

华富中证科创创业 50 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 11 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 7 月 10 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	114,718,436.99 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	39,550,867.91 份	75,167,569.08 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	7,378,938.18	10,498,850.59
2. 本期利润	26,817,284.99	38,162,495.65
3. 加权平均基金份额本期利润	0.9470	0.8980
4. 期末基金资产净值	89,602,350.45	167,690,839.35
5. 期末基金份额净值	2.2655	2.2309

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	69.26%	2.54%	61.86%	2.46%	7.40%	0.08%
过去六个月	60.62%	2.23%	55.88%	2.15%	4.74%	0.08%
过去一年	164.32%	2.21%	148.51%	2.13%	15.81%	0.08%
过去三年	155.67%	1.97%	142.32%	1.98%	13.35%	-0.01%
自基金合同生效起至今	126.55%	1.80%	113.93%	1.84%	12.62%	-0.04%

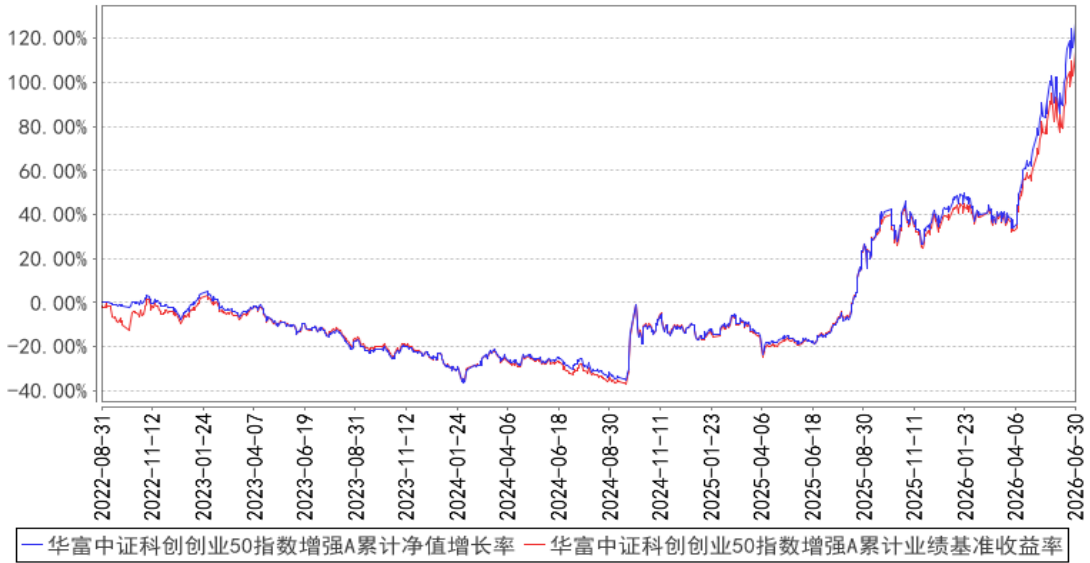
华富中证科创创业 50 指数增强 C

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	69.10%	2.54%	61.86%	2.46%	7.24%	0.08%
过去六个月	60.30%	2.23%	55.88%	2.15%	4.42%	0.08%
过去一年	163.26%	2.21%	148.51%	2.13%	14.75%	0.08%
过去三年	152.62%	1.97%	142.32%	1.98%	10.30%	-0.01%
自基金合同生效起至今	123.09%	1.80%	113.93%	1.84%	9.16%	-0.04%

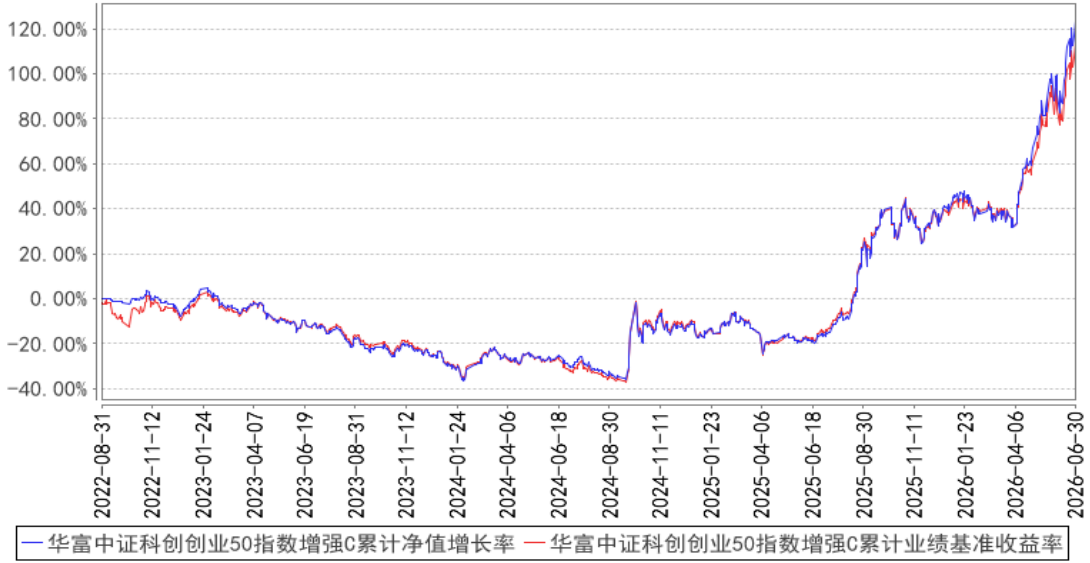
注：业绩比较基准收益率=中证科创创业 50 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

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

华富中证科创创业50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



华富中证科创创业50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 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	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，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、公司公募投资决策委员会委员	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 年二季度，A 股市场震荡上行，结构性行情特征进一步强化。4 月，上市公司一季报密集披露，全市场盈利增速企稳回升、净资产收益率多年来首次拐头向上，业绩拐点的确认显著增强了市场信心，投资逻辑加速从“主题催化”转向“基本面验证”。5 月起，以人工智能为代表的科技板块在业绩验证与产业催化的共振下进入主升阶段；6 月中上旬，地缘政治冲突推升油价、海外货币政策预期反复，市场情绪一度波动，随后随着冲突缓和而修复。整体看，二季度成长风格明显占优，业绩高增的科技方向持续获得资金聚集，同时板块内部的估值分化也升至较高水平。

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 年二季度受益于科技主线行情，整体表现强势。指数覆盖的各细分赛道景气情况来看：

1、人工智能与 TMT 方向（指数中权重约六成），国产算力替代加速。国产开源大模型新版本性能比肩海外顶级闭源模型且成本优势显著，其训练与推理均由国产算力支撑，直接催化了国产芯片链的景气；光模块海外订单持续上调，ASIC 芯片、存储、半导体制造供需两旺，龙头公司在手订单（合同负债与预收账款）持续验证景气；AI 应用从尝鲜走向成熟，token 消耗量高速增长。

2、新能源方向（权重约两成），行业处于筑底改善通道。“反内卷”政策推动供给侧出清加速，储能与固态电池打开需求端新空间，行业估值处于历史较低区域，龙头公司配置价值逐步显现，二季度末板块出现较为明确的边际改善信号。

3、医药生物方向（权重约一成），创新药延续高景气。头部企业获欧美、日本多单对外授权，重磅临床数据在国际学术会议密集读出，板块估值合理、筹码结构较优，6 月以来持续承接科技板块的资金轮动。

2026 年二季度，本基金继续以主动量化的思路进行增强，坚持“先行业比较、后针对性选股”的框架，在严格控制跟踪误差与行业偏离的前提下运作。

行业配置层面：2026 年 4 月底，基于一季报的景气验证与国产大模型的产业催化，加大了对国产算力（半导体）方向的配置，较好把握了随后科技板块的主升行情；6 月底，考虑到算力方向短期涨幅较大、估值分化处于高位，对组合进行再平衡，适度兑现部分收益，转而增配前期滞涨、边际改善明确的新能源与医药方向。

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，在成长行业侧重筛选盈利预测上修、订单能见度高的领先企业，在稳健方向注重估值性价比与经营质量；同时在合规前提下积极参与新股申购，作为超额收益的有效补充。

报告期内组合运作平稳，增强策略执行情况符合预期。我们将继续深化量化与基本面融合的投资框架，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 2.2655 元，累计份额净值为 2.2655 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 69.26%，同期业绩比较基准收益率为 61.86%。截止本期末，华富中证科创创业 50 指数增强 C 份额净值为 2.2309 元，累计份额净值为 2.2309 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 69.10%，同期业绩比较基准收益率为 61.86%。

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	229,231,271.98	86.19
	其中：股票	229,231,271.98	86.19
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,010,492.33	0.38
	其中：债券	1,010,492.33	0.38
	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	30,013,655.74	11.28
8	其他资产	5,711,137.92	2.15
9	合计	265,966,557.97	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	168,921,011.30	65.65
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	24,463,051.56	9.51
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	193,384,062.86	75.16

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	30,042,569.12	11.68
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	5,804,640.00	2.26
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	35,847,209.12	13.93

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	300750	宁德时代	53,700	21,104,637.00	8.20
2	300502	新易盛	28,588	17,352,916.00	6.74
3	300308	中际旭创	13,200	16,764,000.00	6.52
4	688256	寒武纪	9,982	15,926,780.10	6.19

5	688041	海光信息	32,509	12,038,082.70	4.68
6	688981	中芯国际	68,766	10,921,416.12	4.24
7	688008	澜起科技	31,701	9,824,139.90	3.82
8	688012	中微公司	19,533	9,151,210.50	3.56
9	300408	三环集团	45,100	7,527,190.00	2.93
10	688072	拓荆科技	7,840	6,895,515.20	2.68

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	002460	赣锋锂业	51,400	3,361,560.00	1.31
2	300438	鹏辉能源	39,700	3,289,145.00	1.28
3	605117	德业股份	28,300	3,004,894.00	1.17
4	603444	吉比特	8,200	2,939,044.00	1.14
5	002555	三七互娱	140,700	2,655,009.00	1.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,010,492.33	0.39
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,010,492.33	0.39

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019792	25 国债 19	10,000	1,010,492.33	0.39

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	5,711,137.92
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	5,711,137.92

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

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	6,895,515.20	2.68	上市股票停牌

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	29,514,096.83	36,907,967.37
报告期期间基金总申购份额	33,615,681.73	114,759,035.85
减：报告期期间基金总赎回份额	23,578,910.65	76,499,434.14
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	39,550,867.91	75,167,569.08

§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 7 月 11 日