华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 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 2026 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华富中证科创创业 50 指数增强
基金主代码	016122
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 8 月 31 日
报告期末基金份额总额	230,299,247.00 份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证科创创业 50 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金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 8.00%。 股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资以个股精选策略为主。在本基金的投资过程中，将控制股票投资组合与标的指数的结构性偏离，以期在长期实现持续超越标的指数收益率的投资目标。 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，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额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。 本基金的资产配置策略、股票投资策略、债券投资策

	略、国债期货投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、参与转融通证券出借业务策略等详见法律文件。	
业绩比较基准	中证科创创业 50 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，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时，本基金属于指数增强型基金，跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金如果投资港股通标的股票，需承担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	平安银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华富中证科创创业 50 指数增强 A	华富中证科创创业 50 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	016122	016123
报告期末下属分级基金的份额总额	77,413,686.35 份	152,885,560.65 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 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	华富中证科创创业 50 指数增强 A	华富中证科创创业 50 指数增强 C
1.本期已实现收益	-4,491,587.05	-8,327,780.58
2.本期利润	-37,235,222.08	-66,166,320.76
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5802	-0.5655
4.期末基金资产净值	125,472,804.31	243,771,344.08
5.期末基金份额净值	1.6208	1.5945

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

华富中证科创创业 50 指数增强 A

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	-28.46%	2.92%	-31.91%	2.97%	3.45%	-0.05%
过去六个月	21.09%	2.82%	10.22%	2.81%	10.87%	0.01%
过去一年	14.78%	2.43%	4.87%	2.41%	9.91%	0.02%
过去三年	106.39%	2.14%	82.74%	2.15%	23.65%	-0.01%
自基金合同生效起至今	62.08%	1.89%	45.67%	1.93%	16.41%	-0.04%

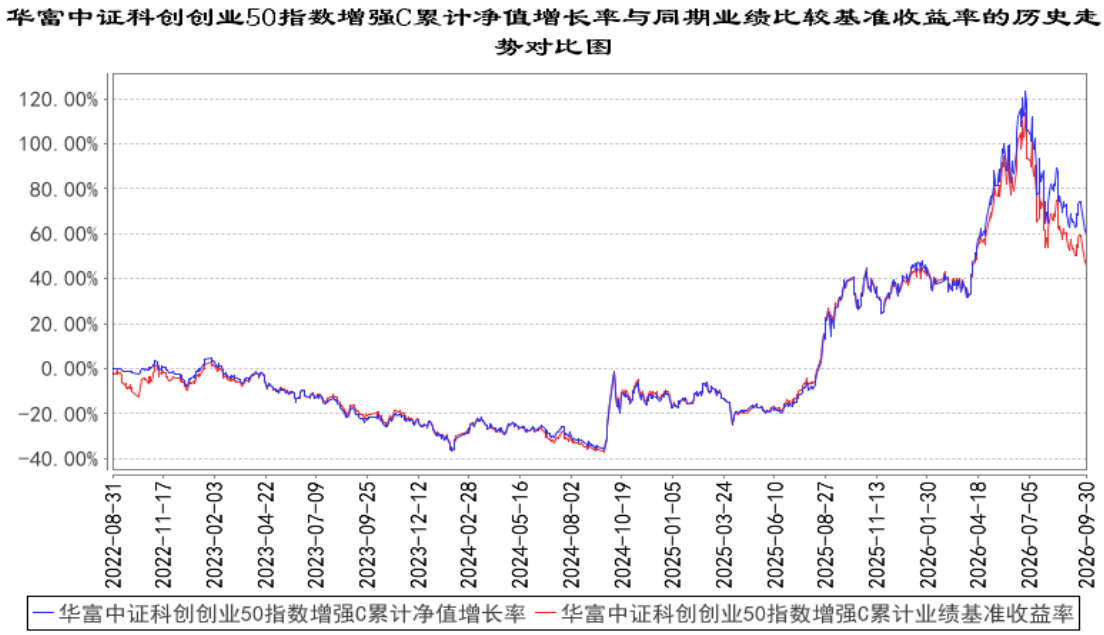
华富中证科创创业 50 指数增强 C

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	-28.53%	2.92%	-31.91%	2.97%	3.38%	-0.05%
过去六个月	20.86%	2.82%	10.22%	2.81%	10.64%	0.01%
过去一年	14.33%	2.43%	4.87%	2.41%	9.46%	0.02%
过去三年	103.93%	2.14%	82.74%	2.15%	21.19%	-0.01%
自基金合同生效起至今	59.45%	1.89%	45.67%	1.93%	13.78%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准收益率=中证科创创业 50 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





注：本基金建仓期为 2022 年 8 月 31 日到 2023 年 2 月 28 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《华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金合同》的相关约定。

§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	2022 年 8 月 31 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，自 2026 年 7 月 1 日起任华富中证港股通信息技术综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2026 年 9 月 28 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发起式联接基金基金经理，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、公司指数投资决策委员会主任委员	2022 年 8 月 31 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。

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遵规守信情况的说明

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

2026 年三季度，A 股市场在上半年科技行情的高位上经历了一轮剧烈调整。7 月，前期涨幅较大、交易高度拥挤的 AI 硬件与半导体方向率先回落，海外科技股调整、杠杆资金去化与美联储加息预期升温相互叠加，市场经历了年内最大的一次月度回调，资金阶段性转向石油石化、煤炭、银行等防御板块。8 月，中报陆续披露，全市场盈利增速较一季度进一步回升，科创板与创业板盈利维持高增长，超跌的科技成长方向迎来修复。9 月，中东局势反复推升国际油价，美国通胀数据超出预期，美联储重启加息，美债长端收益率快速攀升至多年来的高位，全球高估值、长久期资产普遍承压，A 股成长板块再度走弱。

总结 2026 年三季度，市场运行有两个突出特征：一是拥挤度的释放主导了季内波动，上半年“景气外推”的定价方式让位于对估值与业绩匹配度的重新审视；二是海外利率环境由松转

紧，折现率上行对科技成长资产形成明显压制，而上市公司业绩仍在改善，股价与基本面之间出现了阶段性背离。

科创创业50指数聚焦科创板与创业板中的科技创新龙头，2026年上半年涨幅居前、交易集中度较高，三季度在拥挤交易出清与海外利率冲击的双重影响下出现了较大幅度的回撤。各细分赛道来看：

人工智能与TMT方向，股价调整与产业景气走出了不同的轨迹。2026年7月的下跌主要源于极致行情之后的筹码结构脆弱，9月的回落则更多来自海外加息以及市场对AI资本开支回报的审视。但产业景气并未逆转：多家北美云厂商上调全年资本开支指引，海外算力龙头业绩与指引均好于预期；国内存储芯片景气延续，国产AIDC基建链在半年报中开始兑现业绩，9月华为发布的新一代昇腾芯片研发进度较原计划显著提前，国产算力正从单卡比拼走向系统级的全栈竞争。

新能源方向，2026年三季度内经历了从修复到回落的过程。储能项目集中并网，下半年装机需求较为旺盛，“反内卷”持续推动供给侧出清；但锂盐价格自二季度高点持续回落，9月出现单边下行，叠加排产增速放缓和市场对明年储能需求的分歧，电池与能源金属板块在9月调整幅度较大。

医药生物方向，创新药走出“先扬后抑、再度回暖”的行情。2026年7月初，医保与商保创新药目录调整引入预申报等新机制，叠加资金从科技板块切换，创新药强势反弹；8月至9月上旬热度有所降温；9月中旬，医保谈判顺利收官，世界肺癌大会上多项国产创新药数据亮眼，板块重新获得资金关注。

2026年三季度，本基金继续坚持“先行业比较、后针对性选股”的主动量化增强框架，依据量化模型对市场所处状态（成长市、价值市、过渡市）的判断动态调整行业偏离：风格明确时适度放大偏离，风格模糊时收紧偏离、贴近基准，在严格控制跟踪误差的前提下运作。

行业配置层面：2026年三季度季初，考虑到算力方向前期涨幅较大、交易拥挤度处于高位，组合延续6月底再平衡后的结构，超配锂电、医药、游戏等业绩较好而前期滞涨的方向，选股上侧重盈利预期与低波动特征。7月中下旬，科技板块深度调整后，我们判断行业层面进入企稳筑底阶段，行业轮动的置信度下降，因此主动收敛行业偏离，使组合与基准保持较紧的贴合；在有限的偏离中，一是超配前期超跌的AI相关环节中的半导体材料与元件，二是超配电池、能源金属等二线景气行业。8月中报披露期前后，组合在控制行业偏离的前提下重点挖掘业绩超预期的个股；9月海外加息冲击下市场波动加大，组合进一步向指数靠拢，收缩偏离幅度，规避宏观风险。

个股选择层面：延续量化多因子模型与基本面研究相结合的选股体系，并按行业属性区别对待。对于 AI 相关行业，先框定前期跌幅较大的个股，再从中优选技术壁垒高、盈利预期较好的公司；对于二线景气行业，主要优选竞争壁垒突出、盈利预期向好的公司。同时在合规前提下参与新股申购，作为超额收益的补充。

我们将继续深化量化与基本面融合的投资体系，力争在紧密跟踪标的指数的基础上，为持有人创造持续、稳健的超额回报，与投资者共享中国科技创新与产业升级的时代红利。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本期末,华富中证科创创业 50 指数增强 A 份额净值为 1.6208 元,累计份额净值为 1.6208 元。报告期，华富中证科创创业 50 指数增强 A 份额净值增长率为-28.46%,同期业绩比较基准收益率为-31.91%。截止本期末，华富中证科创创业 50 指数增强 C 份额净值为 1.5945 元，累计份额净值为 1.5945 元。报告期，华富中证科创创业 50 指数增强 C 份额净值增长率为-28.53%,同期业绩比较基准收益率为-31.91%。

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	332,642,396.54	88.98
	其中：股票	332,642,396.54	88.98
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	28,910,660.45	7.73
8	其他资产	12,285,659.74	3.29
9	合计	373,838,716.73	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	-	-
C	制造业	270,432,646.45	73.24
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	30,662,662.34	8.30
J	金融业	-	-
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	301,095,308.79	81.54

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	3,390.75	0.00
C	制造业	25,214,663.88	6.83
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	3,396,947.12	0.92
J	金融业	-	-

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	2,932,086.00	0.79
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	31,547,087.75	8.54

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	37,800	30,559,032.00	8.28
2	300502	新易盛	76,488	29,753,832.00	8.06
3	300750	宁德时代	85,800	24,977,238.00	6.76
4	688256	寒武纪	19,734	19,911,803.34	5.39
5	688012	中微公司	58,172	18,530,690.60	5.02
6	688981	中芯国际	149,995	16,797,940.05	4.55
7	688041	海光信息	64,266	14,575,528.80	3.95
8	688008	澜起科技	56,697	11,470,370.07	3.11
9	688498	源杰科技	6,802	10,971,626.00	2.97
10	300408	三环集团	92,200	10,817,826.00	2.93

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	002281	光迅科技	20,500	3,380,040.00	0.92
2	300759	康龙化成	49,200	2,212,524.00	0.60
3	688235	百济神州	6,888	1,821,256.08	0.49
4	000636	风华高科	35,900	1,780,999.00	0.48
5	688702	盛科通信	5,232	1,490,649.12	0.40

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	12,285,659.74
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	12,285,659.74

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	华富中证科创创业 50 指数增强 A	华富中证科创创业 50 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	39,550,867.91	75,167,569.08
报告期期间基金总申购份额	59,717,858.91	203,683,507.56
减:报告期期间基金总赎回份额	21,855,040.47	125,965,515.99
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	77,413,686.35	152,885,560.65

§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、华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金合同

2、华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金托管协议

3、华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富中证科创创业 50 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 10 月 27 日