華富基金 HARFOR FUNDS

专业专注至诚至善

建行代销



华富上证综合指数增强型证券投资基金

A类：029506 C类：029507

建设银行评估的风险等级： R4-中高风险 11月16日-12月4日 火热发售

2026

目录

CONTENT

01 上证指数：“价值+成长”均衡布局

02 华富量化指增策略：分域多模型配置

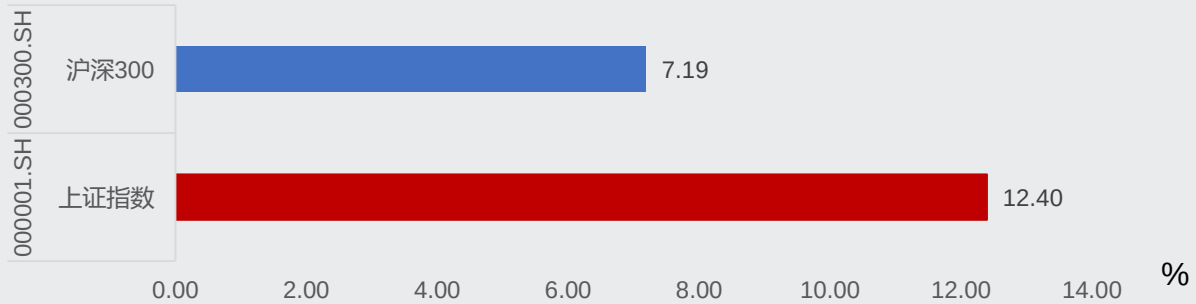
03 产品要素

上证指数：观察A股市场直观的标尺

上证指数走势图



2025年以来上证指数涨幅 vs 沪深300涨幅（%）



“上证指数”标签已深入人心

1. **市场表征指数**
   反映上海证券市场整体表现，是判断A股走势的核心参考
2. **沪市核心资产的“全景图”**
   是反映沪市整体走势的“旗舰宽基”
3. **资金流向指引**
   指数表现影响市场资金流入流出方向
4. **省心省力的配置工具**
   宽基指数ETF凭借高透明度、低费率及分散风险等优势，是分散配置的重要工具

上证指数优化编制方案以来影响力持续提升

上证综合指数（代码：000001）是上海证券交易所股价指数系列中最早编制的股票指数，自1991年7月15日起正式发布。其成份股包括了上海证券交易所上市的股票和红筹企业发行的存托凭证，ST、*ST证券除外。

上证指数自2020年优化编制方案以来，代表性与稳定性显著提升。成分股覆盖沪市核心资产，指数采用总市值加权，行业分布兼顾传统蓝筹与科技创新，是投资A股较好的宽基指数。

数据来源：wind，左上图区间：1990.12.19-2026.10.15，左下图区间：2025/1/1-2026.10.14，沪深300和上证指数代码分别为：000300、000001，相关指数历史业绩不预示其未来表现，不构成对相关类型基金未来业绩表现的保证。

上证指数里程碑式升级：修订后大幅跑赢沪深300

2020年7月22日编制方案修订：里程碑式升级

剔除风险警示股

改善指数质地，避免问题公司影响指数表现

推迟新股纳入时间

避免新股上市之初高位被纳入指数

纳入科创板与红筹CDR

增强指数对科技创新企业的代表性

样本调整规则

风险警示处理

样本被实施风险警示的，从被实施风险警示措施**次月的第二个星期五的下一交易日**起将其从指数样本中剔除

退市处理

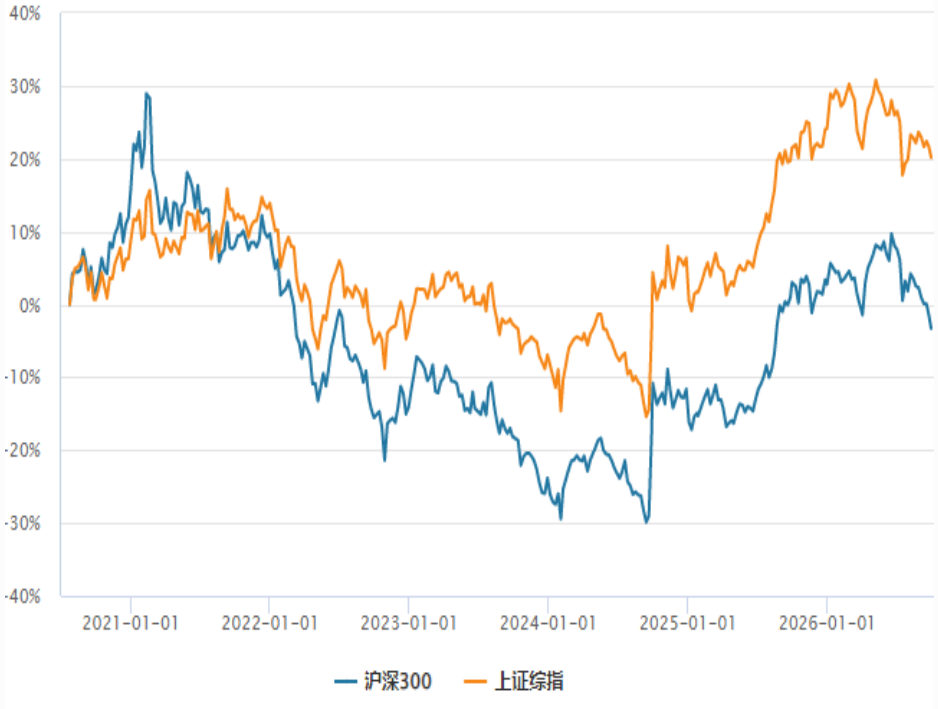
当样本退市时，及时将其从指数样本中剔除，**确保指数的有效性**

新证券纳入

上市以来日均总市值排名在沪市**前10位**的证券于**上市满三个月**后计入指数，其他证券于**上市满一年**后计入指数

指数修订以来相对沪深300超额：22.9%

数据来源：wind，统计区间：2020年7月22日-2026年9月30日，上证指数涨幅15.70%，沪深300下跌7.11%，超额=上证指数业绩-沪深300业绩，相关指数历史业绩不预示其未来表现，不构成对相关类型基金未来业绩表现的保证。

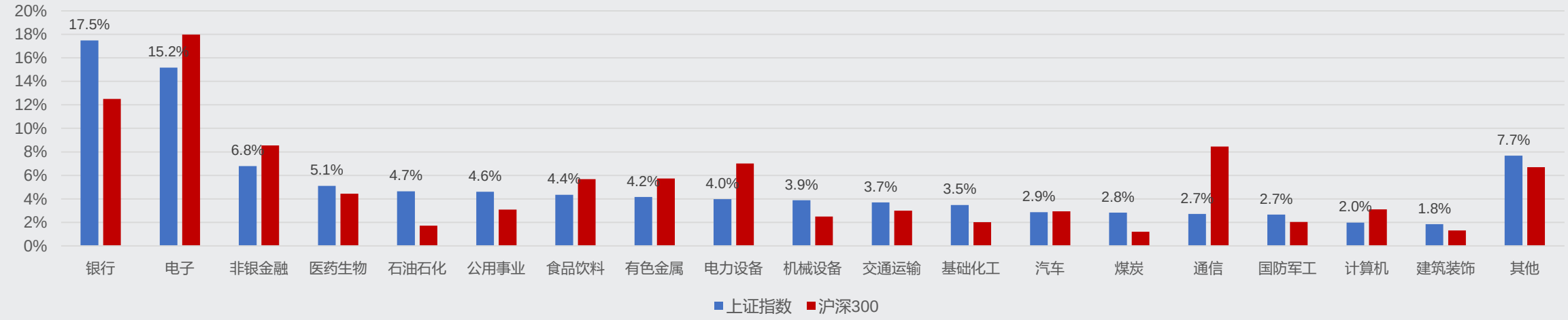


历史意义：这是自1991年上证指数发布以来**对指数编制规则的重大修订**，显著提升了上证指数的可投资性

数据来源：wind，华富基金整理，统计区间：2020.7.22-2026.9.30，沪深300和上证指数代码分别为：000300、000001，相关指数历史业绩不预示其未来表现，不构成对相关类型基金未来业绩表现的保证。

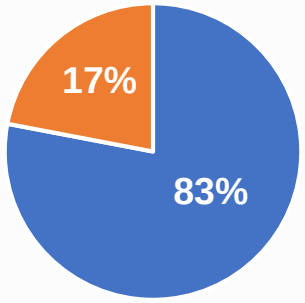
上证指数：均衡布局，宽基中的重要底仓

上证指数：银行占比更高，科技占比更低，防御属性更强



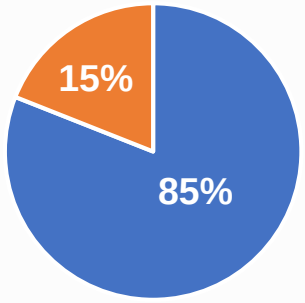
价值 VS 成长

银行占比（橙色）



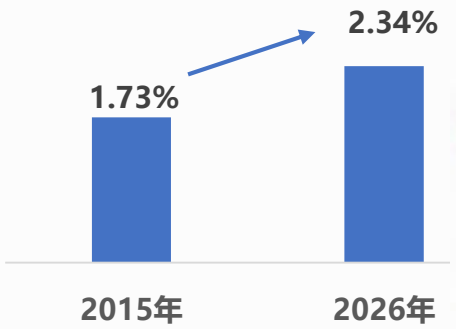


电子行业占比（橙色）



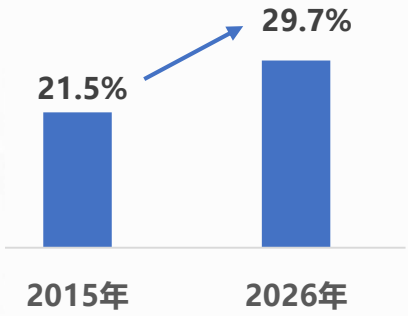
红利 VS 科技

股息率持续上涨





“新质生产力”板块占比提升



注：数据截至2026年9月30日，Wind，华富基金

上证指数：波动率下降，追求长期收益

长期复合收益良好

过去20年累计涨幅
208%
2005-至今

年化收益
6-7%

上证指数
6-7%

中债-综合财富(总值)指数
~4.3%

上证指数波动率下降

十二五（2011-2015）
23.15%

十三五（2016-2020）
18.35%

十四五（2021-2025）
15.39%

↓ 过去十五年指数波动率下降了约8%

指数历年涨跌幅（%）：5年内有4年跑赢沪深300

指数名称	2021	2022	2023	2024	2025
上证指数	4.80	-15.12	-3.70	12.67	18.41
沪深300	-5.20	-21.63	-11.38	14.68	17.66

指数历年波动率（%）：5年内波动率均低于沪深300

指数代码	指数名称	2021	2022	2023	2024	2025
000001.SH	上证指数	13.93	17.81	11.53	19.96	13.48
000300.SH	沪深300	18.51	20.32	13.45	21.30	15.20

数据来源：wind，华富基金整理，左上图数据截至2026年9月30日，沪深300、上证指数和中债-综合财富(总值)指数代码分别为：000300、000001、CBA00201.CS，相关指数历史业绩不预示其未来表现，不构成对相关类型基金未来业绩表现的保证。

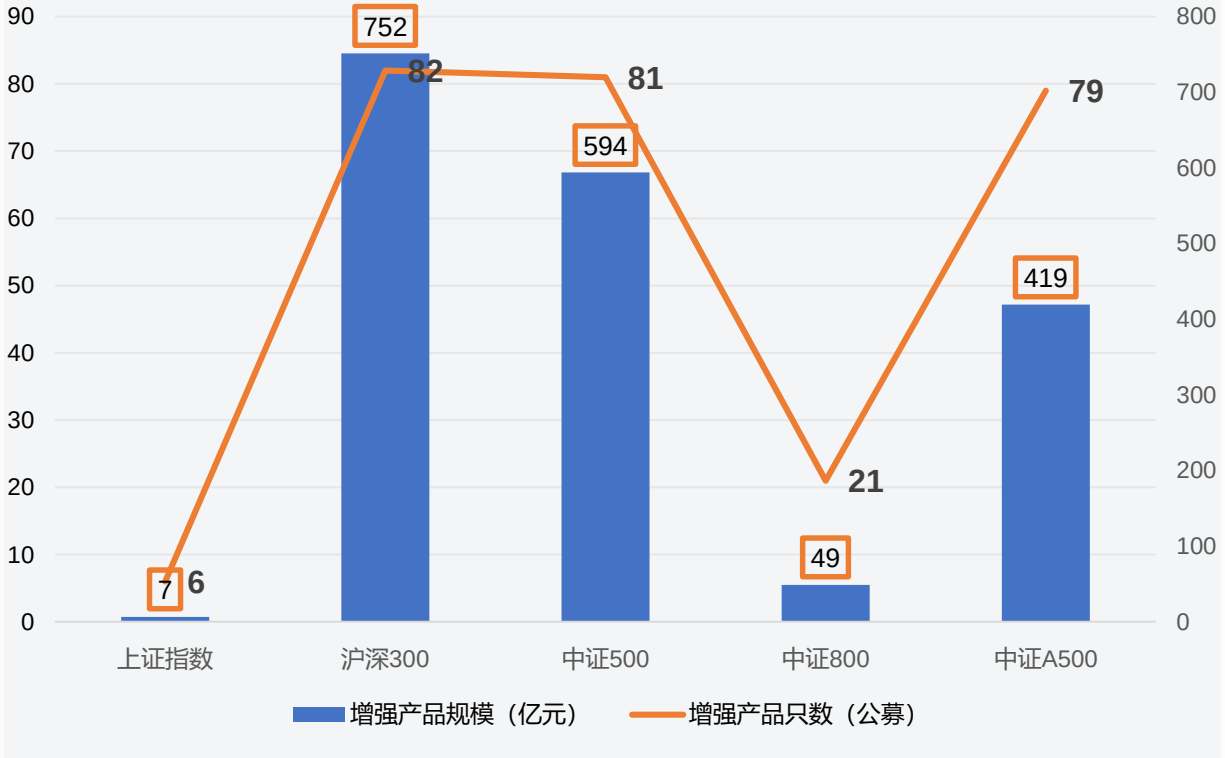
为什么要做上证指数增强：市场格局好，发展空间大

华富基金 HARFOR FUNDS

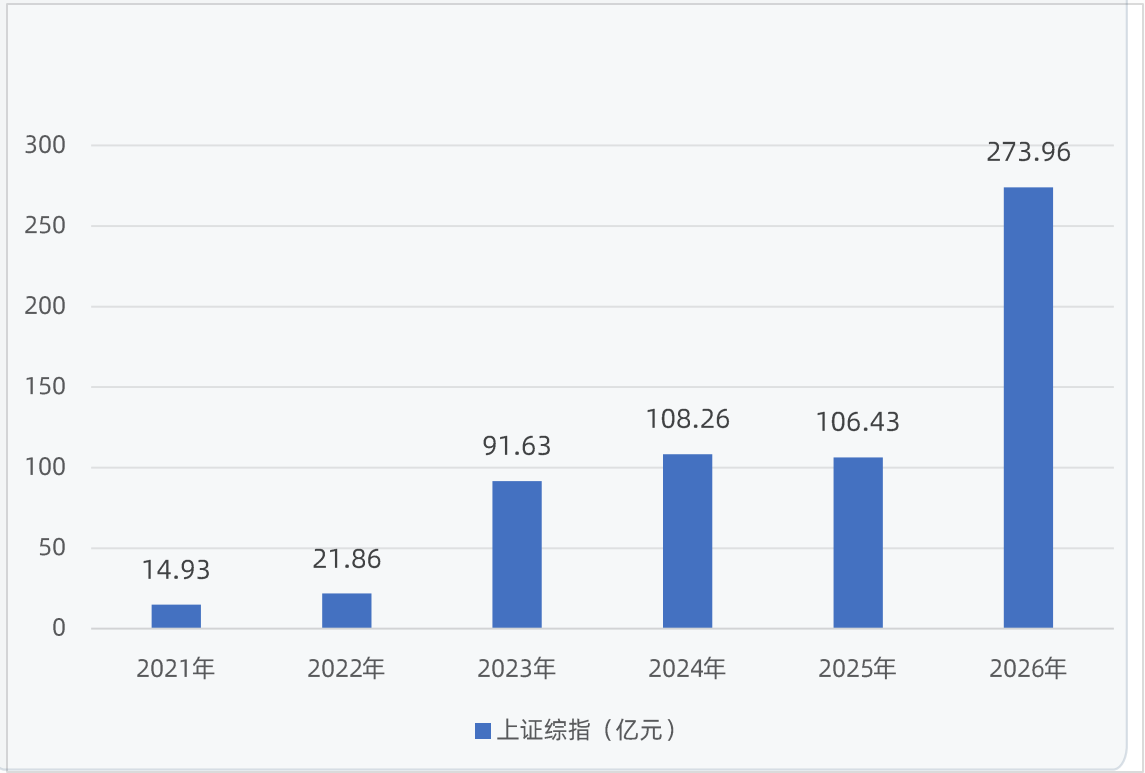
相比其它宽基，上证综合指数指增产品数量少，但指数基金规模快速攀升

- 当前市场共 11家公司 发行 13 只 挂钩上证指数的基金，其中指数增强型基金为6只；
- 上证指数产品是机构进行资产配置的重要底仓，且在今年7月科技大幅回撤的阶段，其**规模**依旧保持了**快速增长**，今年以来累计**增长167.53亿元**（截至2026/10/15）；
- 指数增强基金规模仅7亿，仍有较大发展空间。
- 上证指数成分股高达2229只，相较于成分股数量较少的指数**更有利于做出超额收益**（数据来源：wind，截至2026.10.15）.。

主流宽基指数指增产品数量/规模对比



上证指数基金规模（亿元）



数据来源：wind，左图截止日期：2026/8/31，右图截至日期：2026/10/15，沪深300、上证指数、中证500、中证800、中证A500代码分别为：000300、000001、000905、000906、000510，

目录

CONTENT

01 上证指数：价值+成长”均衡布局

02 华富量化指增策略：分域多模型配置

03 产品要素

华富上证综合指数增强策略：围绕三大核心思路展开

前置股票筛选

上证指数成分多，预先剔除优化成分股，去伪存真，提前规避垃圾股的风险。

01

坚持行业及风格中性

上证指数行业、风格分散，目标实现分散化配置，不主动做行业及风格轮动。

02

创新分域多模型选股

采用启发式动态分域，通过因子筛选、多模型构建、组合优化，最大化选股阿尔法。

03

前置股票筛选：多维度“净化”指数成分，规避风险股

预先剔除负面股票，“净化”指数成分股，以提升长期收益风险比

关键剔除因子（典型示例）

因子类别	剔除标准	剔除逻辑
价值陷阱	边际业绩大幅下滑及残差动量落后	剔除市场共识基本面持续下滑的公司
财务风险	货币资金、存货、在建工程等科目异常	潜在财务造假的公司
流动性风险	过去60日日均成交额低	避免流动性枯竭导致的冲击成本
治理异常	被监管处罚/立案调查且性质严重	规避公司治理黑天鹅事件

为什么?

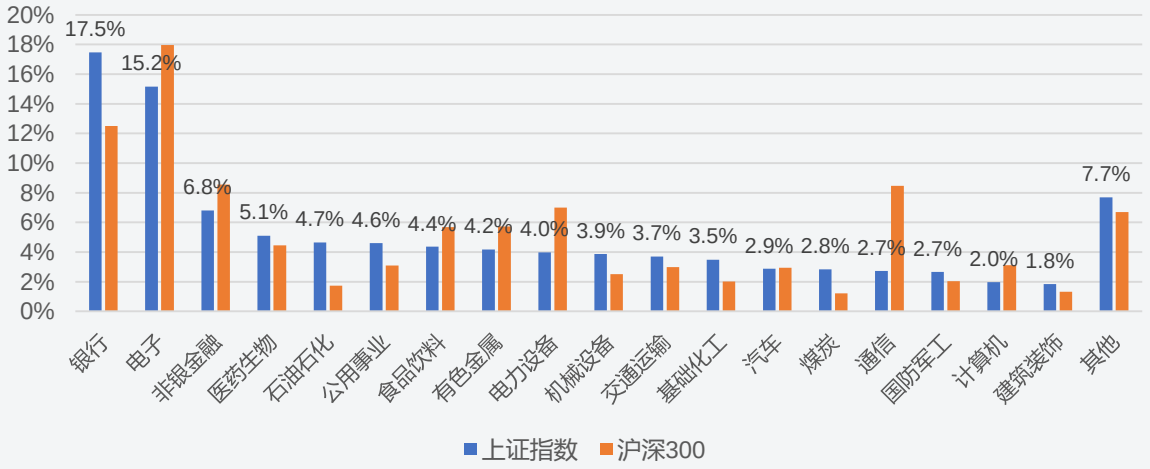
✓ **规避“价值陷阱”**：业绩下滑且市场共识趋弱的公司往往持续跑输；

✓ **防范“黑天鹅“**：财务风险、公司治理问题股易发生暴雷，影响指数；

✓ **流动性剔除**：极低流动性个股关注度低，业绩不透明，交易风险大；

坚持行业及风格中性：降低主观不确定、保持指数自身特点优势

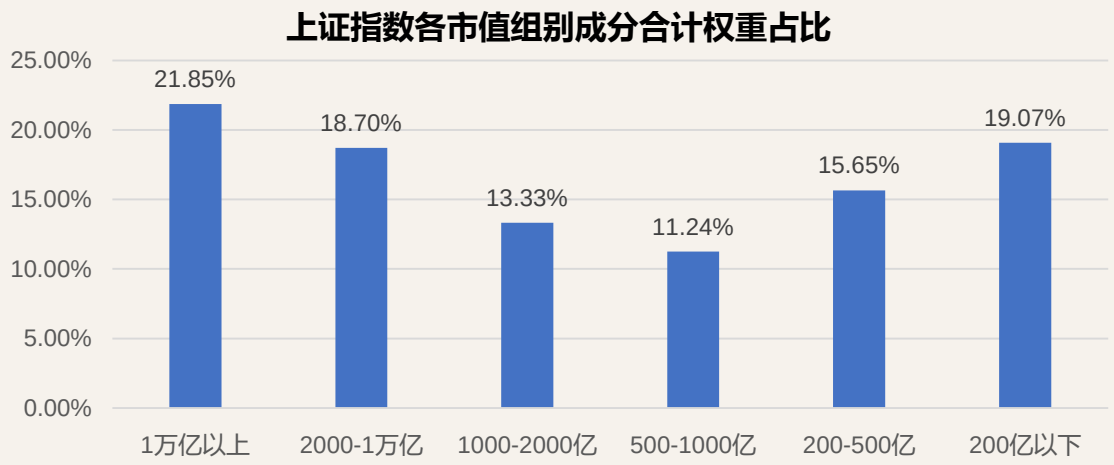
行业分布更均衡



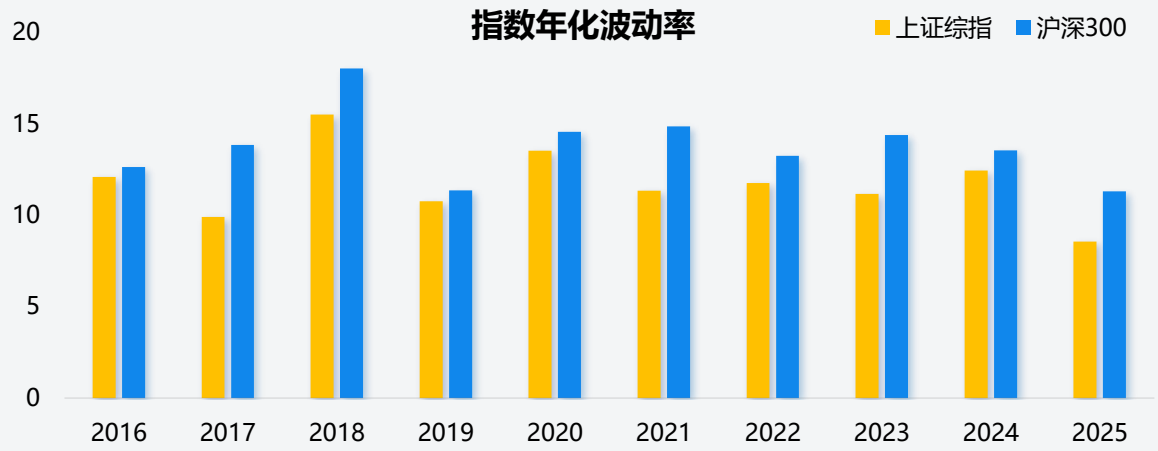
风格更均衡



市值分布均衡



波动率更低



注：数据截至2026年9月30日，Wind，华富基金，沪深300、上证指数、中证2000代码分别为：000300、000001、932000

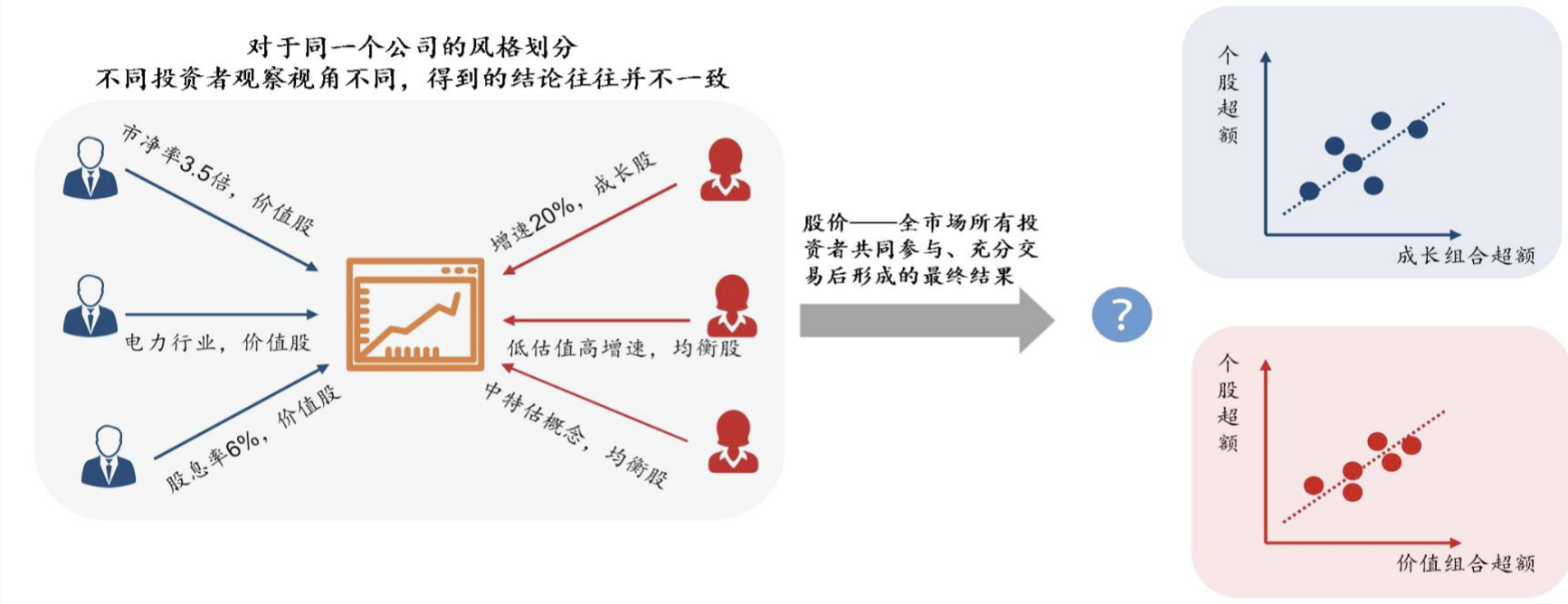
分域选股：传统量化模型的破局之路

传统：将全市场所有股票视为一个整体，用同一套打分标准对个股预期收益进行排序。然而，由于不同股票背后的投资者结构存在区别，其定量化模型的定价逻辑和适用因子也会存在明显的差异。

分域增强的优势：通过找到股票之间的某种共性，根据这一共性对股票进行聚类，随后针对不同股票池采用不同方法进行增强。由于同一类别中的股票往往具有相似的特征，因此可采用特质化的选股方式对股票池进行增强。

华富的分域增强：有效市场假说认为，在竞争充分的市场中，股价是市场参与各方充分报价交易后的最终结果，一切有价值的信息已经反映在股价走势中，**所以华富的分域采用启发式划分方法进行分域。**

图.启发式分域方式(以成长价值二分法为例)



分域选股：启发式动态分域划分方法

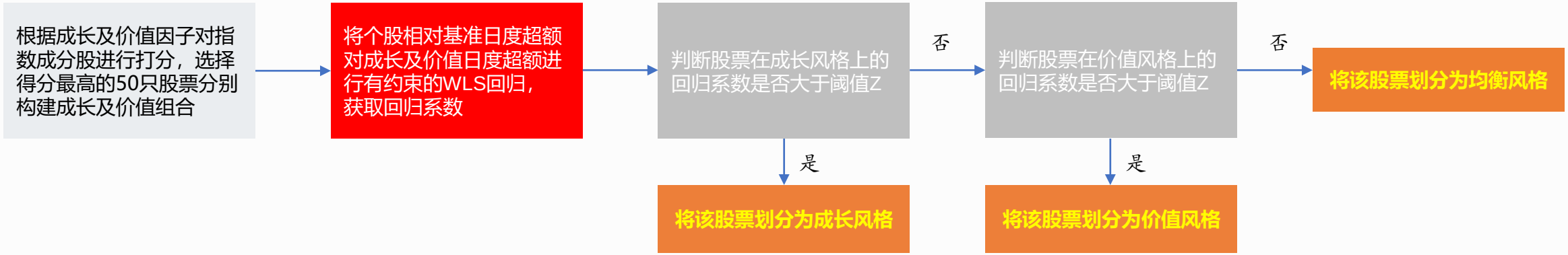
我们基于启发式风格划分法，对上证指数成分股的风格进行划分：

- Step1：每个月月末获取上证指数成分股市值数据，将市值最小的1/2股票定义为小盘风格；
- Step2：在剩余的股票中，依据启发式方法，将股票分为价值、成长、均衡三种风格

WLS回归方程

$$ri,t \sim \beta Value \cdot rValue,t + \beta Growth \cdot rGrowth,t + \varepsilon t$$
$$s.t.\ 0 \le \beta value \le 1$$
$$0 \le \beta Growth \le 1$$
$$\beta Value + \beta Growth = 1$$

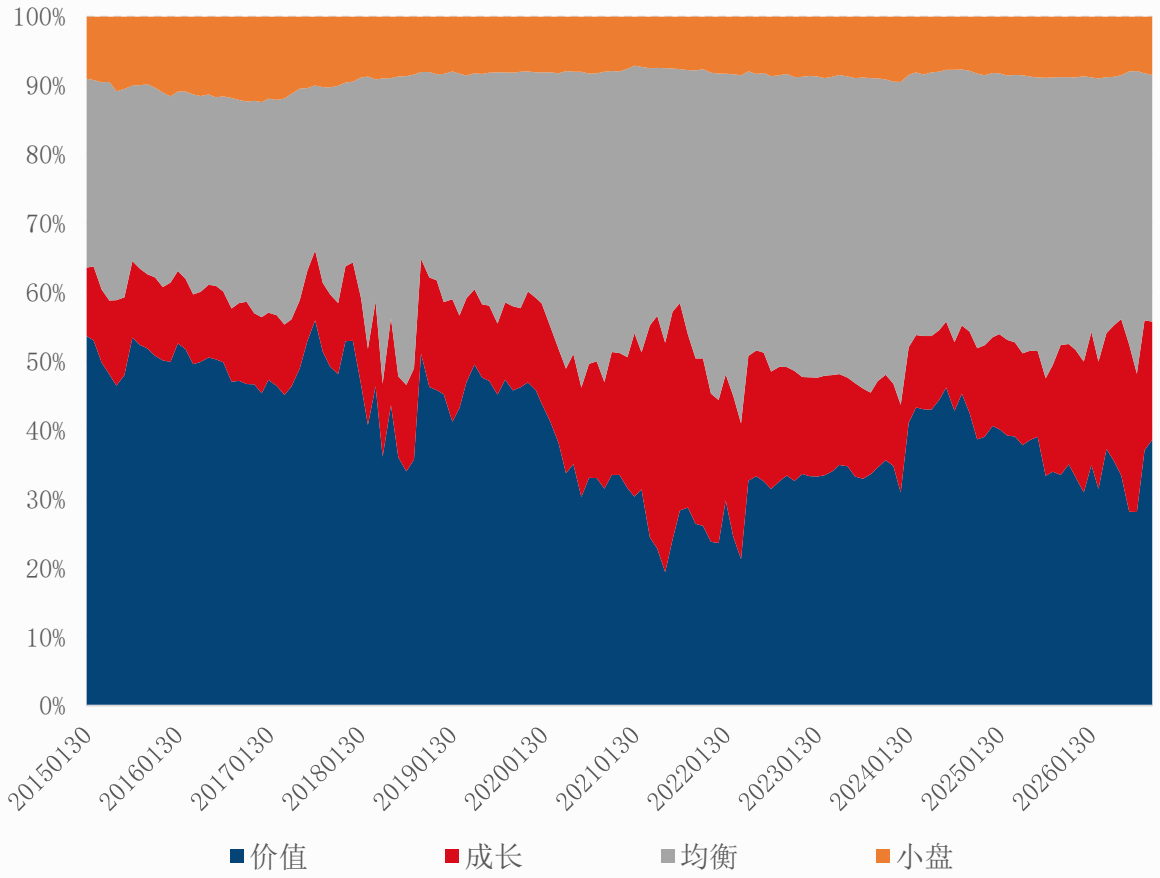
上证指数成分股启发式分域划分流程



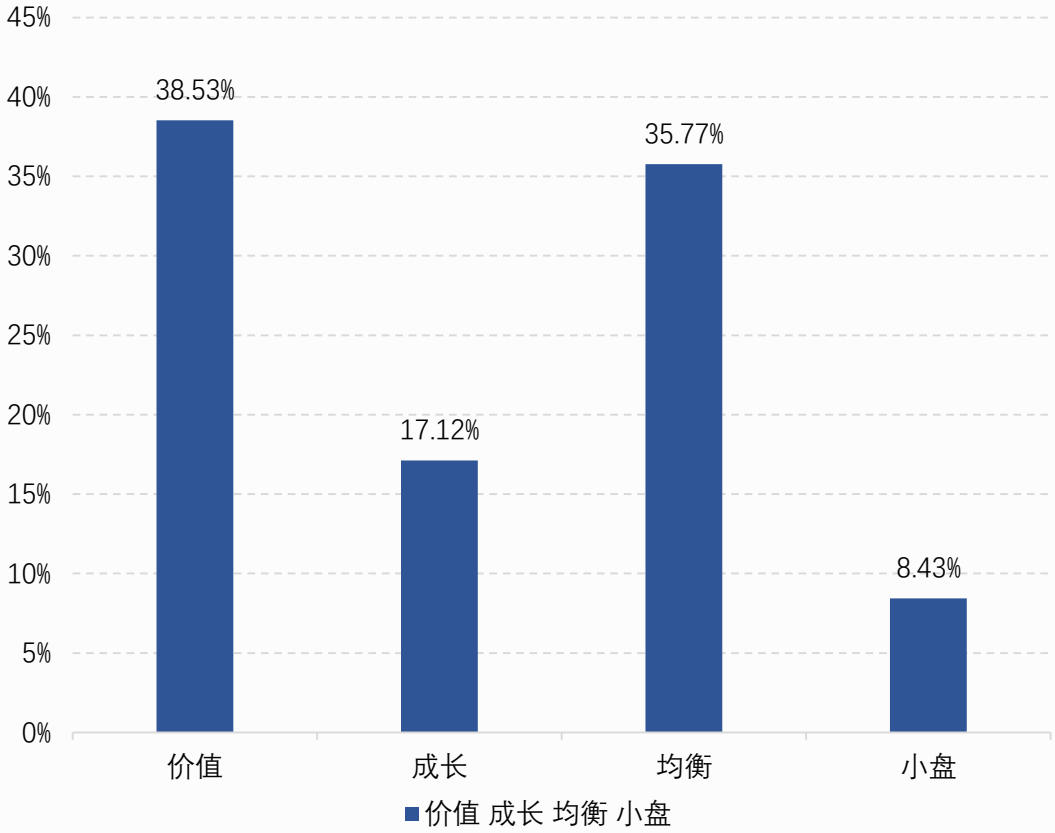
分域选股：启发式分域划分结果

2015年以来，上证指数内平均有39%权重属于价值、18%权重属于成长、35%权重属于均衡、8%权重属于小盘

启发式分域视角下的上证指数风格划分时序变化



启发式分域视角下的上证指数风格平均占比



数据来源：wind，统计区间：2015-1-1-2026-9-30，仅反映过去市场风格分布情况，不代表对未来风格占比的预测或承诺。

分域选股：量化框架

华富基金 HARFOR FUNDS

因子筛选

核心指标体系（对千余因子科学评估）

预测能力：IC均值、 信息比率等

收益表现：多空收益、多头收益等

风险控制：夏普比率、最大回撤等

交易成本&持续性： 换手率 、衰减率等

注：已控制因子相关性

评分权重：超额收益跟踪误差二元评价体系

多空收益	多头收益	IC均值	超额回撤	其他

因子评级

优秀(85-100分)	推荐重点配置
良好(75-85分)	可纳入策略
一般(65-75分)	需进一步观察
较差(55-65分)	谨慎使用
很差(0-55分)：	建议回避

模型生成

批量量化构建多因子模型池：

因子数量与逻辑分散：避免过拟合与过度集中；

多目标优化：控制风险暴露，在保证分散度的同时聚焦优质标的，平衡流动性与Alpha捕获能力。

策略构建

收益模型：年化收益率、超额收益率、卡玛比率等

性价比模型：夏普比率、信息比率、波动率等

抗风险模型：胜率统计、牛熊对比、抗压能力等

在海量模型中，以类CTA的方式为核心，智能搭建月度策略。

组合无偏

以上证指数四大聚类板块权重为基准锚点，确保组合在各板块上的配置比例与指数保持一致。

智能优化

基于既定跟踪误差下超额收益最大化的目标，在行业中性的前提下约束各项风险暴露再次优化权重，形成最终组合。

01 海量因子科学评价

02 CTA智筑分域策略

03 全局组合优化策略

华富基金量化体系

华富基金 HARFOR FUNDS

量化模型库

基本面模型

基于公司基本面、分析师报告、预期等因子，结合市场表现构建有效模型

动量模型

结合股价动量、反转效应、关注度指标、及各类风险因素，构建价量关系模型

深度学习模型

利用大模型有效因子逻辑，发现区别于传统趋势的独特信号

高频模型

基于交易模式，挖掘高频数据中的量价因子并通过机器学习降频使用，提升模型预测能力。

01

数据收集

- 结构化数据：财务数据、量价、研报、分析师
- 另类数据：新闻舆情、产业链数据

02

因子挖掘

- 寻找金融逻辑与统计规律的交集，注重投资逻辑；
- 致力于寻找那些与现有核心因子低相关、能从不同维度解释市场行为的因子，以此提高模型在不同市场环境下的适应能力和整体稳健性；
- 每一个入库的因子都必须通过双重验证。

03

模型构建

- 构建涵盖价值、成长、质量、预期、市场微观结构、舆情、等多维度的多因子模型，实现逻辑的标准化；
- 模型可回测，尊重历史数据，同时避免过度拟合

04

组合优化

- 收益与风险博取平衡，使用BARRA风险模型，控制行业风格暴露，限定个股偏离程度

05

风险控制

- 全方位监控组合的各类风险暴露；
- 策略归因对各类子策略，因子进行评估；业绩归因拆解组合超额收益，清晰每一份收益的来源

目录

CONTENT

01 上证指数：价值+成长”均衡布局

02 华富量化指增策略：分域多模型配置

03 产品要素

华富基金指数产品系列

华富指数投资团队一直以来秉持创新精神，致力于研究开发创新产品和投资工具，打造原创指基精品店。

目前团队产品线适配各类周期环境，为客户提供多元化的投资工具和资产配置解决方案。

行业主题

AI　创新药
金融　新能车
稀金属
港股通信息C

债券指数

信用债
利率债

策略指数

自由现金流
红利价值

核心宽基

科创创业50
中证A100
沪深300
中证A500
中小企业100

华富基金指数产品示例

截至到2026/10/23，华富中证科创创业50指数增强A自2024年以来上涨77.83%，同期业绩比较基准上涨59.94%，超额收益超过17%。



华富中证科创创业50指数增强A业绩回报%

年份	2024	2025	2026至今
华富中证科创创业50指数增强A	13.33	61.57	-2.89
比较基准	13.28	57.47	-10.34
相对比较基准超额收益	0.05	4.09	7.46

数据来源：2026年至今以及2024年至今基金业绩经托管行复核，2024、2025年基金业绩来自基金年报，基准数据来自wind。2026至今统计区间：2026.1.1-2026.10.23，2024年以来统计区间：2024.1.1-2026.10.23，基金的过往业绩并不预示其未来表现，也不构成对基金管理人管理的其他基金的业绩表现的保证。超额收益=华富双创50指增业绩-业绩比较基准同期涨跌幅，华富双创50指增A在管基金经理为张娅和郜哲。

拟任基金经理



张娅女士

总经理助理、指数投资部总监
基金经理

- 22年证券从业经验，其中17年基金管理经验。美国肯特州立大学理学硕士。
- 现任华富基金总经理助理、指数投资部总监、基金经理。
- **善于通过严密的选股逻辑，发掘景气赛道和优质企业。**
- **2007年起正式涉猎ETF产品，见证中国ETF基金发展历程。**

基金代码	基金名称	任职日期
515980	华富中证人工智能产业ETF	2019/12/24
016122	华富中证科创创业50指数增强A	2022/8/31
023746	华富新华中诚信红利价值指数A	2025/5/7
023331	华富中证A500指数A	2025/8/19

数据来源：Wind，截至2026.10.29

拟任基金经理



朱程辉先生

基金经理

- 西安交通大学金融学硕士，23年证券从业经验，其中6年投资管理经验。
- 2010年转型从事卖方研究，2015年11月加入华富基金管理有限公司，曾任专户投资部投资经理，现任指数投资部基金经理。
- 基于宏观研判把握市场方向，聚焦成长，积极挖掘具有阿尔法的优质公司；力争通过平衡的组合持续获得稳健回报。
- 注重定量研究和数据挖掘，能够有效将主观与量化投资相结合。

基金代码	基金名称	任职日期
000398	华富灵活配置A	2025/3/3
410010	华富中小企业100指数增强	2026/8/18
023746	华富新华中诚信红利价值指数A	2026/8/18
561880	华富中证A100ETF	2026/8/18
410008	华富中证A100ETF联接A	2026/8/18
561870	华富中证全指自由现金流ETF	2026/8/18
024770	华富中证全指自由现金流ETF联接A	2026/8/18

数据来源：Wind，截至2026.10.29

产品要素表

基金名称	华富上证综合指数增强型证券投资基金		
基金代码	A类：029506；C类：029507	建设银行评估的风险等级	R4-中高风险，适合C4-进取型（及以上）的投资者，适当性意见请以销售机构为准
基金类型	股票型（指数增强）	运作方式	契约型开放式
基金管理人	华富基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，追求实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。		
投资范围	本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包括主板、科创板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、国债期货、股指期货、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。		
投资比例	本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。 如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。		
业绩比较基准	上证综合指数收益率×95%+活期存款基准利率×5%。		

产品费率

基金名称	华富上证综合指数增强型证券投资基金				
A类基金份额认购费率	认购金额	认购费率	A类基金份额申购费率	申购金额	申购费率
	M < 100万	0.30%		M < 100万	0.30%
	100万≤M < 500万	0.20%		100万≤M < 500万	0.20%
	500万≤M	每笔1000元		500万≤M	每笔1000元
A/C类份额赎回费率（非个人）	持有期限（N）	赎回费率	A/C类份额赎回费率（个人）	持有期限（N）	赎回费率
	N < 7天	1.50%		N < 7天	1.50%
	7天≤N < 30天	1.00%		N≥7天	0.00%
	30 天≤N < 180 天	0.50%			
	N≥180天	0.00%			
管理费率	0.80%				
托管费率	0.15%				
C类份额销售服务费率	0.20%，持有一年以上不再继续收取。				

以上费率详见招募说明书等法律文件，实际费用以销售机构业务规则为准。

感谢关注

华富基金

为每一份信任创造价值



风险提示：**基金有风险，投资须谨慎。**本文关于市场的论述仅为本公司对当下证券市场与相关行业的研究观点，基于市场环境的不确定和多变性，所涉观点后续可能随着市场发生调整或变化不构成对任何机构和个人投资的建议或意见，不代表本公司管理基金当下或未来的持仓，也不必然作为本公司管理之基金进行投资决策的依据，不构成对投资者投资收益的承诺或保证。本文数据来自Wind、中证指数公司与公开资料整理，本公司并不保证本文件所载文字及数据的准确性及完整性，不对任何人因使用此类报告的全部或部分内容而引致的任何损失承担任何责任。投资人购买基金前，应当认真阅读《基金合同》《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，根据自身的风险承受能力自行作出投资选择。华富上证综合指数增强型证券投资基金为股票型基金，标的指数为上证综合指数，股票资产投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%。华富中证科创创业50指数增强型基金为股票型指数增强基金，投资组合中股票资产占基金资产的比例不低于80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%。**由于科创板及创业板股票在上市条件、定价及交易机制、退市规则、监管规则等方面与主板股票有较大差异，本基金可能面临的风险包括但不限于股价波动较大风险、流动性较低风险、退市风险等，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。指数型基金可能发生基金投资组合回报与标的指数回报偏离，指数编制机构停止服务，成份券停牌、摘牌或违约等风险。以上基金面临港股通机制下因投资环境、市场制度、交易规则以及税收政策等差异所带来的特有风险。基金投资收益将受到证券市场调整而发生波动，可能会发生本金亏损。**有关本基金的具体风险，请详见《招募说明书》相关章节。**本产品由建设银行评估的风险等级为R4-中高风险，适合C4-进取型（及以上）的投资者，适当性匹配意见请以销售机构为准，**请投资人根据自身风险承受能力等情况自行做出投资选择。请投资人根据各销售机构对以上产品评级结果进行适当性评估后购买。**上证综合指数和双创50指数的历史收益情况不预示其未来表现，不构成对本基金业绩表现的保证，请投资者关注指数波动的风险。指数型基金可能发生基金投资组合回报与标的指数回报偏离，指数编制机构停止服务，成份券停牌、摘牌或违约等风险。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成基金业绩表现的保证。**基金管理人承诺以诚实守信、勤勉尽责原则管理和运用基金财产，但**不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。**我国基金运作时间较短，不能反映股市/债市发展的所有阶段。基金管理人提示投资者的“买者自负”原则，在作出投资决策后，与基金投资有关的风险由投资者自行承担。**本产品由华富基金管理有限公司发行与管理，建设银行作为代销机构不承担产品的投资和兑付责任。**基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个开放日基金的净赎回申请超过基金总份额的一定比例（开放式基金为百分之十，定期开放基金为百分之二十，中国证监会规定的特殊产品除外）时，您将可能无法及时赎回申请的全部基金份额，或您赎回的款项可能延缓支付。您应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资者进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式，但并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资者获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。张娅，22年证券从业经验，其中17年基金管理经验。2017年4月加入华富基金管理有限公司，目前华富中证人工智能产业ETF（2019.12.24起）、华富中证科创创业50指数增强基金（2022.8.31起）、华富新华中诚信红利价值指数（2025.5.7起）、华富中证A500指数（2025.8.19起）的基金经理。朱程辉，23年证券从业经验，其中6年投资管理经验。2015年11月加入华富基金管理有限公司，目前担任华富灵活配置混合型证券投资基金（2025.3.3起）、华富中小企业100指数增强（2026.8.18起）、华富中证全指自由现金流ETF联接基金（2026.8.18起）、华富中证A100ETF联接基金（2026.8.18起）、华富中证A100ETF（2026.8.18起）、华富新华中诚信红利价值指数（2026.8.18起）、华富中证全指自由现金流ETF（2026.8.18起）的基金经理。郜哲，13年证券从业经验，其中8年基金管理经验。目前担任华富中证人工智能产业ETF（2019.12.24起）、华富中证人工智能产业ETF联接基金（2020.4.23起）、华富中证科创创业50指数增强基金（2022.8.31起）、华富中证港股通创新药指数基金（2025.6.5起）、华富沪深300指数增强基金（2025.7.29起）、华富中证港股通信息技术综合ETF（2026.7.1起）、华富中证稀有金属主题ETF联接基金（2026.9.28）的基金经理。华富中证科创创业 50 指数增强 A 类份额申购费率：金额＜100 万元：1.2%，100 万元≤金额＜200 万元：0.8%，200 万元≤金额＜500 万元：0.5%，金额≥500 万元：1000 元 / 笔；赎回费率：持有期限＜7 天：1.5%，7 天≤持有期限＜30 天：0.5%，持有期限≥30 天：0；不收取销售服务费。华富中证科创创业 50 指数增强 C 类份额不收取申购费；赎回费率：持有期限＜7 天：1.5%，持有期限≥7 天：0；销售服务费率 0.4%/ 年。以上费率详见招募说明书等法律文件，实际费用以销售机构业务规则为准。

华富中证人工智能产业ETF（2019.12.24成立），基准为中证人工智能产业指数收益率，过往业绩回报/同期基准为：2021年6.9%/1.22%、2022年-37.26%/-38.29%、2023年8.34%/7.77%、2024年20.17%/20.63%、2025年78.74%/79.29%。华富中证人工智能产业ETF联接A（2020.4.23年成立），基准为中证人工智能产业指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%，过往业绩回报/同期基准为：2021年5.24%/1.3%、2022年-35.38%/-36.65%、2023年9.01%/7.63%、2024年19.32%/19.97%、2025年69.92%/74.74%，华富中证人工智能产业ETF联接C（2020.4.23年成立），2021年4.93%/1.3%、2022年-35.57 %/-36.65%、2023年8.68%/7.63%、2024年18.96%/19.97%、2025年69.42%/74.74%。华富中证科创创业50指数增强A（2022.8.31成立），基准为中证科创创业50指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%，过往业绩回报/同期基准为：2022年截至当年末基金成立未满六个月，不展示其业绩，2023年-19.57%/-17.91%、2024年13.33%/13.28%、2025年61.57%/57.47%，华富中证科创创业50指数增强C（2022.8.31成立），2022年截至当年末基金成立未满六个月，不展示其业绩，2023年-19.89%/-17.91%、2024年12.87%/13.28%、2025年60.93%/57.47%。华富中证港股通创新药指数A （2025.6.5成立），基准为中证港股通创新药指数收益率(经估值汇率调整后)*95%+银行活期存款利率(税后)*5%，过往业绩回报/同期基准为：2025年（自成立日起）5.99%/12.37%，华富中证港股通创新药指数C（2025.6.5成立），2025年（自成立日起）5.58%/12.37%。华富沪深300指数增强（2025.7.29成立），基准为沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%，过往业绩回报/同期基准为：2025年自成立日起当年不满六个月，不展示业绩。华富新华中诚信红利价值指数（2025.5.7成立），基准为新华中诚信红利价值指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%，截至2025.12.31成立以来A、C份额业绩回报/同期基准为：5.09%、4.82%/5.06%。华富中证A500指数（2025.8.19成立）截至2025.12.31成立不满六个月不展示其业绩（以上数据来自基金定期报告，截至2025.12.31）。华富中证港股通信息技术综合ETF（2026.7.1成立），华富中证稀有金属主题ETF联接A（2026.9.28成立）截至2026年10月26日，基金合同生效未满6个月，不展示其业绩。