

海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金
2023 年第 1 季度报告
2023 年 3 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年四月二十二日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月 21 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 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通中证港股通科技 ETF
场内简称	HKC 科技
基金主代码	513860
交易代码	513860
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 17 日
报告期末基金份额总额	809,470,600.00 份
投资目标	本基金采用被动指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年化跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
投资策略	本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成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进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。

	债券投资方面，本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券投资组合。
业绩比较基准	中证港股通科技指数收益率
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，跟踪中证港股通科技指数，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。本基金主要通过港股通机制投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还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	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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 (2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	-10,947,855.64
2.本期利润	-2,514,612.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0030
4.期末基金资产净值	413,559,552.15
5.期末基金份额净值	0.5109

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

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	-1.31%	1.98%	-1.33%	1.87%	0.02%	0.11%
过去六个月	18.57%	2.61%	19.10%	2.55%	-0.53%	0.06%
过去一年	-1.31%	2.52%	-0.84%	2.46%	-0.47%	0.06%
自基金合同生效起至今	-48.91%	2.58%	-46.74%	2.63%	-2.17%	-0.05%

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

海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2021 年 6 月 17 日至 2023 年 3 月 31 日)



注：本基金合同于2021年6月17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十四部分（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		
江勇	本基金的基金经理	2021-06-17	-	11 年	经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师，资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2018 年 7 月起任海富通上证非周期 ETF 联接基金经理。2018 年 7 月至 2022 年 5 月任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF、海富通中证 100 指数(LOF)基金经理。2018 年 7 月至 2020 年 3 月任海富通中证内地低碳指数（现海富通中证 500 增强）基金经理。2020 年 8 月至 2023 年 3 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 基金经理。2020 年 8 月至 2022 年 5 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 联接基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通稳固收益债券的基金经理。2021 年 2 月起兼任海富通欣睿混合基金经理。2021 年 6 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 和海富通策略收益债券基金经理。2021 年 9 月

					起兼任海富通欣利混合基金经理。2023 年 1 月起兼任海富通强化回报混合基金经理。
陶意非	本基金的基金经理	2021-06-17	2023-03-29	16 年	硕士。持有基金从业人员资格证书。历任花旗集团证券（日本）策略分析师、瑞穗证券（Mizuho Securities）交易员、顶峰资产管理有限公司（ASSET MANAGEMENT ONE Co., Ltd）基金经理、汇丰晋信基金管理有限公司首席港股策略师。2018 年 12 月加入海富通基金管理有限公司。2019 年 1 月至 2023 年 3 月任海富通大中华混合（QDII）、海富通中国海外混合（QDII）的基金经理。2021 年 6 月至 2023 年 3 月兼任海富通中证港股通科技 ETF 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：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

港股一季度表现先扬后抑，年初到春节前，防疫政策的调整、稳增长政策的持续推出以及较强的基本面复苏预期，带动港股市场持续上涨；春节后至 3 月下旬，港股市场开启震荡调整。1 月底中美气象气球外交摩擦引发对中美关系的担忧，美国 1-2 月强劲就业和通胀数据强化美联储鹰派立场，市场持续上调美联储加息预期，造成恐慌情绪加重，资产价格也对美联储结束加息及降息的预期进行了短期且幅度较大的修正。3 月以来，欧美银行业暴雷事件频发，硅谷银行倒闭、瑞士信贷危机持续发酵，市场避险情绪迅速升温，再度拖累港股表现。为缓解市场恐慌情绪，防范美元流动性紧张，3 月 19 日美联储与加拿大央行、英国央行、日本央行、欧洲央行、瑞士央行发布联合声明，宣布通过常设美元流动性互换额度安排加强流动性供应，美联储同意将 7 天到期操作的频率从每周增加到每天，这一操作将于 3 月 20 日开始，港股自此开始反弹。整体来看，一季度 MSCI 中国指数上涨 5.29%、恒生科技指数上涨 4.24%、恒生中国企业指数上涨 3.94%、恒生指数上涨 3.13%。作为指数基金，在操作上我们严格遵守基金合同，应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度，降低跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-1.31%，同期业绩比较基准收益率为-1.33%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.02 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	401,280,198.24	96.93
	其中：股票	401,280,198.24	96.93
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	12,697,950.55	3.07
7	其他资产	0.25	0.00
8	合计	413,978,149.04	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为401,280,198.24元，占资产净值比例为97.03%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

5.2.2 指数投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有指数投资的境内股票。

5.2.3 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 (%)
原材料	1,083,319.88	0.26
非日常生活消费品	95,316,934.38	23.05
日常消费品	16,519,243.72	3.99
金融	794,797.87	0.19
医疗保健	96,179,020.49	23.26
工业	1,516,464.93	0.37
信息技术	114,068,258.01	27.58
通信服务	75,802,158.96	18.33
合计	401,280,198.24	97.03

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	00700	腾讯控股	138,900	46,911,138.42	11.34
2	03690	美团-W	271,470	34,102,423.81	8.25
3	01810	小米集团-W	3,000,627	31,784,024.47	7.69
4	01211	比亚迪股份	154,500	31,080,644.18	7.52
5	02269	药明生物	713,500	30,355,804.70	7.34
6	01024	快手-W	453,100	23,977,387.98	5.80
7	06160	百济神州	207,175	23,468,380.84	5.67
8	02015	理想汽车-W	208,200	17,861,515.48	4.32
9	00981	中芯国际	1,007,063	16,397,630.19	3.96
10	06618	京东健康	228,779	11,696,084.78	2.83

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	06881	中国银河	26,500	91,633.54	0.02
2	02500	启明医疗-B	40	376.78	0.00

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

本基金参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。

本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。

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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

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

本报告期内本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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 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	0.25
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	其他	-
-	合计	0.25

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 报告期末投资的股票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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五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

本报告期期初基金份额总额	878,470,600.00
本报告期基金总申购份额	36,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	105,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	809,470,600.00

§7 基金管理人运用自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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	8,200,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	8,200,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.01

7.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

§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 109 只公募基金。截至 2023 年 3 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1346 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。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”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置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”。2022 年 9 月，海富通荣获“IAMAC 推介 2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

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中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金的文件

- (二)海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (三)海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- (四)海富通中证港股通科技交易型开放式指数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

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

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
二〇二三年四月二十二日