

华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资 基金 2023 年中期报告

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

送出日期：2023 年 8 月 30 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。本中期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 8 月 29 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 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	16
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6 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	43

7.7	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.....	43
7.8	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.....	44
7.9	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.....	44
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	44
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12	投资组合报告附注.....	44
§ 8	基金份额持有人信息.....	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.3	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.....	46
§ 9	开放式基金份额变动.....	46
§ 10	重大事件揭示.....	46
10.1	基金份额持有人大会决议.....	46
10.2	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.....	47
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4	基金投资策略的改变.....	47
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8	其他重大事件.....	48
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	48
11.1	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.....	48
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	49
§ 12	备查文件目录.....	49
12.1	备查文件目录.....	49
12.2	存放地点.....	49
12.3	查阅方式.....	49

§ 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	58,656,204.73 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	29,231,869.95 份	29,424,334.78 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>
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>

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	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码		200120	518001
法定代表人		赵万利	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 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	701,090.26	672,943.25
本期利润	-882,854.17	-1,604,244.14
加权平均基金份额本期利润	-0.0356	-0.0569

本期加权平均净值利润率	-3.74%	-6.01%
本期基金份额净值增长率	-7.48%	-7.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	-3,330,484.30	-3,439,442.84
期末可供分配基金份额利润	-0.1139	-0.1169
期末基金资产净值	25,901,385.65	25,984,891.94
期末基金份额净值	0.8861	0.8831
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-11.39%	-11.69%

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
过去一个月	-0.92%	1.17%	-1.14%	1.22%	0.22%	-0.05%
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%
自基金合同生效起	-11.39%	0.89%	-11.72%	1.18%	0.33%	-0.29%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

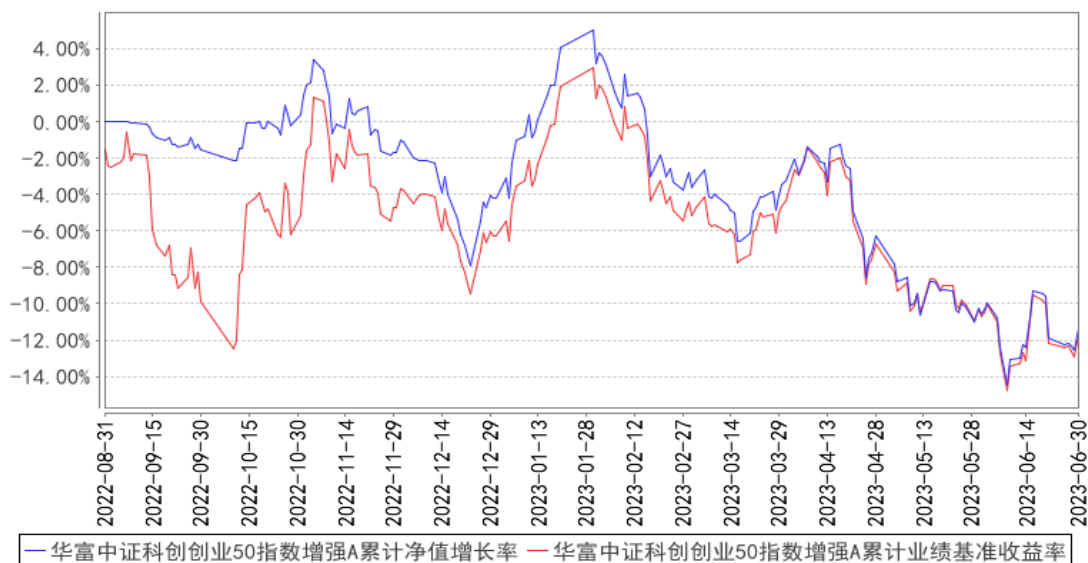
华富中证科创创业 50 指数增强 C

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
过去一个月	-0.95%	1.17%	-1.14%	1.22%	0.19%	-0.05%
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%
自基金合同生效起至今	-11.69%	0.89%	-11.72%	1.18%	0.03%	-0.29%

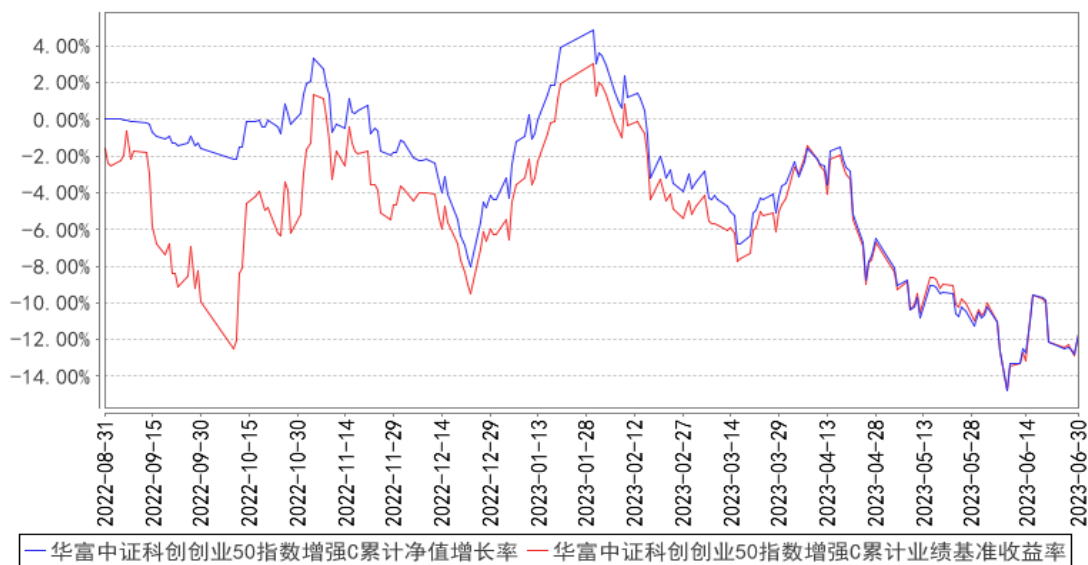
注：业绩比较基准收益率=中证科创创业 50 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

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。本基金的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，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 2023 年 6 月 30 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、华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富时代锐选混合型证券投资基金、华富匠心领航 18 个月持有期混合型证券投资基金、华富数字经济混合型证券投资基金共六十只基金。

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	2022 年	-	十八年	美国肯特州立大学金融工程硕士，硕士研

	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	8 月 31 日			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。
李孝	本基金基	2023 年	-	十年	南开大学金融学硕士、硕士研究生学历。

华	金经理	2 月 9 日			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，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 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 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

2023 年上半年市场波动较大，前半年在疫情管控政策放开，且政府配合一定力度的宽信用政策的情况下，风险偏好抬升，且 ChatGPT 打开了人工智能行业的巨大盈利空间，人工智能和中特估是市场上最显著的主线行业，而在二季度，随着经济内生动能较弱逐渐被市场定价，人工智能板块作为市场较稀缺的高确定性的机会，短期上涨过快后进入调整期，市场风险偏好明显降低，各板块进入回调和震荡期。

上半年科技行业表现差异较大，人工智能技术革新后，TMT 成为科技行业中的领涨板块，而新能源行业的出清仍在延续，整体以下跌为主，期间随着总量经济的波动时有反弹，而医药行业有一定分化，CXO、生物疫苗疫后整体需求放缓，医疗器械和创新药随总量经济的悲观预期持续下跌，中药在中特估行情的催化下表现较好。

本基金在上半年的运作中，在一季度前期主要通过对接总量经济关联性较大的新能源车、医疗、信创等行业进行超配，并于 3 月中旬对存在技术重大突破的人工智能相关子行业进行超配；二季度中，进一步对 AI 细化板块进行超配，五月起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，调整行业分布使之更为贴合指数。

在量化选股方面，采取分而治之的方式，对每个行业采取不同的选股策略。对于尚未出清的新能源行业，主要选取竞争格局相对较优的公司，以及估值较低的公司进行增强；医药行业中主要选取新冠研发占比较低，以及低估的公司；TMT 行业则优选盈利预期上调较多的公司。

4.4.2 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-7.48%，同期业绩比较基准收益率为-5.80%。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-7.66%，同期业绩比较基准收益率为-5.80%。

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 2023 年下半年，当前科创创业 50 指数中的几个重点子行业有较好的低位布局的机会：

1. TMT：受益于信创和 AI 新技术突破，计算机、传媒、通信的 2023 盈利预期增速均大幅提升，且随着产业进展，盈利预期上调仍在持续，当前人工智能应用端的产业落地仍处于初始阶段，下半年随着国内大模型商用的持续发展，行业盈利预期将大概率延续。

2. 半导体：当前行业周期接近触底已经基本成为市场共识，全球半导体销售额数据来看，已处于 08 年金融危机时的历史低位，且当前销售已经开始有触底回升的迹象。需求的恢复一方面来自于 AI 算力需求，当前 AI 相关订单以及制造厂商的资本支出不断扩大，另一方面，中美两国经济预期相对上半年均有不少改善，国内稳增长政策持续出台，海外居民消费能力仍有韧性。

3. 新能源车、光伏：新能源车当前从基本面角度和筹码角度来看，出清更为彻底，度过了戴维斯双杀阶段后，后续业绩将大概率跟随经济逐渐改善。光伏产业当前从交易角度看，也已临近出清，同时，电池片新技术迭代更新也将对业绩有催化作用。

4. 医药：当前医药行业反腐会规范行业发展，激发行业创新活力，而科创创业 50 指数中的医药公司主要为 CXO 和疫苗，销售费用占比较低，此次反腐政策出台后为相关公司带来“黄金坑”的布局机会。

在这一背景下，我们在下半年将继续利用主动量化体系从行业优选和个股优选上对指数进行增强。

行业层面，我们将对盈利预期持续向好的 AI+ 方向，以及周期触底回升的半导体予以配置。而对新能源、医药，则在有较为确定的行业利好时再在行业层面超配。

选股层面，对于 AI+ 方向，我们更注重盈利预期的兑现，优选盈利预期调升且估值合理的公司，医药则逢低优选被错杀的研发能力较强的公司，新能源中则优选壁垒较高，估值较低的公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、督察长、副总经理、基金运营部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或

有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《公开募集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，报告期内未进行利润分配，本期利润为-2,487,098.31 元，期末可供分配的利润-6,769,927.14 元。滚存至下一期进行分配。

4.8 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

从 2023 年 02 月 06 日起至 2023 年 03 月 14 日，本基金基金资产净值存在连续或二十个工作日低于 5000 万元的情形，从 2023 年 03 月 15 日至 2023 年 04 月 28 日，本基金基金资产净值已不存在低于 5000 万元的情形。

从 2023 年 05 月 04 日起至 2023 年 06 月 13 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 14 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 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 托管人对本中期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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,859,817.48	3,756,359.35
结算备付金		507,432.80	602,587.98
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	48,546,549.26	58,338,003.48
其中：股票投资		48,546,549.26	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		115,074.05	349,106.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		52,028,873.59	63,046,056.97
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		39,871.24	842,141.29
应付管理人报酬		40,203.96	53,146.10
应付托管费		4,020.39	5,314.60
应付销售服务费		8,469.64	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	6.4.7.6	50,030.77	140,000.00
负债合计		142,596.00	1,050,484.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	58,656,204.73	64,774,128.90

其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-6,769,927.14	-2,778,556.89
净资产合计		51,886,277.59	61,995,572.01
负债和净资产总计		52,028,873.59	63,046,056.97

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 58,656,204.73 份，其中华富中证科创创业 50 指数增强 A 基金份额总额 29,231,869.95 份，基金份额净值 0.8861 元；华富中证科创创业 50 指数增强 C 基金份额总额 29,424,334.78 份，基金份额净值 0.8831 元。

6.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,107,467.21
1. 利息收入		6,111.43
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,111.43
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,743,297.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,515,528.46
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	227,769.39
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）	6.4.7.16	-3,861,131.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,255.33
减：二、营业总支出		379,631.10
1. 管理人报酬		251,627.26

2. 托管费		25,162.71
3. 销售服务费		53,252.56
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	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.19	49,588.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,487,098.31
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,487,098.31
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-2,487,098.31

注：本基金合同于 2022 年 8 月 31 日生效，无上年度可比期间。

6.3 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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）	64,774,128.90	-	-2,778,556.89	61,995,572.01
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）	64,774,128.90	-	-2,778,556.89	61,995,572.01
三、本	-6,117,924.17	-	-3,991,370.25	-10,109,294.42

期增减变动额 (减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-2,487,098.31	-2,487,098.31
(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)	-6,117,924.17	-	-1,504,271.94	-7,622,196.11
其中:				
1. 基金申购款	42,540,950.52	-	-1,912,990.02	40,627,960.50
2. 基金赎回款	-48,658,874.69	-	408,718.08	-48,250,156.61
(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）	58,656,204.73	-	-6,769,927.14	51,886,277.59
-----------------	---------------	---	---------------	---------------

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 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>赵万里</u>	<u>曹华玮</u>	<u>邵恒</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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）（证监许可【2022】1302 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。

6.4.2 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。

6.4.3 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、经营成果和净资产变动等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无重大变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 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%的征收率缴纳增值税。

（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。

(五) 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%

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	2,859,817.48
等于: 本金	2,859,552.33
加: 应计利息	265.15
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	2,859,817.48

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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	52,766,330.63	-	48,546,549.26	-4,219,781.37
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	52,766,330.63	-	48,546,549.26	-4,219,781.37

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 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	9,916.99
其他	442.20
应付信息披露费	39,671.58
合计	50,030.77

6.4.7.7 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,032,870.59	35,032,870.59
本期申购	9,740,172.56	9,740,172.56
本期赎回（以“-”号填列）	-15,541,173.20	-15,541,173.20
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	29,231,869.95	29,231,869.95

华富中证科创创业 50 指数增强 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,741,258.31	29,741,258.31
本期申购	32,800,777.96	32,800,777.96
本期赎回（以“-”号填列）	-33,117,701.49	-33,117,701.49
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	29,424,334.78	29,424,334.78

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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
上年度末	-96,375.73	-485,778.17	-1,482,153.90
本期利润	701,090.26	-1,583,944.43	-882,854.17
本期基金份额交易产	253,970.75	-1,219,446.98	-965,476.23

生的变动数			
其中：基金申购款	9,909.42	-971,922.03	-962,012.61
基金赎回款	244,061.33	-247,524.95	-3,463.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-41,314.72	-3,289,169.58	-3,330,484.30

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
上年度末	-884,424.95	-411,978.04	-1,296,402.99
本期利润	672,943.25	-2,277,187.39	-1,604,244.14
本期基金份额交易产生的变动数	74,551.38	-613,347.09	-538,795.71
其中：基金申购款	-232,860.96	-718,116.45	-950,977.41
基金赎回款	307,412.34	104,769.36	412,181.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-136,930.32	-3,302,512.52	-3,439,442.84

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	5,329.06
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	782.37
其他	-
合计	6,111.43

注：“其他存款利息收入”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利息收入。“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,515,528.46
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	1,515,528.46

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	58,917,972.98
减：卖出股票成本总额	57,249,220.69
减：交易费用	153,223.83
买卖股票差价收入	1,515,528.46

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	227,769.39
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	227,769.39

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,861,131.82
股票投资	-3,861,131.82
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	-3,861,131.82

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,810.48
基金转换费收入	2,444.85
合计	4,255.33

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

审计费用	9,916.99
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
合计	49,588.57

6.4.7.20 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金合同于 2022 年 8 月 31 日生效，无上年度可比期间。本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	251,627.26
其中：支付销售机构的客户维护费	102,785.46

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）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	25,162.71

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）。

6.4.10.2.3 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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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		8,212.50	8,212.50
平安银行股份有限公司		6,918.87	6,918.87
华安证券		9.36	9.36
合计	-	15,140.73	15,140.73

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）。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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：本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 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：本基金本报告期无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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30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
基金合同生效日（2022年8月31日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	6,923,340.40	7,424,845.77
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	6,923,340.40	7,424,845.77
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.8000%	12.6600%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求，申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额。

6.4.10.5.2 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：本基金本报告期和上年度可比期间基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

6.4.10.6 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
	2023年1月1日至2023年6月30日

	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	2,859,817.48	5,329.06

注：本表仅列示活期存款余额及产生的利息收入。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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同责任，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。

6.4.13.2.1 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

6.4.13.2.2 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投资

6.4.13.2.3 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

6.4.13.2.4 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

6.4.13.2.5 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。

6.4.13.2.6 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。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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 6.4.12 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30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	2,859,817.48	-	-	-	-	-	2,859,817.48
结算备付金	507,432.80	-	-	-	-	-	507,432.80
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	48,546,549.26	48,546,549.26
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	-	-	-	-	-	115,074.05	115,074.05
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,367,250.28	-	-	-	-	48,661,623.31	52,028,873.59
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	39,871.24	39,871.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	40,203.96	40,203.96
应付托管费	-	-	-	-	-	4,020.39	4,020.39
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,469.64	8,469.64
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	50,030.77	50,030.77
负债总计	-	-	-	-	-	142,596.00	142,596.00
利率敏感度缺口	3,367,250.28	-	-	-	-	-48,519,027.31	51,886,277.59
上年度末 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：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：未持有债券类资产，因此若除利率外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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	48,546,549.26	93.56	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	48,546,549.26	93.56	58,338,003.48	94.10

6.4.13.4.3.2 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 (2023年6月30日)	上年度末 (2022年12月31日)	
分析	业绩比较基准上升 百分之五	2,524,866.08	-465,968.06
	业绩比较基准下降 百分之五	-2,524,866.08	465,968.06

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

1. 置信区间(95%)

假设	2. 观察期(1 年)		
	-		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	合计	10,054,732.43	25,901,474.55

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	48,546,549.26	58,338,003.48
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	48,546,549.26	58,338,003.48

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	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	其他各项资产	115,074.05	0.22
9	合计	52,028,873.59	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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

7.2.2 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

7.2.3 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。

7.3 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

7.3.1 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	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
11	688036	传音控股	8,300	1,220,100.00	2.35
12	300782	卓胜微	11,600	1,120,908.00	2.16
13	300316	晶盛机电	15,200	1,077,680.00	2.08
14	300450	先导智能	27,000	976,590.00	1.88
15	300142	沃森生物	36,000	952,200.00	1.84
16	688396	华润微	18,100	948,621.00	1.83
17	300122	智飞生物	21,000	928,200.00	1.79
18	300347	泰格医药	13,200	851,928.00	1.64
19	688777	中控技术	11,310	710,041.80	1.37
20	300408	三环集团	23,900	701,465.00	1.35
21	688223	晶科能源	43,300	608,798.00	1.17
22	688041	海光信息	8,900	607,603.00	1.17
23	300454	深信服	5,300	600,225.00	1.16
24	300661	圣邦股份	7,280	597,906.40	1.15
25	300751	迈为股份	3,500	592,830.00	1.14
26	688005	容百科技	10,543	569,532.86	1.10
27	300759	康龙化成	14,300	547,404.00	1.06
28	300763	锦浪科技	4,900	510,090.00	0.98
29	688126	沪硅产业	23,100	482,790.00	0.93
30	300433	蓝思科技	36,700	431,592.00	0.83
31	300496	中科创达	4,200	404,670.00	0.78
32	688114	华大智造	4,600	398,176.00	0.77
33	688009	中国通号	66,100	383,380.00	0.74
34	301269	华大九天	2,800	343,952.00	0.66
35	688561	奇安信	6,400	331,584.00	0.64

36	300207	欣旺达	20,000	326,400.00	0.63
37	688303	大全能源	7,900	319,555.00	0.62
38	688271	联影医疗	2,200	303,622.00	0.59
39	300223	北京君正	3,400	300,254.00	0.58
40	688349	三一重能	9,000	289,980.00	0.56
41	300919	中伟股份	4,800	289,200.00	0.56
42	300769	德方纳米	2,300	253,529.00	0.49
43	300628	亿联网络	6,720	235,670.40	0.45
44	688180	君实生物	5,646	217,596.84	0.42
45	688348	昱能科技	1,120	210,369.60	0.41
46	688187	时代电气	3,500	146,510.00	0.28
47	688728	格科微	8,800	139,216.00	0.27
48	688065	凯赛生物	2,000	124,520.00	0.24

7.3.2 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	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
6	300118	东方日升	8,900	228,107.00	0.44
7	603688	石英股份	2,000	227,680.00	0.44
8	002709	天赐材料	5,000	205,950.00	0.40
9	600085	同仁堂	3,000	172,680.00	0.33
10	603986	兆易创新	1,600	170,000.00	0.33
11	603444	吉比特	300	147,333.00	0.28
12	688363	华熙生物	1,500	133,740.00	0.26
13	002371	北方华创	400	127,060.00	0.24
14	002459	晶澳科技	3,040	126,768.00	0.24
15	688390	固德威	700	116,802.00	0.23
16	300567	精测电子	1,200	114,180.00	0.22
17	605117	德业股份	720	107,676.00	0.21
18	688037	芯源微	592	101,202.40	0.20
19	002230	科大讯飞	1,400	95,144.00	0.18
20	002850	科达利	700	92,575.00	0.18
21	600129	太极集团	1,500	89,235.00	0.17
22	600750	江中药业	4,000	87,720.00	0.17
23	002594	比亚迪	300	77,481.00	0.15
24	002466	天齐锂业	1,000	69,910.00	0.13
25	603596	伯特利	800	63,408.00	0.12
26	002368	太极股份	1,500	61,755.00	0.12

27	002050	三花智控	2,000	60,520.00	0.12
28	002837	英维克	2,000	59,880.00	0.12
29	603501	韦尔股份	500	49,020.00	0.09
30	002439	启明星辰	1,000	29,760.00	0.06
31	600089	特变电工	1,000	22,290.00	0.04
32	300418	昆仑万维	500	20,140.00	0.04
33	002555	三七互娱	500	17,440.00	0.03
34	688538	和辉光电	3,300	8,382.00	0.02

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	3,491,246.00	5.63
2	688111	金山办公	2,478,140.48	4.00
3	300274	阳光电源	2,061,848.00	3.33
4	300760	迈瑞医疗	1,985,934.00	3.20
5	688981	中芯国际	1,931,416.36	3.12
6	300347	泰格医药	1,893,376.00	3.05
7	601872	招商轮船	1,844,220.00	2.97
8	300124	汇川技术	1,610,471.00	2.60
9	688012	中微公司	1,516,227.95	2.45
10	300408	三环集团	1,382,161.00	2.23
11	688008	澜起科技	1,167,977.64	1.88
12	688599	天合光能	1,040,121.16	1.68
13	688036	传音控股	1,016,103.00	1.64
14	688271	联影医疗	929,897.12	1.50
15	300782	卓胜微	857,971.00	1.38
16	002371	北方华创	840,170.00	1.36
17	688126	沪硅产业	814,642.70	1.31
18	688041	海光信息	803,533.00	1.30
19	300014	亿纬锂能	684,583.00	1.10
20	600489	中金黄金	637,584.00	1.03

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300274	阳光电源	3,902,011.00	6.29
2	300760	迈瑞医疗	3,729,596.00	6.02

3	300750	宁德时代	3,579,806.00	5.77
4	688111	金山办公	2,786,366.29	4.49
5	300124	汇川技术	2,729,524.00	4.40
6	688981	中芯国际	2,426,627.34	3.91
7	688599	天合光能	1,962,099.36	3.16
8	601872	招商轮船	1,755,639.00	2.83
9	002518	科士达	1,699,241.00	2.74
10	688012	中微公司	1,524,162.38	2.46
11	300759	康龙化成	1,408,029.00	2.27
12	300347	泰格医药	1,322,973.70	2.13
13	300454	深信服	1,087,365.00	1.75
14	300450	先导智能	1,065,049.00	1.72
15	300014	亿纬锂能	995,082.00	1.61
16	300122	智飞生物	979,878.00	1.58
17	300142	沃森生物	969,178.00	1.56
18	688396	华润微	954,416.86	1.54
19	300769	德方纳米	883,414.00	1.42
20	688561	奇安信	764,115.00	1.23

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。

7.4.3 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	51,318,898.29
卖出股票收入（成交）总额	58,917,972.98

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、配股、债转股及行权等获得的股票。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	115,074.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	115,074.05

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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	790	37,002.37	6,923,340.40	23.68	22,308,529.55	76.32
华富中证科创创业 50 指数增强 C	2,357	12,483.81	7,805,033.87	26.53	21,619,300.91	73.47
合计	3,147	18,638.77	14,728,374.27	25.11	43,927,830.46	74.89

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自份额级别的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.2 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	248,733.62	0.8509
	华富中证科创创业 50 指数增强 C	363,330.52	1.2348
	合计	612,064.14	1.0435

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.3 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、	华富中证科创创业 50 指数增	0~10

基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	强 A	
	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

§ 9 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
本报告期期初基金份额总额	35,032,870.59	29,741,258.31
本报告期基金总申购份额	9,740,172.56	32,800,777.96
减：本报告期基金总赎回份额	15,541,173.20	33,117,701.49
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	29,231,869.95	29,424,334.78

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 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. 本基金本报告期内基金管理人无重大人事变动。
2. 本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，管理人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 (%)	
国联证券	2	65,066,806.01	59.02	47,744.53	55.76	-
天风证券	2	45,170,065.26	40.98	37,884.38	44.24	-

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) 本报告期本基金交易单元没有发生变化。

10.7.2 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(%)
国联证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 1 月 20 日
2	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	2023 年 2 月 10 日
3	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	2023 年 2 月 10 日
4	华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 2 月 10 日
5	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	2023 年 2 月 10 日
6	华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金 2022 年度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
7	华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 21 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	1	2023. 3. 15-2023. 6. 30	0.00	14,348,186.17	0.00	14,348,186.17	24.4600
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 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 8 月 30 日