

华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资 基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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

送出日期：2023 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2022 年 8 月 31 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	19
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
§ 6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§ 7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	26
§ 8 投资组合报告	46

8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
8.6 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.....	51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51
8.8 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贵金属投资明细.....	51
8.9 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.....	51
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	51
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
8.12 投资组合报告附注.....	51
§ 9 基金份额持有人信息.....	52
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	53
§ 10 开放式基金份额变动.....	53
§ 11 重大事件揭示.....	53
11.1 基金份额持有人大会决议.....	53
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
11.4 基金投资策略的改变.....	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
11.8 其他重大事件.....	56
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
12.1 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.....	57
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§ 13 备查文件目录.....	57
13.1 备查文件目录.....	57
13.2 存放地点.....	58
13.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	64,774,128.90 份	
基金合同存续期	不定期	
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	35,032,870.59 份	29,741,258.31 份

2.2 基金产品说明

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。</p>

（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。

	<p>(三) 债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(四) 国债期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>(五) 股指期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(六) 资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p> <p>(七) 参与转融通证券出借业务策略</p> <p>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> <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>
<p>业绩比较基准</p>	<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>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华富基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	满志弘	李帅帅
	联系电话	021-68886996	0755-25878287
	电子邮箱	manzh@hffund.com	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95511-3
传真		021-68887997	0755-82080387
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码		200120	518001
法定代表人		赵万里	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号新湖商贸大厦 6 楼
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年 8 月 31 日(基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 日	
	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
本期已实现收益	-1,071,388.82	-1,112,125.68
本期利润	-1,296,187.14	-1,245,976.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0323	-0.0236
本期加权平均净值利润率	-3.26%	-2.38%
本期基金份额净值增长率	-4.23%	-4.36%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	
期末可供分配利润	-1,482,153.90	-1,296,402.99
期末可供分配基金份额利润	-0.0423	-0.0436
期末基金资产净值	33,550,716.69	28,444,855.32
期末基金份额净值	0.9577	0.9564
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-4.23%	-4.36%

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) 以上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（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	------	-------	------	-------	-----	-----

	增长率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	-2.70%	0.82%	4.04%	1.39%	-6.74%	-0.57%
自基金合同生效 起至今	-4.23%	0.71%	-6.28%	1.37%	2.05%	-0.66%

华富中证科创创业 50 指数增强 C

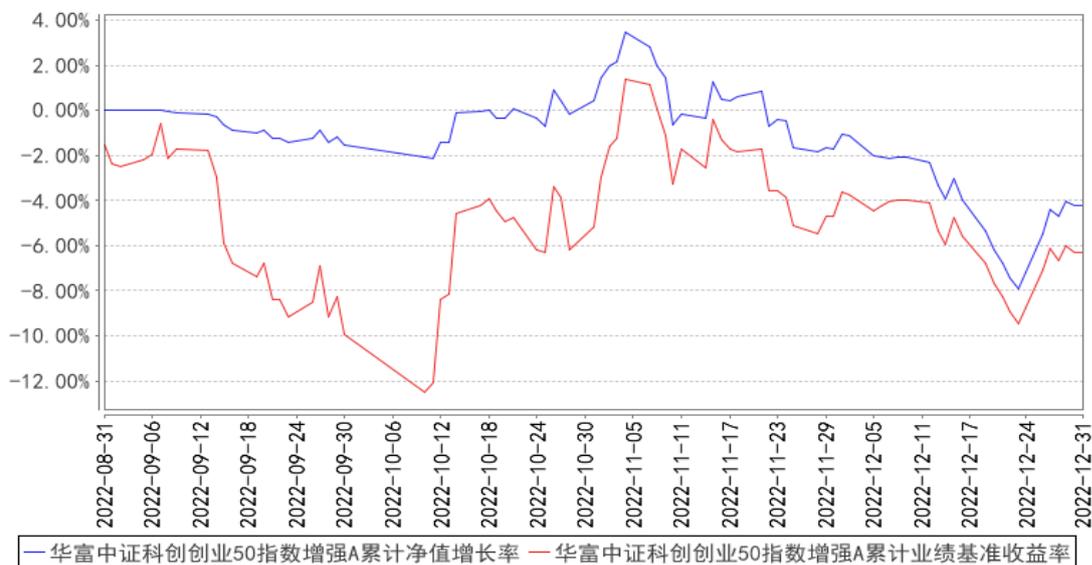
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.80%	0.82%	4.04%	1.39%	-6.84%	-0.57%
自基金合同生效 起至今	-4.36%	0.71%	-6.28%	1.37%	1.92%	-0.66%

注：

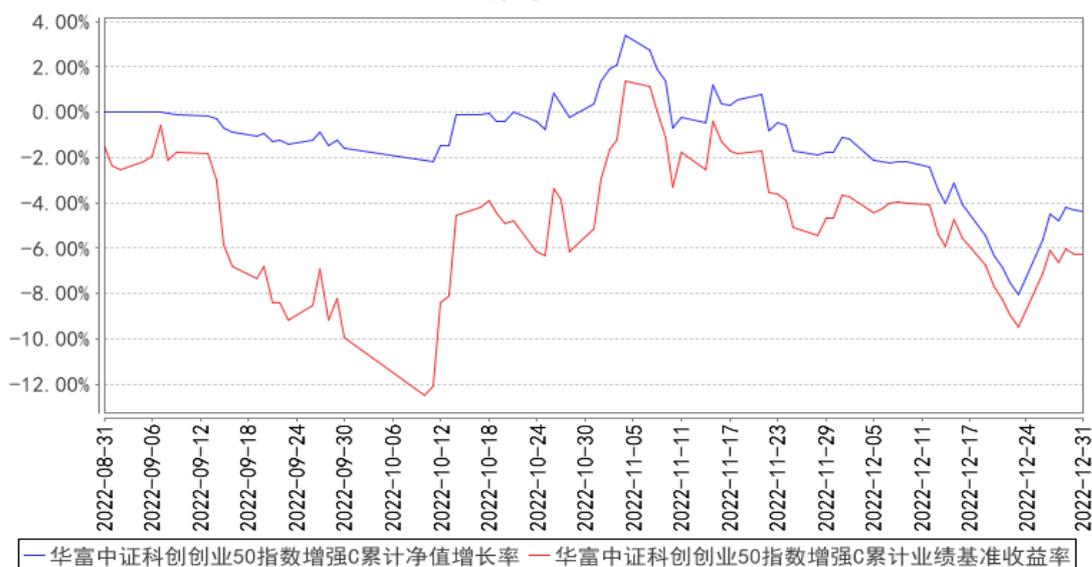
业绩比较基准=中证科创创业 50 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

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

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

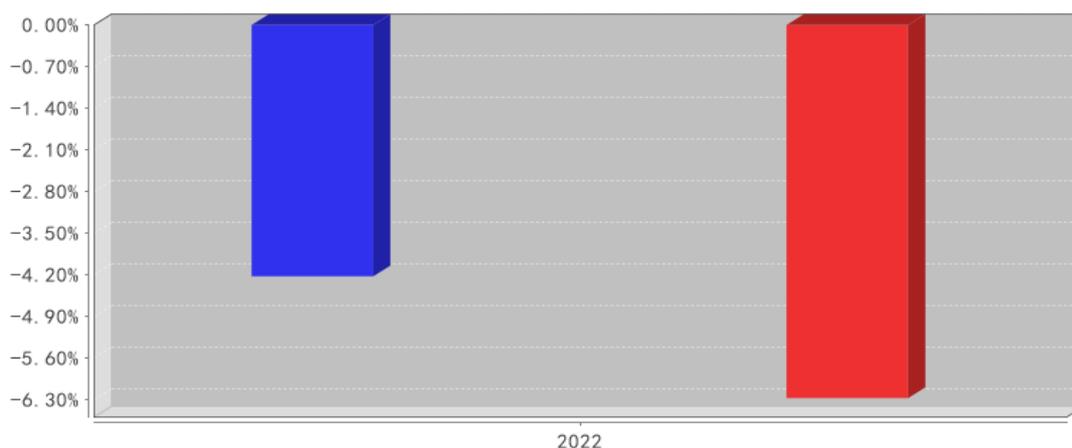


注：根据《华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金》的规定，本基金的资产配置范围为：具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、国债期货、股指期货、货币市场工具及法律法

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。本报告期内，本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为2022年8月31日到2023年2月28日。本报告期内，本基金仍在建仓期。

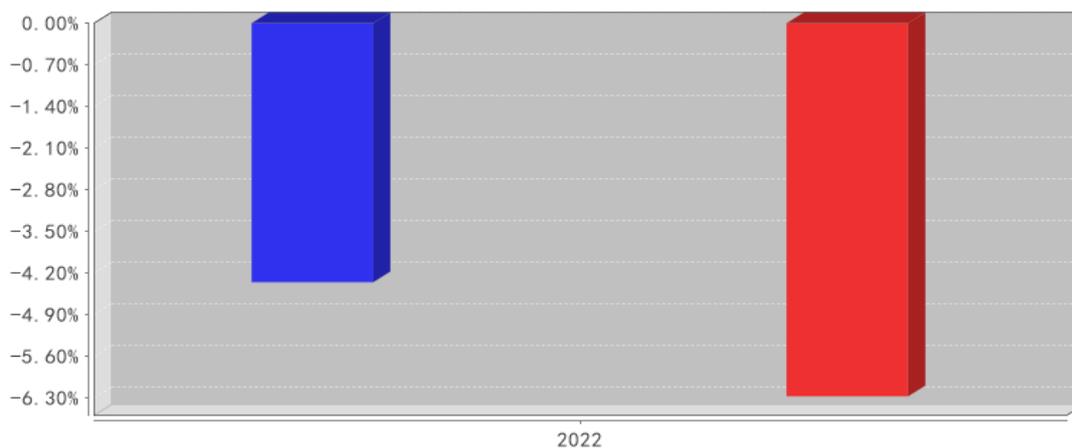
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华富中证科创创业50指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



■ 华富中证科创创业50指数增强A净值增长率
 ■ 华富中证科创创业50指数增强A业绩基准收益率

华富中证科创创业50指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



■ 华富中证科创创业50指数增强C净值增长率
 ■ 华富中证科创创业50指数增强C业绩基准收益率

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用融资担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2022 年 12 月 31 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、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、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、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、华富新能源股票型发起式证券投资基金、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金、华富国潮优选混合型发起式证券投资基金、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华富卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、华富匠心明选一年持有期混合型证券投资基金、华富富鑫一年定期开放债券型发起

式证券投资基金、华富安业一年持有期债券型证券投资基金、华富消费成长股票型证券投资基金、华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、华富时代锐选混合型证券投资基金、华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金共五十八只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	-	十七年	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	本基金的基金经理	2022 年 8 月 31 日	-	八年	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。
--	--	--	--	--	---

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《证券投资基金经营机构董事、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》及相关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》，公司制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公司的公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体控制措施如下：

在研究分析和投资决策环节，公司通过建立规范、完善的研究管理平台，为所有的投资组合经理提供公平的研究服务和支持。公司的各类投资组合，在保证其决策相对独立的同时，在获取投资信息、投资建议及决策实施方面均享有公平的机会。各投资组合经理根据其管理的投资组合的投资风格和投资策略，制定客观、完整的交易决策规则，并按照这些规则进行投资决策，保证各投资组合投资决策的客观性和独立性。

在交易执行环节，公司设立独立的集中交易部门，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。交易执行的公平原则：“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。公司通过完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，确保各

投资组合获得公平的交易机会。

在行为监控和分析评估环节，公司将公平交易作为日常交易监控的重要关注内容，加强对投资交易行为的监察稽核力度，公司集中交易部、监察稽核部等相关部门严格按照公司关于异常交易的界定规则对违反公平交易原则的异常交易进行识别、监控与分析。每日交易时间结束后，集中交易部对每一笔公平交易的执行结果进行登记，逐笔备注发生公平交易各指令的先后顺序及实际执行结果，由具体执行的交易员签字确认留档，并交监察稽核部备案。公司监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，根据纳入样本内的数据分析结果，未发现明显异常情况。

4.3.2 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。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年，权益市场先抑后扬，盈利预期和风险偏好在全年中有较大切换。一季度在联储加息，疫情反复和俄乌冲突等多重利空冲击下，对原本已经处于高估状态的科创行业和消费行业均有较大冲击。1-3 月市场大幅下跌。至 4 月底，绝大多数行业均下跌至估值偏低的区间，此时行业基本面盈利预期一旦发生变化，就容易有较快速的反弹。

科创行业由于盈利预期在 22 年不断变化，因此也呈现了较快速的轮动的行情特征，一季度普跌，二季度，光伏和新能源车是盈利预期变化最显著的两个板块，光伏受益于海外装机增加，新能源车受益于汽车购置税减免延期，下半年盈利预期修复，均有良好表现。但至三季度，由于疫情政策仍未发生变化，市场风险偏好再次降低，科创行业再次陷入大跌。至 4 季度，防疫政策明确转向，多个行业也迎来利好，如医疗在集采政策更为友好，以及新基建贴息贷款增加的环境下，

估值明显提升；计算机在信创加速的刺激下也有明显表现；半导体在周期临近底部后，也开始企稳回升。

本基金于 8 月 31 日成立，在报告期内，通过对产业趋势的紧密跟踪，较好的把握了各科创行业的机会。

在成立之初，判断各行业估值仍然略偏高，且盈利预期普遍较悲观，在 9 月维持低仓位运作，规避了科创行业 9 月的大幅波动，10 月初，通过对医疗集采缓和和贴息贷款对行业盈利预期改善预期的判断，及时配齐医疗行业，在 10 月中旬，通过对信创加速的判断配齐计算机和半导体制造行业。在 10 月底判断半导体周期大概率见底，及时配齐半导体其它环节。11 月-12 月，通过紧密跟踪光伏上游硅料价格变动，在其超预期降价后，逐渐配齐光伏行业。

选股层面我们有针对性的对每个行业采取符合行业现阶段逻辑的选股方法，而非采取统一的完全纯数据驱动的量化方法。对于盈利预期明确向好的行业，我们优选盈利预期提升幅度最大的公司，对于利空出尽，进入磨底阶段的行业，我们优选格局较优，行业利好信息出现时会率先被市场认可的公司；对于盈利有转好预期，但尚未形成市场统一认知的行业，我们优选基本面和估值性价比均较优的公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本期末华富中证科创创业 50 指数增强 A 份额净值为 0.9577 元，累计份额净值为 0.9577 元。报告期，本基金份额净值增长率为-4.23%，同期业绩比较基准收益率为-6.28%。

截至本期末华富中证科创创业 50 指数增强 C 份额净值为 0.9564 元，累计份额净值为 0.9564 元。报告期，本基金份额净值增长率为-4.36%，同期业绩比较基准收益率为-6.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 23 年，国内当前呈现弱复苏态势，安全主线是当前重要的投资逻辑，今年有不少科创行业存在盈利预期明确转好的拐点：

(1) 计算机行业受益于信创和 AI 新技术的出现，盈利预期已经开始向好，等待 23 年业绩兑现时，股价中枢有望稳步抬升。

(2) 半导体行业周期见底，预期在今年 1-2 季度内某个时点，将随着需求复苏周期重新拐点向上。

(3) 光伏随着上游成本压力下降，下游装机量也可能在今年某个时刻出现大幅上升，带动行业盈利水平阶段性提升。

(4) 新能源车是政府刺激消费的重要抓手，新年伊始，发改委发文大力鼓励新能车的消费，在补贴延续的基础上，有望有进一步鼓励措施出台，同时随着疫后可选消费的修复，车企以价换

量促销行为，销量也有望出现超预期的表现。

(5) 医药行业在集采缓和，全球医药创新新周期在今年有望开启的背景下，业绩相较去年也大概率改善。

综上，以年为维度，科创行业表现可期，此时通过双创 50 来布局科创行业，一方面可以降低单行业因盈利预期不稳定造成的大幅波动，另一方面也可以把握潜在的盈利预期持续转好的新兴行业的机会。

后续操作上，我们将依据各行业的盈利预期变化动态调整和分配权重，并在行业内依据行业盈利预期确定性，采取适用的选股方式。以期投资者创造更好的投资收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2022 年度，为加强公司内部控制，监察稽核工作从制度建设和内部监察稽核入手为公司持续发展奠定坚实的基础。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，独立、客观、公正地开展基金运作和公司管理的合规性监察，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

- 1、逐步建立和完善架构清晰、控制有效的内部控制机制。2022 年制定了《华富基金管理有限公司培训生管理办法》，明确了公司培训生管理工作的实施流程与规范秩序；制定了《华富基金管理有限公司互联网平台管理办法》，根据法规要求以及公司业务发展现状加强了对公司各互联网平台账号、发布内容、日常监控等方面的管理；根据《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》修订了《华富基金管理有限公司章程》；修订了《华富基金管理有限公司投资决策委员会工作规程》，优化了公募和专户投资决策委员会的人员架构、职责内容和议事规则。
- 2、多方位开展监察稽核工作，不断提高稽核覆盖面和检查力度。通过定期和不定期监察稽核工作的开展，公司的各个部门、各项业务的规范性和完善性都得到了较大的提高，各部门及时发现和弥补了制度建设中的漏洞和缺陷，实际业务操作流程更加科学有效。
- 3、加强风险监控，严格控制投资风险，通过对各基金的运行状况、投资比例、相关指标进行监控和跟踪，及时报告异常情况，确保基金投资规范运作。
- 4、扩大风险控制工作的覆盖面。风险控制工作不再局限于投资管理，从公司运营整体规范要求，风险控制渗透在业务的各个环节和所有部门，每月定时向风险控制委员会报告，进行及时的风险揭示。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学

性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为-2,542,164.05 元，期末可供分配利润为 -2,778,556.89 元。本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审〔2023〕6-92 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金（以下简称中证科创创业 50 基金）财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日的利润表、净资产（基金净值）变动表，以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中证科创创业 50 基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况，以及 2022 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日的经营成果和净资产（基金净值）变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中证科创创业 50 基金及其管理人华富基金管理有限公司（以下简称基金管理人），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>基金管理人管理层（以下简称管理层）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	3,756,359.35
结算备付金		602,587.98
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	58,338,003.48
其中：股票投资		58,338,003.48
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		349,106.16
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		63,046,056.97
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		842,141.29
应付管理人报酬		53,146.10
应付托管费		5,314.60
应付销售服务费		9,882.97
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-

递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	140,000.00
负债合计		1,050,484.96
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	64,774,128.90
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.8	-2,778,556.89
净资产合计		61,995,572.01
负债和净资产总计		63,046,056.97

注：本基金合同于 2022 年 8 月 31 日生效，无上年度可比期间。报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 64,774,128.90 份，其中华富中证科创创业 50 指数增强 A 基金份额总额 35,032,870.59 份，基金份额净值 0.9577 元；华富中证科创创业 50 指数增强 C 基金份额总额 29,741,258.31 份，基金份额净值 0.9564 元。

7.2 利润表

会计主体：华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 8 月 31 日（基金合同 生效日）至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-1,998,464.98
1. 利息收入		165,693.79
其中：存款利息收入	7.4.7.9	45,982.91
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		119,710.88
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,859,417.07
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,861,649.68
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	2,232.61
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-358,649.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	53,907.85
减：二、营业总支出		543,699.07
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	304,058.30
2. 托管费	7.4.10.2.2	30,405.79
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	68,034.98
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.19	141,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,542,164.05
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,542,164.05
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-2,542,164.05

注：本基金合同于 2022 年 8 月 31 日生效，无上年度可比期间。报表附注为财务报表的组成部分。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错	-	-	-	-

更正				
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	246,457,010.15	-	-	246,457,010.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-181,682,881.25	-	-2,778,556.89	-184,461,438.14
（一）、综合收益总额	-	-	-2,542,164.05	-2,542,164.05
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-181,682,881.25	-	-236,392.84	-181,919,274.09
其中： 1. 基金申购款	32,080,450.64	-	-212,438.47	31,868,012.17
2. 基金赎回款	-213,763,331.89	-	-23,954.37	-213,787,286.26
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值	-	-	-	-

减少以 “-”号 填列)				
(四)、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本 期期末 净资产 (基金 净值)	64,774,128.90	-	-2,778,556.89	61,995,572.01

注：本基金合同于 2022 年 8 月 31 日生效，无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

赵万里

曹华玮

邵恒

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）（证监基金字【2022】122 号）核准，基金合同于 2022 年 8 月 31 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具《验资报告》（天健正信验（2022）6-61 号）。有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资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。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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期会计报表的实际编制期间为 2022 年 8 月 31 日（合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金目前暂无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金持有的其他金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和以摊余成本计量的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。在考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息的基础上，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失，应当分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，按照未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。本基金确定金融工具在估值日只具有较低的信用风险的，可以假设该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加（即处于第一阶段）。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：

（1）收取金融资产现金流量的合同权利终止；（2）金融资产已转移，且已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；（3）金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对金融资产的控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

（1） 估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使

用的输入值分以下层级，并依次使用：

- 1) 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 2) 第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；
- 3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据做出的财务预测等。

(2) 估值方法及关键假设

1) 根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告〔2017〕13号）规定，在下列情况下本基金采用的估值方法及关键假设如下：

① 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。

② 对不存在活跃市场的投资品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

③ 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，对估值进行调整并确定公允价值。

2) 对于发行时明确一定期限限售期的股票（包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），根据中国证券投资基金业协会《关于发布《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的通知》（中基协发〔2017〕6号），估值处理如下：

① 流通受限股票按以下公式确定估值日该流通受限股票的价值： $FV=S \times (1-LoMD)$

其中：FV：估值日该流通受限股票的价值；S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值；LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣。

② 引入看跌期权计算该流通受限股票对应的流动性折扣。 $LoMD=P/S$ ，P 是估值日看跌期权的价值。

③ 证券投资基金持有的流通受限股票在估值日按平均价格亚式期权模型确定估值日看跌期权的价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认；
卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后最后一位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式及红利再投资形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

7.4.4.12 分部报告

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1号）、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2012〕85号）、《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》（财税〔2014〕81号）、《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》（财税〔2016〕127号）、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2015〕101号）、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36号）、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》（财税〔2016〕46号）、《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税〔2016〕140号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号）、《关于金

融机构同业往来等增值税补充政策的通知》（财税〔2016〕70号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税〔2017〕90号）及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（一）自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征税率缴纳增值税。

（二）对基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收企业所得税；

（三）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

（四）对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

主要税种及税率列示如下：

税种	计税依据	税率
增值税	以按税法规定计算的金融服务销售额	3%
城市维护建设税	实际缴纳的流转税税额	7%
教育费附加	实际缴纳的流转税税额	3%
地方教育附加	实际缴纳的流转税税额	2%

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	3,756,359.35
等于：本金	3,755,927.71
加：应计利息	431.64
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—

其中：存款期限 1 个月以内	
存款期限 1-3 个月	
存款期限 3 个月以上	
其他存款	
等于：本金	
加：应计利息	
减：坏账准备	
合计	3,756,359.35

注：“其他存款”所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	58,696,653.03	-	58,338,003.48	-358,649.55
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	58,696,653.03	-	58,338,003.48	-358,649.55

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本期末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本期末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	20,000.00
应付信息披露费	120,000.00
合计	140,000.00

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华富中证科创创业 50 指数增强 A

项目	本期 2022 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	52,172,660.05	52,172,660.05
本期申购	6,700,620.14	6,700,620.14
本期赎回（以“-”号填列）	-23,840,409.60	-23,840,409.60
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	35,032,870.59	35,032,870.59

华富中证科创创业 50 指数增强 C

项目	本期 2022 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	194,284,350.10	194,284,350.10
本期申购	25,379,830.50	25,379,830.50
本期赎回（以“-”号填列）	-189,922,922.29	-189,922,922.29
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	29,741,258.31	29,741,258.31

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华富中证科创创业 50 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-1,071,388.82	-224,798.32	-1,296,187.14
本期基金份额交易产生的变动数	75,013.09	-260,979.85	-185,966.76
其中：基金申购款	-44,292.18	-55,878.40	-100,170.58
基金赎回款	119,305.27	-205,101.45	-85,796.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-996,375.73	-485,778.17	-1,482,153.90

华富中证科创创业 50 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-1,112,125.68	-133,851.23	-1,245,976.91
本期基金份额交易产生的变动数	227,700.73	-278,126.81	-50,426.08
其中：基金申购款	-289,877.95	177,610.06	-112,267.89
基金赎回款	517,578.68	-455,736.87	61,841.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-884,424.95	-411,978.04	-1,296,402.99

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年8月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	14,045.86
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	31,937.05
其他	-
合计	45,982.91

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年8月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,861,649.68
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-

股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,861,649.68

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	47,156,691.71
减：卖出股票成本总额	48,829,308.35
减：交易费用	189,033.04
买卖股票差价收入	-1,861,649.68

7.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,232.61
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,232.61

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-358,649.55
股票投资	-358,649.55
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-358,649.55

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2022

	年 12 月 31 日
基金赎回费收入	53,893.18
基金转换费收入	14.67
合计	53,907.85

7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	20,000.00
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	-
其他	1,200.00
合计	141,200.00

注：其他为证券账户开户费。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告批准报出日，无重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
安徽省信用融资担保集团有限公司	基金管理人的股东
合肥兴泰金融控股（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

基金合同于 2022 年 8 月 31 日生效，无上年度可比期间。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	304,058.30
其中：支付销售机构的客户维护费	129,069.70

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	30,405.79

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
华富基金管理有限公司		6,603.40	6,603.40

华安证券股份有限公司		45.21	45.21
平安银行股份有限公司	-	13,447.11	13,447.11
合计	-	20,095.72	20,095.72

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。计算公式 $H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$ （H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费，E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值）。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本报告期内本基金管理人没有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本报告期内本基金管理人没有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期内和上年度可比期基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	3,756,359.35	14,045.86

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内未参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无银行间债券正回购余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不

超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的债券

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,756,359.35	-	-	-	-	-	3,756,359.35
结算备付金	602,587.98	-	-	-	-	-	602,587.98
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	58,338,003.48	58,338,003.48
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	349,106.16	349,106.16
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,358,947.33	-	-	-	-	58,687,109.64	63,046,056.97
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	842,141.29	842,141.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	53,146.10	53,146.10
应付托管费	-	-	-	-	-	5,314.60	5,314.60
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,882.97	9,882.97
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	140,000.00	140,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,050,484.96	1,050,484.96
利率敏感度缺口	4,358,947.33	-	-	-	-	-57,636,624.68	61,995,572.01

注：本表各期限按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早作为期限分类标准。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2021 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2021 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	58,338,003.48	94.10
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	58,338,003.48	94.10

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2022 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 百分之五	-465,968.06
	沪深 300 指数下降 百分之五	465,968.06

注：本期及上期末股票类权益资产占基金资产净值的比例为 94.1%，因此若除利率和汇率外的其他市场因素变化导致本基金持有的权益性工具的公允价值变动 5%而其他市场变量保持不变，则

本基金资产净值不会发生重大变动。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间（95%）	
	2. 观察期（1 年）	
	-	
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2022 年 12 月 31 日）
	合计	25,901,474.55

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	58,338,003.48
第二层次	-
第三层次	-
合计	58,338,003.48

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金本报告期无第三层次公允价值余额及变动

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	58,338,003.48	92.53
	其中：股票	58,338,003.48	92.53
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	4,358,947.33	6.91
8	其他各项资产	349,106.16	0.55
9	合计	63,046,056.97	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 8.11.3 其他各项资产构成。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	46,187,342.21	74.50
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	4,905,397.58	7.91
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	2,324,800.00	3.75
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	53,417,539.79	86.16

8.2.2 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	4,634,298.69	7.48
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	286,165.00	0.46

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	4,920,463.69	7.94

8.2.3 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	300760	迈瑞医疗	14,900	4,707,953.00	7.59
2	300750	宁德时代	11,600	4,563,672.00	7.36
3	300274	阳光电源	38,000	4,248,400.00	6.85
4	300124	汇川技术	55,200	3,836,400.00	6.19
5	688981	中芯国际	66,100	2,719,354.00	4.39
6	300014	亿纬锂能	30,000	2,637,000.00	4.25
7	688599	天合光能	41,200	2,626,912.00	4.24
8	300142	沃森生物	52,000	2,089,880.00	3.37
9	300122	智飞生物	22,000	1,932,260.00	3.12
10	300759	康龙化成	23,400	1,591,200.00	2.57
11	688111	金山办公	6,000	1,586,940.00	2.56
12	300450	先导智能	37,200	1,497,300.00	2.42
13	688396	华润微	27,000	1,421,550.00	2.29
14	688012	中微公司	14,300	1,401,543.00	2.26
15	300661	圣邦股份	7,300	1,259,980.00	2.03
16	300454	深信服	9,200	1,035,460.00	1.67
17	688180	君实生物	15,846	991,959.60	1.60
18	300782	卓胜微	8,200	937,260.00	1.51
19	688008	澜起科技	14,600	913,960.00	1.47

20	300628	亿联网络	15,000	908,850.00	1.47
21	688777	中控技术	10,000	908,300.00	1.47
22	300496	中科创达	7,900	792,370.00	1.28
23	300763	锦浪科技	4,400	792,220.00	1.28
24	300347	泰格医药	7,000	733,600.00	1.18
25	300751	迈为股份	1,700	700,128.00	1.13
26	300769	德方纳米	3,000	688,770.00	1.11
27	300207	欣旺达	32,000	676,800.00	1.09
28	688348	昱能科技	1,064	604,884.00	0.98
29	300601	康泰生物	18,600	586,458.00	0.95
30	300316	晶盛机电	9,200	584,752.00	0.94
31	688561	奇安信	8,854	582,327.58	0.94
32	688036	传音控股	7,200	572,544.00	0.92
33	688005	容百科技	7,743	532,331.25	0.86
34	300223	北京君正	5,000	352,200.00	0.57
35	688303	大全能源	6,327	301,671.36	0.49
36	688223	晶科能源	20,000	293,000.00	0.47
37	688169	石头科技	1,000	247,750.00	0.40
38	688009	中国通号	36,800	176,272.00	0.28
39	688728	格科微	8,800	154,352.00	0.25
40	300433	蓝思科技	9,200	96,876.00	0.16
41	300919	中伟股份	1,400	91,854.00	0.15
42	688187	时代电气	600	32,742.00	0.05
43	688538	和辉光电	2,800	7,504.00	0.01

8.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	002518	科士达	27,200	1,566,720.00	2.53
2	688390	固德威	1,800	581,562.00	0.94
3	002594	比亚迪	2,177	559,423.69	0.90
4	002709	天赐材料	12,000	526,320.00	0.85
5	300693	盛弘股份	6,000	325,680.00	0.53
6	603688	石英股份	2,000	262,640.00	0.42
7	300253	卫宁健康	25,000	257,000.00	0.41
8	688016	心脉医疗	1,300	245,752.00	0.40
9	301266	宇邦新材	3,000	226,800.00	0.37
10	301308	江波龙	3,000	176,940.00	0.29
11	688558	国盛智科	2,600	91,182.00	0.15
12	300633	开立医疗	1,300	71,279.00	0.11
13	600536	中国软件	500	29,165.00	0.05

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	7,292,703.00	11.76
2	300760	迈瑞医疗	6,270,749.00	10.11
3	300274	阳光电源	5,329,155.00	8.60
4	688599	天合光能	4,164,163.86	6.72
5	300124	汇川技术	3,728,311.00	6.01
6	688981	中芯国际	3,710,764.07	5.99
7	002594	比亚迪	3,622,652.86	5.84
8	300014	亿纬锂能	3,558,305.00	5.74
9	300142	沃森生物	3,259,590.00	5.26
10	300122	智飞生物	2,903,258.00	4.68
11	300661	圣邦股份	2,827,676.00	4.56
12	688111	金山办公	2,645,992.64	4.27
13	300450	先导智能	1,976,785.00	3.19
14	688718	唯赛勃	1,932,609.91	3.12
15	300759	康龙化成	1,918,576.00	3.09
16	688008	澜起科技	1,916,106.96	3.09
17	688348	昱能科技	1,862,794.32	3.00
18	688012	中微公司	1,739,943.26	2.81
19	300751	迈为股份	1,665,755.00	2.69
20	688396	华润微	1,552,496.82	2.50
21	002518	科士达	1,453,558.00	2.34
22	300763	锦浪科技	1,362,324.00	2.20
23	300316	晶盛机电	1,354,411.00	2.18
24	688180	君实生物	1,341,572.83	2.16
25	688005	容百科技	1,331,912.94	2.15

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002594	比亚迪	2,759,851.00	4.45
2	300750	宁德时代	2,576,804.00	4.16
3	688718	唯赛勃	1,966,371.61	3.17
4	300661	圣邦股份	1,912,658.50	3.09
5	300760	迈瑞医疗	1,671,156.00	2.70
6	688599	天合光能	1,416,207.92	2.28

7	688111	金山办公	1,344,779.56	2.17
8	300142	沃森生物	1,271,240.00	2.05
9	688348	昱能科技	1,207,400.00	1.95
10	600690	海尔智家	1,156,979.00	1.87
11	000651	格力电器	1,147,411.00	1.85
12	688008	澜起科技	1,125,192.16	1.81
13	000333	美的集团	1,122,483.00	1.81
14	300274	阳光电源	1,101,361.00	1.78
15	301168	通灵股份	1,008,352.00	1.63
16	688981	中芯国际	972,634.75	1.57
17	300122	智飞生物	912,893.00	1.47
18	300003	乐普医疗	866,572.00	1.40
19	002049	紫光国微	838,660.00	1.35
20	300014	亿纬锂能	828,500.00	1.34

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	107,525,961.38
卖出股票收入（成交）总额	47,156,691.71

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、债转股及行权等获得的股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末无债券投资。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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本期未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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	349,106.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	349,106.16

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 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情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
华富中证科创创业 50 指数增强 A	850	41,215.14	4,056,001.83	11.58	30,976,868.76	88.42
华富中证科创创业 50 指数增强 C	1,696	17,536.12	380,188.10	1.28	29,361,070.21	98.72
合计	2,546	25,441.53	4,436,189.93	6.85	60,337,938.97	93.15

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	华富中证科创创业 50 指数增强 A	191,527.92	0.5467
	华富中证科创创业 50 指数增强 C	350,283.16	1.1778
	合计	541,811.08	0.8365

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华富中证科创创业 50 指数增强 A	0~10
	华富中证科创创业 50 指数增强 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华富中证科创创业 50 指数增强 A	0~10
	华富中证科创创业 50 指数增强 C	0
	合计	0~10

§ 10 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
基金合同生效日 (2022 年 8 月 31 日) 基金份额总额	52,172,660.05	194,284,350.10

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,700,620.14	25,379,830.50
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	23,840,409.60	189,922,922.29
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	35,032,870.59	29,741,258.31

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 2022 年 1 月 20 日，因华富中债-0-5 年中高等级信用债收益平衡指数证券投资基金清盘，张娅女士和郜哲先生不再担任华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
2. 2022 年 3 月 9 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘尤之奇先生为华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金基金经理。
3. 2022 年 3 月 30 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘陈奇先生为华富时代锐选混合型证券投资基金基金经理。
4. 2022 年 4 月 26 日，因华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金清盘，姚姣姣女士不再担任华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
5. 2022 年 6 月 7 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘倪莉莎女士为华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理。
6. 2022 年 6 月 29 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，张娅女士不再担任华富新能源股票型发起式证券投资基金基金经理的职务。
7. 2022 年 6 月 29 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，郜哲先生不再担任华富新能源股票型发起式证券投资基金基金经理的职务。
8. 2022 年 7 月 11 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘姚姣姣女士为华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

9. 2022 年 8 月 19 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘沈成先生为华富科技动能混合型证券投资基金基金经理。
10. 2022 年 8 月 19 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘陈奇先生为华富竞争力优选混合型证券投资基金基金经理。
11. 2022 年 8 月 19 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘王羿伟先生为华富国潮优选混合型发起式证券投资基金基金经理。
12. 2022 年 8 月 19 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜先生不再担任华富科技动能混合型证券投资基金、华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富国潮优选混合型发起式证券投资基金基金经理的职务。
13. 2022 年 8 月 24 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，倪莉莎女士不再担任华富天盈货币市场基金基金经理的职务。
14. 2022 年 8 月 25 日，华富基金管理有限公司第七届董事会第二次会议审议通过，因工作需要，聘任李宏升先生担任公司财务负责人，龚炜先生不再担任公司副总经理。
15. 2022 年 9 月 1 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘李孝华先生为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
16. 2022 年 9 月 1 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，姚姣女士不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
17. 2022 年 9 月 19 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘戴弘毅先生为华富安鑫债券型证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金的基金经理。
18. 2022 年 10 月 14 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘王羿伟先生为华富竞争力优选混合型证券投资基金基金经理。
19. 本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。本基金本年度需支付给审计机构天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计报酬为 2 万元人民币。天健会计师事务所（特殊普通合伙）从 2022 年起为本公司提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
天风证券	2	120,776,738.75	78.08	105,157.75	81.08	-
国联证券	2	33,905,914.34	21.92	24,544.64	18.92	-

注：1)根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的券商租用了基金专用交易单元。

2)此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

3)本报告期本基金所有交易单元均为新增。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)

天风证 券	-	-	1,255,000,00 0.00	100.00	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
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及招募说明书提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 07 月 22 日
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	中国证监会指定披露媒介	2022 年 07 月 22 日
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	中国证监会指定披露媒介	2022 年 07 月 22 日
4	华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会指定披露媒介	2022 年 07 月 22 日
5	华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 07 月 22 日
6	华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要	中国证监会指定披露媒介	2022 年 07 月 25 日
7	华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要	中国证监会指定披露媒介	2022 年 07 月 25 日
8	华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2022 年 09 月 01 日
9	华富基金管理有限公司关于网上直销平台费率优惠的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 09 月 01 日
10	华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 09 月 01 日
11	华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2022 年 09 月 01 日
12	华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 09 月 03 日
13	华富基金管理有限公司关于网上直销平台费率优惠的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 10 月 18 日
14	华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2022 年 11 月 29 日
15	华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会指定披露媒介	2022 年 11 月 29 日

16	华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2022 年 11 月 29 日
----	--	-------------	------------------

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 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 3 月 31 日