

# 华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金

## 金

### 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 07 月 01 日起至 2021 年 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 华富智慧城市灵活配置混合   |
| 基金主代码      | 000757   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2014 年 10 月 31 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 32,079,268.11 份  |
| 投资目标       | 本基金通过深入研究并积极投资与智慧城市相关的优质上市公司，分享其发展和成长的机会，力求获取超额收益与长期资本增值。  |
| 投资策略       | 本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济、证券市场以及智慧城市相关行业的发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。 |
| 业绩比较基准     | 沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%   |
| 风险收益特征     | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。   |
| 基金管理人      | 华富基金管理有限公司   |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司   |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 5,421,504.99                        |
| 2. 本期利润         | 3,010,304.87                        |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0898                              |
| 4. 期末基金资产净值     | 54,515,475.32                       |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.699                               |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③     | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | 4.68%      | 1.86%         | -2.47%         | 0.60%                 | 7.15%   | 1.26% |
| 过去六个月          | 26.04%     | 1.65%         | -0.07%         | 0.55%                 | 26.11%  | 1.10% |
| 过去一年           | 31.91%     | 1.75%         | 6.30%          | 0.61%                 | 25.61%  | 1.14% |
| 过去三年           | 133.70%    | 1.79%         | 30.36%         | 0.67%                 | 103.34% | 1.12% |
| 过去五年           | 64.00%     | 1.60%         | 37.08%         | 0.59%                 | 26.92%  | 1.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 87.39%     | 1.97%         | 73.16%         | 0.75%                 | 14.23%  | 1.22% |

注：本基金业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率\*50%+中证全债指数收益率\*50%。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华富智慧城市灵活配置混合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《华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%，投资于本合同界定的智慧城市相关证券不低于非现金基金资产的 80%；其余资产投资于债券、权证、货币市场工具、资产支持证券等金融工具；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金建仓期为 2014 年 10 月 31 日到 2015 年 4 月 31 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《华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                                   | 任本基金的基金经理期限    |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|--------------------------------------|----------------|------|--------|---|
|     |                                      | 任职日期           | 离任日期 |        |   |
| 高靖瑜 | 华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富健康文娱灵活配置混合型基金基 | 2017 年 5 月 9 日 | -    | 二十一年   | 复旦大学金融学硕士，本科学历。历任金鼎综合证券（维京）股份有限公司上海代表处研究员、上海天相投资咨询有限公司研究员，2007 年 7 月加入华富基金管理有限公司，任行业研究员，2013 年 3 月 1 日至 2014 年 12 月 14 日任华富价值增长混合型基金基金经理助理，2014 年 12 月 15 日至 2016 年 1 月 12 日任华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理，2017 |

|  |   |  |  |  |   |
|--|---|--|--|--|---|
|  | 金经理、<br>华富策略<br>精选灵活<br>配置混合<br>型基金基<br>金经理 |  |  |  | 年 9 月 12 日至 2019 年 7 月 17 日任华富中证 100 指数基金基金经理，2017 年 9 月 12 日至 2019 年 7 月 17 日任华富中小板指数增强基金基金经理。 |
|--|---|--|--|--|---|

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年三季度，在工业品通胀、能耗双控、局部疫情反复等因素影响下国内经济明显走弱。

9 月 PMI 总体下降，制造业 PMI 仍在荣枯线以下，显示出原材料价格高企对于下游企业景气度的压制，但 9 月 BCI 与 PMI 出现了背离，BCI 企业销售前瞻和利润前瞻指数分别较上月上升 5 和 7.7 个百分点至 74.7 和 55.7，显示新兴成长行业相对景气度仍在。通胀持续分化，工业品通胀高企而生活资料价格低迷，8 月 PPI 同比涨幅达 9.5%，略超预期，煤炭、黑色金属、有色、化工、化纤涨幅显著，8 月 CPI 同比涨幅重新回到 1%以内；环比涨幅也只有 0.1%，低于 7 月，非食品 and 核心 CPI 同样疲弱。融资环境方面，地产需求走弱和地方调控政策升温对居民部门贷款形成抑制，原材料价格高企且基建支撑暂不明显导致企业融资需求亦疲软，8 月社融数据新增社融 2.96 万亿元，环比未有明显超季节性，存量社融增速下降 0.4 个点至 10.3%。

海外宏观主线主要在美国联储政策、疫苗和中美关系三个方面。中美关系方面，两国元首在 9.10 的电话会晤、孟晚舟回国、美国 USTR 贸易代表发表“中美贸易关系的新方法”等事件，表明中美关系长期竞争环境下短期阶段性好转。疫情方面，三季度海外疫情因 delta 变异毒株而一度升级，近期逐渐好转，随着默沙东与 Ridgeback 宣布新冠口服药物 Molnupiravir 的临床数据取得突破，未来疫情控制在向好的方向发展。美联储政策方面，9 月 FOMC 会议偏鹰、疫情逐步好转、财政部 TGA 账户低位等原因下，美债利率与美元震荡上行，Taper 在年底落地逐渐成为市场共识，但对于资产的影响已经在逐渐消化。

2021 年三季度，市场总体回撤，但结构分化进一步加剧，沪深 300 指数累计下跌 6.85%，创业板指累计下跌 6.69%。三季度行业分化更为严重，资源类行业延续了二季度的强势，如煤炭、有色金属等行业涨幅较大，而消费以及 TMT 行业则出现了不同程度的回撤，如医药、食品饮料、电子等。三季度涨幅居前的行业为煤炭、有色金属、钢铁、电力、基础化工等，而社服、医药、食品饮料、家电、纺服等行业则跌幅靠前。

本基金季度末重点配置行业包括新能源、机械、TMT 等。随着经济发展，我国城镇化率仍在不断提升，国家政策也在不断推进智慧城市建设，智能化深入吃穿住行。另外，疫情也改变了生活的各个方面，我们更多的依赖于科技与网络，线上办公、在线教育、线上生鲜、线上医疗等各类需求增加，相关行业短中期机会凸显，我们也积极参与其中以获取超额收益。随着碳达峰、碳中和相关政策不断推进，环保升级尤其是城市环保政策趋严，各种新能源需求在政策推动以及市场自发需求共振之下表现较好，我们也持续看好其中机会。

展望 2021 年四季度：首先，随着新冠口服药 III 期临床数据逐渐公布，疫情控制进入新的阶段，后期全球出现的政策变化值得观察，对于全球经济走向的影响值得跟踪；其次，全球宽流动性逐渐退出的影响将逐渐显现，对于市场估值体系的变化值得思考；国内经济数据转弱、对滞涨的担忧、部分行业数据恶化等都阶段性影响市场对于财政政策和货币政策的预期；短期看来，国内外

环境都在一个调整的阶段，在这个阶段我们相对谨慎，预期市场仍然是结构性行情，我们相对看好中长期增长可期的行业、逐渐好转的行业。持续看好的行业，我们继续看好制造业补短板以及智能化推进，这两个方向在智慧城市的推进上都将有所体现：具体而言，碳达峰/碳中和可能是未来多年全球经济体共同致力于解决的大问题，传统能源行业供需格局将产生较大变化，新能源行业则将摆脱依靠补贴的被动局面而走出市场需求推动的行业趋势，我们也相对看好其中的长线机会；我国中长期发展重点也提示了明确方向，大制造、大健康、大科技等相关行业都将受益于政策倾斜，我们中长期看好相关行业。好转的行业我们主要将关注大众消费品相关行业。综合来看，我们预计市场仍将呈现结构性倾斜的格局，我们将持续深入研究行业精选个股以获得更佳投资机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，本基金份额净值为 1.699 元，累计份额净值为 1.899 元。报告期，本基金份额净值增长率为 4.68%，同期业绩比较基准收益率为-2.47 %。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 48,446,500.34 | 88.34        |
|    | 其中：股票             | 48,446,500.34 | 88.34        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 364,173.40    | 0.66         |
|    | 其中：债券             | 364,173.40    | 0.66         |
|    | 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 | 5,953,036.53  | 10.85  |
| 8 | 其他资产         | 79,787.54     | 0.15   |
| 9 | 合计           | 54,843,497.81 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 3,921,990.00  | 7.19         |
| C  | 制造业              | 38,983,109.54 | 71.51        |
| 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  | 2,500,600.80  | 4.59         |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | 2,244,800.00  | 4.12         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 796,000.00    | 1.46         |
| 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               | 48,446,500.34 | 88.87        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 002460 | 赣锋锂业 | 21,000  | 3,421,740.00 | 6.28         |
| 2  | 600048 | 保利发展 | 160,000 | 2,244,800.00 | 4.12         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 3  | 000425 | 徐工机械 | 300,000 | 2,097,000.00 | 3.85 |
| 4  | 300073 | 当升科技 | 24,000  | 1,970,400.00 | 3.61 |
| 5  | 300003 | 乐普医疗 | 70,000  | 1,878,100.00 | 3.45 |
| 6  | 002415 | 海康威视 | 34,000  | 1,870,000.00 | 3.43 |
| 7  | 601168 | 西部矿业 | 130,000 | 1,827,800.00 | 3.35 |
| 8  | 600570 | 恒生电子 | 31,199  | 1,787,078.72 | 3.28 |
| 9  | 688122 | 西部超导 | 24,000  | 1,723,200.00 | 3.16 |
| 10 | 300568 | 星源材质 | 38,000  | 1,711,900.00 | 3.14 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -          | -            |
| 2  | 央行票据      | -          | -            |
| 3  | 金融债券      | -          | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -          | -            |
| 4  | 企业债券      | -          | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -          | -            |
| 6  | 中期票据      | -          | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 364,173.40 | 0.67         |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |
| 10 | 合计        | 364,173.40 | 0.67         |

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1  | 113618 | 美诺转债 | 2,000 | 239,520.00 | 0.44         |
| 2  | 118002 | 天合转债 | 890   | 124,653.40 | 0.23         |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体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。

#### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 16,248.92 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 1,174.05  |
| 5  | 应收申购款   | 62,364.57 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 79,787.54 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1  | 113618 | 美诺转债 | 239,520.00 | 0.44         |

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 36,076,757.19 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 1,613,048.03  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 5,610,537.11  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 32,079,268.11 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |      |      | 报告期末持有基金情况 |      |
|--------|----------------|-------------------------|------|------|------------|------|
|        | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额       | 持有份额 |
| 产品特有风险 |                |                         |      |      |            |      |
| 无      |                |                         |      |      |            |      |

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2021 年 10 月 26 日