

华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资  
基金  
2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 月 21 日

## 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 07 月 20 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 04 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 华富中证科创创业 50 指数增强  |
| 基金主代码      | 016122  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2022 年 8 月 31 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 58,656,204.73 份   |
| 投资目标       | 本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略       | <p>本基金采用指数增强型投资策略，以中证科创创业 50 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8.00%。</p> <p>股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资以个股精选策略为主。在本基金的投资过程中，将控制股票投资组合与标的指数的结构性偏离，以期在长期实现持续超越标的指数收益率的投资目标。</p> <p>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。</p> <p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋</p> |

势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置，在控制基金跟踪误差的前提下，通过对基本面的深入研究及分析谋求在偏离风险和超额收益间的最佳配置。

(二) 股票投资策略

本基金采用“指数化被动投资为主、主动增强为辅”的投资策略来构建股票投资组合。

(1) 指数化投资策略

本基金将运用指数化的投资方法，通过参考标的指数成份股的构成及其权重确定本基金投资组合的基本构成和大致占比，并通过控制投资组合中成份股对标的指数中权重的偏离，以控制跟踪误差，进而达成对标的指数的跟踪目标。

由于标的指数编制方法调整，或预期成份股及其权重发生变化

(包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等)时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。

(2) 指数增强策略

本基金主要通过主动精选个股，选取并持有基本面良好的股票构成投资组合，在控制组合跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。本基金将在满足投资比例要求基础上，进行成份股优化增强、非成份股优选增强对组合进行优化。具体来说，股票投资采用定量和定性分析相结合的策略选取基本面良好的股票。

1) 定性分析方面

在定性分析方面，本基金主要挑选全部或部分具备以下特征的上市公司：

- A、所处行业具备良好的长期发展前景，受益于消费升级、产业升级等国家战略发展方向，拥有良好盈利增长前景的优质企业；
- B、商业模式良好，具备中长期稳定的盈利预期；
- C、在行业中具有较为明显的竞争优势和地位，核心竞争力较为稳固；
- D、公司具有良好的治理结构，从大股东、管理层到中层业务骨干有良好的激励机制，并且企业的信息披露公开透明；
- E、公司具有良好的创新能力。

2) 定量分析方面

本基金定量的方法主要通过对公司成长性指标、财务指标和估值指标等方面的综合评估，以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。包括：成长性指标（收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等）、财务指标（毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率等）、估值指标（PE、PEG、PS 等）等。

(3) 港股通标的股票投资策略

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。考虑到香港股票市场与 A 股股票市场的差异，对

于港股通标的股票，本基金还将关注香港股票市场制度与内地股票市场存在的差异对股票投资价值的影响，比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌停限制、估值与盈利回报等方面；港股通每日额度应用情况；人民币与港币之间的汇兑比率变化情况等因素，精选符合本基金投资目标的港股通标的股票。

### （三）债券投资策略

本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，基于本基金流动性管理的需要投资于政府债券、央行票据和金融债等固定收益类品种，以保证基金资产流动性，并降低组合跟踪误差。

此外，本基金可投资于可转换债券和可交换债券，因为可转换债券和可交换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，且具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券和可交换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。

### （四）国债期货投资策略

在法律法规许可时，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### （五）股指期货投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

### （六）资产支持证券投资策略

本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

### （七）参与转融通证券出借业务策略

为更好的实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要，参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况、组合风险收益情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

|                 |  |                    |
|-----------------|--|--------------------|
|                 | <p>若相关转融通证券出借业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p> <p>未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标及风险收益特征的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新。</p>   |                    |
| 业绩比较基准          | <p>中证科创创业 50 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。</p> <p>未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。</p> <p>自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。</p> |                    |
| 风险收益特征          | <p>本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时，本基金属于指数增强型基金，跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p> <p>本基金如果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有风险。</p>   |                    |
| 基金管理人           | 华富基金管理有限公司   |                    |
| 基金托管人           | 平安银行股份有限公司   |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 华富中证科创创业 50 指数增强 A   | 华富中证科创创业 50 指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 016122   | 016123             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 29,231,869.95 份  | 29,424,334.78 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                              |
|        | (2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |

|   | 月<br>30<br>日)   |   |
|---|---|---|
|   | 华<br>富<br>中<br>证<br>科<br>创<br>创<br>业<br>50<br>指<br>数<br>增<br>强<br>A | 华<br>富<br>中<br>证<br>科<br>创<br>创<br>业<br>50<br>指<br>数<br>增<br>强<br>C |
| 1. 本<br>期已<br>实现<br>收益                  | -<br>13<br>6, 3,<br>77<br>9. 0.<br>84                               | -<br>17<br>26<br>0.<br>59   |
| 2. 本<br>期利<br>润                         | -<br>1,<br>80<br>5, 7,<br>29<br>2. 0.<br>26                         | -<br>44<br>63<br>90   |
| 3. 加<br>权平<br>均基<br>金份<br>额本<br>期利<br>润 | -<br>0. 0.<br>07<br>50  | -<br>08<br>07   |
| 4. 期<br>末基<br>金资<br>产净<br>值             | 25<br>, 9,<br>01<br>, 3,<br>85<br>. 6.<br>5                         | 25<br>, 9,<br>84<br>, 8<br>91<br>9<br>4                             |

|      |       |  |
|------|-------|--|
| 5. 期 |       |  |
| 末基   | 0. 0. |  |
| 金份   | 8888  |  |
| 额净   | 6131  |  |
| 值    |       |  |

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

华富中证科创创业 50 指数增强 A

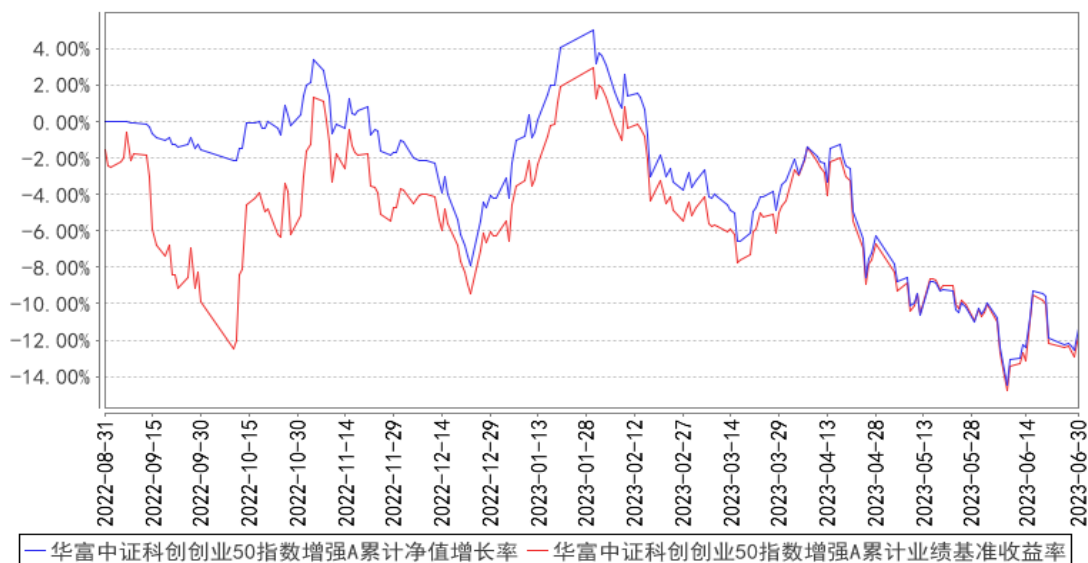
| 阶段             | 净值增长率①  | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|---------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -8.42%  | 1.07%         | -7.74%         | 1.11%                 | -0.68% | -0.04% |
| 过去六个月          | -7.48%  | 1.00%         | -5.80%         | 1.03%                 | -1.68% | -0.03% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -11.39% | 0.89%         | -11.72%        | 1.18%                 | 0.33%  | -0.29% |

华富中证科创创业 50 指数增强 C

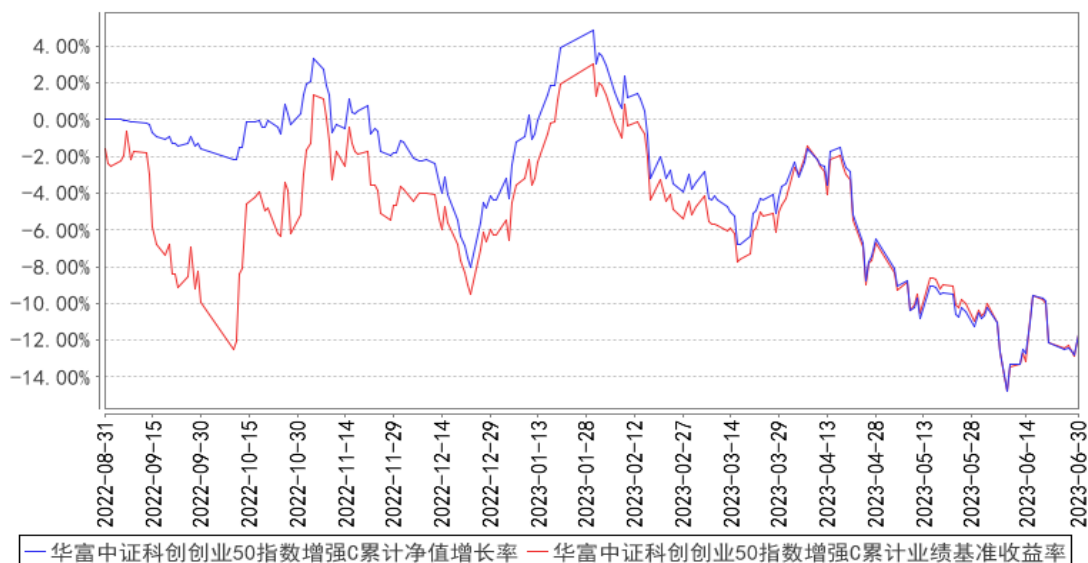
| 阶段             | 净值增长率①  | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|---------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -8.52%  | 1.07%         | -7.74%         | 1.11%                 | -0.78% | -0.04% |
| 过去六个月          | -7.66%  | 1.00%         | -5.80%         | 1.03%                 | -1.86% | -0.03% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -11.69% | 0.89%         | -11.72%        | 1.18%                 | 0.03%  | -0.29% |

#### 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

**华富中证科创创业50指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



**华富中证科创创业50指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



注：根据《华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金》的规定，本基金的资产配置范围为：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、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）。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。本基金建仓期为 2022 年 8 月 31 日到 2023 年 2 月



28 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《华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金》的相关规定。

## § 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 |        |   |
| 张娅 | 本基金基金经理、公司公募投资决策委员会委员、公司总经理助理、指数投资部总监 | 2022 年 8 月 31 日 | -    | 十八年    | 美国肯特州立大学金融工程硕士，硕士研究生学历。曾先后担任华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部总监兼基金经理、上海同安投资管理有限公司副总经理兼宏观量化中心总经理。2017 年 4 月加入华富基金管理有限公司，自 2019 年 1 月 28 日起任华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 24 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 4 月 23 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2020 年 8 月 3 日起任华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 7 月 22 日起任华富消费成长股票型证券投资基金基金经理，自 2022 年 8 月 31 日起任华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。 |
| 郜哲 | 本基金基金经理                               | 2022 年 8 月 31 日 | -    | 九年     | 北京大学理学博士，硕士研究生学历。先后担任方正证券股份有限公司博士后研究员、上海同安投资管理有限公司高级研究员。2017 年 4 月加入华富基金管理有限公司，自 2018 年 2 月 23 日起任华富中证 100 指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 1 月 28 日起任华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 24 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金  |

|     |         |                |   |  |  |
|-----|---------|----------------|---|--|--|
|     |         |                |   | <p>经理，自 2020 年 4 月 23 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2020 年 8 月 3 日起任华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 15 日起任华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 11 日起任华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 9 月 15 日起任华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 7 月 22 日起任华富消费成长股票型证券投资基金基金经理，自 2022 年 8 月 31 日起任华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。</p> |  |
| 李孝华 | 本基金基金经理 | 2023 年 2 月 9 日 | - | 十年   | <p>南开大学金融学硕士、硕士研究生学历。曾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，自 2021 年 5 月 7 日起任华富中证 100 指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 28 日起任华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 11 日起任华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 17 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，自 2022 年 9 月 5 日起任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任华富中证科创创业 50 指数增强型证</p> |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 券投资基金基金经理，自 2023 年 3 月 24 日起任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，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

2023 年二季度，市场风险偏好较一季度降低，分化仍在加剧，且轮动快速。自 5 月初，市场开始对通缩预期有所担忧，市场风险偏好持续降低。截止 5 月底，市场对经济悲观预期基本充分定价，市场进一步分化，人工智能新技术突破后，TMT 板块在经历了一个季度领涨和跟随大盘一起调整了 1 个月后，市场更注重业绩能率先兑现的板块，因此 CPO，服务器等业绩率先落地的板块很快续创新高，而应用端则在底部震荡为主，同时新能源、医药、半导体等也超跌明显，自

6 月起逐渐企稳，均有短期反弹行情。市场也由此呈现出板块快速轮动的特征。

本基金在一季度的运作中，在四月主要对盈利预期向好，技术重大突破的人工智能相关的子行业进行超配，五月起进一步集中于其中的算力板块，6 月中下旬，基于稳增长预期提升，板块整体反弹概率增大的判断，调整行业分布更为均衡。

展望 2023 年三季度，当前科创创业 50 指数中的几个重点子行业或者盈利预期在持续抬升，或者估值性价比明显提升，科创创业 50 指数仍是处于逢低布局的好时机：

(1) TMT：受益于信创和 AI 新技术突破，2023 盈利预期增速明显转好，且仍在持续抬升，当前算力环节在海外需求拉动下，业绩已逐步兑现，而国内仍有较大的更新需求，在三季度仍可能对算力环节持续拉动，而应用环节，当前 B 端应用逐渐清晰落地，C 端也具备了监管备案条件，后续有望出现再次引燃市场预期的大市场空间的国内应用。

(2) 半导体：周期下行近 2 年，当前已临近底部，从全球半导体销售额数据来看，已接近 08 年金融危机时的历史低位，库存周期见底的认知较为统一。而需求端也在逐渐改善，一方面 AI 算力带来较为持续的增量需求，另一方面，随着海外经济软着陆概率加大，国内稳增长政策在三季度也有望出现成效，周期向上趋势越来越临近出现。

(3) 新能源车、光伏：新能源车当前无论是交易层面还是筹码层面，相对一季度更临近出清，后续随着经济恢复，业绩将逐渐改善。光伏产业在 HJT 新技术临近平价的状态下，也或有阶段性反弹行情

(4) 创新药：创新药新研发周期有望在后半年内某个时刻开启。

在这一背景下，我们将继续对盈利向好确定性较高的 TMT 行业维持超配，并在内部选取盈利预期上调和估值性价比较高的公司予以配置。而对于半导体、新能源车，将在出现较为确定性的稳增长政策生效时，予以超配。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富中证科创创业 50 指数增强 A 份额净值为 0.8861 元，累计份额净值为 0.8861 元。报告期，华富中证科创创业 50 指数增强 A 份额净值增长率为-8.42%，同期业绩比较基准收益率为-7.74%。截止本期末，华富中证科创创业 50 指数增强 C 份额净值为 0.8831 元，累计份额净值为 0.8831 元。报告期，华富中证科创创业 50 指数增强 C 份额净值增长率为-8.52%，同期业绩比较基准收益率为-7.74%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2023 年 05 月 04 日起至 2023 年 06 月 14 日，本基金基金资产净值存在连续二十个工作日

低于 5000 万元的情形，从 2023 年 06 月 15 日至本报告期末（2023 年 06 月 30 日），本基金基金资产净值已不存在低于 5000 万元的情形。

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              | 48,546,549.26 | 93.31        |
|    | 其中：股票             | 48,546,549.26 | 93.31        |
| 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      | 3,367,250.28  | 6.47         |
| 8  | 其他资产              | 115,074.05    | 0.22         |
| 9  | 合计                | 52,028,873.59 | 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         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 38,096,976.10 | 73.42        |
| 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  | 4,665,628.76  | 8.99         |
| 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    | 1,399,332.00  | 2.70  |
| 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            | 44,161,936.86 | 85.11 |

### 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              | 4,013,040.40 | 7.73         |
| 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  | 371,572.00   | 0.72         |
| 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               | 4,384,612.40 | 8.45         |

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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  | 300750 | 宁德时代 | 21,100 | 4,827,469.00 | 9.30         |
| 2  | 300760 | 迈瑞医疗 | 9,500  | 2,848,100.00 | 5.49         |
| 3  | 300274 | 阳光电源 | 22,300 | 2,600,849.00 | 5.01         |
| 4  | 300124 | 汇川技术 | 39,500 | 2,536,295.00 | 4.89         |
| 5  | 688981 | 中芯国际 | 49,500 | 2,500,740.00 | 4.82         |
| 6  | 688111 | 金山办公 | 4,818  | 2,275,155.96 | 4.38         |
| 7  | 688012 | 中微公司 | 13,200 | 2,065,140.00 | 3.98         |
| 8  | 300014 | 亿纬锂能 | 28,100 | 1,700,050.00 | 3.28         |
| 9  | 688008 | 澜起科技 | 24,800 | 1,424,016.00 | 2.74         |
| 10 | 688599 | 天合光能 | 31,200 | 1,329,432.00 | 2.56         |

### 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  | 300601 | 康泰生物 | 15,600 | 396,084.00 | 0.76         |
| 2  | 300308 | 中际旭创 | 2,000  | 294,900.00 | 0.57         |
| 3  | 600276 | 恒瑞医药 | 6,000  | 287,400.00 | 0.55         |
| 4  | 300502 | 新易盛  | 4,000  | 271,880.00 | 0.52         |
| 5  | 002812 | 恩捷股份 | 2,600  | 250,510.00 | 0.48         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

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

注：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

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，惠州亿纬锂能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规定的备选股票库

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   | -          |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 115,074.05 |
| 6  | 其他应收款   | -          |



|   |    |            |
|---|----|------------|
| 7 | 其他 | -          |
| 8 | 合计 | 115,074.05 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

##### 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

注：本基金本报告期末指数前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

#### 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

| 项目                        | 华富中证科创创业 50 指数增强 A | 华富中证科创创业 50 指数增强 C |
|---------------------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 23,697,573.25      | 32,881,094.50      |
| 报告期期间基金总申购份额              | 7,774,777.87       | 6,006,599.85       |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 2,240,481.17       | 9,463,359.57       |
| 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               | 29,231,869.95      | 29,424,334.78      |

## § 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

单位：份

| 项目               | 华富中证科创创业 50 指数增强 A | 华富中证科创创业 50 指数增强 C |
|------------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 0.00               | 7,424,845.77       |
| 报告期期间买入/申购总份     | 6,923,340.40       | 0.00               |

|                               |              |              |
|-------------------------------|--------------|--------------|
| 额                             |              |              |
| 报告期期间卖出/赎回总份<br>额             | 0.00         | 0.00         |
| 报告期期末管理人持有的本<br>基金份额          | 6,923,340.40 | 7,424,845.77 |
| 报告期期末持有的本基金份<br>额占基金总份额比例 (%) | 11.80        | 12.66        |

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式  | 交易日期       | 交易份额(份)      | 交易金额(元)      | 适用费率(%) |
|----|-------|------------|--------------|--------------|---------|
| 1  | 基金转换入 | 2023-06-14 | 4,655,477.44 | 4,085,181.45 | 0       |
| 2  | 申购    | 2023-06-14 | 2,267,862.96 | 1,990,049.75 | 0.5     |
| 合计 |       |            | 6,923,340.40 | 6,075,231.20 |         |

## § 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<br>基金情况   |                  |                         |
|-------|----------------|--|------------------|------------------|------------------|------------------|-------------------------|
|       | 序号             | 持有<br>基金<br>份<br>额<br>比<br>例<br>达<br>到<br>或<br>者<br>超<br>过<br>20%<br>的<br>时<br>间<br>区<br>间 | 期<br>初<br>份<br>额 | 申<br>购<br>份<br>额 | 赎<br>回<br>份<br>额 | 持<br>有<br>份<br>额 | 份<br>额<br>占<br>比<br>(%) |
| 机构    | 1              | 2023.4.1-  | 7,424,845.77     | 6,923,340.40     | 0.00             | 14,348,186.17    | 24.4600                 |

|        |   |           |   |   |   |   |   |   |
|--------|---|-----------|---|---|---|---|---|---|
|        |   | 2023.6.30 |   |   |   |   |   |   |
| 个人     | - | -         | - | - | - | - | - | - |
| -      | - | -         | - | - | - | - | - | - |
| 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、华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金合同
- 2、华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金托管协议
- 3、华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富中证科创创业 50 指数增强型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

2023 年 7 月 21 日