

海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金
2023 年第 3 季度报告
2023 年 9 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

§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 2023 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通电子信息传媒产业股票
基金主代码	006080
交易代码	006080
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2018 年 12 月 26 日
报告期末基金份额总额	467,024,078.19 份
投资目标	本基金重点投资于与电子信息传媒产业相关的子行业或企业，分享中国电子信息传媒产业发展带来的投资机会，在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金为股票型基金，股票投资及存托凭证占基金资产的比例为 80-95%，在进行资产配置决策时，在研究宏观经济基本面、政策面、市场情绪、资金面和投资者行为等多种因素的基础上，形成对不同市场周期的预测和判断，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，确定股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例。本基金依托基金管理人的投资研究平台，重点关注我国电子信息传媒产业发展带来的投资机

	会，投资于电子信息传媒产业相关行业或主题的股票及存托凭证占非现金基金资产的比例不低于 80%。	
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数收益率×70%+中证港股通 TMT 主题指数收益率×15%+上证国债指数收益率×15%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险及预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金将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。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通电子信息传媒产业股票 A	海富通电子信息传媒产业股票 C
下属两级基金的交易代码	006081	006080
报告期末下属两级基金的份额总额	228,343,806.96 份	238,680,271.23 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)	
	海富通电子信息传媒产业股票 A	海富通电子信息传媒产业股票 C
1.本期已实现收益	-112,207,928.89	-112,617,666.55
2.本期利润	-212,156,963.56	-207,920,712.01
3.加权平均基金份额本期利润	-0.8125	-0.7907
4.期末基金资产净值	516,694,717.17	515,253,533.66
5.期末基金份额净值	2.2628	2.1588

注：（1）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。

(2) 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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、海富通电子信息传媒产业股票 A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-25.06%	1.94%	-8.90%	1.09%	-16.16%	0.85%
过去六个月	-17.13%	2.56%	-12.93%	1.27%	-4.20%	1.29%
过去一年	-19.28%	2.24%	15.02%	1.26%	-34.30%	0.98%
过去三年	11.04%	2.20%	-18.05%	1.21%	29.09%	0.99%
自基金合同生效起至今	126.28%	2.19%	28.59%	1.36%	97.69%	0.83%

2、海富通电子信息传媒产业股票 C：

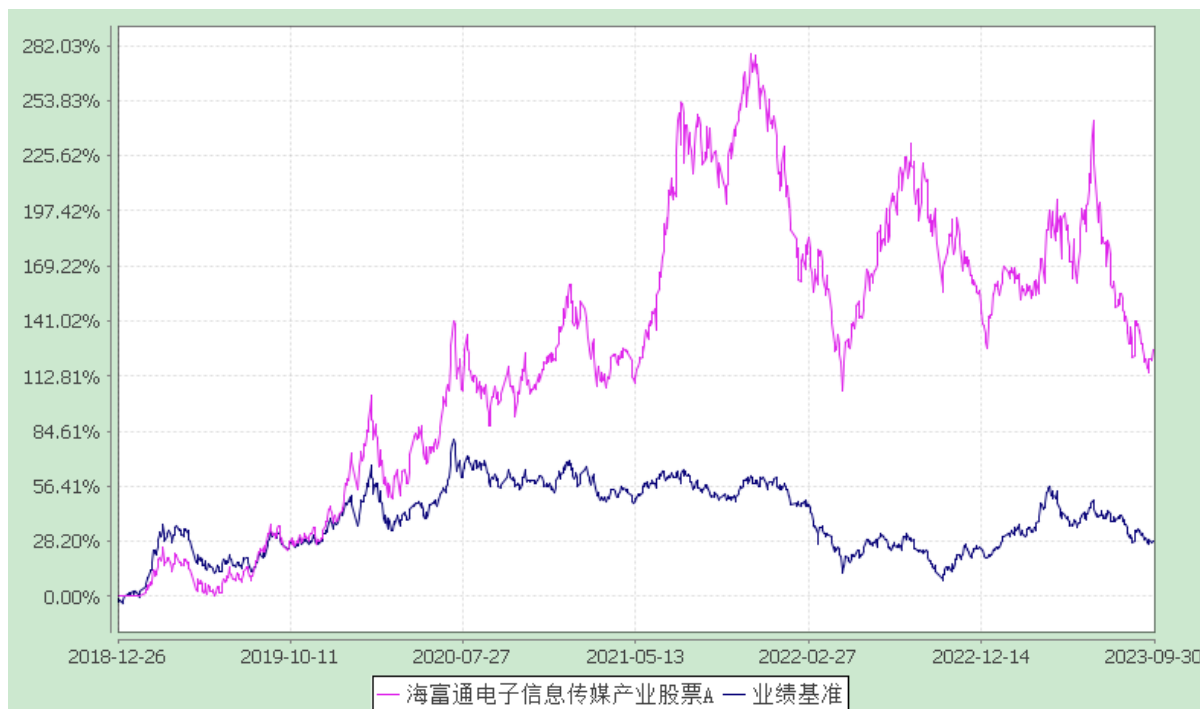
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-25.21%	1.94%	-8.90%	1.09%	-16.31%	0.85%
过去六个月	-17.46%	2.56%	-12.93%	1.27%	-4.53%	1.29%
过去一年	-19.92%	2.25%	15.02%	1.26%	-34.94%	0.99%
过去三年	8.42%	2.20%	-18.05%	1.21%	26.47%	0.99%
自基金合同生效起至今	115.88%	2.19%	28.59%	1.36%	87.29%	0.83%

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

海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1. 海富通电子信息传媒产业股票 A

(2018 年 12 月 26 日至 2023 年 9 月 30 日)



2. 海富通电子信息传媒产业股票 C

(2018 年 12 月 26 日至 2023 年 9 月 30 日)



注：本基金合同于 2018 年 12 月 26 日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

§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		
杨宁嘉	本基金的基金经理	2021-09-01	-	9 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任海通国际证券集团有限公司首席分析师助理、光大证券股份有限公司行业研究员。2017 年 5 月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师、高级股票分析师、基金经理助理。2021 年 9 月起任海富通电子信息传媒产业股票基金经理。2022 年 12

					月起兼任海富通新内需混合基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

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》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，A 股市场经历了一轮调整。以万得全 A 指数来看，当季度跌幅 4.33%。分市场看，沪深 300 指数下跌 3.98%、中证 500 指数下跌 5.13%、科创 50 指数下跌 11.67%、创业板综下跌 8.25%、中小综指下跌 7.42%。分行业看，申万一级行业表现靠前的板块是非银金融、煤炭、石油石化、钢铁、银行，跌幅较大的板块是电力设备、传媒、计算机、通信。

三季度美国经济、通胀仍然超越市场预期。美非农就业数据持续表现强劲，呈现出较强的韧性，其他诸如制造业 PMI、失业率数据也都好于预期。在此背景下，美联储停止加息甚至降息的预期不断落空。美债利率持续上行，人民币贬值压力加大，都对 A 股市场的资金面和估值面产生了较大压力，也影响了市场风险偏好。因此，三季度风险

偏好较高且前期涨幅较大的 TMT 板块有较大幅度的调整。

国内因素方面，三季度最大的变化是经济逐步探底回升，政策端逐步发力。政策端，七月政治局会议政策转向稳增长，在房地产、地方债务化解、活跃资本市场等方面的表述超出市场预期。八月下旬以来，在房地产、化债、活跃资本市场三个领域的政策推进速度明显加快。九月央行宣布下调存款准备金率。此外，房地产方面，更多的二线城市宣布全面放开限购。明年城中村改造纳入专项债支持范围。总体来看，三季度财政发力和货币政策配合的组合逐步出现。经济端，6 月以来制造业 PMI 持续回升，9 月重回扩张区域至 50.2%。PPI 在 6 月触底后连续两个月的同比抬升也正式确认了降价去库行为的结束。经济内生增长动能企稳回升，逆周期政策持续发力的情形下，三季度传统工业、基建投资需求表现较优。在此背景下，受益于活跃资本市场政策的非银行金融以及经济周期相关的顺周期品种如煤炭、石油石化、钢铁、银行表现较优，取得正收益。

三季度本基金回撤较大，主要因为之前持仓较重的 AI 板块本季度跌幅较大，除了前期涨幅较大的原因之外，还在于行业边际变化减弱而且没有看到新的 AI 应用落地，所以板块三季度回撤较大。但是站在当前时点看，板块经历过快速下跌后位置已经具有很强的性价比，很多公司不管是位置还是估值都回落到了很好的买点。后续市场反弹主线还是聚焦在华为产业链（手机和车）、算力（国内算力租赁和光模块），AI 的话主要是多模态、AI+教育等细分赛道，消费电子板块受华为拉货补库存的影响叠加位置在底部区间，也较为看好。本基金持仓主要分布在电子、计算机、通信和传媒板块，主要布局方向在 AI+、算力、汽车智能化、消费电子、半导体等重点领域方向，希望抓住这波 AI 创新的浪潮，给投资者带来好的投资体验。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通电子信息传媒产业股票 A 净值增长率为-25.06%，同期业绩比较基准收益率为-8.90%，基金净值跑输业绩比较基准 16.16 个百分点。海富通电子信息传媒产业股票 C 净值增长率为-25.21%，同期业绩比较基准收益率为-8.90%，基金净值跑输业绩比较基准 16.31 个百分点。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§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	963,075,832.82	87.09
	其中：股票	963,075,832.82	87.09
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	82,609,640.99	7.47
7	其他资产	60,197,311.53	5.44
8	合计	1,105,882,785.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	768,640,104.95	74.48
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	175,177,059.87	16.98
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	19,258,668.00	1.87

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	963,075,832.82	93.33

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 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	603220	中贝通信	1,789,000	60,647,100.00	5.88
2	300260	新莱应材	1,460,860	55,351,985.40	5.36
3	688072	拓荆科技	226,385	53,927,170.85	5.23
4	301308	江波龙	549,200	48,109,920.00	4.66
5	300308	中际旭创	389,500	45,104,100.00	4.37
6	688012	中微公司	283,105	42,621,457.75	4.13
7	002463	沪电股份	1,788,700	40,263,637.00	3.90
8	603496	恒为科技	1,327,140	39,469,143.60	3.82
9	300474	景嘉微	485,086	39,335,623.74	3.81
10	300666	江丰电子	612,226	38,013,112.34	3.68

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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 本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	1,328,115.44
2	应收证券清算款	58,757,762.64

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	111,433.45
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	60,197,311.53

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通电子信息传媒 产业股票A	海富通电子信息传媒 产业股票C
本报告期期初基金份额总额	295,413,189.00	274,653,724.04
本报告期基金总申购份额	3,121,296.00	113,823,032.11
减：本报告期基金总赎回份额	70,190,678.04	149,796,484.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	228,343,806.96	238,680,271.23

§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

本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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

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

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 110 只公募基金。截至 2023 年 9 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1505 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2020 年 3 月，由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，海富通荣获“金牛进取奖”，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖项。2020 年 7 月，由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓，海富通荣获“金基金·股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获“IAMAC 推介 2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证

券投资基金荣获“金基金 偏股混合型基金五年期奖”。

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。2023 年 8 月，海富通荣获《上海证券报》颁发的“上证·中国基金投教创新案例奖”。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金的文件
- (二)海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金基金合同
- (三)海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

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。

海富通基金管理有限公司
二〇二三年十月二十五日

