

华富中证 A500 指数型证券投资基金 2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 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 2026 年 4 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华富中证 A500 指数
基金主代码	023331
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 8 月 19 日
报告期末基金份额总额	40,460,116.31 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的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，预期年化跟踪误差不超过 4%。本基金的港股通标的股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货交易策略、股指期货交易策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略详见招募说明书等法律文件。
业绩比较基准	中证 A500 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。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。本基金如果投资港股通标的股票，还可能面临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	华富基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华富中证 A500 指数 A	华富中证 A500 指数 C
下属分级基金的交易代码	023331	023332
报告期末下属分级基金的份额总额	12, 049, 671. 04 份	28, 410, 445. 27 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 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）	
	华富中证 A500 指数 A	华富中证 A500 指数 C
1. 本期已实现收益	1, 094, 845. 10	1, 601, 098. 36
2. 本期利润	2, 443, 402. 16	3, 498, 899. 66
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 1711	0. 1601
4. 期末基金资产净值	13, 951, 364. 99	32, 781, 898. 51
5. 期末基金份额净值	1. 1578	1. 1539

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

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 A500 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	14. 37%	1. 35%	13. 54%	1. 34%	0. 83%	0. 01%
过去六个月	12. 76%	1. 24%	11. 34%	1. 22%	1. 42%	0. 02%
自基金合同 生效起至今	15. 78%	1. 08%	24. 03%	1. 15%	-8. 25%	-0. 07%

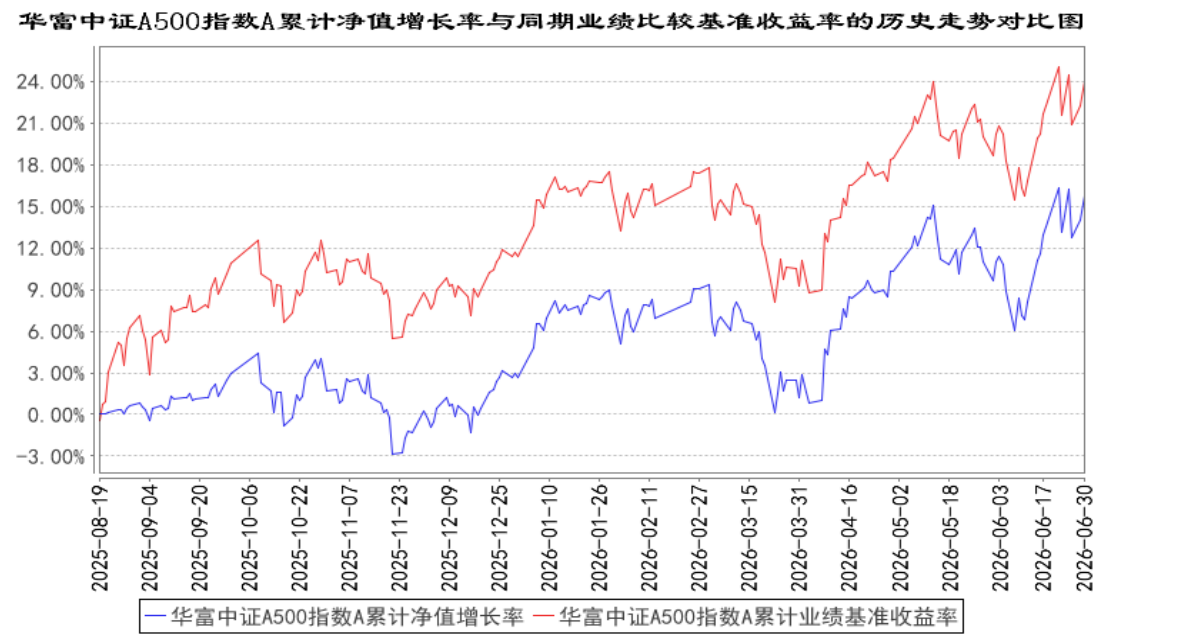
华富中证 A500 指数 C

阶段	净值增长率①	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	--------	-------	-------	-------	-----	-----

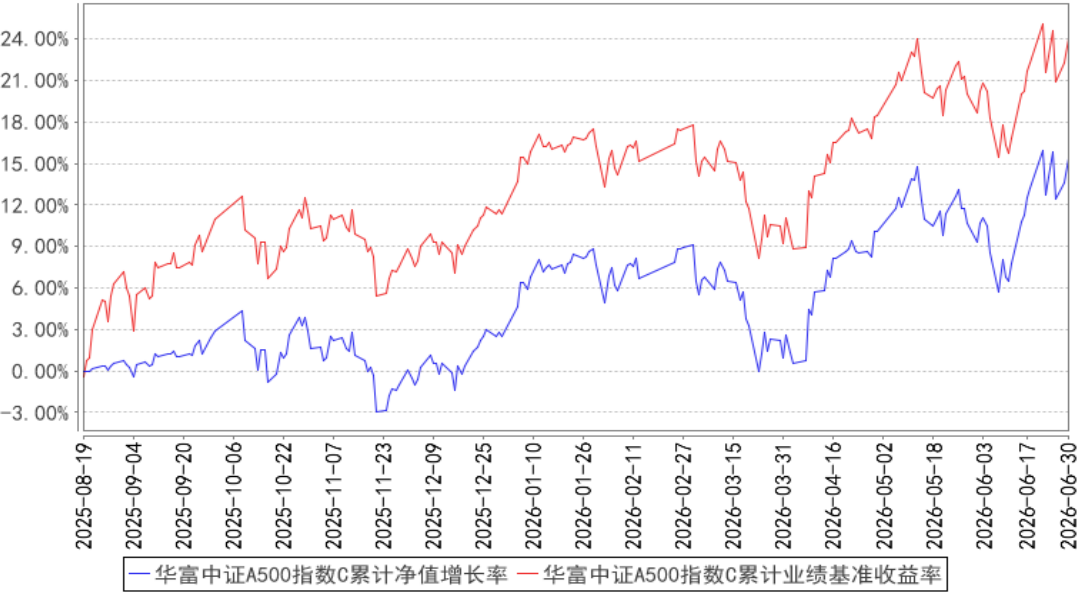
		标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	14.27%	1.35%	13.54%	1.34%	0.73%	0.01%
过去六个月	12.54%	1.24%	11.34%	1.22%	1.20%	0.02%
自基金合同生效起至今	15.39%	1.08%	24.03%	1.15%	-8.64%	-0.07%

注：本基金业绩比较基准收益率=中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（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A500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：截至本报告披露日，本基金的基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2025 年 8 月 19 日到 2026 年 2 月 19 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 A500 指数型证券投资基金基金合同》的规定。

§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		
李孝华	本基金基金经理、指数投资部权益指数经理	2025 年 8 月 19 日	-	十二年	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，自 2025 年 4 月 29 日起任华富中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 5 月 7 日起任华富新华中诚信红利价值指数型证券投资基金基金经理，自 2025 年 6 月 10 日起任华富华证沪深港汽车制造主题指数型发起式证券投资基金基金经理，自 2025 年 7 月 25 日起任华富中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2025 年 8 月 19 日起任华富中证 A500 指数型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。
张娅	本基金基金经理、公司总经理助理、指数投资部总监、公司公募投资决策委员会委员	2025 年 8 月 19 日	-	二十二年	美国肯特州立大学理学硕士，硕士研究生学历。历任华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部总监兼基金经理、上海同安投资管理有限公司副总经理兼宏观量化中心总经理。2017 年 4 月加入华富基金管理有限公司，自 2019 年 1 月 28 日起任华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金基金经理，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 2020 年 8 月 3 日起任华富中债-安徽省公司信用类债券指数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 5 月 7 日起任华富新华中诚信红利价值指数型证券投资基金基金经理，自 2025 年 8 月 19 日起任华富中证 A500 指数型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。
吴志鹏	本基金基金经理	2026 年 3 月 25 日	-	十年	美国锡拉丘兹大学理学硕士，硕士研究生学历。历任德邦基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理。2025 年 2

					月加入华富基金管理有限公司，曾任产品战略部产品专员，自 2025 年 11 月 13 日起任华富沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理，自 2026 年 3 月 25 日起任华富中证 A500 指数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。

4.2 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

在 2026 年第二季度的市场走势中，A 股市场整体呈现出“震荡修复、成长占优、结构分化、波动放大”的特征。经历一季度末的调整后，市场在二季度逐步企稳修复，风险偏好围绕科技成长方向重新抬升。6 月 30 日上半年收官日，主要宽基指数集体上涨，其中以科创 50 指数涨

幅居前，超过 64%，创业板指涨幅超过 35%，深证成指涨幅接近 20%，而上证指数涨幅相对温和，显示出成长风格显著强于传统大盘风格的市场特征。

从季度内节奏看，2026 年二季度 A 股并非单边上行，而是在科技主线带动下反复震荡。4 月至 5 月，人工智能、算力硬件、半导体、PCB、CPO、机器人、商业航天等方向持续活跃，推动创业板和科创板相关指数不断走强。进入 6 月后，受外部地缘扰动、海外利率预期变化以及前期热门板块交易拥挤度上升等因素影响，市场波动有所加大，科技成长方向一度出现快速调整，银行、保险等金融权重及部分高股息资产阶段性体现防御属性。但从产业趋势和资金偏好看，科技成长仍是二季度最核心的市场主线。

从行业结构看，2026 年二季度市场赚钱效应高度集中，电子、通信、半导体、存储芯片、CPO、PCB 等方向表现突出，而大消费、部分传统周期及地产链相关方向整体承压。上半年申万一级行业中，电子和通信行业涨幅居前，其中电子行业涨幅超过 80%，通信行业涨幅超过 70%；相比之下，商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料等大消费方向表现较弱，反映出市场对于产业景气度、盈利兑现能力和成长确定性的定价权重进一步提升。

本基金作为采取被动跟踪策略的指数基金产品，在 2026 年二季度期间整体运作平稳，未来我们将继续紧密跟踪标的指数，力求成为投资者配置 A 股核心资产的理想工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富中证 A500 指数 A 份额净值为 1.1578 元，累计份额净值为 1.1578 元。报告期，华富中证 A500 指数 A 份额净值增长率为 14.37%，同期业绩比较基准收益率为 13.54%。截止本期末，华富中证 A500 指数 C 份额净值为 1.1539 元，累计份额净值为 1.1539 元。报告期，华富中证 A500 指数 C 份额净值增长率为 14.27%，同期业绩比较基准收益率为 13.54%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2026 年 3 月 2 日起至 2026 年 4 月 14 日，本基金基金资产净值存在连续二十个工作日低于 5000 万元的情形。从 2026 年 4 月 22 日起至 2026 年 6 月 30 日，本基金基金资产净值存在连续二十个工作日低于 5000 万元的情形，至本报告期末（2026 年 6 月 30 日）基金资产净值仍低于 5000 万元。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取相关措施，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

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	41,371,633.60	88.05
	其中：股票	41,371,633.60	88.05
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	2,982,678.58	6.35
8	其他资产	2,629,718.03	5.60
9	合计	46,984,030.21	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	14,326.00	0.03
B	采矿业	1,363,438.00	2.92
C	制造业	29,355,426.21	62.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	582,559.00	1.25
E	建筑业	241,018.00	0.52
F	批发和零售业	119,154.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	917,257.00	1.96
H	住宿和餐饮业	21,714.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,078,005.05	4.45
J	金融业	3,582,691.00	7.67
K	房地产业	158,725.00	0.34
L	租赁和商务服务业	76,359.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	674,759.00	1.44
N	水利、环境和公共设施管理业	210,688.00	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	11,700.00	0.03
Q	卫生和社会工作	38,416.00	0.08

R	文化、体育和娱乐业	15,687.00	0.03
S	综合	—	—
	合计	39,461,922.26	84.44

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

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	1,631,359.34	3.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	56,301.00	0.12
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	17,341.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	26,460.00	0.06
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	150,443.00	0.32
K	房地产业	27,807.00	0.06
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	1,909,711.34	4.09

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	300308	中际旭创	1,500	1,905,000.00	4.08
2	300750	宁德时代	3,700	1,454,137.00	3.11
3	300502	新易盛	2,040	1,238,280.00	2.65
4	603986	兆易创新	1,100	896,500.00	1.92

5	600519	贵州茅台	700	829,843.00	1.78
6	688256	寒武纪	511	815,326.05	1.74
7	002384	东山精密	2,400	629,640.00	1.35
8	002371	北方华创	700	619,192.00	1.32
9	688012	中微公司	1,276	597,806.00	1.28
10	688041	海光信息	1,555	575,816.50	1.23

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	600522	中天科技	7,000	424,760.00	0.91
2	688525	佰维存储	800	395,784.00	0.85
3	000657	中钨高新	3,000	287,160.00	0.61
4	688017	绿的谐波	600	250,716.00	0.54
5	600816	建元信托	57,900	141,276.00	0.30

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

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

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

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

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本期未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。

5.11.2 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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约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	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	2,629,718.03
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	2,629,718.03

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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

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

单位：份

项目	华富中证 A500 指数 A	华富中证 A500 指数 C
报告期期初基金份额总额	18,706,266.94	24,186,236.58
报告期期间基金总申购份额	3,587,775.52	23,683,401.79
减：报告期期间基金总赎回份额	10,244,371.42	19,459,193.10
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	12,049,671.04	28,410,445.27

§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

本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、华富中证 A500 指数型证券投资基金基金合同
- 2、华富中证 A500 指数型证券投资基金托管协议
- 3、华富中证 A500 指数型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富中证 A500 指数型证券投资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

2026 年 7 月 21 日