富安达中证A500指数增强型证券投资基金

2026年第3季度报告

2026年09月30日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2026年10月24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 11
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 14
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 14
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 14
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。基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达中证A500指数增强
基金主代码	023435
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025年04月01日
报告期末基金份额总额	43,716,648.82份
投资目标	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	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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	富安达中证A500指数增强A	富安达中证A500指数增强C
下属分级基金的交易代码	023435	023436
报告期末下属分级基金的份额总额	28,722,586.26份	14,994,062.56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07月01日 - 2026年09月30日)	
	富安达中证A500指数增强A	富安达中证A500指数增强C
1.本期已实现收益	879,850.25	429,465.94
2.本期利润	-1,323,782.40	-1,013,742.54
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0476	-0.0698
4.期末基金资产净值	34,454,077.07	17,918,430.70
5.期末基金份额净值	1.1995	1.1950

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

富安达中证A500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	-5.26%	1.41%	-14.23%	1.43%	8.97%	-0.02%
过去六个月	4.64%	1.36%	-2.62%	1.40%	7.26%	-0.04%
过去一年	3.22%	1.21%	-4.10%	1.24%	7.32%	-0.03%
自基金合同生效起至今	19.95%	1.04%	16.23%	1.17%	3.72%	-0.13%

富安达中证A500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	-5.32%	1.41%	-14.23%	1.43%	8.91%	-0.02%
过去六个月	4.50%	1.36%	-2.62%	1.40%	7.12%	-0.04%
过去一年	2.96%	1.21%	-4.10%	1.24%	7.06%	-0.03%
自基金合同生效起至今	19.50%	1.04%	16.23%	1.17%	3.27%	-0.13%

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





§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）	2025-04-01	-	18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、富安达稳健配置6个月持有期混合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、富安达智优量化选股混合型发起式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、《富安达中证A500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

2026年三季度A股震荡调整，终结了上半年科技领涨的行情，市场开启深度调整与风格再平衡。资金大幅从高位科技成长板块流出，向高股息、资源品等价值板块迁移，高低切换特征十分突出。市场下行由科技板块估值消化与全球流动性收紧双重驱动，叠加杠杆资金去化，市场进入整固阶段。量化因子维度，拥挤交易退潮，防御因子占据上风：价值、红利、低波、质量因子表现占优，成长、动量、小市值等前期拥挤因子回撤剧烈。我们的策略模型在市场回撤中避开了前期较为拥挤的选股因子，呈现出较好的抗跌性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达中证A500指数增强A基金份额净值为1.1995元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.26%，同期业绩比较基准收益率为-14.23%；截至报告期末富安达中证A500指数增强C基金份额净值为1.1950元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.32%，同期业绩比较基准收益率为-14.23%。

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，本基金曾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	49,029,762.31	93.27
	其中：股票	49,029,762.31	93.27
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	3,486,389.22	6.63
8	其他资产	50,155.01	0.10
9	合计	52,566,306.54	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	-	-
B	采矿业	2,452,394.00	4.68
C	制造业	27,386,898.23	52.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,285,055.00	2.45
E	建筑业	908,345.00	1.73
F	批发和零售业	872,255.00	1.67
G	交通运输、仓储和邮政业	1,029,613.00	1.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,169,559.70	4.14
J	金融业	4,278,222.00	8.17
K	房地产业	734,090.00	1.40
L	租赁和商务服务业	455,735.00	0.87
M	科学研究和技术服务业	686,094.00	1.31
N	水利、环境和公共设施管理业	114,972.00	0.22
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	186,584.00	0.36
S	综合	224,738.00	0.43

	合计	42,784,554.93	81.69

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	-	-
C	制造业	3,489,206.96	6.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	275,210.00	0.53
E	建筑业	182,270.00	0.35
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	167,349.00	0.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	739,548.42	1.41
J	金融业	872,938.00	1.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	190,021.00	0.36
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	328,664.00	0.63
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	6,245,207.38	11.92

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	300308	中际旭创	2,100	1,697,724.00	3.24
2	600519	贵州茅台	900	1,132,758.00	2.16
3	601318	中国平安	19,700	1,049,813.00	2.00
4	300750	宁德时代	3,200	931,552.00	1.78
5	600036	招商银行	19,900	821,074.00	1.57
6	601899	紫金矿业	27,500	819,225.00	1.56
7	000725	京东方Ａ	124,500	712,140.00	1.36
8	603259	药明康德	4,100	686,094.00	1.31
9	300408	三环集团	5,500	645,315.00	1.23
10	000333	美的集团	8,055	645,205.50	1.23

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	600380	健康元	21,300	216,408.00	0.41
2	000877	天山股份	52,700	198,152.00	0.38
3	002958	青农商行	66,900	196,686.00	0.38
4	601169	北京银行	35,000	194,950.00	0.37
5	603866	桃李面包	46,300	194,923.00	0.37

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约定的备选股票库。

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	50,155.01
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	50,155.01

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

本基金本报告期末指数投资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

	富安达中证A500指数增强A	富安达中证A500指数增强C
报告期期初基金份额总额	24,185,902.26	14,848,379.34
报告期期间基金总申购份额	12,263,127.56	1,292,358.46
减：报告期期间基金总赎回份额	7,726,443.56	1,146,675.24
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	28,722,586.26	14,994,062.56

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

单位：份

	富安达中证A500指数增强A	富安达中证A500指数增强C
报告期期初管理人持有的本基金份额	3,624,777.09	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,624,777.09	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	12.62	-

注：买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、 2026年7月18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、2026年7月18日，富安达中证A500指数增强型证券投资基金2026年第2季度报告

3、2026年8月19日，富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加广发证券股份有限公司为销售机构的公告

4、 2026年8月29日，富安达基金管理有限公司旗下全部基金中期报告提示性公告

5、 2026年8月29日，富安达中证A500指数增强型证券投资基金2026年中期报告

6、 2026年8月31日，富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加福克斯(北京)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

7、 2026年9月9日，富安达基金管理有限公司关于北京分公司注销的公告

8、2026年9月11日，富安达基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料的公告

9、 2026年9月16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

10、 2026年9月19日，富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华鑫证券有限责任公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告

§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中证A500指数增强型证券投资基金注册的文件：

《富安达中证A500指数增强型证券投资基金招募说明书》；

《富安达中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》；

《富安达中证A500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10月24日