

方正富邦科技创新混合型证券投资基金

2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：方正富邦基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 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 2022 年 07 月 01 日起至 2022 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	方正富邦科技创新	
基金主代码	008640	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 1 月 21 日	
报告期末基金份额总额	100,918,891.49 份	
投资目标	本基金在有效控制风险并保持良好流动性的前提下，重点投资于科技和创新为动力和支撑，具有核心科技或创新优势的优质上市公司，把握相关领域科技发展与创新所带来的投资机会，力争获得超额收益与长期资本增值。	
投资策略	本基金主要通过采取资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略等投资策略以实现投资目标。	
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×60%+中债综合指数收益率×30%+恒生指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，将面临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	方正富邦基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	方正富邦科技创新 A	方正富邦科技创新 C
下属分级基金的交易代码	008640	008641
报告期末下属分级基金的份额总额	53,497,832.76 份	47,421,058.73 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）	
	方正富邦科技创新 A	方正富邦科技创新 C
1. 本期已实现收益	5,014,052.17	4,289,410.27
2. 本期利润	-19,516,890.96	-16,949,095.25
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.3612	-0.3569
4. 期末基金资产净值	93,110,765.52	81,899,582.68
5. 期末基金份额净值	1.7405	1.7271

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

方正富邦科技创新 A

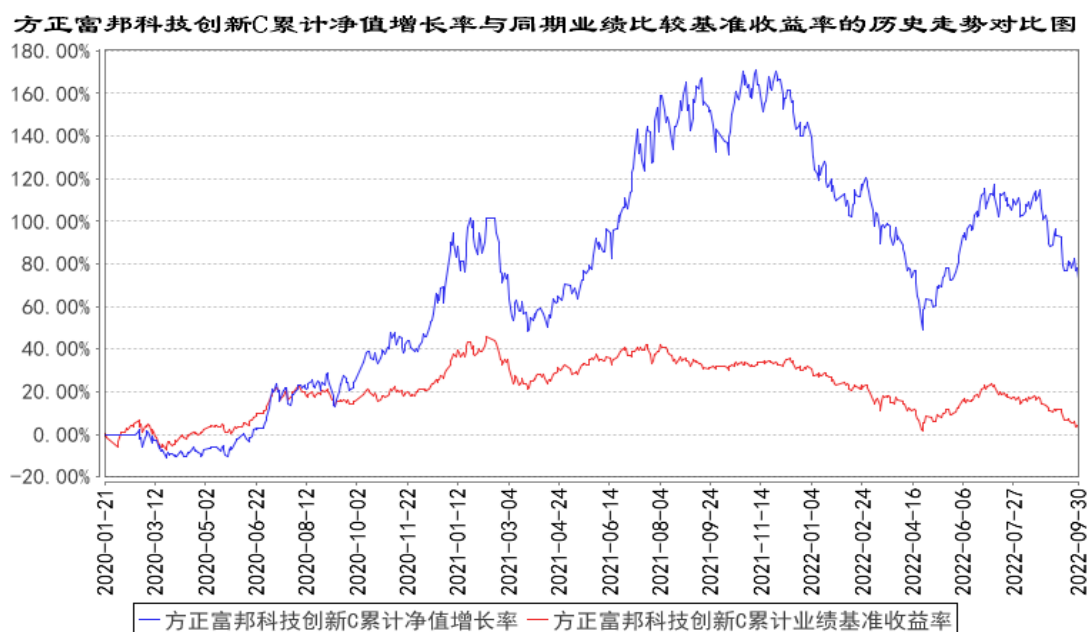
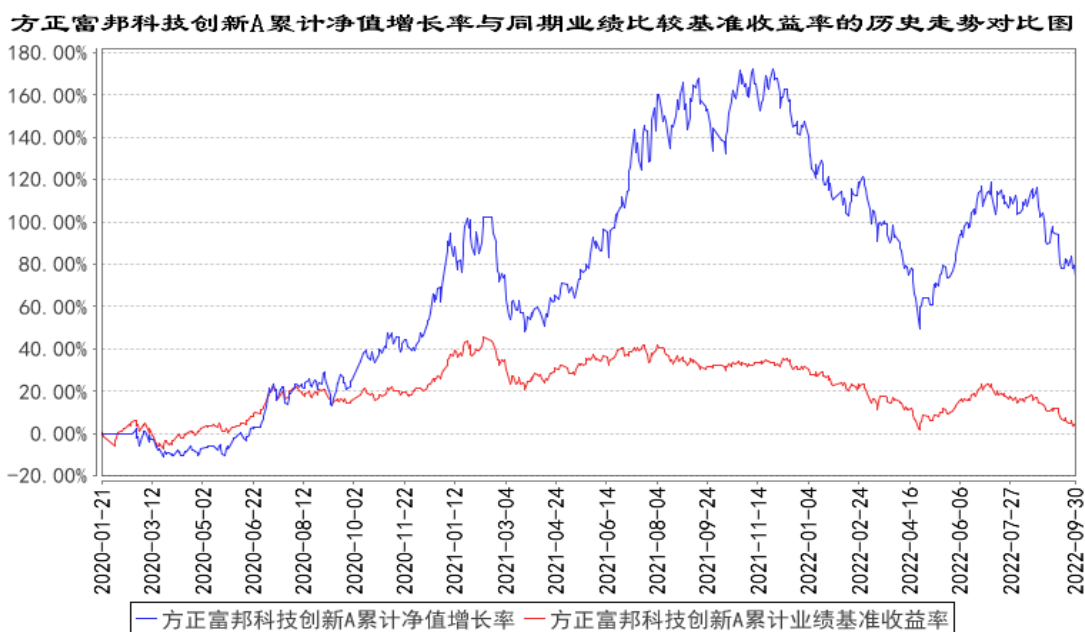
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-17.35%	1.78%	-15.93%	0.88%	-1.42%	0.90%
过去六个月	-9.67%	2.01%	-11.23%	1.14%	1.56%	0.87%
过去一年	-28.77%	1.97%	-22.15%	1.06%	-6.62%	0.91%
自基金合同生效起至今	74.05%	2.15%	2.88%	1.15%	71.17%	1.00%

方正富邦科技创新 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	-17.41%	1.78%	-15.93%	0.88%	-1.48%	0.90%

过去六个月	-9.81%	2.01%	-11.23%	1.14%	1.42%	0.87%
过去一年	-28.98%	1.97%	-22.15%	1.06%	-6.83%	0.91%
自基金合同生效起至今	72.71%	2.15%	2.88%	1.15%	69.83%	1.00%

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



§ 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		
吴昊	数量投资部总经理兼本基金基金经理	2020 年 10 月 29 日	-	8 年	北京邮电大学计算机学院本科、硕士，清华大学经管学院硕士。曾任华夏基金管理有限公司数量投资部任副总裁；2018 年 4 月加入方正富邦基金管理有限公司，现任权益投决会委员、董事总经理、数量投资部总经理、基金经理。2018 年 6 月至报告期末，任方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金（自 2021 年 1 月 1 日起已变更为方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金）的基金经理，2018 年 11 月至报告期末，任方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2018 年 11 月至 2021 年 4 月，任方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 1 月至 2021 年 4 月，任方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2019 年 3 月至 2021 年 4 月，任方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2019 年 5 月至报告期末，任方正富邦红利精选混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至 2022 年 3 月，任方正富邦天鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦天睿灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦天恒灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月，任方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 11 月至报告期末，任方正富邦中证主要消费红利指数增强型证券投资基金（LOF）的基金经理。2020 年 1 月至 2021 年 4 月，任方正富邦天璇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月至 2021 年 12 月，任方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金经理。2020 年 10 月至报告期末，任方正富邦科技创

					<p>新混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月至报告期末，任方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 1 月至报告期末，任方正富邦 ESG 主题投资混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月至报告期末，任方正富邦中证沪港深人工智能 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

注：1. “任职日期”和“离任日期”分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3. 本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内无此情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规及基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无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，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》的规定，通过系统和人工等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。

在投资决策内部控制方面，本基金管理人建立了统一的投资研究管理平台和全公司适用的投资对象备选库和交易对象备选库，确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度，通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式，使不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行控制方面，本基金管理人实行集中交易制度，交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先，价格优先的原则严格执行所有指令，确保公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易，按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制制度，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

2022 年以来，全球经济在地缘政治、通胀高粘性中面临严峻考验。刚刚过去的三季度，在美联储不断大幅加息的预期和节奏影响下，引发市场对海外衰退的担忧，同时国内经济复苏承压，A 股各大核心指数出现了连续的调整，市场成交量在 9 月出现明显萎缩，估值已调整至历史低位区域。展望后市，财政政策仍将积极发力助力稳增长，随着前期稳经济增长的政策逐步落地及后续增量政策出台，经济数据呈现逐月改善态势，四季度经济有望筑底企稳，这将有利于资本市场信心的回暖；海外来看，地缘政治、以及美联储加息态度的模糊，使得外部环境的不确定性也较大。我们认为 A 股估值和股权风险溢价水平等指标的分位数均已处于历史极值水平，配置权益资产已具备较高的赔率，同时，尽管当前流动性对估值的约束进一步缓和，但是面对未来宏观波动率的上升，市场投资逻辑可能从总量转向结构性亮点，寻找高景气、高增长、持续盈利能力的企业将更为重要。

过去几年，我国在政策的助推下新能源汽车渗透率逐渐提升。进入 2022 年新能源汽车的销量继续稳定增长，新能源汽车产业链也取得了瞩目发展。对于光伏、风电等新能源产业来说，在“碳达峰碳中和”背景下迎来了快速发展期，光伏、风电等产业有望持续收益。展望未来，随着新能源汽车渗透率的不断提升，光伏、风电装机稳步增长，新能源板块有望持续保持较高的增长，仍旧看好未来新能源板块的中长期投资价值。

本基金将继续关注新能源产业链中具备中长期投资价值的优秀企业，同时时刻保持清醒的头脑，敢于在价值低估时左侧提前布局，努力实现资产的保值增值。

报告期内的基金投资运作严守基金合同，在运作过程中坚持以公司基本面分析为主，通过精选个股，主要配置了新能源产业链上下游优质的成长性公司。同时认真对待投资者申购、赎回等事项，保障基金的正常运作，为持有人争取更高的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末方正富邦科技创新 A 基金份额净值为 1.7405 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.35%；截至本报告期末方正富邦科技创新 C 基金份额净值为 1.7271 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.41%；业绩比较基准收益率为-15.93%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内本基金不存在基金持有人数或基金资产净值预警的情况。

§ 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	159,457,406.36	89.29
	其中：股票	159,457,406.36	89.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	117,006.15	0.07
	其中：债券	117,006.15	0.07
	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	18,628,258.79	10.43
8	其他资产	379,679.19	0.21
9	合计	178,582,350.49	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 16,382,664.38 元，占基金资产净值比例为 9.36%。

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	-	-
B	采矿业	4,184,310.84	2.39
C	制造业	137,613,800.89	78.63
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	228,451.24	0.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	952,280.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	73,246.05	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	22,652.96	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	143,074,741.98	81.75

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者必须品	10,484,268.48	5.99
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	5,898,395.90	3.37
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	16,382,664.38	9.36

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	27,700	11,104,653.00	6.35
2	03690	美团-W	70,000	10,484,268.48	5.99
3	002594	比亚迪	38,000	9,576,380.00	5.47
4	300014	亿纬锂能	100,000	8,460,000.00	4.83
5	605117	德业股份	15,800	6,639,318.00	3.79
6	688408	中信博	68,000	6,528,000.00	3.73
7	300274	阳光电源	58,000	6,415,960.00	3.67
8	601012	隆基绿能	128,000	6,132,480.00	3.50
9	300124	汇川技术	105,800	6,084,558.00	3.48
10	600438	通威股份	128,000	6,010,880.00	3.43

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	-	-
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）	117,006.15	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	117,006.15	0.07

注：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

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	127073	天赐转债	1,170	117,006.15	0.07

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投资。

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投资股指期货。

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投资国债期货。

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

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的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	126,327.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	253,351.90
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	379,679.19

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不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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	方正富邦科技创新 A	方正富邦科技创新 C
报告期期初基金份额总额	55,307,826.87	48,748,640.06
报告期期间基金总申购份额	5,904,615.37	9,259,951.99
减：报告期期间基金总赎回份额	7,714,609.48	10,587,533.32
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	53,497,832.76	47,421,058.73

注：总申购份额含转换入份额，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

本报告期本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

本报告期本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

本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (2) 《方正富邦科技创新混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《方正富邦科技创新混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《方正富邦科技创新混合型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

方正富邦基金管理有限公司

2022 年 10 月 26 日