华富中证A100交易型开放式指数证券投资基金
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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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 A100ETF
场内简称	A100 指数
基金主代码	561880
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 1 月 15 日
报告期末基金份额总额	84,389,000.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将运用其他合理的投资方法对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.20%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 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。 本基金的债券投资策略、国债期货交易策略、股指期货交易策略、资产支持证券投资策略、参与融资与转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略等详见法律文件。
业绩比较基准	中证 A100 指数收益率
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。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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）
1.本期已实现收益	1,242,639.02
2.本期利润	-15,546,874.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1900
4.期末基金资产净值	100,672,279.62
5.期末基金份额净值	1.1930

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

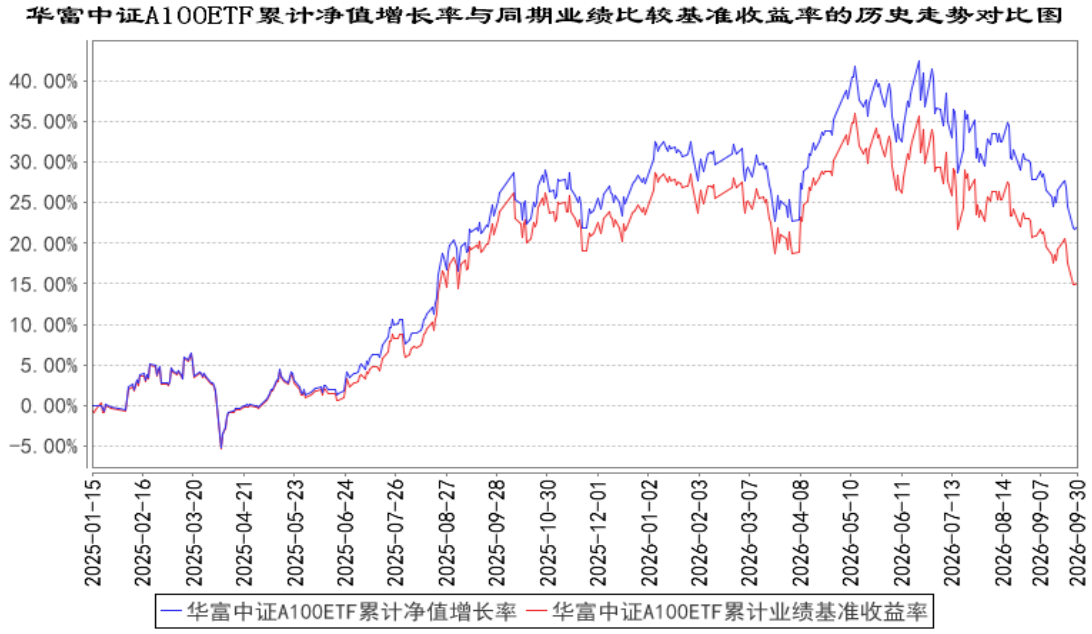
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-13.71%	1.41%	-14.09%	1.41%	0.38%	0.00%
过去六个月	-0.93%	1.40%	-3.46%	1.40%	2.53%	0.00%
过去一年	-3.28%	1.24%	-7.03%	1.24%	3.75%	0.00%
自基金合同	22.10%	1.13%	15.15%	1.13%	6.95%	0.00%

生效起至今						

注：本基金业绩比较基准收益率=中证 A100 指数收益率

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 2025 年 1 月 15 日到 2025 年 7 月 15 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 A100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的约定。

§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		
朱程辉	本基金基金经理	2026 年 8 月 18 日	-	二十三年	西安交通大学经济学硕士、硕士研究生学历。历任德恒证券有限公司信息技术经理、东吴基金管理有限公司机构营销专员、德邦证券股份有限公司研究所研究员、湘财证券有限责任公司研究所研究员、华安证券股份有限公司研究所研究员。2015 年 11 月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部行业研究员、基金经理助理兼行业研究员，专户投资部投资经理助理、投资经理，自 2025 年 3 月 3 日起任华富灵活配置混合

					型证券投资基金基金经理，自 2026 年 8 月 18 日起任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基金经理，自 2026 年 8 月 18 日起任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基金经理，自 2026 年 8 月 18 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 2026 年 8 月 18 日起任华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2026 年 8 月 18 日起任华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2026 年 8 月 18 日起任华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。
李孝华	本基金基金经理、指数投资部权益指数经理	2025 年 1 月 15 日	2026 年 8 月 18 日	十二年	南开大学经济学硕士、硕士研究生学历。历任金瑞期货研究所贵金属研究员、国泰安信息技术有限公司量化投资平台设计与开发员、华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理助理。2019 年 10 月加入华富基金管理有限公司，曾任基金经理助理，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，国内经济延续温和修复态势，但月度数据仍有波动。制造业采购经理指数在 7 月回落后逐月改善，9 月升至 50.1%，生产和新订单重回扩张区间，显示经济景气度边际回升。消费、服务业和高技术制造继续为经济提供支撑，设备更新、新型基础设施建设等领域保持一定韧性；房地产仍处于调整过程中，居民和企业部门的融资与投资意愿尚待进一步修复。政策层面，财政政策继续围绕稳增长、扩内需和产业升级发力，货币环境保持合理充裕，为经济平稳运行和资本市场稳定提供支持。海外方面，主要经济体通胀与货币政策路径仍有反复，贸易摩擦、地缘局势和能源价格波动持续影响全球风险偏好。A 股市场在二季度快速上涨后进入震荡调整阶段，指数普遍回落，市场风格发生明显切换。报告期内，上证指数、沪深 300 和创业板指分别下跌 6.16%、12.49%和 27.80%。前期涨幅较大、估值较高的科技成长板块回调较多，银行、红利等低估值和高股息方向表现出较强韧性。市场从集中交易产业趋势，逐步转向兼顾盈利质量、估值安全边际和股东回报，结构分化与波动均处于较高水平。

2026 年三季度报告期内，本基金跟踪的中证 A100 指数下跌 14.09%。该指数以各行业具有代表性的龙头上市公司为样本，兼顾大盘核心资产与行业均衡配置。三季度市场调整过程中，大盘龙头同样受到风险偏好回落影响。报告期内，本基金按照基金合同约定实施被动投资管理，结合申购赎回和成份股调整等情况做好组合管理，整体运作平稳。未来，华富中证 A100ETF 将继续做好对标的指数的紧密跟踪，力求为投资者提供配置 A 股龙头核心资产的有效工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，本基金份额净值为 1.1930 元，累计基金份额净值为 1.2223 元。报告期，本基金份额净值增长率为-13.71%，同期业绩比较基准收益率为-14.09%。

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	100,342,310.60	99.49
	其中：股票	100,342,310.60	99.49
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	482,309.15	0.48
8	其他资产	30,245.79	0.03
9	合计	100,854,865.54	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	789,570.00	0.78
B	采矿业	7,775,015.20	7.72
C	制造业	64,753,019.46	64.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,929,527.00	2.91
E	建筑业	1,198,069.00	1.19
F	批发和零售业	155,064.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	2,560,213.00	2.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,883,472.24	4.85
J	金融业	10,823,124.36	10.75
K	房地产业	841,342.00	0.84
L	租赁和商务服务业	338,218.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	2,861,514.00	2.84
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	256,158.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	100,164,306.26	99.50

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	178,004.34	0.18
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	-	-
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	178,004.34	0.18

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	7,700	6,224,988.00	6.18
2	600519	贵州茅台	4,300	5,412,066.00	5.38

3	300750	宁德时代	18,300	5,327,313.00	5.29
4	601318	中国平安	73,400	3,911,486.00	3.89
5	300502	新易盛	9,500	3,695,500.00	3.67
6	600036	招商银行	85,300	3,519,478.00	3.50
7	601899	紫金矿业	113,600	3,384,144.00	3.36
8	603259	药明康德	17,100	2,861,514.00	2.84
9	000333	美的集团	33,900	2,715,390.00	2.70
10	600900	长江电力	84,500	2,411,630.00	2.40

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	688808	联讯仪器	46	68,879.02	0.07
2	688781	视涯科技	1,109	40,866.65	0.04
3	688820	盛合晶微	171	19,230.66	0.02
4	688635	长进光子	51	11,766.72	0.01
5	688813	泰金新能	90	11,528.10	0.01

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中，招商银行股份有限公司曾出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本报告期内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	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,245.79
8	其他	-
9	合计	30,245.79

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

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	688808	联讯仪器	68,879.02	0.07	新股流通受限
2	688781	视涯科技	40,866.65	0.04	新股流通受限
3	688820	盛合晶微	19,230.66	0.02	新股流通受限
4	688635	长进光子	11,766.72	0.01	新股流通受限
5	688813	泰金新能	11,528.10	0.01	新股流通受限

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

报告期期初基金份额总额	80,389,000.00
报告期期间基金总申购份额	6,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	2,000,000.00
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	84,389,000.00

§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	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	20260701-20260930	52,192,600.00	838,300.00	751,200.00	52,279,700.00	61.95
产品特有风险							
无							

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 A100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同

2、华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议

3、华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富中证 A100 交易型开放式指数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