

# 富安达上证科创板综合指数增强型证券投资基金

2026年第1季度报告

2026年03月31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04月21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	12
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	12
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	13
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	13
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	13
§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	14

## §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4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1月1日起至3月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	富安达上证科创板综合指数增强
基金主代码	025875
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025年11月21日
报告期末基金份额总额	105,369,144.00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	<p>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%的基础上获得超越标的指数的表现。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成分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，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分股进行调整。</p>
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率*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	富安达上证科创板综合指数增强A	富安达上证科创板综合指数增强C
下属分级基金的交易代码	025875	025876
报告期末下属分级基金的份额总额	87,386,852.88份	17,982,291.12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01月01日 - 2026年03月31日)	
	富安达上证科创板综合指数增强A	富安达上证科创板综合指数增强C
1.本期已实现收益	-259,194.93	-98,048.50
2.本期利润	-7,396,425.82	-1,682,770.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0715	-0.0844
4.期末基金资产净值	79,232,878.21	16,289,934.25
5.期末基金份额净值	0.9067	0.9059

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本基金《基金合同》生效日为2025年11月21日，截至本报告期末，基金成立未满1年。

#### 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

富安达上证科创板综合指数增强A净值表现

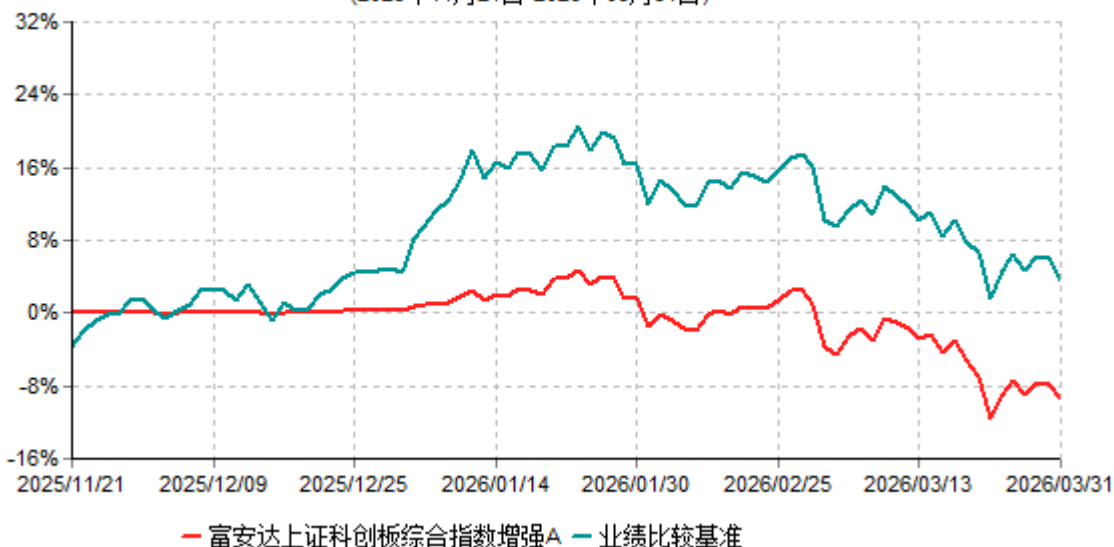
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④

				④		
过去三个月	-9.65%	1.54%	-0.99%	1.92%	-8.66%	-0.38%
自基金合同生效起至今	-9.33%	1.25%	3.52%	1.72%	-12.85%	-0.47%

## 富安达上证科创板综合指数增强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	-9.70%	1.54%	-0.99%	1.92%	-8.71%	-0.38%
自基金合同生效起至今	-9.41%	1.25%	3.52%	1.72%	-12.93%	-0.47%

## 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

富安达上证科创板综合指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2025年11月21日-2026年03月31日)

富安达上证科创板综合指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2025年11月21日-2026年03月31日)

注：①本基金《基金合同》生效日为2025年11月21日，截至本报告期末，基金成立未满1年。

②根据本基金《基金合同》规定，本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2026年5月20日。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## §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）	2025-11-21	-	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、富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金、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》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、《富安达上证科创板综合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年第一季度，A股市场整体运行呈现政策预期先行驱动、基本面数据接力验证、外部风险传导扰动的递进式演化特征。在内外宏观因素交织影响下，市场由前期情绪修复逐步转向震荡调整，全季度风险偏好整体呈现先升后降、逐步收敛的格局。季度初期，在“十五五”规划开局的政策红利支撑下，市场情绪与流动性环境偏积极；进入季中及后期，受美伊地缘政治冲突持续升级影响，全球避险情绪显著升温，市场波动率明显放大，前期领涨的科技成长板块出现阶段性回调，市场增量资金入场节奏亦同步边际放缓。风格与因子维度，本季度A股量化因子表现出鲜明且连贯的轮动特征：期初成长、动量因子表现占优；随着市场进入震荡整固阶段，质量与价值因子逐步取得相对收益；至后期避险情绪主导环境下，价值与质量因子的防御属性进一步凸显。本产品采用指数增强投资策略，依托系统化多因子模型开展量化选股，并在组合管理中对各类风险因子暴露实施动态约束与精细化管控。由于前期市场上涨斜率较高，本基金建仓期采用分段建仓方式，目前已基本到达基础仓位水平。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达上证科创板综合指数增强A基金份额净值为0.9067元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.65%，同期业绩比较基准收益率为-0.99%；截至报告期末富安达上证科创板综合指数增强C基金份额净值为0.9059元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.70%，同期业绩比较基准收益率为-0.99%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §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	89,421,606.64	93.46
	其中：股票	89,421,606.64	93.46
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	6,239,281.18	6.52
8	其他资产	18,784.74	0.02
9	合计	95,679,672.56	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	-	-
C	制造业	57,534,247.34	60.23
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	14,978,454.05	15.68
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	1,375,142.81	1.44
N	水利、环境和公共设施管理业	150,154.20	0.16
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	74,037,998.40	77.51

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	129,636.00	0.14
B	采矿业	313,677.00	0.33
C	制造业	11,956,448.24	12.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	220,356.00	0.23
E	建筑业	825,382.00	0.86
F	批发和零售业	62,624.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	60,532.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	943,317.00	0.99
J	金融业	61,420.00	0.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	158,510.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	233,028.00	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	110,396.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	308,282.00	0.32
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	15,383,608.24	16.10

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	688041	海光信息	23,385	4,916,930.10	5.15
2	688256	寒武纪	3,848	3,782,584.00	3.96
3	688012	中微公司	7,317	2,241,782.46	2.35
4	688981	中芯国际	19,805	1,862,660.25	1.95
5	688008	澜起科技	14,124	1,769,454.72	1.85
6	688126	沪硅产业	55,799	943,003.10	0.99
7	688009	中国通号	164,630	935,098.40	0.98
8	688249	晶合集成	34,009	897,157.42	0.94
9	688187	时代电气	16,679	866,474.05	0.91
10	688072	拓荆科技	2,253	833,610.00	0.87

### 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	688795	摩尔线程	2,361	1,317,131.07	1.38
2	688802	沐曦股份	1,945	1,170,890.00	1.23
3	688758	赛分科技	20,779	408,307.35	0.43
4	688583	思看科技	3,118	378,369.30	0.40
5	000408	藏格矿业	4,200	332,934.00	0.35

## 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，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。**

#### 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	18,784.74
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	18,784.74

**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

	富安达上证科创板综合 指数增强A	富安达上证科创板综合 指数增强C
报告期期初基金份额总额	165,107,166.98	25,731,830.13
报告期期间基金总申购份额	3,288,958.51	3,398,227.53
减：报告期期间基金总赎回份额	81,009,272.61	11,147,766.54
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	87,386,852.88	17,982,291.12

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**

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**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1月7日，富安达基金管理有限公司关于通过直销柜台办理公募基金认、申购、转换转入业务费率优惠的公告

2. 2026年1月23日，富安达基金管理有限公司关于通过直销柜台办理公募基金认、申购、转换转入业务费率优惠的公告

3. 2026年2月3日，富安达基金管理有限公司关于富安达上证科创板综合指数增强型证券投资基金增加上海利得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

4. 2026年2月3日，富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加京东肯特瑞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

5. 2026年2月3日，富安达基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告

6. 2026年2月27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

7. 2026年3月17日，富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告

8. 2026年3月31日，富安达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）

## §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上证科创板综合指数增强型证券投资基金注册的文件：  
《富安达上证科创板综合指数增强型证券投资基金招募说明书》；  
《富安达上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》；  
《富安达上证科创板综合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](http://www.fadfunds.com)）查阅。

富安达基金管理有限公司

2026年04月21日