

# 华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金

## 金

### 2022 年第 2 季度报告

2022 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 7 月 20 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 2022 年 07 月 19 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 2022 年 04 月 01 日起至 2022 年 06 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	34,891,708.47 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（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-3,020,608.24
2. 本期利润	1,817,573.63
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0592
4. 期末基金资产净值	52,679,869.09
5. 期末基金份额净值	1.510

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

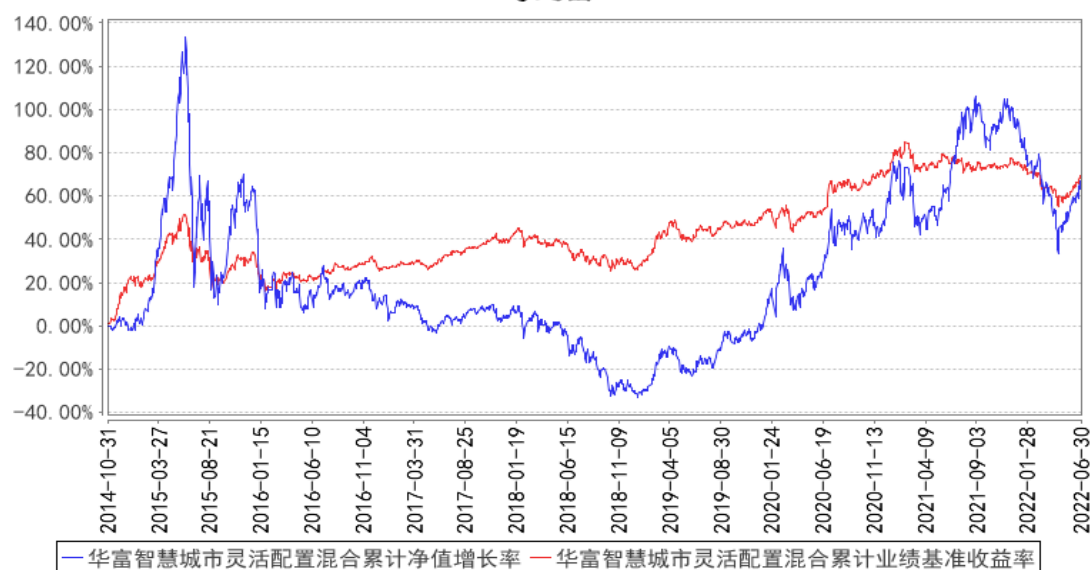
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 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	3.85%	1.67%	3.79%	0.71%	0.06%	0.96%
过去六个月	-14.88%	1.62%	-3.52%	0.72%	-11.36%	0.90%
过去一年	-6.96%	1.60%	-4.50%	0.62%	-2.46%	0.98%
过去三年	100.53%	1.74%	17.40%	0.63%	83.13%	1.11%
过去五年	59.45%	1.65%	27.60%	0.63%	31.85%	1.02%
自基金合同 生效起至今	66.54%	1.93%	69.56%	0.74%	-3.02%	1.19%

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	本基金的基金经理	2017 年 5 月 9 日	-	二十二年	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，曾任行业研究员、基金经理助理，自 2017 年 5 月 9 日起任华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 5 月 9 日起任华富策略精选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

2022 年二季度，国内疫情升温，经济下行压力加剧，6 月随着重点地区疫情缓解，复工复产稳步推进，经济正在重回复苏趋势，但后期疫情对经济如何影响还有待观察。二季度受疫情冲击，经济增速大概率较一季度出现明显回落，具体来说，4 月是经济受疫情冲击最大的时期，各项经济数据明显回落，工业增加值、社会消费品零售等数据同比均出现负增长。5 月、6 月，随着国内

疫情形势逐步得到控制、各地复工复产，经济开始出现疫后修复，各项经济数据边际上都出现较大的改善，但距离本轮疫情前的基本面水平还有一定距离。海外方面，由于海外通胀高企，欧美国家央行纷纷趋紧，美联储 6 月 FOMC 会议加息 75BP，且市场预期 7 月与 9 月仍分别有 3 次与 2 次加息幅度；经济基本面方面，6 月美国密西根大学消费信心指数下跌幅度与以往衰退前夕相当，6 月 PMI 也下降明显，二季度末开始海外衰退预期显著升温。

国内市场二季度各大指数呈现先抑后扬的态势，上证指数、沪深 300、创业板指分别上涨 4.50%、6.21%、5.68%。行业表现方面，疫后复苏主线和成长主线表现相对较好，稳增长板块有所回调，中信一级行业指数涨跌幅居前 5 位的依次为消费者服务、汽车、食品饮料、电力设备及新能源、家电，涨跌幅分别为 25.27%、24.91%、21.19%、13.88%、12.66%。下跌方面，综合金融、房地产、传媒、综合、农林牧渔跌幅居前，分别下跌 15.74%、8.38%、5.10%、4.52%、3.55%。

本基金季度末重点配置行业包括 TMT、新能源、地产建筑、机械、医药等。我国城镇化率仍在提升，且科技对城市建设的推动日益增强，数字化、智能化逐渐渗透吃穿住行，我们也持续看好过程中相关行业的机会。另外，疫情持续时间较长，深度改变了一些生活习惯，如线上办公、在线教育、生鲜快递等，相关行业短期中期机会凸显，我们也积极参与其中以获取超额收益；抗疫可能在未来相当一段时间中仍将与我们的生活相伴，我们也关注其中医药、城市管理相关的一些机会。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 2022 年三季度：随着全国各地疫情陆续平复和复工复产稳步推进，中国经济重回复苏这一趋势已在 5 月的各项数据中有所印证，未来预计将延续改善趋势，但不断点发的疫情以及疫情政策的变化对经济的影响仍存在边际变化，这点需要持续关注，在这个阶段预期仍以结构性机会为主。从配置上看，随着经济逐渐步入复苏，行业逻辑逐步回到常态，供需格局再度成为矛盾主线，高景气行业仍需重点关注，如新能源、高端装备、医药等，但个股挖掘难度提升，机会更多来自于细分行业的配置优化，个股深度挖掘、继续下沉。另外，三季度看，内部经济复苏，伴随着全球经济走弱与加息并存的风险，市场可能在纠结与不断修正中前行，受此干扰最小以及复苏变化较大的行业值得持续关注。未来复苏中，消费领域值得持续关注，众多头部品牌在疫情中脱颖而出或者维持不倒，后续发展可能优势更为明确，值得挖掘。

#### 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 1.510 元，累计份额净值为 1.710 元。报告期，本基金份额净值增长率为 3.85%，同期业绩比较基准收益率为 3.79%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2022 年 3 月 3 日起至 2022 年 6 月 23 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 2022 年 6 月 24 日至本报告期期末(2022 年 06 月 30 日)本基金已不存在基金资产净值低于 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	45,852,413.70	84.21
	其中:股票	45,852,413.70	84.21
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	6,632,098.51	12.18
8	其他资产	1,964,944.66	3.61
9	合计	54,449,456.87	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	33,829,242.80	64.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,069,300.00	2.03
E	建筑业	1,928,150.00	3.66
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	1,473,180.90	2.80
I	信息传输、软件和信息技术服务业	991,440.00	1.88
J	金融业	-	-

K	房地产业	4,405,200.00	8.36
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,155,900.00	4.09
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	45,852,413.70	87.04

### 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	601012	隆基绿能	53,200	3,544,716.00	6.73
2	600048	保利发展	160,000	2,793,600.00	5.30
3	688599	天合光能	31,000	2,022,750.00	3.84
4	601669	中国电建	245,000	1,928,150.00	3.66
5	001979	招商蛇口	120,000	1,611,600.00	3.06
6	600754	锦江酒店	23,421	1,473,180.90	2.80
7	603019	中科曙光	50,000	1,451,000.00	2.75
8	300014	亿纬锂能	14,800	1,443,000.00	2.74
9	601100	恒立液压	23,000	1,419,560.00	2.69
10	000999	华润三九	31,000	1,395,000.00	2.65

### 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

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中，惠州亿纬锂能股份有限公司、中国电力建设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。

#### 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	15,973.65

2	应收证券清算款	1,940,804.02
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,166.99
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,964,944.66

#### 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

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	30,611,438.72
报告期期间基金总申购份额	5,506,078.84
减：报告期期间基金总赎回份额	1,225,809.09
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	34,891,708.47

## § 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

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	4,943,216.21
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,943,216.21

基金份额	
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	14.17

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	基金转换入	2022-06-24	1,088,934.17	1,601,822.17	0.0000
2	基金转换入	2022-06-24	3,854,282.04	5,669,648.88	0.0000
合计			4,943,216.21	7,271,471.05	

## § 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

2022 年 7 月 20 日