
华富沪深 300 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

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

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 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	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
7.8 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贵金属投资明细	45

7.9 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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	48
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
11.1 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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富沪深 300 指数增强型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份 额总额	42,871,194.67 份	
基金合同存续期	不定期	
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

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华富基金管理有限公司	恒丰银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	林之懿	梁明
	联系电话	021-68886996	021-63890689
	电子邮箱	linzy@hffund.com	liangming@hfbank.com.cn

客户服务电话	400-700-8001	95395
传真	021-68887997	021-63890708
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层	济南市历下区泺源大街 8 号
办公地址	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	上海市黄浦区开平路 88 号瀛通绿地大厦 16 楼
邮政编码	200120	200023
法定代表人	余海春	辛树人

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
据和指标	华富沪深 300 指数增强 A	华富沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	1,859,937.04	3,062,458.89
本期利润	3,807,140.80	5,476,647.73
加权平均基金份额本期利润	0.1735	0.1779
本期加权平均净值利润率	15.42%	15.89%
本期基金份额净值增长率	16.77%	16.54%
3.1.2 期末数	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
据和指标		
期末可供分配利润	3,350,079.61	5,735,328.67
期末可供分配基金份额利润	0.2148	0.2103

期末基金资产净值	19,595,846.91	34,131,576.74
期末基金份额净值	1.2562	1.2515
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	25.62%	25.15%

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）以上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（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3）期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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%

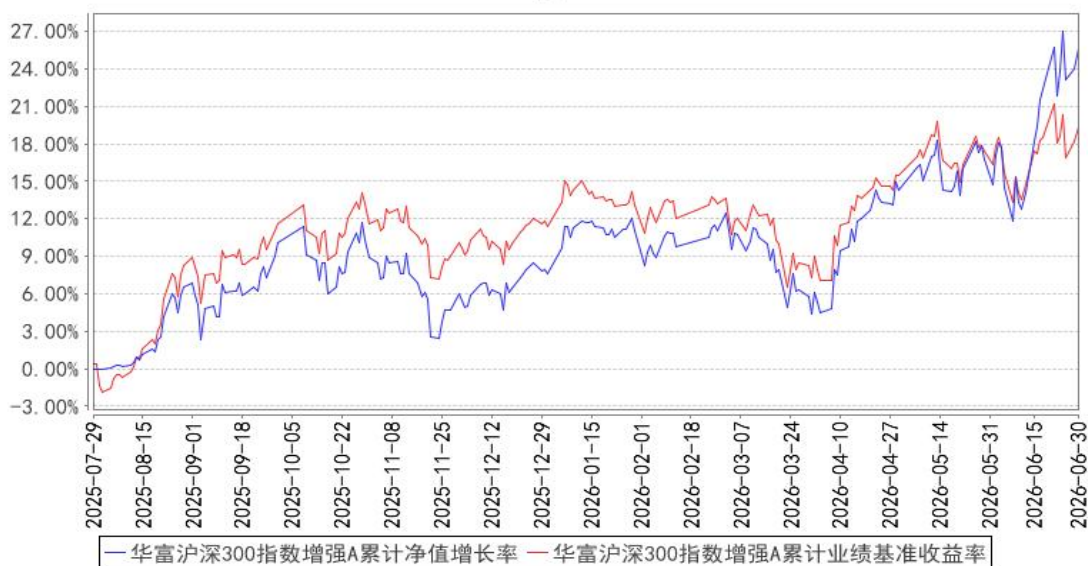
华富沪深 300 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	20.24%	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：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份额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：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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号

文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用融资担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、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、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、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、华富新能源股票型发起式证券投资基金、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华富匠心明选一年持有期混合型证券投资基金、华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富安业一年持有期债券型证券投资基金、华富消费成长股票型证券投资基金、华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、华富时代锐选混合型证券投资基金、华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富匠心领航 18 个月持有期混合型证券投资基金、华富数字经济混合型证券投资基金、华富荣盛一年持有期混合型证券投资基金、华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金、华富泰合平衡 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华富恒享纯债债券型证券投资基金、华富恒惠纯债债券型证券投资

资基金、华富半导体产业混合型发起式证券投资基金、华富祥晖 6 个月持有期债券型证券投资基金、华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金、华富鼎信 3 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、华富新华中诚信红利价值指数型证券投资基金、华富吉福 120 天滚动持有债券型证券投资基金、华富中证港股通创新药指数型发起式证券投资基金、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、华富祥康 12 个月持有期债券型证券投资基金、华富富润债券型证券投资基金、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、华富沪深 300 指数增强型证券投资基金、华富富源三个月持有期债券型证券投资基金、华富医疗创新混合型发起式证券投资基金、华富中证 A500 指数型证券投资基金、华富安顺一年持有期债券型证券投资基金、华富福盛一年持有期混合型证券投资基金、华富安康三个月持有期债券型证券投资基金、华富安和债券型证券投资基金、华富富泽六个月持有期债券型证券投资基金、华富安颐九个月持有期债券型证券投资基金、华富裕诚一年持有期债券型证券投资基金、华富天华货币市场基金、华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）、华富安沣债券型证券投资基金、华富淳丰保守养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）共九十只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在 2026 年上半年的市场走势中，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。从运行节奏看，上半年市场大致可分为两个阶段：一季度，A 股在“十五五”开局之年实现平稳起步，宏观总量保持稳定，但市场整体以震荡整理为主，结构分化已经开始显现；二季度，经历一季度末调整后，市场逐步企稳修复，风险偏好重新围绕科技成长方向抬升，

带动主要成长风格指数显著上行。

从指数表现看，2026 年上半年主要宽基指数整体上涨，但风格分化极为明显。截至 6 月 30 日，科创 50 指数涨幅超过 60%，创业板指涨幅超过 30%，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。从更长的报告期视角看，一季度市场并非单边走强，科创 50 一季度仍下跌，而进入二季度后成长方向快速修复并成为主线，这也说明上半年市场的收益主要集中在后半程释放。

回到量化增强的角度，2026 年上半年因子表现呈现出较为清晰的阶段性演化特征。一季度，成长类因子在经历 2025 年四季度短期调整后进入震荡蓄势阶段，但中期趋势并未改变；进入二季度后，成长类因子重新延续强势，不过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。与此同时，价值类、反转类因子持续走弱，目前仍未看到明显改善迹象；质量类因子则逐步呈现底部企稳向上的特征。这一变化与此前对因子周期的判断基本一致：质量类因子自 2021 年上半年高点以来，调整时间已接近 3 年半，时间和空间上均相对到位，后续有望逐步进入新一轮相对长期的上行阶段。

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，积极获取超额收益率。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。

4.4.2 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 16.77%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。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 16.54%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，国内经济总体仍有望延续稳中有进、结构分化的运行特征。上半年经济运行总体平稳，但外需与新动能表现好于内需与传统链条，呈现出较为明显的 K 型分化格局。在此背景下，下半年政策重点预计仍将围绕加快存量政策落地、强化财政与货币协同、推动新旧动能平稳切换展开。财政端，超长期特别国债、专项债及新型政策性金融工具有望在三、四季度加快形成实物工作量，重点支持“两重”、“六网”、城市更新、能源电网、算力网络及民生服务等领域；货币端，适度宽松基调预计延续，流动性环境整体保持充裕，但政策操作将更强调精准性与结构性支持。

从证券市场看，A 股在经历 2026 年上半年科技成长主导的结构性上涨后，下半年仍有望延续震荡演绎、结构分化的特征。市场的核心驱动预计将进一步从上半年的估值扩张转向业绩验证，投资者对盈利兑现能力、景气持续性和基本面稳定性的要求将明显提升。短期看，市场在中报披露和外部流动性扰动阶段或仍面临波动；但在国内流动性保持支持性、增量资金入市仍可期待的背景下，A 股整体大幅下行风险相对有限，结构性机会仍值得积极把握。

从行业与风格演绎看，科技成长仍然是中期值得重点跟踪的主线。全球 AI 产业资本开支持续高增，需求正由训练端向推理端、应用端扩散，电子、通信、半导体、算力硬件及相关高端制造方向仍具备较强景气支撑。但经历 2026 年上半年快速上涨后，科技成长内部的交易拥挤度和波动水平已有所上升，后续行情更可能从“成长普涨”转向“优质成长分化”，即超额收益更多集中于景气趋势明确、业绩兑现能力强、质量稳定性更高的优质公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、利润分配情况等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华富沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	5,205,245.82	2,801,997.15
结算备付金		663,136.08	3,850,180.53
存出保证金		342,820.80	—
交易性金融资产	6.4.7.2	47,447,883.85	71,504,277.00
其中：股票投资		47,447,883.85	71,504,277.00
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收清算款		—	—
应收股利		—	—
应收申购款		566,921.14	64,703.14
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—
资产总计		54,226,007.69	78,221,157.82
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		381,059.64	1,754,459.12
应付管理人报酬		37,227.03	58,632.41
应付托管费		4,653.39	7,329.04
应付销售服务费		10,185.21	19,336.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	65,458.77	161,400.00
负债合计		498,584.04	2,001,156.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	42,871,194.67	70,933,444.59
未分配利润	6.4.7.12	10,856,228.98	5,286,556.41
净资产合计		53,727,423.65	76,220,001.00
负债和净资产总计		54,226,007.69	78,221,157.82

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 42,871,194.67 份，其中华富沪深 300 指数增强 A 基金份额总额 15,599,179.33 份，基金份额净值 1.2562 元；华富沪深 300 指数增强 C 基金份额总额 27,272,015.34 份，基金份额净值 1.2515 元。

6.2 利润表

会计主体：华富沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		9,681,221.44
1. 利息收入		6,070.47
其中：存款利息收入	6.4.7.13	6,070.47
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,284,201.93
其中：股票投资收益	6.4.7.14	4,884,161.57
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-

衍生工具收益	6.4.7.18	25,209.34
股利收益	6.4.7.19	374,831.02
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	4,361,392.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	29,556.44
减：二、营业总支出		397,432.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	234,837.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	29,354.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	68,682.66
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		91.22
8. 其他费用	6.4.7.23	64,466.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,283,788.53
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,283,788.53
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		9,283,788.53

注：本基金成立于 2025 年 07 月 29 日，无上年度可比期间。

6.3 净资产变动表

会计主体：华富沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	70,933,444.59	-	5,286,556.41	76,220,001.00
二、本期期初净资产	70,933,444.59	-	5,286,556.41	76,220,001.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-28,062,249.92	-	5,569,672.57	-22,492,577.35
（一）、综合收益总额	-	-	9,283,788.53	9,283,788.53
（二）、本期基金份额交易产生的	-28,062,249.92	-	-3,714,115.96	-31,776,365.88

净资产变动数 （净资产减少以 “-”号填列）				
其中：1. 基金申 购款	27,139,969.34	-	3,735,666.01	30,875,635.35
2. 基金赎 回款	-55,202,219.26	-	-7,449,781.97	-62,652,001.23
（三）、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的净 资产变动（净资 产减少以“-”号 填列）	-	-	-	-
四、本期期末净 资产	42,871,194.67	-	10,856,228.98	53,727,423.65

注：本基金成立于 2025 年 07 月 29 日，无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

余海春
基金管理人负责人

曹华玮
主管会计工作负责人

束庆斌
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华富沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证监会 2025 年证监许可【2025】1198 号核准，基金合同于 2025 年 7 月 29 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集资金到位情况经容诚会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具《验资报告》（容诚验字【2025】200Z0111 号）。有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案。本基金的管理人为华富基金管理有限公司，基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为恒丰银行股份有限公司。

根据《华富沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包括主板、科创板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、地方政府债券、政府支持债券、政府

支持机构债券、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、国债期货、股指期货、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照企业会计准则及其应用指南、准则解释及其他相关规定（包括《资产管理产品相关会计处理规定》）（以下统称企业会计准则）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》《证券投资基金会计核算业务指引》基金合同和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净资产变动等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于

上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比

例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	2,353,789.42
等于：本金	2,353,663.15
加：应计利息	126.27
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	2,851,456.40
等于：本金	2,851,413.55
加：应计利息	42.85
合计	5,205,245.82

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		41,650,343.12	-	47,447,883.85	5,797,540.73
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		41,650,343.12	-	47,447,883.85	5,797,540.73

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------

	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,799,360.00	-	-	-
其中：股指期货投资	2,799,360.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,799,360.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2612	IF2612	2.00	2,856,840.00	57,480.00
合计				57,480.00
减：可抵销期货暂收款				57,480.00
净额				-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	24,795.19
其他	992.00
应付信息披露费	39,671.58
合计	65,458.77

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华富沪深 300 指数增强 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,296,828.62	24,296,828.62
本期申购	14,780,579.56	14,780,579.56
本期赎回（以“-”号填列）	-23,478,228.85	-23,478,228.85
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	15,599,179.33	15,599,179.33

华富沪深 300 指数增强 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	46,636,615.97	46,636,615.97
本期申购	12,359,389.78	12,359,389.78
本期赎回（以“-”号填列）	-31,723,990.41	-31,723,990.41
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	27,272,015.34	27,272,015.34

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华富沪深 300 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,833,913.66	-993,264.90	1,840,648.76
本期期初	2,833,913.66	-993,264.90	1,840,648.76
本期利润	1,859,937.04	1,947,203.76	3,807,140.80
本期基金份额交易产生的变动数	-1,343,771.09	-307,350.89	-1,651,121.98
其中：基金申购款	2,368,199.23	-404,453.82	1,963,745.41
基金赎回款	-3,711,970.32	97,102.93	-3,614,867.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,350,079.61	646,587.97	3,996,667.58

华富沪深 300 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,349,266.16	-1,903,358.51	3,445,907.65
本期期初	5,349,266.16	-1,903,358.51	3,445,907.65
本期利润	3,062,458.89	2,414,188.84	5,476,647.73
本期基金份额交易产生的变动数	-2,676,396.38	613,402.40	-2,062,993.98
其中：基金申购款	2,027,248.10	-255,327.50	1,771,920.60
基金赎回款	-4,703,644.48	868,729.90	-3,834,914.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,735,328.67	1,124,232.73	6,859,561.40

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,577.59
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	678.48
结算备付金利息收入	2,814.40
其他	-
合计	6,070.47

注：1. “其他” 包含结算保证金利息收入及认申购款利息收入。

2. 其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
----	----------------------------

股票投资收益——买卖股票差价收入	4,884,161.57
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	4,884,161.57

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	209,719,679.24
减：卖出股票成本总额	204,636,208.05
减：交易费用	199,309.62
买卖股票差价收入	4,884,161.57

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	25,209.34

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	374,831.02
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	374,831.02

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,303,912.60
股票投资	4,303,912.60
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	57,480.00
权证投资	-
期货投资	57,480.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,361,392.60

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	29,556.44
合计	29,556.44

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
合计	64,466.77

6.4.7.20 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
恒丰银行股份有限公司（“恒丰银行”）	基金托管人、基金销售机构
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金成立于 2025 年 07 月 29 日，无上年度可比期间。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
华安证券	60,320,845.41	15.63

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
华安证券	11,213.78	16.09	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费等费用后的净额列示。

2. 根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，本产品交易佣金仅用于支付向证券公司租用交易单元所产生的费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	234,837.51
其中：应支付销售机构的客户维护费	105,901.32
应支付基金管理人的净管理费	128,936.19

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.8% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	29,354.75

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H=E\times \text{年托管费率}\div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富沪深 300 指数增 强 A	华富沪深 300 指数增 强 C	合计
华安证券	-	5,593.76	5,593.76
华富基金管理有限公司	-	-	-
恒丰银行	-	2,531.78	2,531.78
合计	-	8,125.54	8,125.54

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40%年费率每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。计算公式 $H=E\times \text{年销售服务费率}\div \text{当年天数}$ （H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费，E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值）。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期和上年度可比期间基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
恒丰银行股份有限公司	2,353,789.42	2,577.59
华安证券	1,382,612.31	198.02

注：本基金采用券商结算模式，本基金的银行存款由基金托管人、证券经纪商华安证券股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	上市股票停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	500	268,763.11	439,765.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无未到期交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的風險主要包括信用風險、流动性風險及市場風險。本基金管理人已建立董事會領導下的架構清晰、控制有效、系統全面、切實可行的風險控制體系，並設定適當的風險限額及內部控制流程，通過可靠的管理及信息系統持續監控上述各類風險。

董事會下設風險管理委員會，負責對公司風險管理制度進行審查並提供諮詢和建議。總經理下設投資決策委員會和風險控制委員會，負責對公司经营及基金運作中的風險進行研究、評估和監控。公司設督察長，組織、指導公司監察稽核工作，監督檢查基金及公司運作的合法合規情況和公司的內部風險控制情況。公司設有獨立的风险管理部、監察稽核部，對公司各部門內部風險控制制度的建立和落實情況進行檢查，對公司的內部風險控制制度的合理性、有效性進行分析，提出改進意見，上報總經理，通報督察長。

6.4.13.2 信用風險

信用風險是指基金在交易過程中因交易對手未履行合約責任，或者基金所投資證券之發行人出現違約、拒絕支付到期本息等情況，導致基金資產損失和收益變化的風險。

本基金的基金管理人在交易前對交易對手的資信狀況進行了充分的評估。本基金的銀行存款均存放於信用良好的銀行，因而與銀行存款相關的信用風險不重大。本基金在交易所進行的交易均以中國證券登記結算有限責任公司為交易對手完成證券交收和款項清算，違約可能性很小；在銀行間同業市場進行交易前均對交易對手進行信用評估並對證券交割方式進行限制以控制相應的信用風險。

本基金的基金管理人建立了信用風險管理流程，通過對投資品種信用等級評估來控制證券發行人的信用風險，且通過分散化投資以分散信用風險。

6.4.13.2.1 按短期信用評級列示的債券投資

本基金本報告期末和上年度末未持有按短期信用評級列示的債券

6.4.13.2.2 按短期信用評級列示的資產支持證券投資

本基金本報告期末和上年度末未持有按短期信用評級列示的資產支持證券。

6.4.13.2.3 按短期信用評級列示的同業存單投資

本基金本報告期末和上年度末未持有按短期信用評級列示的同業存單

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的债券

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。除卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所持有的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期

等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	5,205,245.82	-	-	-	-	-	5,205,245.82
结算备付金	663,136.08	-	-	-	-	-	663,136.08
存出保证金	342,820.80	-	-	-	-	-	342,820.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	47,447,883.85	47,447,883.85
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	566,921.14	566,921.14
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	6,211,202.70	-	-	-	-	48,014,804.99	54,226,007.69
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	381,059.64	381,059.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	37,227.03	37,227.03
应付托管费	-	-	-	-	-	4,653.39	4,653.39
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,185.21	10,185.21
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	65,458.77	65,458.77
负债总计	-	-	-	-	-	498,584.04	498,584.04
利率敏感度缺口	6,211,202.70	-	-	-	-	47,516,220.95	53,727,423.65
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产							
货币资金	2,801,997.15	-	-	-	-	-2,801,997.15	
结算备付金	3,850,180.53	-	-	-	-	-3,850,180.53	
存出保证金	-	-	-	-	-	-	
交易性金融资产	-	-	-	-	-	71,504,277.00	71,504,277.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	
债权投资	-	-	-	-	-	-	
应收股利	-	-	-	-	-	-	
应收申购款	-	-	-	-	-	64,703.14	64,703.14
应收清算款	-	-	-	-	-	-	
其他资产	-	-	-	-	-	-	
资产总计	6,652,177.68	-	-	-	-	71,568,980.14	78,221,157.82
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,754,459.12	1,754,459.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	58,632.41	58,632.41
应付托管费	-	-	-	-	-	7,329.04	7,329.04
应付清算款	-	-	-	-	-	-	
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	
应付销售服务费	-	-	-	-	-	19,336.25	19,336.25
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	
应付利润	-	-	-	-	-	-	
应交税费	-	-	-	-	-	-	
其他负债	-	-	-	-	-	161,400.00	161,400.00
负债总计	-	-	-	-	-	2,001,156.82	2,001,156.82
利率敏感度缺口	6,652,177.68	-	-	-	-	69,567,823.32	76,220,001.00

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金净值无重大影响（上期末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	47,447,883.85	88.31	71,504,277.00	93.81
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	47,447,883.85	88.31	71,504,277.00	93.81

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升百分之五	3,218,243.21	4,185,665.63

	沪深 300 指数下降 百分之五	-3, 218, 243. 21	-4, 185, 665. 63
--	---------------------	------------------	------------------

6. 4. 14 公允价值

6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

6. 4. 14. 2. 1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	47, 008, 118. 85	71, 332, 458. 00
第二层次	439, 765. 00	171, 819. 00
第三层次	-	-
合计	47, 447, 883. 85	71, 504, 277. 00

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6. 4. 14. 3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6. 4. 14. 4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	其他各项资产	909,741.94	1.68
9	合计	54,226,007.69	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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

7.2.2 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

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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
11	688012	中微公司	2,337	1,094,884.50	2.04
12	600183	生益科技	6,100	1,057,740.00	1.97
13	300059	东方财富	49,800	1,014,924.00	1.89
14	600150	中国船舶	28,600	966,394.00	1.80
15	002916	深南电路	2,100	961,590.00	1.79
16	002142	宁波银行	28,800	855,072.00	1.59
17	605117	德业股份	6,700	711,406.00	1.32
18	601138	工业富联	9,700	699,855.00	1.30
19	002709	天赐材料	13,000	668,590.00	1.24
20	601995	中金公司	17,500	632,625.00	1.18
21	300661	圣邦股份	4,400	631,312.00	1.18
22	000725	京东方 A	72,400	628,432.00	1.17
23	601988	中国银行	109,800	628,056.00	1.17
24	601939	建设银行	61,800	595,134.00	1.11
25	300033	同花顺	2,420	583,220.00	1.09
26	600160	巨化股份	11,000	583,110.00	1.09
27	000333	美的集团	7,700	581,581.00	1.08
28	600026	中远海能	30,000	538,200.00	1.00
29	601088	中国神华	13,500	527,040.00	0.98
30	002371	北方华创	400	353,824.00	0.66
31	000301	东方盛虹	30,000	343,500.00	0.64
32	300394	天孚通信	1,060	320,840.80	0.60
33	002466	天齐锂业	5,000	306,600.00	0.57
34	603288	海天味业	8,000	265,280.00	0.49
35	000338	潍柴动力	9,600	261,600.00	0.49
35	002460	赣锋锂业	4,000	261,600.00	0.49
36	600309	万华化学	3,000	205,230.00	0.38
37	600900	长江电力	7,600	201,172.00	0.37
38	302132	中航成飞	3,100	180,792.00	0.34

39	601100	恒立液压	1,500	161,340.00	0.30
40	603369	今世缘	6,300	149,373.00	0.28
41	601225	陕西煤业	7,000	142,450.00	0.27
42	601398	工商银行	19,500	137,865.00	0.26
43	601899	紫金矿业	5,100	128,214.00	0.24
44	603260	合盛硅业	2,400	115,824.00	0.22
45	600030	中信证券	3,000	86,190.00	0.16
46	601888	中国中免	1,400	75,194.00	0.14
47	688041	海光信息	200	74,060.00	0.14
48	000001	平安银行	7,100	71,355.00	0.13
49	601998	中信银行	10,200	70,686.00	0.13
50	000776	广发证券	2,900	67,860.00	0.13
51	600999	招商证券	3,200	67,520.00	0.13
52	601818	光大银行	22,700	65,603.00	0.12
53	600460	士兰微	1,200	65,592.00	0.12
54	601211	国泰海通	3,600	65,520.00	0.12
55	601881	中国银河	5,200	65,364.00	0.12
56	603019	中科曙光	600	64,338.00	0.12
57	601318	中国平安	1,300	62,062.00	0.12
58	688008	澜起科技	200	61,980.00	0.12
59	600000	浦发银行	7,100	61,131.00	0.11
60	601066	中信建投	2,100	61,047.00	0.11
61	688506	百利天恒	200	58,806.00	0.11
62	300014	亿纬锂能	900	58,527.00	0.11
63	300442	润泽科技	700	58,149.00	0.11
64	601901	方正证券	8,000	57,600.00	0.11
65	601009	南京银行	5,600	55,384.00	0.10
66	000938	紫光股份	1,900	54,834.00	0.10
67	000166	申万宏源	12,400	54,560.00	0.10
68	601688	华泰证券	2,600	53,612.00	0.10
69	601628	中国人寿	1,500	53,025.00	0.10
70	002493	荣盛石化	4,900	52,675.00	0.10
71	002050	三花智控	1,200	52,596.00	0.10
72	600276	恒瑞医药	1,000	52,040.00	0.10
73	600362	江西铜业	1,200	51,960.00	0.10
74	600415	小商品城	5,100	51,816.00	0.10
75	601288	农业银行	8,500	51,595.00	0.10
76	601878	浙商证券	5,400	51,300.00	0.10
77	600015	华夏银行	8,000	51,120.00	0.10
78	601689	拓普集团	900	50,778.00	0.09
79	600919	江苏银行	4,700	50,666.00	0.09
80	300832	新产业	1,200	50,400.00	0.09
81	001965	招商公路	5,500	50,380.00	0.09

82	600918	中泰证券	9,400	50,008.00	0.09
83	601166	兴业银行	3,000	49,680.00	0.09
84	000630	铜陵有色	7,800	49,608.00	0.09
85	600674	川投能源	3,500	49,595.00	0.09
86	600019	宝钢股份	9,100	49,413.00	0.09
87	605499	东鹏饮料	400	49,372.00	0.09
88	600025	华能水电	5,500	48,895.00	0.09
89	601658	邮储银行	9,900	48,807.00	0.09
90	600887	伊利股份	2,000	47,920.00	0.09
91	002415	海康威视	1,400	47,880.00	0.09
92	002027	分众传媒	9,800	47,432.00	0.09
93	000538	云南白药	1,000	47,370.00	0.09
94	600515	海南机场	17,100	46,854.00	0.09
95	600016	民生银行	14,400	46,368.00	0.09
96	002422	科伦药业	1,200	46,224.00	0.09
97	600482	中国动力	1,400	45,920.00	0.09
98	600406	国电南瑞	2,000	45,700.00	0.09
99	688223	晶科能源	9,400	44,650.00	0.08
100	601136	首创证券	3,200	44,640.00	0.08
101	002648	卫星化学	1,900	44,631.00	0.08
102	002311	海大集团	1,000	44,610.00	0.08
103	600372	中航机载	4,100	44,485.00	0.08
104	300418	昆仑万维	1,100	44,396.00	0.08
105	002049	紫光国微	500	44,375.00	0.08
106	300628	亿联网络	1,300	43,966.00	0.08
107	600809	山西汾酒	400	43,748.00	0.08
108	603799	华友钴业	900	43,434.00	0.08
109	600111	北方稀土	900	43,245.00	0.08
110	601236	红塔证券	6,300	42,966.00	0.08
111	601825	沪农商行	5,700	42,693.00	0.08
112	601238	广汽集团	8,400	42,672.00	0.08
113	600036	招商银行	1,200	42,600.00	0.08
114	600346	恒力石化	2,400	42,504.00	0.08
115	601377	兴业证券	7,000	42,280.00	0.08
116	000807	云铝股份	1,900	42,066.00	0.08
117	600061	国投资本	6,400	41,920.00	0.08
118	601788	光大证券	2,900	41,847.00	0.08
119	601916	浙商银行	15,900	41,817.00	0.08
120	600600	青岛啤酒	800	41,784.00	0.08
121	601336	新华保险	700	41,762.00	0.08
122	000408	藏格矿业	600	41,592.00	0.08
123	300015	爱尔眼科	5,000	41,300.00	0.08
124	688036	传音控股	700	41,265.00	0.08

125	601021	春秋航空	900	41,022.00	0.08
126	002736	国信证券	4,100	40,959.00	0.08
127	300760	迈瑞医疗	300	40,749.00	0.08
128	000999	华润三九	1,800	40,482.00	0.08
129	600196	复星医药	1,800	40,446.00	0.08
130	603993	洛阳钼业	2,300	40,365.00	0.08
131	000596	古井贡酒	500	39,900.00	0.07
132	601328	交通银行	6,200	39,866.00	0.07
133	601186	中国铁建	6,600	39,270.00	0.07
134	601360	三六零	4,500	39,105.00	0.07
135	600926	杭州银行	2,700	39,015.00	0.07
136	601059	信达证券	2,400	38,856.00	0.07
137	000568	泸州老窖	500	38,760.00	0.07
138	600989	宝丰能源	1,900	38,627.00	0.07
139	601058	赛轮轮胎	3,300	38,049.00	0.07
140	600233	圆通速递	2,400	37,800.00	0.07
141	600039	四川路桥	4,800	37,536.00	0.07
142	601857	中国石油	4,300	37,324.00	0.07
143	601127	赛力斯	600	36,750.00	0.07
144	600570	恒生电子	1,700	36,023.00	0.07
145	000617	中油资本	5,300	34,927.00	0.07
146	002028	思源电气	200	34,600.00	0.06
147	600028	中国石化	7,700	34,342.00	0.06
148	601800	中国交建	5,900	33,689.00	0.06
149	300413	芒果超媒	2,300	33,649.00	0.06
150	601838	成都银行	1,900	33,630.00	0.06
151	688472	阿特斯	3,100	33,542.00	0.06
152	600426	华鲁恒升	1,400	33,488.00	0.06
153	000157	中联重科	4,800	33,456.00	0.06
154	601898	中煤能源	2,700	32,886.00	0.06
155	002230	科大讯飞	800	32,672.00	0.06
156	600029	南方航空	6,100	31,598.00	0.06
157	601390	中国中铁	7,500	31,275.00	0.06
158	600115	中国东航	8,000	30,480.00	0.06
159	601077	渝农商行	4,500	27,495.00	0.05
160	000975	山金国际	1,600	27,200.00	0.05
161	600219	南山铝业	6,800	27,132.00	0.05

7.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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
6	600487	亨通光电	3,000	328,020.00	0.61
7	688469	芯联集成	28,000	297,080.00	0.55
8	001309	德明利	300	282,870.00	0.53
9	688603	天承科技	1,000	207,950.00	0.39
10	300857	协创数据	600	203,940.00	0.38
11	688525	佰维存储	400	197,892.00	0.37
12	000988	华工科技	1,000	184,610.00	0.34
13	688625	呈和科技	2,000	168,820.00	0.31
14	603324	盛剑科技	3,000	153,780.00	0.29
15	002741	光华科技	4,000	142,960.00	0.27
16	605376	博迁新材	500	135,650.00	0.25
17	600869	远东股份	4,000	133,880.00	0.25
18	603688	石英股份	1,500	123,915.00	0.23
19	688183	生益电子	900	119,160.00	0.22
20	001389	广合科技	500	118,625.00	0.22
21	301377	鼎泰高科	200	110,180.00	0.21
22	002484	江海股份	1,000	105,000.00	0.20
23	300835	龙磁科技	400	91,796.00	0.17
24	603893	瑞芯微	300	56,508.00	0.11
25	601456	国联民生	5,500	48,620.00	0.09
26	600522	中天科技	800	48,544.00	0.09
27	002625	光启技术	1,400	42,448.00	0.08

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	4,513,907.00	5.92
2	300308	中际旭创	3,187,462.00	4.18
3	600176	中国巨石	3,106,984.00	4.08
4	688256	寒武纪	2,866,229.00	3.76
5	300502	新易盛	2,778,627.00	3.65
6	605117	德业股份	2,665,753.00	3.50
7	601138	工业富联	2,537,019.00	3.33
8	000408	藏格矿业	2,399,471.00	3.15
9	601939	建设银行	2,390,744.00	3.14
10	601398	工商银行	2,127,861.00	2.79
11	600519	贵州茅台	2,111,038.00	2.77
12	600183	生益科技	1,966,061.00	2.58
13	601088	中国神华	1,946,937.00	2.55
14	600160	巨化股份	1,945,592.00	2.55

15	603799	华友钴业	1,910,806.00	2.51
16	002709	天赐材料	1,875,983.31	2.46
17	002460	赣锋锂业	1,846,123.00	2.42
18	000630	铜陵有色	1,810,398.00	2.38
19	600938	中国海油	1,794,712.00	2.35
20	300476	胜宏科技	1,740,559.24	2.28
21	601872	招商轮船	1,722,201.00	2.26
22	600026	中远海能	1,688,205.00	2.21
23	300394	天孚通信	1,684,319.00	2.21
24	688111	金山办公	1,661,087.51	2.18
25	002384	东山精密	1,649,824.00	2.16
26	002463	沪电股份	1,622,499.00	2.13
27	603986	兆易创新	1,621,367.00	2.13
28	002371	北方华创	1,595,512.00	2.09
29	300059	东方财富	1,581,247.00	2.07
30	002415	海康威视	1,573,981.00	2.07

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	5,268,351.00	6.91
2	601398	工商银行	3,963,178.00	5.20
3	688256	寒武纪	3,754,033.08	4.93
4	300750	宁德时代	3,567,899.00	4.68
5	300502	新易盛	3,475,520.00	4.56
6	601899	紫金矿业	3,306,511.00	4.34
7	600176	中国巨石	3,010,287.00	3.95
8	601336	新华保险	2,924,886.00	3.84
9	300442	润泽科技	2,628,369.99	3.45
10	000408	藏格矿业	2,550,708.00	3.35
11	600066	宇通客车	2,500,395.00	3.28
12	603296	华勤技术	2,499,430.00	3.28
13	300476	胜宏科技	2,300,537.00	3.02
14	300274	阳光电源	2,231,874.00	2.93
15	000166	申万宏源	2,227,066.00	2.92
16	002916	深南电路	2,225,116.00	2.92
17	600989	宝丰能源	2,195,384.00	2.88
18	002028	思源电气	2,157,804.00	2.83
19	002371	北方华创	2,115,953.00	2.78
20	000708	中信特钢	2,113,167.00	2.77

21	300033	同花顺	2,070,914.00	2.72
22	603259	药明康德	2,012,965.00	2.64
23	601138	工业富联	2,002,446.00	2.63
24	603993	洛阳钼业	1,962,789.00	2.58
25	601628	中国人寿	1,933,472.00	2.54
26	605117	德业股份	1,926,291.92	2.53
27	600183	生益科技	1,917,737.00	2.52
28	601939	建设银行	1,873,092.00	2.46
29	601872	招商轮船	1,861,032.00	2.44
30	603986	兆易创新	1,813,423.00	2.38
31	600039	四川路桥	1,802,038.00	2.36
32	302132	中航成飞	1,795,957.00	2.36
33	605499	东鹏饮料	1,693,682.00	2.22
34	600938	中国海油	1,675,977.28	2.20
35	600029	南方航空	1,670,427.00	2.19
36	600519	贵州茅台	1,650,374.00	2.17
37	000630	铜陵有色	1,637,761.00	2.15
38	600150	中国船舶	1,617,485.90	2.12
39	000895	双汇发展	1,614,916.00	2.12
40	688111	金山办公	1,613,827.60	2.12
41	603799	华友钴业	1,589,736.00	2.09
42	601377	兴业证券	1,582,339.00	2.08
43	688008	澜起科技	1,562,025.52	2.05

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	176,275,902.30
卖出股票收入（成交）总额	209,719,679.24

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 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贵金属投资明细
无。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策
无。

7.11.2 本期国债期货投资评价
无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	342,820.80
2	应收清算款	-
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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	909,741.94

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	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

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
华富沪深300指数增强A	901	17,313.18	198,019.80	1.27	15,401,159.53	98.73
华富沪深300指数增强C	1,870	14,583.97	5,744,525.45	21.06	21,527,489.89	78.94
合计	2,771	15,471.38	5,942,545.25	13.86	36,928,649.42	86.14

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自份额级别的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业	华富沪深300指数增强A	68,454.18	0.4388
	华富沪深300指数增强C	360.04	0.0013

人员持有本基金			
	合计	68,814.22	0.1605

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华富沪深 300 指数增强 A	0
	华富沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华富沪深 300 指数增强 A	0~10
	华富沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0~10

§ 9 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
基金合同生效日 （2025 年 7 月 29 日） 基金份额总额	98,318,193.12	171,010,145.81
本报告期期初基金份额总额	24,296,828.62	46,636,615.97
本报告期基金总申购份额	14,780,579.56	12,359,389.78
减：本报告期基金总赎回份额	23,478,228.85	31,723,990.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	15,599,179.33	27,272,015.34

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人重大人事变动情况如下：

2026 年 3 月 27 日，经公司董事会审议批准，由公司总经理曹华玮先生代为履行督察长职务，代行期限不超过六个月。

2026 年 6 月 30 日，经公司董事会审议批准，免去尹培俊先生公司副总经理职务。

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人不存在受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员不存在受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人不存在受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人相关从业人员不存在受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
金元证券	2	205,427,822.87	53.22	36,134.30	51.84	-
广发证券	2	120,246,913.26	31.15	22,354.00	32.07	-

华安证券	2	60,320,845.41	15.63	11,213.78	16.09	-
------	---	---------------	-------	-----------	-------	---

注：1）根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称“规定”）（证监会公告[2024]3号），我公司在综合比较多家证券经营机构的财务状况、经营状况后，选择了财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易服务能力较强的券商租用了基金专用交易单元进行证券投资或委托证券公司办理证券投资。

2）我公司自 2024 年 7 月 1 日起执行法规关于佣金比例的规定，本产品本报告期内佣金比例符合法规有关要求。

3）此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

4）本基金使用券商结算模式，本报告期内管理人选择以上券商作为证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
金元证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华富沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 1 月 22 日
2	华富基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 1 月 22 日
3	华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 3 月 20 日
4	华富基金管理有限公司关于总经理代为履行督察长职务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2026 年 3 月 28 日

		站	
5	华富沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 3 月 31 日
6	华富基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 3 月 31 日
7	华富基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 3 月 31 日
8	华富基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 4 月 22 日
9	华富沪深 300 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 4 月 22 日
10	华富基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 4 月 22 日
11	公募基金管理人华富基金管理有限公司对外行使投票表决权（2025 年度）情况信息披露	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026 年 4 月 23 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 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 8 月 31 日