

海富通科技创新混合型证券投资基金
2021 年第 3 季度报告
2021 年 9 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十七日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通科技创新混合
基金主代码	009024
交易代码	009024
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 10 日
报告期末基金份额总额	267,079,456.74 份
投资目标	本基金将积极把握科技创新的发展趋势，聚焦于具有科技创新优势的行业和企业，充分把握其投资机会，在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金为混合型基金，股票投资及存托凭证占基金资产的比例为 60%-95%，在进行资产配置决策时，在研究宏观经济基本面、政策面、市场情绪、资金面和投资者行为等多种因素的基础上，形成对不同市场周期的预测和判断，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，确定股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例。 科技创新是重塑经济增长动力的源泉。本基金将积极把

	握科技创新的发展趋势，聚焦于具有科技创新优势的行业和企业，充分把握其投资机会，在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益。同时，结合行业配置策略、个股精选策略、港股投资策略、科创板股票的投资策略、存托凭证投资策略等进行投资。	
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+上证国债指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险及预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金可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定风险。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C
下属两级基金的交易代码	009025	009024
报告期末下属两级基金的份额总额	181,743,907.03 份	85,335,549.71 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 (2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日)	
	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C
1.本期已实现收益	76,277,002.12	25,880,887.98
2.本期利润	54,928,656.24	16,310,656.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.3019	0.2390
4.期末基金资产净值	281,400,610.44	130,497,807.31
5.期末基金份额净值	1.5483	1.5292

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、海富通科技创新混合 A：

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	24.63%	3.09%	-6.66%	1.25%	31.29%	1.84%
过去六个月	51.75%	2.55%	6.32%	1.19%	45.43%	1.36%
过去一年	55.03%	2.35%	16.18%	1.33%	38.85%	1.02%
自基金合同生效起至今	54.83%	2.41%	40.01%	1.33%	14.82%	1.08%

2、海富通科技创新混合 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	24.39%	3.09%	-6.66%	1.25%	31.05%	1.84%
过去六个月	51.15%	2.55%	6.32%	1.19%	44.83%	1.36%
过去一年	53.80%	2.35%	16.18%	1.33%	37.62%	1.02%
自基金合同生效起至今	52.92%	2.41%	40.01%	1.33%	12.91%	1.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

海富通科技创新混合型证券投资基金 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1. 海富通科技创新混合 A

(2020 年 3 月 10 日至 2021 年 9 月 30 日)



2. 海富通科技创新混合 C

(2020 年 3 月 10 日至 2021 年 9 月 30 日)



注：本基金合同于 2020 年 3 月 10 日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

§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		
吕越超	本基金的基金经理；公募权益投资部副总监。	2020-03-10	-	11 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任长江证券研究所分析师，泰达宏利基金管理有限公司研究员、基金经理。2014 年 11 月至 2016 年 7 月任泰达宏利周期混合基金经理，2015 年 6 月至 2016 年 7 月兼任泰达宏利创益混合基金经理。2016 年 11 月起任海富通股票混合基金经理。2019 年 12 月起兼任海富通先进制造股票基金经理。2020 年 3 月起兼任海富通科技创新混合基金经理。2020 年 9 月起兼任海富通成长甄选混合基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年三季度，国内经济下行趋势明显，尤其是消费以及房地产投资。消费受制于经济下行，收入预期放缓以及疫情反复影响下，消费同比增速持续下滑。房地产投资受较为严苛的信贷政策以及房企“三条红线”的影响，也快速下滑。价格指数方面，CPI 表现平稳，但 PPI 持续上行超预期。在“碳中和”、“碳达峰”以及“双限”的背景下，能源板块供需错配情况较为严重，价格上涨凶猛。海外经济方面，美国第三季度受 Delta 病毒主导的新一轮疫情冲击，经济活动再次疲弱。货币政策方面，市场对于美联储在 11 月议息会议后宣布开启逐步缩减购债规模有较强的共识。

三季度国内权益市场小幅下跌，周期、消费表现分化显著。A 股主要指数方面，上证指数下跌 0.64%，沪深 300 下跌 6.85%，中证 800 下跌 4.36%，中小 100 指下跌 4.98%，创业板指下跌 6.69%，中证 500 上涨 4.34%。分行业看，周期板块显著上涨，其中涨幅前五的行业为煤炭、有色金属、钢铁、电力及公用事业、基础化工，全部为周期行业，分别上涨 40.87%、26.63%、22.46%、20.25% 和 17.83%。消费板块显著回调，跌幅前五的行业为消费者服务、医药、食品饮料、家电、纺织服装，分别下跌 17.89%、14.67%、12.91%、10.24% 和 9.91%。从三季度 A 股内部的结构看，消费板块表现弱势和国内消费数据快速下滑相符，而周期板块大幅上涨和不断上行超预期的 PPI 数据相吻合。

市场结构方面，三季度市场结构延续了上半年的情况，周期和成长交相呼应成为市场两条主线，消费表现弱势。但分化裂口在三季度继续加速和扩大。业绩增速高且未来确定性强的新能源汽车产业链引领整个成长板块的行情，也从需求端带动了部分周期品的上涨。消费领域除了医药 CXO 和次高端白酒，整体表现较弱。季末在裂口极大的情况下分化有所收敛，部分消费品和“核心资产”有触底反弹的趋势，而周期和成长则开始回调。

在三季度的操作中，本基金坚持自上而下的行业比较和自下而上的个股挖掘相结合的投资策略，基本把握住了市场的节奏变化和结构转换，取得了一定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期，海富通科技创新混合 A 类份额净值增长率为 24.63%，同期基金业绩比较基准收益率为-6.66%，基金净值跑赢业绩比较基准 31.29 个百分点；海富通科技创新混合 C 类份额净值增长率为 24.39%，同期基金业绩比较基准收益率为-6.66%，基金净值跑赢业绩比较基准 31.05 个百分点。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§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	389,325,595.17	92.72
	其中：股票	389,325,595.17	92.72
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	25,412,801.04	6.05
7	其他资产	5,134,538.98	1.22
8	合计	419,872,935.19	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	12,350.52	0.00
B	采矿业	50,388,607.00	12.23
C	制造业	293,972,552.58	71.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,244,943.00	0.79
E	建筑业	6,791,400.00	1.65
F	批发和零售业	6,978,256.78	1.69
G	交通运输、仓储和邮政业	418,240.00	0.10
H	住宿和餐饮业	40,233.44	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,964.00	0.00
J	金融业	2,255,003.00	0.55
K	房地产业	20,571,457.00	4.99
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	438,407.46	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	22,379.17	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,167,876.00	1.01
R	文化、体育和娱乐业	3,925.22	0.00
S	综合	-	-
	合计	389,325,595.17	94.52

5.2.2 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股票。

5.3 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	603026	石大胜华	96,800	29,335,240.00	7.12
2	605117	德业股份	122,300	27,493,040.00	6.67
3	002176	江特电机	1,026,556	24,021,410.40	5.83

4	300390	天华超净	202,500	21,738,375.00	5.28
5	002466	天齐锂业	183,800	18,670,404.00	4.53
6	002240	盛新锂能	300,699	17,933,688.36	4.35
7	002192	融捷股份	128,900	17,143,700.00	4.16
8	002756	永兴材料	172,400	16,219,392.00	3.94
9	000733	振华科技	158,200	15,854,804.00	3.85
10	600338	西藏珠峰	298,200	10,526,460.00	2.56

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的盛新锂能（002240），因与关联方资金往来信息披露不准确、不及时，部分关联交易未履行决策程序，定期报告信息披露不准确，上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》的规定，于2021年5月14日被深圳证监局对其公司及时任董事长、时任总经理、时任及现任财务总监、时任董事会秘书及副总经理采取出具警示函的行政监管措施。

对该证券的投资决策程序的说明：公司战略聚焦新能源锂盐材料，轻装上阵。公司“致力于成为全球锂电新能源材料领先企业”，主营业务和发展战略清晰，锂盐产能产量快速扩产。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

报告期内本基金投资的西藏珠峰（600338），公司已对外披露、并召开股东大会审议通过了 2019 年三季度利润分配预案，但公司并未按照规定要求，在规定期限内执行公开披露的现金分红方案，影响了投资者的合理预期。同时，公司也未就影响分红的相关事项及时公告，风险提示不充分。上述行为违反了《上市公司监管指引第 3号——上市公司现金分红》、《股票上市规则》等相关规定，上海证券交易所于2021年4月21日对西藏珠峰资源股份有限公司及时任董事长、董事会秘书、财务总监等人予以监管关注。

对该证券的投资决策程序的说明：公司主要在全球“一带一路”沿线国家的地区开发有色金属矿产资源，目前主要业务为铅锌多金属矿山的采选生产，主要子公司塔中矿业有限公司是中国企业在中亚地区目前获得的最具有战略价值的多金属矿山资源。公司盐湖项目开发稳定推进，铅锌产量远期将持续爬升。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规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	173,492.21

2	应收证券清算款	588,673.06
3	应收股利	-
4	应收利息	3,272.36
5	应收申购款	4,369,101.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,134,538.98

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C
本报告期期初基金份额总额	215,195,309.65	66,679,327.89
本报告期基金总申购份额	97,986,084.62	111,728,323.31
减：本报告期基金总赎回份额	131,437,487.24	93,072,101.49
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	181,743,907.03	85,335,549.71

§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

本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未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

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

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 104 只公募基金。截至 2021 年 9 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模超 1380 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金再度被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·成长基金管理公司奖。

2020 年 3 月，由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，

海富通基金管理有限公司荣获“金牛进取奖”，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖项。2020 年 7 月，由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金基金·股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通科技创新混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通科技创新混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通科技创新混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通科技创新混合型证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36—37 层本基金管理人办公地址。

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。

海富通基金管理有限公司
二〇二一年十月二十七日