

华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资  
基金  
2024 年第 3 季度报告

2024 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 07 月 01 日起至 2024 年 09 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 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  |
| 报告期末基金份额总额 | 73,758,837.72 份  |
| 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       | 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%。<br>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。<br>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。<br>本基金的资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、 |

|                 |  |                    |
|-----------------|--|--------------------|
|                 | 国债期货投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、参与转融通证券出借业务策略等详见法律文件。   |                    |
| 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%  |                    |
| 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> |                    |
| 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   |                    |
| 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 | 32,932,416.28 份  | 40,826,421.44 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（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 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 |
| 1. 本期已实现收益      | -841,055.57                         | -911,063.15        |
| 2. 本期利润         | 4,703,620.64                        | 6,076,112.85       |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1414                              | 0.1621             |
| 4. 期末基金资产净值     | 28,314,979.32                       | 34,809,732.71      |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.8598                              | 0.8526             |

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华富中证科创创业 50 指数增强 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标 | 业绩比较基准 | 业绩比较基准 | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|--------|--------|--------|-----|-----|
|----|--------|--------|--------|--------|-----|-----|

|                |         | 准差②   | 收益率③    | 收益率标准差<br>④ |        |        |
|----------------|---------|-------|---------|-------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 20.02%  | 2.44% | 22.58%  | 2.51%       | -2.56% | -0.07% |
| 过去六个月          | 15.64%  | 1.95% | 15.03%  | 2.01%       | 0.61%  | -0.06% |
| 过去一年           | 9.49%   | 1.72% | 6.37%   | 1.75%       | 3.12%  | -0.03% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -14.02% | 1.36% | -15.21% | 1.46%       | 1.19%  | -0.10% |

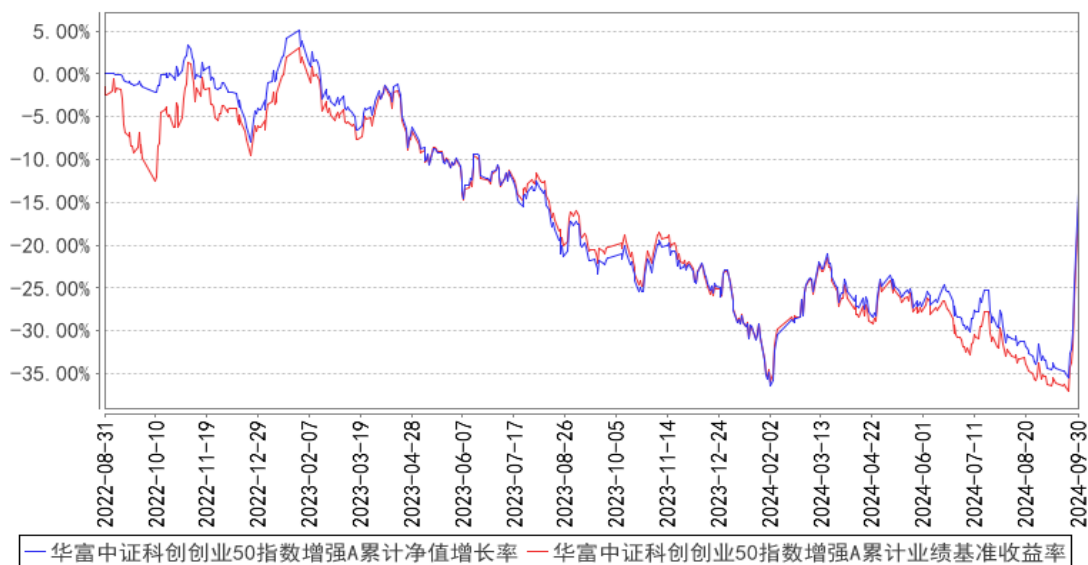
华富中证科创创业 50 指数增强 C

| 阶段             | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|---------|-----------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 19.90%  | 2.44%     | 22.58%         | 2.51%                 | -2.68% | -0.07% |
| 过去六个月          | 15.40%  | 1.94%     | 15.03%         | 2.01%                 | 0.37%  | -0.07% |
| 过去一年           | 9.04%   | 1.72%     | 6.37%          | 1.75%                 | 2.67%  | -0.03% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -14.74% | 1.36%     | -15.21%        | 1.46%                 | 0.47%  | -0.10% |

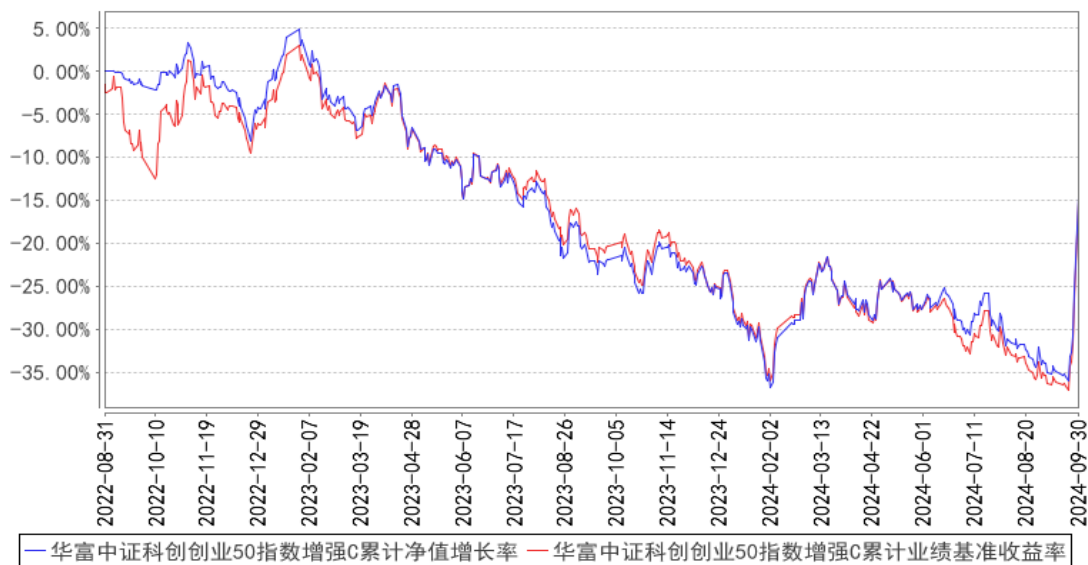
注：业绩比较基准收益率=中证科创创业 50 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

### 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：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 |        |                                      |
| 张娅 | 本基金基金经理、 | 2022年8月31日  | -    | 二十年    | 美国肯特州立大学理学硕士，硕士研究生学历。历任华泰柏瑞基金管理有限公司指 |

|     |                               |                 |   |     |   |
|-----|-------------------------------|-----------------|---|-----|---|
|     | 公司总经理助理、指数投资部总监、公司公募投资决策委员会委员 |                 |   |     | 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 | - | 十一年 | 北京大学理学博士,博士研究生学历。历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 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 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,自 2024 年 3 月 20 日起任华富产业智选混合型证券投资基金基金经理,具有基金从业资格。 |
| 李孝华 | 本基金基金经理、指数投资部权益指数经理           | 2023 年 2 月 9 日  | - | 十年  | 南开大学经济学硕士、硕士研究生学历。历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、华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理助理。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  |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | <p>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。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

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，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

2024 年三季度，国内经济复苏的内生动能不强，9 月下旬，政府出台了较大幅度的刺激政策，货币政策和财政政策并举，一系列组合措施首先利于市场风险偏好的恢复，后续也利于国内经济的修复。而科创创业 50 指数中，既有前期盈利预期向好，受市场情绪压制的高景气行业（如 TMT），也有与经济周期高关联的行业（如新能源、医药），后续有望成为值得投资者重点关注的科创宽基。

科创创业 50 所跟踪的科创板和创业板中各个子行业与其中的龙头公司景气趋势开始向上，截至 2024 年 9 月 30 日，科创创业 50 指数 2024 年 wind 一致预期盈利增速为 11.7%，2025 年一致预期盈利增速为 23.5%。具体各个子行业来看：

1、TMT：当前半导体行业周期见底，且人工智能技术带来极大的算力需求，我国光模块、服务器、PCB 板卡已深度参与到全球 AI 供应链之中，随着未来 AI 应用进一步深化至大众日常应用，或对国内 TMT 行业相关公司有更大的新增盈利拉动。

2、新能源：当前行业出清接近尾声，光伏产业中，组件价格已回落至 2019 年初的水平，且自 2024 年 6 月以来出现明显的企稳迹象，随着后续经济的复苏，龙头企业有望随行业渗透率的提升稳定增长。

3、医药生物：自 2019 年我国医改以来，当前行业进入创新收获期，当前国内医药企业在肺癌、胰岛素、核磁共振仪等领域已经开始出现越来越多的和海外同等疗效或技术的产品，且企业也开始从增收走向增利，随着周期的复苏，需求端景气有望进一步提升，A 股的医药投资也开始逐渐从过去偏主题投资转向景气投资，预期未来行业内公司的波动将大大降低。

本基金在 2024 年三季度的运作中，在行业层面主要超配了周期明显回升的半导体行业以及消费电子行业。在选股层面，对于景气趋势上升的 TMT 行业主要利用盈利预期类因子进行选股；而对于出清中的新能源行业，主要优选率先出清的子行业的龙头公司；对于医药行业，则主要优选盈利预期提升，且具有能进行国产替代的“me too”以及“me better”的高壁垒产品的公司。

展望 2024 年四季度，在政策密集出台后，预期市场会率先出现情绪上的修复，后续则需要观察经济数据是否会随着政策出现较明显的好转，因此四季度的经济数据将对后市走势极为重要，本基金也将密切关注货币与财政政策的实际效果，采取不同的投资策略应对。

在行业层面，我们将对独立于经济周期，受益于 AI 技术发展的 TMT 行业，在其估值合理的区间始终维持超配；而对新能源，如果经济数据好转明显，则会在行业层面把握其估值修复的机会，而如果经济数据未及乐观预期，则会精选其中供给端出清更充分的子行业龙头予以配置；对医药



行业，如果经济数据好转明显，会对受益于财政恢复的医疗设备、耗材等公司予以超配，而如果经济数据未及乐观预期，则从低估值的个股中，寻找取得创新突破，实现与海外产品相比疗效更佳或副作用更低的创新药公司的机会。

选股层面，我们对于景气趋势向上的 TMT 行业，将着重选取盈利预期边际提升较快，估值处于中等水平的公司，而对于新能源、医疗器械等行业，我们将着重选取现金流良好，分红开始提升的龙头公司。通过上述先进行行业层面属性判断，再进行行业内选股的方法，以期为持有人谋求更好的收益。

#### 4.5 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 0.8598 元，累计份额净值为 0.8598 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 20.02%，同期业绩比较基准收益率为 22.58%。截止本期末，华富中证科创创业 50 指数增强 C 份额净值为 0.8526 元，累计份额净值为 0.8526 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 19.90%，同期业绩比较基准收益率为 22.58%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2024 年 08 月 02 日起至 2024 年 09 月 24 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 2024 年 09 月 25 日起至本报告期末（2024 年 09 月 30 日），本基金基金资产净值已不存在连续二十个工作日低于 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 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              | 59,669,772.64 | 89.87        |
|    | 其中：股票             | 59,669,772.64 | 89.87        |
| 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 | 5,938,136.72  | 8.94   |
| 8 | 其他资产         | 787,883.76    | 1.19   |
| 9 | 合计           | 66,395,793.12 | 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              | 46,320,018.94 | 73.38        |
| 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  | 3,289,463.10  | 5.21         |
| 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       | 869,471.00    | 1.38         |
| 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               | 50,478,953.04 | 79.97        |

### 5.2.2 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              | 136,050.00   | 0.22         |
| C  | 制造业              | 8,578,771.60 | 13.59        |
| 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  | 193,254.00   | 0.31         |

|   |               |              |       |
|---|---------------|--------------|-------|
| 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    | 282,744.00   | 0.45  |
| 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            | 9,190,819.60 | 14.56 |

### 5.2.3 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。

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 300750 | 宁德时代 | 22,400 | 5,642,336.00 | 8.94         |
| 2  | 300274 | 阳光电源 | 41,440 | 4,126,595.20 | 6.54         |
| 3  | 300308 | 中际旭创 | 24,400 | 3,778,584.00 | 5.99         |
| 4  | 300760 | 迈瑞医疗 | 12,100 | 3,545,300.00 | 5.62         |
| 5  | 688981 | 中芯国际 | 49,680 | 2,980,303.20 | 4.72         |
| 6  | 688008 | 澜起科技 | 38,096 | 2,547,860.48 | 4.04         |
| 7  | 300124 | 汇川技术 | 39,900 | 2,491,755.00 | 3.95         |
| 8  | 688041 | 海光信息 | 22,108 | 2,283,314.24 | 3.62         |
| 9  | 688012 | 中微公司 | 13,554 | 2,222,856.00 | 3.52         |
| 10 | 300408 | 三环集团 | 47,700 | 1,769,670.00 | 2.80         |

#### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

| 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  | 002475 | 立讯精密 | 13,900 | 604,094.00 | 0.96         |
| 2  | 002371 | 北方华创 | 1,600  | 585,568.00 | 0.93         |
| 3  | 002384 | 东山精密 | 20,000 | 470,800.00 | 0.75         |
| 4  | 688608 | 恒玄科技 | 2,200  | 467,236.00 | 0.74         |
| 5  | 300633 | 开立医疗 | 11,900 | 432,089.00 | 0.68         |

### 5.4 报告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

注：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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券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   | -          |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 787,883.76 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 787,883.76 |

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告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。

#### 5.11.5.2 报告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的情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 华富中证科创创业 50 指数增强 A | 华富中证科创创业 50 指数增强 C |
|---------------------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 33,708,115.04      | 35,054,814.50      |
| 报告期期间基金总申购份额              | 862,164.53         | 20,874,950.67      |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 1,637,863.29       | 15,103,343.73      |
| 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               | 32,932,416.28      | 40,826,421.44      |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目                        | 华富中证科创创业 50 指数增强 A | 华富中证科创创业 50 指数增强 C |
|---------------------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额          | 14,045,474.84      | 7,424,845.77       |
| 报告期期间买入/申购总份额             | 0.00               | 0.00               |
| 报告期期间卖出/赎回总份额             | 0.00               | 0.00               |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额          | 14,045,474.84      | 7,424,845.77       |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 19.04              | 10.07              |

### 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

| 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              | 20240701-20240930        | 21,470,320.61 | 0.00 | 0.00 | 21,470,320.61 | 29.11    |
| 个人     | -              | -                        | -             | -    | -    | -             | -        |
| -      | -              | -                        | -             | -    | -    | -             | -        |
| 产品特有风险 |                |                          |               |      |      |               |          |
| 无      |                |                          |               |      |      |               |          |

### 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

## 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

2024 年 10 月 25 日