

华富物联世界灵活配置混合型证券投资基  
金  
2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 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：2023 年 4 月 21 日

## 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 04 月 20 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 01 月 01 日起至 2023 年 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华富物联世界灵活配置混合
基金主代码	001709
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 21 日
报告期末基金份额总额	10,447,887.74 份
投资目标	本基金通过深入研究并积极投资于与物联世界主题相关的优质上市公司，精选个股，分享其发展和成长的机会，力求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、证券市场以及物联世界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%+上证国债指数收益率×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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日）
1. 本期已实现收益	408,348.59
2. 本期利润	3,609,246.77
3. 加权平均基金份额本期利润	0.3255
4. 期末基金资产净值	20,560,205.45
5. 期末基金份额净值	1.968

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

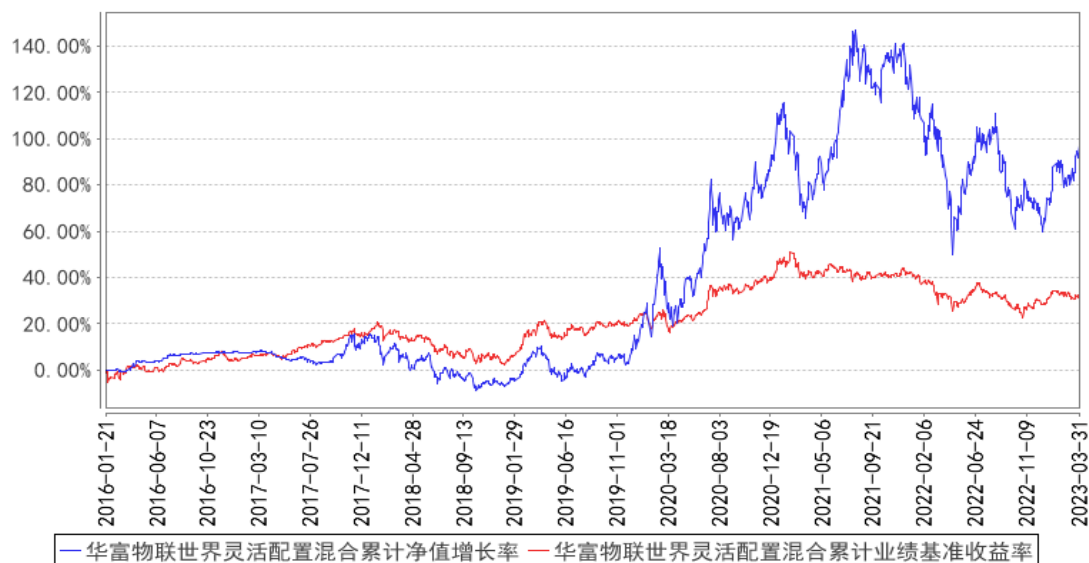
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	19.06%	1.43%	2.71%	0.43%	16.35%	1.00%
过去六个月	17.21%	1.46%	3.92%	0.55%	13.29%	0.91%
过去一年	4.68%	1.76%	-0.00%	0.57%	4.68%	1.19%
过去三年	65.10%	1.77%	11.54%	0.60%	53.56%	1.17%
过去五年	85.31%	1.59%	15.83%	0.64%	69.48%	0.95%
自基金合同 生效起至今	96.80%	1.36%	32.39%	0.60%	64.41%	0.76%

注：本基金业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×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

华富物联世界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《华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：股票投资比例为基金资产的 0%-95%，投资于本基金合同界定的物联世界主题相关证券不低于非现金基金资产的 80%；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 2016 年 1 月 21 日到 2016 年 7 月 21 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《华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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		
陈奇	本基金基金经理、研究发展部副总监	2019 年 10 月 21 日	-	十三年	复旦大学微电子专业硕士，硕士研究生学历。曾任群益证券研究部研究员。2015 年 12 月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部研究员、基金经理助理，自 2019 年 10 月 21 日起任华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2020 年 8 月 26 日起任华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 19 日起任华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2022 年 8 月 22 日起任华富竞争力优选混合型证券投资基

					金基金经理，自 2022 年 12 月 1 日起任华富时代锐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

2023 年一季度，随着疫情影响逐步消退，稳经济政策靠前部署，中国经济持续恢复，生产和需求两端双双改善，就业和物价总体稳定，市场信心和预期显著好转。宏观数据来看，内需回升在一定程度上抵补外需放缓压力，经济运行总体呈现企稳回升态势。投资方面，1-2 月份，全国固定资产投资（不含农户）为 53577 亿元，同比增长 5.5%。从三大分项来看，制造业再度走强，基建仍有韧性，地产降幅收窄，具体来说，1-2 月制造业投资增速回升至 8.1%，新兴产业投

资增速高于整体。消费方面，1-2 月份，社会消费品零售总额为 77067 亿元，同比增长 3.5%。结构上看，消费内部也存在明显分化，一方面，疫情影响明显消退，服务消费恢复快于商品消费，旅游、餐饮等接触性消费领域尤为亮眼；另一方面，经济复苏初期，居民资产负债表受损影响仍未消退，而地产销售改善对相关消费的带动也存在滞后性，必需消费表现好于可选消费。出口方面，1-2 月，出口（按美元计）同比下降 6.8%，降幅较 2022 年 12 月收窄 3.1 个百分点。

国内市场一季度各指数继续回升，上证指数、沪深 300、创业板指分别收涨 5.94%、4.63%、2.25%。行业表现方面，TMT 一枝独秀，超额收益明显，中信一级行业指数涨跌幅居前 5 位的依次为计算机、传媒、通信、电子、建筑，涨跌幅分别为 38.70%、34.23%、28.88%、16.89%、11.46%。下跌方面，房地产、消费者服务、综合、银行、电力设备及新能源跌幅居前，涨跌幅分别为-6.21%、-5.29%、-2.65%、-2.25%、-0.18%。

回顾一季度的市场，1 月各板块快速轮动，无论赛道股，还是消费，以及顺周期，基本都有所表现；但进入 2 月之后，随着 chatGPT 的横空出世，以及产业的快速推进，AIGC 板块逐步成为市场最瞩目的热点。围绕 GPT 的大模型、算力、应用等方向的投资热点演绎精彩纷呈。本季度本基金净值有所上涨，主要受益于本基金配置的计算机、半导体个股有所表现，而光伏、电动车、军工则为拖累项。

展望二季度，经济将全面进入疫后修复期，基建和制造业投资预计将保持较快增长，房地产投资逐步企稳，消费有望延续较好恢复势头，出口增速有望筑底修复，叠加 2022 年同期基数较低，预计二季度 GDP 增速或将为全年高点，为 A 股提供分子端的支撑。

综合国内外形势来看，几个方向仍值得我们重点关注。AIGC 方面，作为全球各大产业巨头竞相参与的方向，有望从主题投资往主线投资演绎。我们将密切关注受益人工智能产业趋势的个股，争取挖掘相关投资机会。数字经济方面，2022 年初国务院发布《“十四五”数字经济发展规划》，自此，数字经济相关顶层政策不断落地。2023 年初《求是》上发布《加快构建中国特色数据基础制度体系，促进全体人民共享数字经济发展红利》的文章，数字经济顶级战略地位再获强调。“东数西算”/数据交易所/数据确权/政务大数据/国资云，可见配套政策是泛化到广阔领域。从社会发展史看，人类经历了农业革命、工业革命，正在经历信息革命。过去 10 年，以大数据、云计算、人工智能等为代表的新一轮信息技术迅猛发展，以赋能实体经济为重点，数据要素价值正在不断释放。数字经济正以前所未有的深度和广度参与社会生产生活，数据要素、关键核心技术、数字基础设施、产业数字化、数字经济安全等方向，均有望在新时代下，释放出更高的产业价值和投资价值。半导体方面，虽然全球半导体都在经历去库存，但市场悲观情绪展示已较充分，同时在国产化、新应用和新创新产品的带动下，国内的半导体公司或迎来中长期的加

大配置窗口。

未来在基金的运作管理上，我们将重点聚焦符合国家长期战略规划和科技进步方向的新兴产业，同时关注各个行业的显性龙头或隐性的冠军企业，即在景气赛道中持续寻找具有确定性的企业，同时积极关注行业边际变化带来的机会。紧跟产业趋势，去伪存真，寻找确定性的成长机会是本基金努力的方向。我们一直在努力调整组合，力争为持有人创造更好的回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金份额净值为 1.968 元，累计份额净值为 1.968 元。报告期，华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金份额净值增长率为 19.06%，同期业绩比较基准收益率为 2.71%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2017 年 10 月 31 日起至本报告期末（2023 年 03 月 31 日），本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于 5000 万元的情形，至本报告期期末（2023 年 03 月 31 日）基金资产净值仍低于 5000 万元。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取相关措施，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

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	15,896,532.38	76.58
	其中：股票	15,896,532.38	76.58
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	4,837,497.27	23.30
8	其他资产	23,870.52	0.11
9	合计	20,757,900.17	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	6,571,347.00	31.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	320,682.00	1.56
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	8,429,103.38	41.00
J	金融业	408,600.00	1.99
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	166,800.00	0.81
S	综合	-	-
	合计	15,896,532.38	77.32

### 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	603986	兆易创新	10,000	1,220,000.00	5.93
2	300687	赛意信息	30,000	1,164,300.00	5.66
3	002368	太极股份	26,541	1,119,499.38	5.44
4	000938	紫光股份	35,000	1,025,150.00	4.99
5	002371	北方华创	3,000	797,550.00	3.88
6	688383	新益昌	6,000	792,660.00	3.86
7	600536	中国软件	9,100	626,353.00	3.05



8	300226	上海钢联	15,000	613,200.00	2.98
9	000063	中兴通讯	18,100	589,336.00	2.87
10	002153	石基信息	20,000	513,200.00	2.50

#### 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	5,805.75

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,064.77
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	23,870.52

#### 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	12,336,663.74
报告期期间基金总申购份额	1,645,173.31
减：报告期期间基金总赎回份额	3,533,949.31
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	10,447,887.74

### § 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	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

类别		间区间					
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	2023. 1. 1-2023. 3. 31	5,000,000.00	0.00	0.00	5,000,000.00	47.8600
-	-	-	-	-	-	-	-
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、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富物联世界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

2023 年 4 月 21 日