

华富沪深 300 指数增强型证券投资基金 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：恒丰银行股份有限公司

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。

基金托管人恒丰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	华富沪深 300 指数增强
基金主代码	024626
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 7 月 29 日
报告期末基金份额总额	42,871,194.67 份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，追求实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置，在控制基金跟踪误差的前提下，通过对基本面的深入研究及分析谋求在偏离风险和超额收益间的最佳配置。本基金的股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货交易策略、股指期货交易策略等详见招募说明书等法律文件。
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	恒丰银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华富沪深 300 指数增强 A	华富沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	024626	024627
报告期末下属分级基金的份额总额	15, 599, 179. 33 份	27, 272, 015. 34 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）	
	华富沪深 300 指数增强 A	华富沪深 300 指数增强 C
1. 本期已实现收益	897, 607. 43	1, 302, 873. 63
2. 本期利润	4, 373, 875. 91	5, 889, 488. 16
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 1887	0. 2157
4. 期末基金资产净值	19, 595, 846. 91	34, 131, 576. 74
5. 期末基金份额净值	1. 2562	1. 2515

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

华富沪深 300 指数增强 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	20. 36%	1. 51%	11. 30%	1. 19%	9. 06%	0. 32%
过去六个月	16. 77%	1. 29%	7. 20%	1. 07%	9. 57%	0. 22%
自基金合同 生效起至今	25. 62%	1. 15%	19. 37%	1. 00%	6. 25%	0. 15%

华富沪深 300 指数增强 C

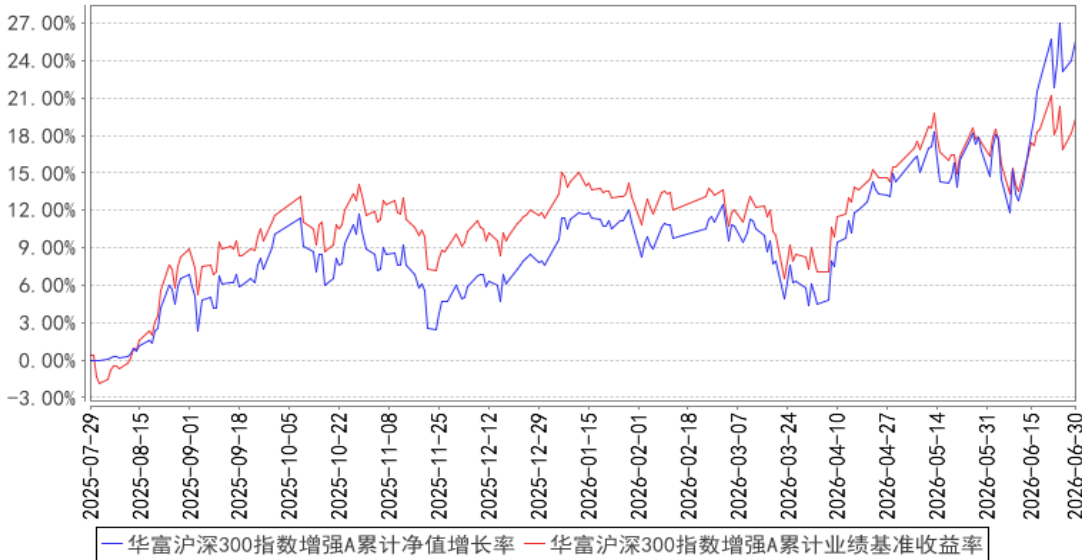
阶段	净值增长率①	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	--------	-------	-------	-------	-----	-----

		标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	20.24%	1.51%	11.30%	1.19%	8.94%	0.32%
过去六个月	16.54%	1.29%	7.20%	1.07%	9.34%	0.22%
自基金合同生效起至今	25.15%	1.15%	19.37%	1.00%	5.78%	0.15%

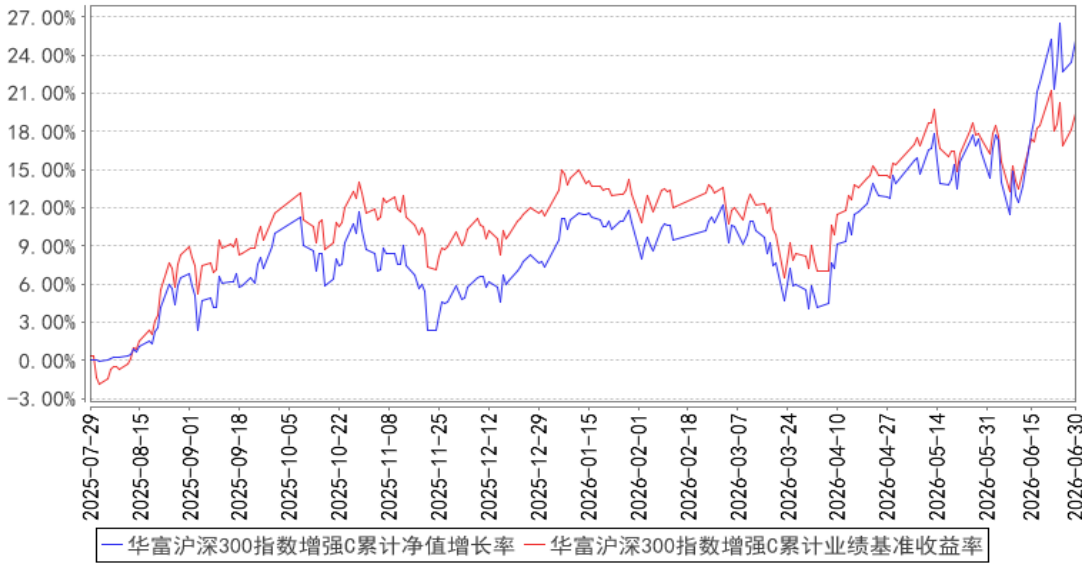
注：本基金业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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

华富沪深300指数增强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



华富沪深300指数增强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，本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2025 年 7 月 29 日到 2026 年 1 月 29 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《华富沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的相关规定。

§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		
郜哲	本基金基金经理	2025 年 7 月 29 日	-	十三年	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 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 6 月 5 日起任华富中证港股通创新药指数型发起式证券投资基金基金经理，自 2025 年 7 月 29 日起任华富沪深 300 指数增强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	2025 年 11 月 13 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。

回到量化增强的角度，成长类在 2026 年二季度继续延续了一季度的强势，但随着交易拥挤度抬升和市场轮动加快，短期波动也有所放大。价值类、反转类因子持续走弱，目前仍未看到改善的迹象，质量类因子底部企稳向上。综上，后续科技成长仍然是中期值得重点跟踪的主线，但未来超额收益的获取将更多依赖对基本面改善、质量稳定性等能力的筛选，而非对单一成长性的线性外推。

在投资管理上，本基金坚持采取量化策略进行投资管理与风险控制，通过以基本面为驱动的多因子选股模型，把握优质个股的投资机会，积极获取超额收益。组合构建上，本基金将继续关注成长类方向中的优质公司，同时逐步提升对质量、盈利稳定性和低波动特征的重视程度，在控制组合波动与回撤的前提下，力争在 A 股市场的结构性行情中持续积累超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富沪深 300 指数增强 A 份额净值为 1.2562 元，累计份额净值为 1.2562 元。报告期，华富沪深 300 指数增强 A 份额净值增长率为 20.36%，同期业绩比较基准收益率为 11.30%。截止本期末，华富沪深 300 指数增强 C 份额净值为 1.2515 元，累计份额净值为 1.2515 元。报告期，华富沪深 300 指数增强 C 份额净值增长率为 20.24%，同期业绩比较基准收益率为 11.30%。

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

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	47,447,883.85	87.50
	其中：股票	47,447,883.85	87.50
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	5,868,381.90	10.82
8	其他资产	909,741.94	1.68
9	合计	54,226,007.69	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	—	—
B	采矿业	969,821.00	1.81
C	制造业	27,788,385.30	51.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	299,662.00	0.56
E	建筑业	141,770.00	0.26
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	729,480.00	1.36
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,791,106.55	3.33
J	金融业	6,502,232.00	12.10
K	房地产业	46,854.00	0.09
L	租赁和商务服务业	174,442.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	1,431,865.00	2.67
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	41,300.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	39,916,917.85	74.30

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	7,482,346.00	13.93
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	48,620.00	0.09
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	-	-
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	7,530,966.00	14.02

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	2,400	3,048,000.00	5.67
2	300750	宁德时代	6,000	2,358,060.00	4.39
3	300502	新易盛	3,820	2,318,740.00	4.32
4	688256	寒武纪	941	1,501,412.55	2.79
5	603259	药明康德	11,500	1,431,865.00	2.67
6	600519	贵州茅台	1,200	1,422,588.00	2.65
7	603986	兆易创新	1,600	1,304,000.00	2.43
8	002463	沪电股份	8,400	1,283,520.00	2.39
9	300408	三环集团	7,100	1,184,990.00	2.21
10	600176	中国巨石	15,100	1,100,488.00	2.05

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	301308	江波龙	1,900	1,337,220.00	2.49
2	002384	东山精密	3,500	918,225.00	1.71
3	000657	中钨高新	8,900	851,908.00	1.59
4	600549	厦门钨业	8,000	681,600.00	1.27
5	688072	拓荆科技	500	439,765.00	0.82

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

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
----	----	-----	---------	-----------	------

		(买/卖)			
IF2612	IF2612	2	2,856,840.00	57,480.00	-
公允价值变动总额合计（元）					57,480.00
股指期货投资本期收益（元）					-64.57
股指期货投资本期公允价值变动（元）					57,480.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数增强型基金，投资于股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要。在综合考虑股指期货合约的流动性，股指期货合约的基差等多种因素下，动态选择股指期货合约进行投资，以更好地实现投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

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	342,820.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	566,921.14
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	909,741.94

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

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	688072	拓荆科技	439,765.00	0.82	上市股票停牌

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	华富沪深 300 指数增强 A	华富沪深 300 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	21,314,211.40	28,937,055.63
报告期期间基金总申购份额	10,425,222.96	7,837,135.31
减：报告期期间基金总赎回份额	16,140,255.03	9,502,175.60
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	15,599,179.33	27,272,015.34

§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、华富沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同
- 2、华富沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议
- 3、华富沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富沪深 300 指数增强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