

华富科技动能混合型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	华富科技动能混合	
基金主代码	007713	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 11 月 6 日	
报告期末基金份额总额	68,723,063.42 份	
投资目标	本基金通过把握科技进步实现产业弯道超车的战略性机遇，精选受益于科技动能主题中具有核心竞争优势的个股，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金重点投资于在科技创新中有持续成长潜力的上市公司，在充分控制基金资产风险和保持资产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，争取实现基金的长期稳健增值。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×75%+中证综合债券指数收益率×25%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	华富科技动能混合 A	华富科技动能混合 C
下属分级基金的交易代码	007713	017968
报告期末下属分级基金的份额总额	67,679,276.60 份	1,043,786.82 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)	
	华富科技动能混合 A	华富科技动能混合 C
1. 本期已实现收益	-3,727,267.58	-61,812.40
2. 本期利润	-1,417,365.62	-12,196.07
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0194	0.0134
4. 期	691,	

末基	, 206	
金资	646,	
产净	, 326	
值	430.	
	. 476	
	4	
5. 期		
末基	1. 1.	
金份	0202	
额净	3415	
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

华富科技动能混合 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	-1.56%	1.85%	-3.47%	0.60%	1.91%	1.25%
过去六个月	-10.13%	1.70%	0.76%	0.60%	-10.89%	1.10%
过去一年	-18.62%	2.01%	-8.46%	0.71%	-10.16%	1.30%
过去三年	-18.56%	1.88%	-0.37%	0.87%	-18.19%	1.01%
自基金合同 生效起至今	6.27%	1.92%	6.06%	0.90%	0.21%	1.02%

华富科技动能混合 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	-1.71%	1.85%	-3.47%	0.60%	1.76%	1.25%

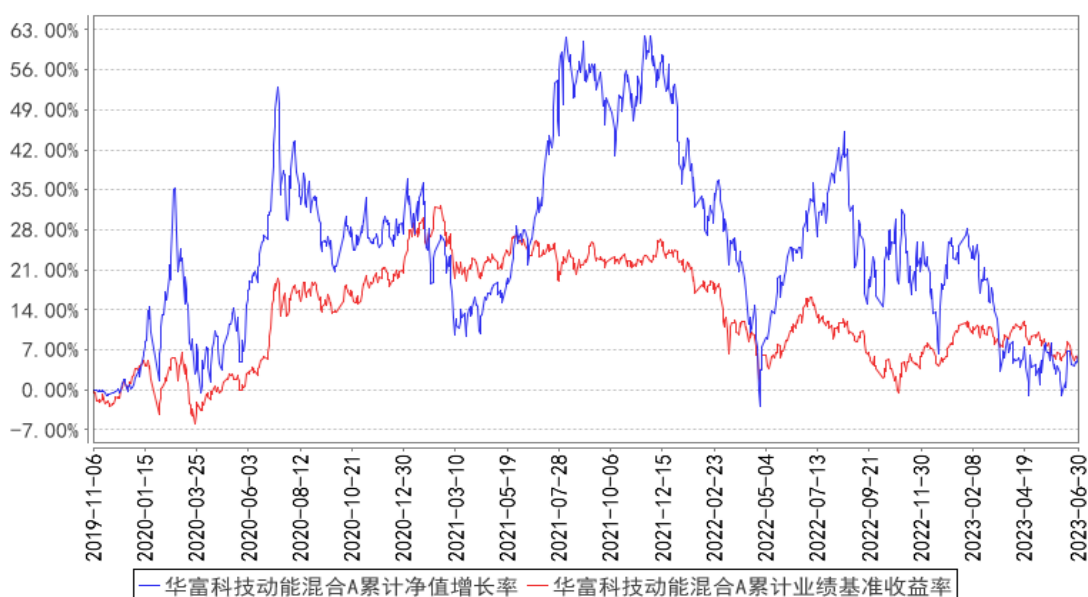
自基金合同 生效起至今	-8.16%	1.79%	-3.03%	0.58%	-5.13%	1.21%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

注：本基金业绩比较基准收益率=中证 800 指数收益率×75%+中证综合债券指数收益率×25%。

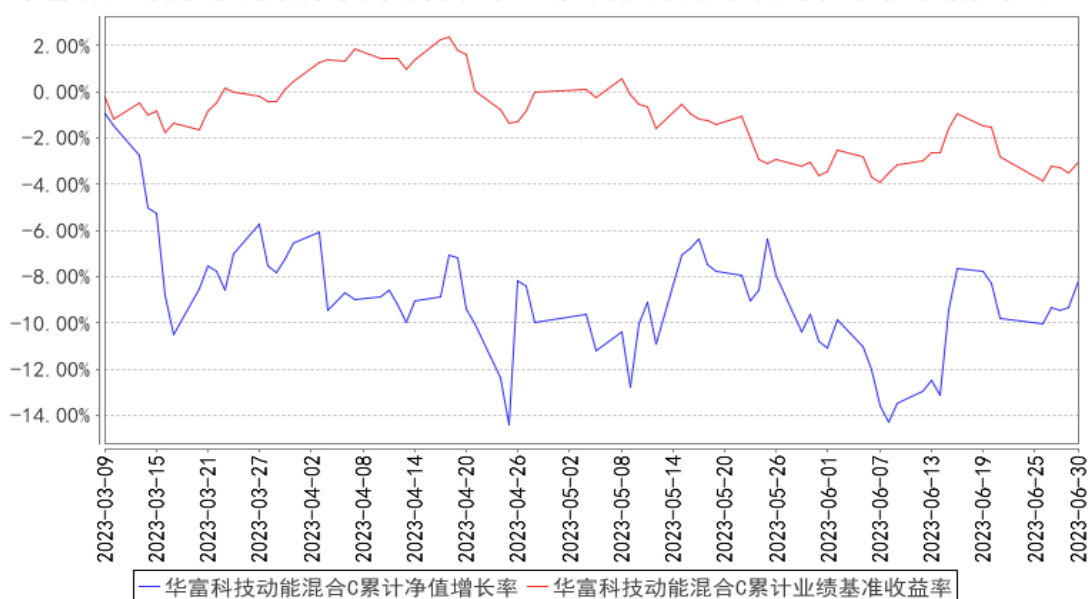
本基金于 2023 年 3 月 9 日起增加 C 类基金份额，本基金 C 类份额报告期间的起始日为 2023 年 3 月 9 日。

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

华富科技动能混合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



华富科技动能混合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：1、根据《华富科技动能混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资组合比例

为：股票投资比例为基金资产的 45%-90%，投资于本基金界定的科技动能主题相关证券不低于非现金基金资产的 80%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金建仓期为 2019 年 11 月 6 日到 2020 年 5 月 6 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《华富科技动能混合型证券投资基金基金合同》的规定。

2、本基金于 2023 年 3 月 9 日起新增 C 类份额，本基金 C 类份额报告期间的起始日为 2023 年 3 月 9 日。

§ 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		
沈成	本基金基金经理	2022 年 8 月 22 日	-	十二年	上海交通大学技术经济及管理专业硕士，硕士研究生学历。曾先后任职于长城证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司。2021 年 11 月 26 日加入华富基金管理有限公司，自 2021 年 12 月 29 日起任华富新能源股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2022 年 8 月 22 日起任华富科技动能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，经济恢复势头有所放缓，这既体现了疫情“疤痕效应”的影响，也叠加了经济转型升级的结构性阵痛。

国内 A 股市场二季度各指数有所回调，上证指数、沪深 300、创业板指涨跌幅分别为-2.16%、-5.15%、-7.69%。行业表现方面，中信一级行业指数涨跌幅居前 5 位的依次为通信、家电、传媒、机械、电力及公用事业，涨跌幅分别为 12.83%、7.12%、6.86%、5.24%、4.18%；居后 5 位的依次为消费者服务、食品饮料、农林牧渔、建材、综合，涨跌幅分别为-23.89%、-11.34%、-10.72%、-10.38%、-9.37%。

展望 2023 年三季度，中国经济增长仍将主要取决于内需的恢复程度。在促消费政策、服务消费加快释放的带动下，消费有望保持温和复苏，基建投资继续较快增长，高技术产业投资对制造业投资增长带来支撑，房地产开发投资降幅缓慢收窄。金融形势方面，鉴于复苏基础尚不牢固，预计人民银行将灵活使用公开市场操作、各类借贷便利工具确保流动性合理充裕，维持稳健略宽的流动性环境。

全球可再生能源渗透率不断提升，而储能是提升电力系统调节能力、保障电力系统安全运行的必然选择，未来储能的需求刚性有望进一步强化。除了抽水蓄能之外，电化学储能、压缩空气储能、重力储能等新型储能方兴未艾。电化学储能中，锂电池是当前的主流路线，钠电池、钒电池等新技术百花齐放。基于储能蓬勃发展的产业趋势，中国、美国、欧洲等国家或地区均出台相关的政策，支持、推动储能的应用与发展。

2023 年上半年，储能系统的诸多原材料成本进入下降通道，储能项目的经济性显著改善，“光储平价”进入视野。大型储能项目需求依然旺盛，户用储能渠道端去库存持续推进。国内用电侧峰谷电价差拉大、正午时段设为电价谷时的省市增多，部分地区可实现每天两充两放，故国内工商业储能经济性有望显著提升，2023 年有望实现从 0-1 的超高速增长。过去仅靠发电侧调节已经可以实现电力供需平衡，但随着风光等随机性的电源发电占比提高，未来需要用户侧也参与到功率调节中。虚拟电厂是一种通过先进信息通信技术和软件系统，实现分布式电源、储能系统、可控负荷、电动汽车等分布式能源资源的聚合和协调优化，以作为一个特殊电厂参与电力市场和电网运行的电源协调管理系统，是泛储能领域的新兴产业趋势。2025 年国家能源局规划需求响应达最大负荷的 3%-5%，而当前几近于无，因此虚拟电厂是一个从 0-1 的产业，未来需要电力市场化改革和商业模式探索共同推进虚拟电厂行业的发展。这可能带来一些系统、软硬件的投资机会，同时用户侧储能或分布式光伏相关企业亦有望通过其用户侧客户优势进一步价值变现。

我们预计 2022-2025 年全球电化学储能需求的复合增速有望超过 50%，需求景气具备较强的持续性；因此，本产品将重点配置储能行业，储能电池、储能逆变器、储能系统集成、核心零部件、虚拟电厂等环节，都是我们关注的重点；同时，我们也积极关注各类转型储能的公司，识别并享受其储能业务的高成长。我们希望精选契合储能产业趋势的高质量、可持续增长品种，努力调整组合及仓位，为持有人创造更好的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富科技动能混合 A 份额净值为 1.0234 元，累计份额净值为 1.0734 元。报告期，华富科技动能混合 A 份额净值增长率为-1.56%，同期业绩比较基准收益率为-3.47%。截止本期末，华富科技动能混合 C 份额净值为 1.0215 元，累计份额净值为 1.0215 元。报告期，华富科技动能混合 C 份额净值增长率为-1.71%，同期业绩比较基准收益率为-3.47%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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	61,995,291.74	85.40

	其中：股票	61,995,291.74	85.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,277,293.70	1.76
	其中：债券	1,277,293.70	1.76
	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	8,947,371.16	12.32
8	其他资产	375,402.18	0.52
9	合计	72,595,358.78	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	54,411,291.74	77.37
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	6,927,400.00	9.85
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	656,600.00	0.93
	合计	61,995,291.74	88.15

5.2.2 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	30,000	6,863,700.00	9.76
2	300274	阳光电源	44,000	5,131,720.00	7.30
3	300693	盛弘股份	130,074	4,802,332.08	6.83
4	603063	禾望电气	120,000	3,690,000.00	5.25
5	605117	德业股份	20,000	2,991,000.00	4.25
6	688390	固德威	16,000	2,669,760.00	3.80
7	600875	东方电气	140,000	2,611,000.00	3.71
8	002335	科华数据	70,000	2,516,500.00	3.58
9	688100	威胜信息	69,991	2,086,431.71	2.97
10	688472	阿特斯	110,000	2,019,600.00	2.87

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）	1,277,293.70	1.82
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,277,293.70	1.82

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	118019	金盘转债	10,000	1,277,293.70	1.82

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：本基金本报告期内未投资股指期货。

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：本基金本报告期内未投资国债期货。

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，科华数据股份有限公司、宁波德业科技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	27,545.45

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	347,856.73
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	375,402.18

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	118019	金盘转债	1,277,293.70	1.82

5.11.5 报告期末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。

5.11.6 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	华富科技动能混合 A	华富科技动能混合 C
报告期期初基金份额总额	71,722,116.83	777,578.99
报告期期间基金总申购份额	14,171,930.90	2,402,408.81
减：报告期期间基金总赎回份额	18,214,771.13	2,136,200.98
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	67,679,276.60	1,043,786.82

§ 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	华富科技动能混合 A	华富科技动能混合 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	7,018,652.23	0.00

报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	4,200,000.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	2,818,652.23	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	4.1	0

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	基金转换出	2023-06-14	4,200,000.00	-4,085,181.45	0.25
合计			4,200,000.00	-4,085,181.45	

§ 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					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险
无

注：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

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、华富科技动能混合型证券投资基金基金合同
- 2、华富科技动能混合型证券投资基金托管协议
- 3、华富科技动能混合型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富科技动能混合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