行积极的投资组合管理与风险控制，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金作为增强型的指数基金，以量化组合投资管理方式为基础，力求在控制本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的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过8.0%的基础上获取超越标的指数的表现。 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或违约风险，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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是一只股票型指数增强基金，其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。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及

	其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	富安达基金管理有限公司	
基金托管人	苏州银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	富安达沪深300指数增强A	富安达沪深300指数增强C
下属分级基金的交易代码	022090	022091
报告期末下属分级基金的份额总额	5,715,013.01份	24,403,975.39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(2025年10月01日 - 2025年12月31日)	
	富安达沪深300指数增强A	富安达沪深300指数增强C
1.本期已实现收益	307,049.67	1,449,206.59
2.本期利润	49,216.55	145,337.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0076	0.0051
4.期末基金资产净值	6,615,162.65	28,169,637.19
5.期末基金份额净值	1.15750000	1.15430000

注：

①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。

②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

富安达沪深300指数增强A净值表现

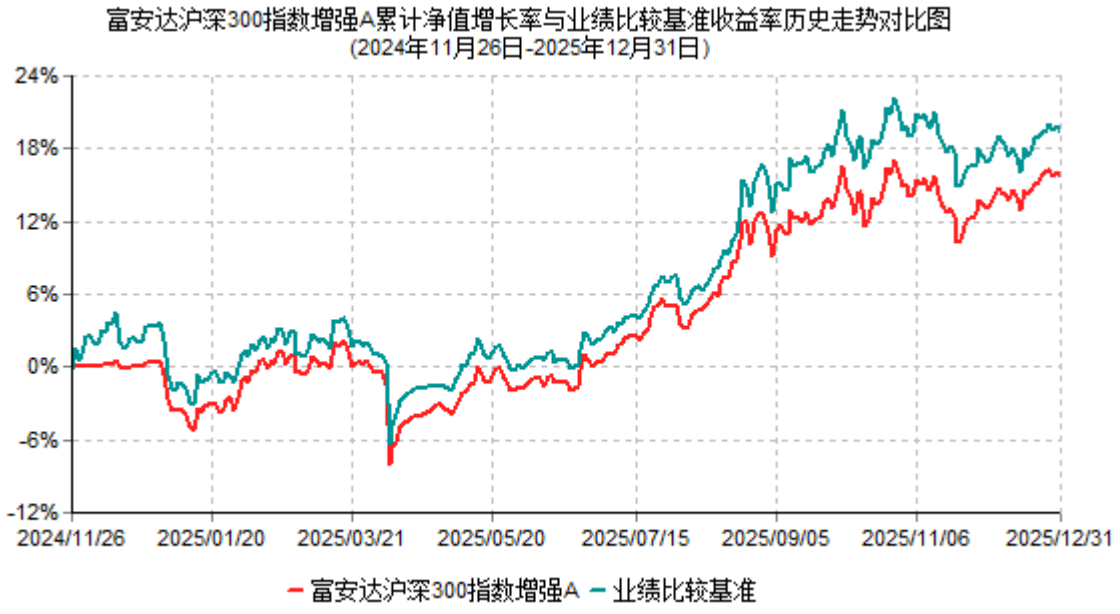
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

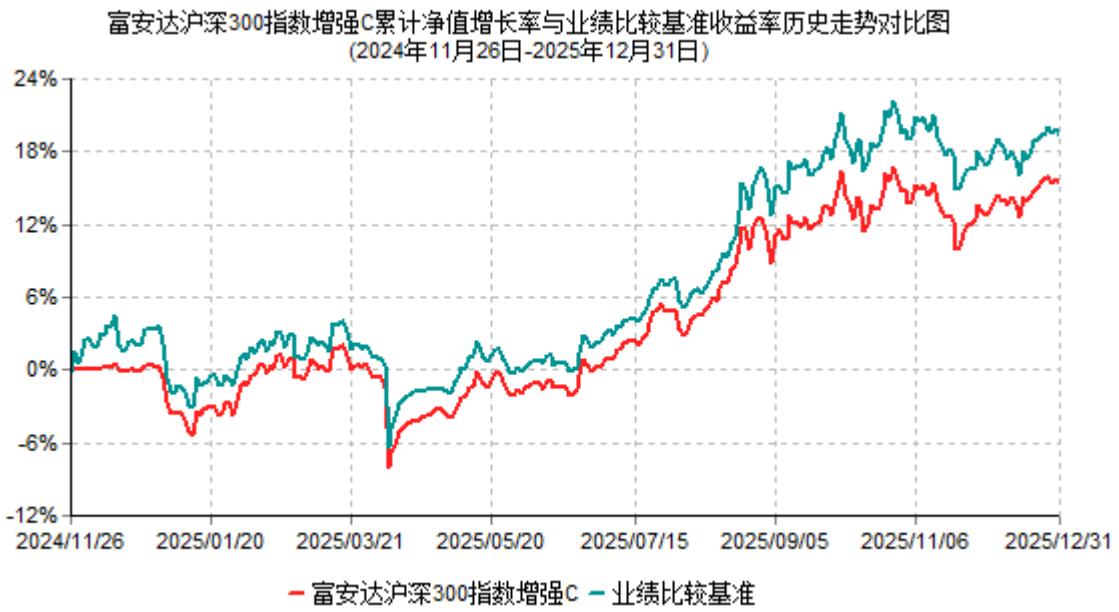
过去三个月	0.71%	0.85%	-0.20%	0.90%	0.91%	-0.05%
过去六个月	15.38%	0.80%	16.72%	0.86%	-1.34%	-0.06%
过去一年	16.42%	0.86%	16.79%	0.91%	-0.37%	-0.05%
自基金合同生效起至今	15.75%	0.82%	19.30%	0.91%	-3.55%	-0.09%

富安达沪深300指数增强C净值表现

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	0.65%	0.85%	-0.20%	0.90%	0.85%	-0.05%
过去六个月	15.23%	0.80%	16.72%	0.86%	-1.49%	-0.06%
过去一年	16.12%	0.86%	16.79%	0.91%	-0.67%	-0.05%
自基金合同生效起至今	15.43%	0.82%	19.30%	0.91%	-3.87%	-0.09%

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：根据本基金《基金合同》规定，本基金建仓期为 6 个月，建仓截止日为 2025 年 5 月 25 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

§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		
纪青	本基金的基金经理、指数与量化投资部副经理（主持工作）	2024-11-26	-	17年	硕士。历任中海基金投研中心金融工程分析师。2013年加入富安达基金管理有限公司。现任指数与量化投资部副经理（主持工作）、富安达中证500指数增强型证券投资基金、富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金、富安达中小盘六个月持有期混合型发起式证券投资基金、富安达沪深300指数增强型证券投资基金、富安达中证A500指数增

					强型证券投资基金、富安达上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。曾任富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2022年7月至2022年11月兼任投资经理。

注：

①基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，即基金的首任基金经理，其任职日期为基金合同生效日，其离职日期为公司作出决定后正式对外公告之日；

②证券从业年限计算标准遵从中国证监会《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》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《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》及其各项实施准则、《富安达沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》和其他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,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》，并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系，涵盖了所有投资组合，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节，确保公平对待旗下的每一个投资组合。本报告期内，公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截止报告日，公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析，按照特定计算周期，分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异，未发现公平交易异常情形。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2025年第四季度，A股市场呈现震荡格局下的结构性分化特征。市场风格自“成长单边占优”逐步切换为“价值修复”与“成长内部分化”并存的再平衡态势，以科技、医药为代表的高弹性板块阶段性回调。资金层面，宽基指数获集中流入，两融余额稳步攀升并于年末突破2.5万亿元，市场流动性环境趋松，资金结构持续优化。政策方面，保险资金入市约束进一步放宽--监管下调长期持有沪深300、科创板相关资产的风险因子，释放配置空间；中央经济工作会议明确对科技、消费等重点领域予以政策支持，叠加全球流动性宽松预期，共同缓冲市场下行压力，塑造相对温和的调整环境。在此期间，本基金所采用的指数增强策略继续依托多因子量化选股框架，在执行层面严格控制小市值风格暴露，并通过备选池优化机制防范微盘股相关风险，最终在震荡行情中实现对标指数的有效跟踪，并获取了相应的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达沪深300指数增强A基金份额净值为1.15750000元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.71%，同期业绩比较基准收益率为-0.20%；截至报告期末富安达沪深300指数增强C基金份额净值为1.15430000元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.65%，同期业绩比较基准收益率为-0.20%。

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，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§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	32,723,232.44	93.46
	其中：股票	32,723,232.44	93.46
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	2,287,471.87	6.53
8	其他资产	2,277.57	0.01
9	合计	35,012,981.88	100.00

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

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	462,290.00	1.33
B	采矿业	2,146,569.00	6.17
C	制造业	14,506,285.00	41.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	772,365.00	2.22
E	建筑业	581,219.00	1.67
F	批发和零售业	276,150.00	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	554,930.00	1.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,742,797.00	5.01
J	金融业	5,565,006.00	16.00
K	房地产业	126,144.00	0.36
L	租赁和商务服务业	478,753.00	1.38
M	科学研究和技术服务业	280,984.00	0.81
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	27,493,492.00	79.04

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

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	147,466.00	0.42
C	制造业	3,245,533.44	9.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	305,285.00	0.88
E	建筑业	73,769.00	0.21
F	批发和零售业	67,252.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	202,592.00	0.58
H	住宿和餐饮业	108,661.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	520,212.00	1.50
J	金融业	436,482.00	1.25
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	122,488.00	0.35
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	5,229,740.44	15.03

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

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	3,400	1,248,684.00	3.59
2	601318	中国平安	15,500	1,060,200.00	3.05
3	600519	贵州茅台	700	964,026.00	2.77
4	601899	紫金矿业	26,000	896,220.00	2.58
5	300308	中际旭创	1,300	793,000.00	2.28
6	002475	立讯精密	12,400	703,204.00	2.02
7	000333	美的集团	8,700	679,905.00	1.95
8	600036	招商银行	14,900	627,290.00	1.80
9	601211	国泰海通	24,200	497,310.00	1.43
10	600887	伊利股份	15,200	434,720.00	1.25

5.3.2 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	002078	太阳纸业	15,400	242,550.00	0.70
2	600418	江淮汽车	3,900	193,050.00	0.55
3	688536	思瑞浦	1,200	191,856.00	0.55
4	600933	爱柯迪	9,000	180,900.00	0.52
5	002759	天际股份	3,800	176,434.00	0.51

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金管理人在遵守法律法规和公司管理制度的前提下进行指数投资。整个过程中严格履行了相关的投资决策程序。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,277.57
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,277.57

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	富安达沪深300指数增强A	富安达沪深300指数增强C
报告期期初基金份额总额	7,396,274.82	37,797,887.02
报告期期间基金总申购份额	329,162.79	651,265.13
减：报告期期间基金总赎回份额	2,010,424.60	14,045,176.76
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	5,715,013.01	24,403,975.39

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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	20251001-20251231	14,190,454.95	-	-	14,190,454.95	47.11%
产品特有风险							

当持有基金份额比例达到或超过20%的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大的冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。

注：

①"申购份额"包含份额申购、转换转入、红利再投等导致份额增加的情况；

②"赎回份额"包含份额赎回、转换转出等导致份额减少的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、2025年10月25日，富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告

2、2025年10月25日，富安达沪深300指数增强型证券投资基金2025年第3季度报告

3、2025年11月05日，富安达沪深300指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新

4、2025年11月05日，富安达沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（二〇二五年第一号）

5、2025年11月05日，富安达沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书更新提示性公告

6、2025年11月18日，富安达基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子假冒本公司名义进行诈骗活动的公告

7、2025年11月20日，富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海国信嘉利基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告

8、2025年11月29日，富安达基金管理有限公司关于终止直销网上交易平台、微信交易平台相关业务服务的公告

9、2025年12月19日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加奕丰基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告

10、2025年12月25日，富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告

11、2025年12月27日，富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予富安达沪深300指数增强型证券投资基金注册的文件：

《富安达沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书》；

《富安达沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》；

《富安达沪深300指数增强型证券投资基金托管协议》。

2、《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

3、基金管理人业务资格批件和营业执照；

4、基金托管人业务资格批件和营业执照；

5、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

9.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.fadfunds.com）查阅。

富安达基金管理有限公司

2026年01月21日