

# 海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金

## 2023 年中期报告

### 2023 年 6 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：二〇二三年八月三十一日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告</b> .....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
7.6 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.....	56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	56
7.8 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贵金属投资明细.....	56
7.9 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.....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	58
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	58
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>59</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
10.4 基金投资策略的改变 .....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
10.8 其他重大事件 .....	62
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>62</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>63</b>
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	64
12.3 查阅方式 .....	64

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金	
基金简称	海富通创业板增强	
基金主代码	005287	
交易代码	005287	
基金运作方式	契约型、开放式、发起式	
基金合同生效日	2018 年 4 月 8 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	
报告期末基金份额总额	65,296,393.46 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C
下属分级基金的交易代码	005288	005287
报告期末下属分级基金的份额总额	26,908,673.65 份	38,387,719.81 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的投资策略模型精选创业板优质股票，力争将本基金净值增长率与业绩基准涨跌幅的日均偏离度控制在 0.5% 以内、年化跟踪误差控制在 7.5% 以内，同时力求使基金的业绩超越创业板综合指数表现。
投资策略	本基金为增强型指数基金，对指数投资部分将采用抽样复制标的指数投资方法，利用成熟的量化技术模型实现对创业板综合指数的紧密跟踪。本基金对主动投资部分采取积极配置策略，力争在跟踪误差控制范围内，使基金的业绩超越创业板综合指数表现。
业绩比较基准	创业板综合指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率×5%（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	郭明
	联系电话	021-38650788	010-66105799
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588
传真		021-33830166	010-66105798

注册地址	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	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	杨仓兵	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C
本期已实现收益	-766,685.66	-1,254,189.52
本期利润	1,922,626.93	2,601,787.97
加权平均基金份额本期利润	0.0777	0.0725
本期加权平均净值利润率	4.65%	4.42%
本期基金份额净值增长率	4.80%	4.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C
期末可供分配利润	13,942,933.53	18,539,584.71
期末可供分配基金份额利润	0.5182	0.4830
期末基金资产净值	44,890,104.36	62,774,185.94

期末基金份额净值	1.6682	1.6353
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C
基金份额累计净值增长率	66.82%	63.53%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 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

##### 海富通创业板增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	1.54%	1.03%	1.00%	1.17%	0.54%	-0.14%
过去三个月	-0.68%	0.88%	-2.51%	1.01%	1.83%	-0.13%
过去六个月	4.80%	0.88%	5.97%	0.96%	-1.17%	-0.08%
过去一年	-12.26%	1.14%	-6.59%	1.15%	-5.67%	-0.01%
过去三年	10.45%	1.49%	8.14%	1.47%	2.31%	0.02%
自基金合同生效起至今	66.82%	1.50%	27.89%	1.57%	38.93%	-0.07%

##### 海富通创业板增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	1.51%	1.03%	1.00%	1.17%	0.51%	-0.14%
过去三个月	-0.78%	0.88%	-2.51%	1.01%	1.73%	-0.13%
过去六个月	4.60%	0.88%	5.97%	0.96%	-1.37%	-0.08%
过去一年	-12.60%	1.14%	-6.59%	1.15%	-6.01%	-0.01%
过去三年	9.14%	1.49%	8.14%	1.47%	1.00%	0.02%
自基金合同生效起至今	63.53%	1.50%	27.89%	1.57%	35.64%	-0.07%

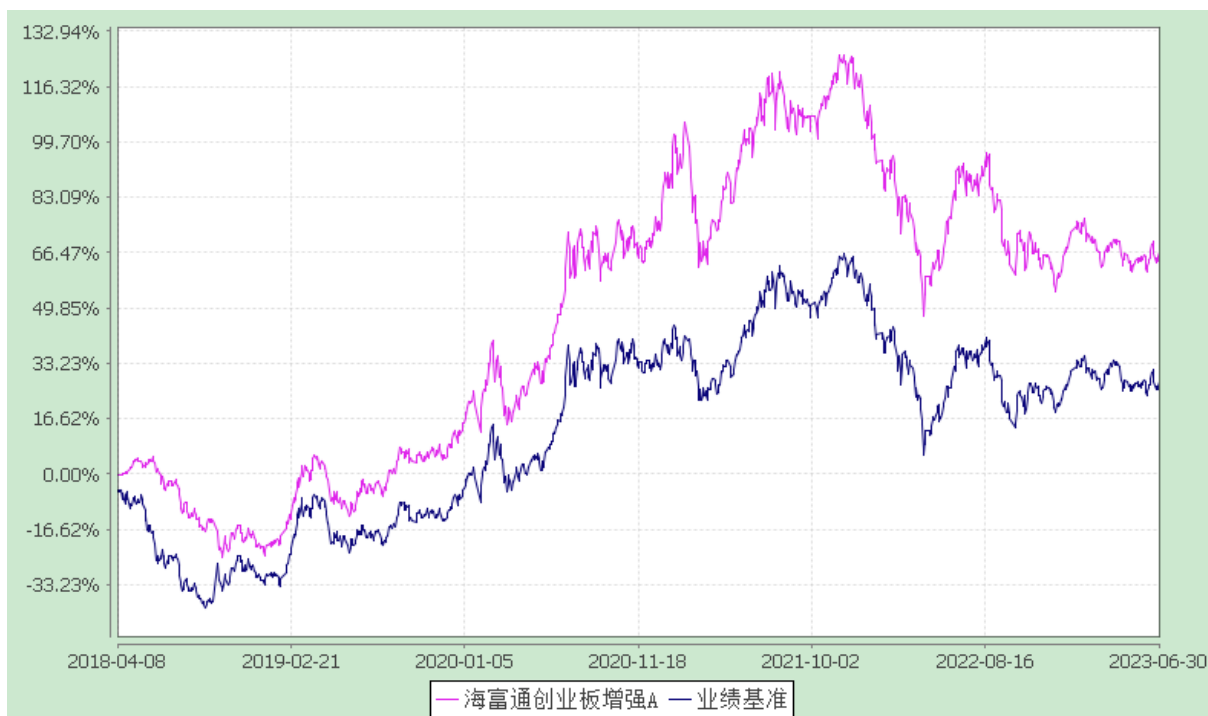
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 4 月 8 日至 2023 年 6 月 30 日)

海富通创业板增强 A



海富通创业板增强 C



注：本基金合同于 2018 年 4 月 8 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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 90 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指

数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通欣润混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜晓海	本基金的基金经理；总经理助理兼量化投资部总监。	2018-04-09	-	23 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通基金管理有限公司总经理助理兼

				<p>量化投资部总监。2016 年 6 月起任海富通安颐收益混合(原海富通养老收益混合)基金经理。2016 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 10 月兼任海富通富睿混合(现海富通沪深 300 增强)基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至 2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月至 2021 年 7 月兼任海富通中证 500 增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 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 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的样本，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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，国内经济总体呈现复苏态势，其中一季度由于积压需求释放表现尤其明显。3 月后经济运行有所放缓，总需求的修复本身需要一个过程，经济仍在主动去库存阶段，价格端呈现下行态势，但总体来说，上半年宏观经济呈现稳中向好态势，政策定力较足。海外方面，美国一季度发生银行业危机事件，美联储降息的预期时点一度被提前。但美国经济在二季度仍表现较强韧性，通胀读数仍偏高，市场对美国经济衰退的预期不断延后，相应利率终点的预期也后移，影响全球资产价格。产业端，上半年 AI 浪潮席卷全球，全球科技巨头大量增加相关资本开支，一些 AI 应用逐渐涌现，全球主要科技巨头走出牛市行情。

A 股市场整体表现稍弱，风格出现明显切换。春节前，顺周期风格下消费、金融、部分周期品、地产链涨幅靠前，出行链、新能源等资产表现较弱。随着 3 月后国内经济走弱以及 AI 科技浪潮爆发，权益市场出现明显风格切换，以 TMT 为代表的科技成长板块及以低估值、高股息为代表的“中特估”板块表现较好。二季度市场呈现了主题投资活跃的状态。

上半年 A 股主要指数表现方面，上证指数上涨 3.65%，沪深 300 下跌 0.75%，中证 800 上涨 0.02%，

中小综指上涨 2.25%，创业板指下跌 5.61%。分行业看，成长板块表现较强，通信、传媒、计算机行业分别上涨 50.7%、42.8%、27.6%；顺周期与消费板块相对落后，房地产和建筑材料行业分别下跌 14.3%、10.5%，商贸零售、美容护理、食品饮料行业分别下跌 23.4%、13.6%、9.1%。

从上半年市场内部结构来看，主线还是在成长，中字头央企行情也表现亮眼。成长主线基本从 2 月份开始演绎，随着 OpenAI 的 AI 软件全球用户数量的快速上升，3-4 月市场沿着应用-大模型-基础算力的产业变化在传媒、计算机、通信等板块寻找投资机会。由于全球科技龙头相关资本开支的快速增加，算力板块表现尤其突出。另外，由于消费疫后复苏条线预期充分，白酒、航空、机场等相关板块上半年表现弱势，而新能源板块跟随自身产业周期，调整幅度也较大。整体而言，市场上半年反映了中国经济内在结构调整的运行节奏，也反映了市场对产业优化升级的期待，产业逻辑仍是主导市场的线索。

本报告期，在力求对创业板综指进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通创业板增强 A 净值增长率为 4.80%，同期业绩比较基准收益率为 5.97%，基金净值跑输业绩比较基准 1.17 个百分点。海富通创业板增强 C 净值增长率为 4.60%，同期业绩比较基准收益率为 5.97%，基金净值跑输业绩比较基准 1.37 个百分点。报告期内，市场的预期博弈强于基本面，上半年市场风格波动剧烈，组合没能及时做出相应调整，股票部分表现不佳，导致基金净值跑输基准。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着宏观政策基调转向稳增长，国内经济预期企稳，将进入自然复苏阶段，经济复苏的态势将延续。从库存周期看，下半年中美经济周期均将进入被动去库存阶段，今年年底明年年初可能进入主动补库存阶段，内需将逐步企稳回升，外需保持较强韧性。同时，在房地产市场托底、地方债务化解背景下，国内货币政策将保持宽松状态，流动性合理充裕，对 A 股较为偏正面。海外，美联储加息周期也行至尾声，对全球风险资产估值的压制减轻。同时，随着国内外政策态度的明朗，上半年市场风险偏好逐步下行的过程基本结束，下半年风险偏好有望回升。

下半年，继续关注政策驱动、产业驱动的投资主线。结构上，受益于近期宏观政策的调整，顺周期核心资产包括消费、地产链、部分库存偏低的商品及制造业，将有修复性机会。以 AI 为代表的 TMT 板块，更多地需要关注其自身的技术、产品等产业周期发展，关注国内外 AI 应用的进展。中期看，经济结构变化带来的红利较为确定，汽车、半导体等受益于产业趋势及政策导向的行业，或

更加容易把握。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——海富通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净

值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	764,842.96	1,261,166.11
结算备付金		236,542.22	250,218.64
存出保证金		15,825.67	16,700.73
交易性金融资产	6.4.7.2	106,441,049.75	92,021,688.63
其中：股票投资		101,377,567.40	87,953,376.39
基金投资		-	-
债券投资		5,063,482.35	4,068,312.24
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		407,969.41	208,662.04
应收股利		-	-
应收申购款		304,003.48	67,081.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		108,170,233.49	93,825,517.86
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		152,752.46	81,633.92
应付管理人报酬		103,388.47	98,824.74
应付托管费		17,231.40	16,470.78
应付销售服务费		20,130.42	19,724.74
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	212,440.44	393,822.84
负债合计		505,943.19	610,477.02
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	65,296,393.46	59,183,225.56
未分配利润	6.4.7.8	42,367,896.84	34,031,815.28
净资产合计		107,664,290.30	93,215,040.84
负债和净资产总计		108,170,233.49	93,825,517.86

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.6682 元，C 类基金份额净值 1.6353 元。基金份额总额 65,296,393.46 份，其中 A 类基金份额 26,908,673.65 份，C 类基金份额 38,387,719.81 份。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		5,511,993.82	-16,037,195.88
1.利息收入		4,965.30	11,261.40
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,965.30	11,261.40
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,074,693.88	-3,600,970.46
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,891,672.03	-4,220,442.07



基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	69,269.39	58,559.35
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-17,165.11
股利收益	6.4.7.14	747,708.76	578,077.37
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	6,545,290.08	-12,502,200.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	36,432.32	54,713.80
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>987,578.92</b>	<b>1,060,146.21</b>
1. 管理人报酬		596,530.68	632,078.03
2. 托管费		99,421.77	105,346.27
3. 销售服务费		116,722.45	137,959.28
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		10.24	-
其中：卖出回购金融资产支出		10.24	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		0.01	0.07
8. 其他费用	6.4.7.17	174,893.77	184,762.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>4,524,414.90</b>	<b>-17,097,342.09</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>4,524,414.90</b>	<b>-17,097,342.09</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>4,524,414.90</b>	<b>-17,097,342.09</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	59,183,225.56	-	34,031,815.28	93,215,040.84
二、本期期初净	59,183,225.56	-	34,031,815.28	93,215,040.84

资产（基金净值）				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,113,167.90	-	8,336,081.56	14,449,249.46
（一）、综合收益总额	-	-	4,524,414.90	4,524,414.90
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	6,113,167.90	-	3,811,666.66	9,924,834.56
其中：1.基金申购款	18,037,103.63	-	11,591,788.75	29,628,892.38
2.基金赎回款	-11,923,935.73	-	-7,780,122.09	-19,704,057.82
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	65,296,393.46	-	42,367,896.84	107,664,290.30
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	58,164,119.08	-	68,551,827.83	126,715,946.91
二、本期期初净资产（基金净值）	58,164,119.08	-	68,551,827.83	126,715,946.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,042,156.77	-	-18,148,187.73	-19,190,344.50
（一）、综合收益总额	-	-	-17,097,342.09	-17,097,342.09
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,042,156.77	-	-1,050,845.64	-2,093,002.41
其中：1.基金申购	20,346,894.64	-	16,286,118.97	36,633,013.61

款				
2.基金赎回款	-21,389,051.41	-	-17,336,964.61	-38,726,016.02
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	57,121,962.31	-	50,403,640.10	107,525,602.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：胡光涛，会计机构负责人：胡正万

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]1237 号文《关于准予海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金注册的批复》注册,由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为发起式股票型证券投资基金,运作方式为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 39,773,225.86 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0254 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 8 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 39,787,405.14 份,A 类基金份额 23,917,653.02 份, C 类基金份额 15,869,752.12 份,其中认购资金利息折合 A 基金份额 8,924.90 份,认购资金利息折合 C 基金份额 5,254.38 份。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,基金管理人作为发起资金的提供方认购的金额为 1,000 万元且承诺持有期限不少于三年。

根据《海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的 90%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;本基金在每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。如以后法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的业绩比较基准为:创业板综合指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率 $\times$ 5%(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2023 年 8 月 30 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	764,842.96
等于：本金	764,608.51
加：应计利息	234.45
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	764,842.96

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	97,840,068.48	-	101,377,567.40	3,537,498.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	45,982.35		
	市场	5,004,008.00	5,063,482.35	13,492.00
	银行间		-	
	市场	-	-	-
合计	5,004,008.00	45,982.35	5,063,482.35	13,492.00
资产支持证券	-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	102,844,076.48	45,982.35	106,441,049.75	3,550,990.92

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	69.21
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	87,904.46
其中：交易所市场	87,904.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	74,466.77
应付指数使用费	50,000.00
合计	212,440.44

#### 6.4.7.7 实收基金

海富通创业板增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,241,101.09	24,241,101.09
本期申购	5,267,070.16	5,267,070.16
本期赎回（以“-”号填列）	-2,599,497.60	-2,599,497.60
本期末	26,908,673.65	26,908,673.65

海富通创业板增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,942,124.47	34,942,124.47
本期申购	12,770,033.47	12,770,033.47
本期赎回（以“-”号填列）	-9,324,438.13	-9,324,438.13
本期末	38,387,719.81	38,387,719.81

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.7.8 未分配利润**

海富通创业板增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,301,105.20	1,044,188.57	14,345,293.77
本期利润	-766,685.66	2,689,312.59	1,922,626.93
本期基金份额交易产生的变动数	1,408,513.99	304,996.02	1,713,510.01
其中：基金申购款	2,821,720.75	647,236.23	3,468,956.98
基金赎回款	-1,413,206.76	-342,240.21	-1,755,446.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,942,933.53	4,038,497.18	17,981,430.71

海富通创业板增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,035,703.76	1,650,817.75	19,686,521.51
本期利润	-1,254,189.52	3,855,977.49	2,601,787.97



本期基金份额交易产生的变动数	1,758,070.47	340,086.18	2,098,156.65
其中：基金申购款	6,499,397.56	1,623,434.21	8,122,831.77
基金赎回款	-4,741,327.09	-1,283,348.03	-6,024,675.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,539,584.71	5,846,881.42	24,386,466.13

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	3,057.62	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	1,756.99	
其他	150.69	
合计	4,965.30	

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	122,911,625.27	
减：卖出股票成本总额	124,494,406.77	
减：交易费用	308,890.53	
买卖股票差价收入	-1,891,672.03	

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
债券投资收益——利息收入	43,264.69	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	26,004.70	
债券投资收益——赎回差价收入	-	
债券投资收益——申购差价收入	-	
合计	69,269.39	

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,396,535.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,289,654.00
减：应计利息总额	80,872.00
减：交易费用	4.66
买卖债券差价收入	26,004.70

**6.4.7.12 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.13 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	747,708.76
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	747,708.76

**6.4.7.14 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	6,545,290.08
——股票投资	6,537,171.60
——债券投资	8,118.48
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-

合计	6,545,290.08
----	--------------

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	36,291.53
基金转换费收入	140.79
合计	36,432.32

注：本基金赎回费收入、转换费收入归入基金财产部分具体见本基金基金合同、招募说明书（更新）等法律文件规定。

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	49,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	427.00
指数使用费	100,000.00
合计	174,893.77

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000 元。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
海通证券	60,530,566.70	23.89%	30,855,854.04	21.91%

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
海通证券	43,661.47	26.30%	43,661.47	49.67%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
海通证券	21,948.00	24.81%	-	-

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	596,530.68	632,078.03
其中：支付销售机构的客户维护费	171,388.10	142,765.83

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 x1.20%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	99,421.77	105,346.27

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 x0.20%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通创业板增强A	海富通创业板增强C	合计
工商银行	-	20,100.07	20,100.07
海通证券	-	19,152.14	19,152.14
海富通基金	-	25,771.15	25,771.15
合计	-	65,023.36	65,023.36
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通创业板增强A	海富通创业板增强C	合计
工商银行	-	21,849.55	21,849.55
海通证券	-	18,667.77	18,667.77
海富通基金	-	58,817.59	58,817.59
合计	-	99,334.91	99,334.91

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.40%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。销售服务费的计算方法如下：日销售服务费=前一日 C 类份额的基金资产净值 x0.40%/当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	海富通创业板增强A	海富通创业板增强C	海富通创业板增强A	海富通创业板增强C
期初持有的基金份额	10,493,445.94	-	10,493,445.94	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	10,493,445.94	-	10,493,445.94	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	39.00%	-	49.19%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	764,842.96	3,057.62	2,327,109.60	5,214.58

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
海通证券	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
海通证券	301228	实朴检测	网下发行	2,191	43,995.28

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

## 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

## 6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新股锁定	11.88	21.02	130	1,544.40	2,732.60	-
00136	海森	2023-0	6个月	新股	44.48	39.48	20	889.60	789.60	-

7	药业	3-30		锁定						
001380	华纬科技	2023-05-09	6个月	新股锁定	28.84	30.78	61	1,759.24	1,877.58	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6个月	新股锁定	41.20	42.69	77	3,172.40	3,287.13	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6个月	新股锁定	56.50	52.93	45	2,542.50	2,381.85	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6个月	新股锁定	34.00	34.93	78	2,652.00	2,724.54	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	885	22,850.70	22,850.70	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股未上市并锁定	25.82	25.82	99	2,556.18	2,556.18	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	新股锁定	57.88	49.17	70	4,051.60	3,441.90	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	新股锁定	35.66	33.26	111	3,958.26	3,691.86	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6个月	新股锁定	72.50	58.42	54	3,915.00	3,154.68	-
301260	格力博	2023-01-20	6个月	新股锁定	30.85	23.63	193	5,954.05	4,560.59	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月	新股锁定	38.13	31.03	139	5,300.07	4,313.17	-
301292	海科新源	2023-06-29	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	1,607	32,123.93	32,123.93	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个月	新股未上市并锁定	19.99	19.99	179	3,578.21	3,578.21	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	新股锁定	29.60	71.42	97	2,871.20	6,927.74	-
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	新股锁定	32.29	51.12	87	2,809.23	4,447.44	-
301320	豪江智能	2023-06-01	6个月	新股锁定	13.06	20.62	287	3,748.22	5,917.94	-
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	新股锁定	39.06	39.36	66	2,577.96	2,597.76	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	新股锁定	32.60	30.37	73	2,379.80	2,217.01	-
30134	涛涛	2023-0	6个月	新股	73.45	46.64	34	2,497.	1,585.	-



5	车业	3-10		锁定				30	76	
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月	新股锁定	50.00	48.39	54	2,700.00	2,613.06	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	新股锁定	23.77	42.89	123	2,923.71	5,275.47	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6个月	新股锁定	71.88	92.60	41	2,947.08	3,796.60	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	新股锁定	33.73	31.85	83	2,799.59	2,643.55	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	新股锁定	24.66	22.51	137	3,378.42	3,083.87	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6个月	新股锁定	23.80	32.84	128	3,046.40	4,203.52	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新股锁定	29.99	23.79	97	2,909.03	2,307.63	-
301387	光大同创	2023-04-10	6个月	新股锁定	58.32	45.36	77	4,490.64	3,492.72	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6个月	新股锁定	24.80	43.85	127	3,149.60	5,568.95	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月	新股锁定	26.35	30.60	81	2,134.35	2,478.60	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	新股锁定	19.99	16.90	130	2,598.70	2,197.00	-

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118036	力合转债	2023-06-29	1个月内(含)	老股东配债	100.00	100.00	80	8,000.00	8,000.16	-

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

## 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行

人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.01%（2022 年 12 月 31 日：0.02%）。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,055,482.19	4,051,363.29
合计	5,055,482.19	4,051,363.29

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	16,948.95
AAA 以下	8,000.16	-
未评级	-	-
合计	8,000.16	16,948.95

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均能及时变现。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性

金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	764,842.96	-	-	-	764,842.96
结算备付金	236,542.22	-	-	-	236,542.22
存出保证金	15,825.67	-	-	-	15,825.67
交易性金融资产	5,055,482.19	-	8,000.16	101,377,567.40	106,441,049.75
应收清算款	-	-	-	407,969.41	407,969.41
应收申购款	-	-	-	304,003.48	304,003.48
资产总计	6,072,693.04	-	8,000.16	102,089,540.29	108,170,233.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	152,752.46	152,752.46
应付管理人报酬	-	-	-	103,388.47	103,388.47
应付托管费	-	-	-	17,231.40	17,231.40
应付销售服务费	-	-	-	20,130.42	20,130.42
其他负债	-	-	-	212,440.44	212,440.44
负债总计	-	-	-	505,943.19	505,943.19
利率敏感度缺口	6,072,693.04	-	8,000.16	101,583,597.10	107,664,290.30
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	1,261,166.11	-	-	-	1,261,166.11
结算备付金	250,218.64	-	-	-	250,218.64
存出保证金	16,700.73	-	-	-	16,700.73
交易性金融资产	4,051,363.29	16,948.95	-	87,953,376.39	92,021,688.63
应收清算款	-	-	-	208,662.04	208,662.04
应收申购款	-	-	-	67,081.71	67,081.71
资产总计	5,579,448.77	16,948.95	-	88,229,120.14	93,825,517.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	81,633.92	81,633.92
应付管理人报酬	-	-	-	98,824.74	98,824.74
应付托管费	-	-	-	16,470.78	16,470.78
应付销售服务费	-	-	-	19,724.74	19,724.74
其他负债	-	-	-	393,822.84	393,822.84
负债总计	-	-	-	610,477.02	610,477.02
利率敏感度缺口	5,579,448.77	16,948.95	-	87,618,643.12	93,215,040.84

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2023年6月30日	2022年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-6,815.93	-3,296.48
	市场利率下降 25 个基点	6,843.37	3,309.00

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易

的股票、存托凭证和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产和存托凭证投资比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	101,377,567. 40	94.16	87,953,376.39	94.36
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	101,377,567. 40	94.16	87,953,376.39	94.36

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

	影响金额（单位：人民币元）	
	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	4,214,917.16	4,678,484.27
2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-4,214,917.16	-4,678,484.27

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	101,222,148.26	87,738,844.78
第二层次	5,124,591.37	4,157,390.49
第三层次	94,310.12	125,453.36
合计	106,441,049.75	92,021,688.63

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：



同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	101,377,567.40	93.72
	其中：股票	101,377,567.40	93.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,063,482.35	4.68
	其中：债券	5,063,482.35	4.68
	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	1,001,385.18	0.93
8	其他各项资产	727,798.56	0.67
9	合计	108,170,233.49	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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	511,029.35	0.47
B	采矿业	503,142.00	0.47
C	制造业	73,789,014.88	68.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	476,978.00	0.44
E	建筑业	1,333,570.00	1.24
F	批发和零售业	838,062.47	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	233,772.00	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,344,434.05	10.54
J	金融业	1,782,626.80	1.66
K	房地产业	92,846.00	0.09
L	租赁和商务服务业	640,155.45	0.59
M	科学研究和技术服务业	5,252,749.21	4.88
N	水利、环境和公共设施管理业	717,381.00	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,826,064.09	1.70
R	文化、体育和娱乐业	2,035,742.10	1.89
S	综合	-	-
	合计	101,377,567.40	94.16

### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	42,980	9,833,394.20	9.13
2	300760	迈瑞医疗	21,100	6,325,780.00	5.88
3	300274	阳光电源	31,500	3,673,845.00	3.41
4	300059	东方财富	111,704	1,586,196.80	1.47
5	300316	晶盛机电	21,900	1,552,710.00	1.44

6	300015	爱尔眼科	77,077	1,429,778.35	1.33
7	300887	谱尼测试	35,320	1,397,965.60	1.30
8	300308	中际旭创	8,260	1,217,937.00	1.13
9	300146	汤臣倍健	47,500	1,139,050.00	1.06
10	300124	汇川技术	16,550	1,062,675.50	0.99
11	300416	苏试试验	48,787	1,051,847.72	0.98
12	300130	新国都	30,600	866,898.00	0.81
13	300223	北京君正	9,600	847,776.00	0.79
14	300982	苏文电能	13,100	793,336.00	0.74
15	300470	中密控股	17,000	785,740.00	0.73
16	300408	三环集团	26,700	783,645.00	0.73
17	301179	泽宇智能	22,400	754,880.00	0.70
18	300476	胜宏科技	30,600	737,766.00	0.69
19	300634	彩讯股份	26,400	696,960.00	0.65
20	300938	信测标准	15,500	678,900.00	0.63
21	300592	华凯易佰	24,900	677,778.00	0.63
22	300811	铂科新材	10,820	643,140.80	0.60
23	300384	三联虹普	36,800	625,232.00	0.58
24	300118	东方日升	23,600	604,868.00	0.56
25	300866	安克创新	6,800	595,000.00	0.55
26	300360	炬华科技	32,760	585,748.80	0.54
27	300002	神州泰岳	41,100	575,400.00	0.53
28	300638	广和通	24,987	566,705.16	0.53
29	300036	超图软件	23,700	561,927.00	0.52
30	300773	拉卡拉	31,000	540,640.00	0.50
31	300674	宇信科技	29,740	525,803.20	0.49
32	300358	楚天科技	35,100	524,043.00	0.49
33	300504	天邑股份	25,600	513,792.00	0.48
34	300284	苏交科	84,800	508,800.00	0.47
35	300502	新易盛	7,439	505,628.83	0.47
36	300533	冰川网络	9,550	477,118.00	0.44
37	300443	金雷股份	13,300	471,485.00	0.44
38	300407	凯发电气	51,000	465,630.00	0.43
39	300837	浙矿股份	11,400	437,760.00	0.41
40	300031	宝通科技	17,600	435,072.00	0.40
41	300628	亿联网络	12,300	431,361.00	0.40
42	300494	盛天网络	17,280	428,371.20	0.40
43	300009	安科生物	42,224	422,240.00	0.39
44	300315	掌趣科技	53,000	413,400.00	0.38
45	300660	江苏雷利	10,680	407,976.00	0.38
46	300014	亿纬锂能	6,702	405,471.00	0.38
47	300532	今天国际	19,700	405,032.00	0.38
48	000333	美的集团	6,700	394,764.00	0.37
49	300144	宋城演艺	31,800	394,320.00	0.37

50	300627	华测导航	12,140	394,185.80	0.37
51	300109	新开源	15,200	378,024.00	0.35
52	300122	智飞生物	8,400	371,280.00	0.34
53	300687	赛意信息	13,200	366,696.00	0.34
54	300861	美畅股份	8,200	355,634.00	0.33
55	000063	中兴通讯	7,800	355,212.00	0.33
56	300019	硅宝科技	20,700	352,935.00	0.33
57	300820	英杰电气	4,275	352,174.50	0.33
58	300775	三角防务	10,400	351,312.00	0.33
59	300833	浩洋股份	3,200	350,176.00	0.33
60	301061	匠心家居	9,300	343,635.00	0.32
61	300990	同飞股份	6,800	342,040.00	0.32
62	002517	恺英网络	21,500	338,410.00	0.31
63	300724	捷佳伟创	3,000	337,050.00	0.31
64	300171	东富龙	14,700	334,425.00	0.31
65	300298	三诺生物	12,300	332,592.00	0.31
66	300633	开立医疗	6,000	327,000.00	0.30
67	300351	永贵电器	19,900	326,957.00	0.30
68	300181	佐力药业	26,700	326,007.00	0.30
69	300856	科思股份	4,100	322,957.00	0.30
70	300413	芒果超媒	9,410	321,916.10	0.30
71	300138	晨光生物	17,920	320,768.00	0.30
72	300244	迪安诊断	12,100	310,123.00	0.29
73	300314	戴维医疗	14,400	304,416.00	0.28
74	300796	贝斯美	24,120	290,163.60	0.27
75	300570	太辰光	5,200	284,492.00	0.26
76	300765	新诺威	21,960	283,064.40	0.26
77	301087	可孚医疗	5,600	276,080.00	0.26
78	300548	博创科技	7,900	272,155.00	0.25
79	300604	长川科技	5,730	272,117.70	0.25
80	300068	南都电源	13,900	269,104.00	0.25
81	300294	博雅生物	7,400	268,472.00	0.25
82	300442	润泽科技	8,700	267,612.00	0.25
83	603993	洛阳钼业	49,700	264,901.00	0.25
84	300133	华策影视	37,300	264,457.00	0.25
85	600566	济川药业	9,000	261,360.00	0.24
86	300496	中科创达	2,700	260,145.00	0.24
87	300693	盛弘股份	7,039	259,879.88	0.24
88	300415	伊之密	13,400	257,280.00	0.24
89	300642	透景生命	12,720	256,562.40	0.24
90	300058	蓝色光标	26,300	254,321.00	0.24
91	002371	北方华创	800	254,120.00	0.24
92	300286	安科瑞	6,700	253,662.00	0.24
93	300951	博硕科技	4,500	245,835.00	0.23

94	300860	锋尚文化	4,400	243,936.00	0.23
95	300832	新产业	4,134	243,906.00	0.23
96	300037	新宙邦	4,700	243,883.00	0.23
97	300979	华利集团	5,000	243,700.00	0.23
98	301096	百诚医药	4,000	242,440.00	0.23
99	301195	北路智控	5,197	241,972.32	0.22
100	300925	法本信息	17,000	240,210.00	0.22
101	300545	联得装备	8,600	238,822.00	0.22
102	301302	华如科技	6,300	231,840.00	0.22
103	300718	长盛轴承	10,400	231,400.00	0.21
104	300806	斯迪克	12,169	227,803.68	0.21
105	301029	怡合达	5,040	225,187.20	0.21
106	300487	蓝晓科技	3,600	224,712.00	0.21
107	301296	新巨丰	13,200	222,816.00	0.21
108	300569	天能重工	26,271	221,201.82	0.21
109	300396	迪瑞医疗	6,780	220,282.20	0.20
110	300897	山科智能	6,400	219,008.00	0.20
111	688332	中科蓝讯	2,605	217,986.40	0.20
112	300354	东华测试	4,800	214,560.00	0.20
113	300666	江丰电子	3,100	210,676.00	0.20
114	301039	中集车辆	15,800	209,034.00	0.19
115	301129	瑞纳智能	2,800	206,276.00	0.19
116	300684	中石科技	9,300	205,530.00	0.19
117	300498	温氏股份	11,189	205,318.15	0.19
118	300119	瑞普生物	11,500	204,700.00	0.19
119	601058	赛轮轮胎	17,900	203,881.00	0.19
120	300224	正海磁材	15,800	203,188.00	0.19
121	300993	玉马遮阳	17,700	202,665.00	0.19
122	300347	泰格医药	3,116	201,106.64	0.19
123	300697	电工合金	16,700	200,066.00	0.19
124	002126	银轮股份	11,300	200,010.00	0.19
125	300406	九强生物	8,540	199,238.20	0.19
126	300996	普联软件	6,480	198,936.00	0.18
127	600131	国网信通	9,700	195,843.00	0.18
128	300291	百纳千成	27,800	195,712.00	0.18
129	300481	濮阳惠成	9,500	195,320.00	0.18
130	002705	新宝股份	10,800	194,724.00	0.18
131	300185	通裕重工	69,400	193,626.00	0.18
132	300383	光环新网	17,900	192,425.00	0.18
133	300129	泰胜风能	20,000	191,800.00	0.18
134	300986	志特新材	6,800	190,400.00	0.18
135	300127	银河磁体	10,400	188,552.00	0.18
136	300738	奥飞数据	18,446	188,149.20	0.17
137	300957	贝泰妮	2,100	186,648.00	0.17

138	300788	中信出版	5,600	185,976.00	0.17
139	301363	美好医疗	4,200	184,758.00	0.17
140	603305	旭升集团	6,580	183,384.60	0.17
141	300898	熊猫乳品	8,100	181,278.00	0.17
142	300870	欧陆通	3,000	179,790.00	0.17
143	300918	南山智尚	13,000	178,490.00	0.17
144	688257	新锐股份	6,720	178,147.20	0.17
145	301012	扬电科技	6,860	177,331.00	0.16
146	301208	中亦科技	3,200	177,056.00	0.16
147	300033	同花顺	1,000	175,280.00	0.16
148	601668	中国建筑	30,100	172,774.00	0.16
149	300573	兴齐眼药	800	171,040.00	0.16
150	300827	上能电气	4,700	169,435.00	0.16
151	300999	金龙鱼	4,213	168,477.87	0.16
152	300510	金冠股份	24,100	168,218.00	0.16
153	002555	三七互娱	4,800	167,424.00	0.16
154	300394	天孚通信	1,549	165,479.67	0.15
155	300853	申昊科技	4,700	164,970.00	0.15
156	601567	三星医疗	13,000	164,190.00	0.15
157	300567	精测电子	1,700	161,755.00	0.15
158	300515	三德科技	10,000	161,200.00	0.15
159	300692	中环环保	21,800	159,358.00	0.15
160	301018	申菱环境	4,400	158,356.00	0.15
161	300026	红日药业	28,600	155,012.00	0.14
162	300087	荃银高科	14,930	154,376.20	0.14
163	300054	鼎龙股份	6,200	153,326.00	0.14
164	301030	仕净科技	2,200	152,020.00	0.14
165	300474	景嘉微	1,650	148,483.50	0.14
166	300595	欧普康视	4,832	145,878.08	0.14
167	300616	尚品宅配	7,100	143,988.00	0.13
168	300447	全信股份	7,500	143,925.00	0.13
169	300777	中简科技	3,000	141,780.00	0.13
170	601138	工业富联	5,600	141,120.00	0.13
171	300908	仲景食品	3,100	140,585.00	0.13
172	002154	报喜鸟	24,600	135,792.00	0.13
173	300114	中航电测	2,741	134,720.15	0.13
174	300332	天壕环境	11,600	133,052.00	0.12
175	300012	华测检测	6,700	130,650.00	0.12
176	300389	艾比森	6,400	130,368.00	0.12
177	300950	德固特	6,000	127,200.00	0.12
178	002463	沪电股份	5,900	123,546.00	0.11
179	301186	超达装备	3,400	121,924.00	0.11
180	300590	移为通信	9,940	121,466.80	0.11
181	600079	人福医药	4,500	121,230.00	0.11

182	300740	水羊股份	7,800	120,900.00	0.11
183	300864	南大环境	5,500	120,890.00	0.11
184	300782	卓胜微	1,238	119,627.94	0.11
185	300745	欣锐科技	2,700	119,259.00	0.11
186	300166	东方国信	10,546	118,537.04	0.11
187	300136	信维通信	5,900	118,472.00	0.11
188	000811	冰轮环境	7,500	118,200.00	0.11
189	300092	科新机电	7,100	116,440.00	0.11
190	000338	潍柴动力	9,300	115,878.00	0.11
191	300121	阳谷华泰	12,100	115,555.00	0.11
192	300232	洲明科技	12,600	115,164.00	0.11
193	300997	欢乐家	7,900	115,103.00	0.11
194	002050	三花智控	3,800	114,988.00	0.11
195	002158	汉钟精机	4,600	114,816.00	0.11
196	603298	杭叉集团	4,800	113,040.00	0.10
197	300212	易华录	3,400	112,982.00	0.10
198	688239	航宇科技	1,606	112,339.70	0.10
199	300017	网宿科技	15,800	112,338.00	0.10
200	600835	上海机电	6,400	109,952.00	0.10
201	603889	新澳股份	14,600	109,646.00	0.10
202	002851	麦格米特	3,000	109,410.00	0.10
203	601857	中国石油	14,600	109,062.00	0.10
204	603801	志邦家居	3,300	108,966.00	0.10
205	301158	德石股份	6,200	107,322.00	0.10
206	300789	唐源电气	5,200	107,224.00	0.10
207	301119	正强股份	4,030	107,198.00	0.10
208	300170	汉得信息	9,200	106,168.00	0.10
209	300306	远方信息	8,400	105,924.00	0.10
210	300433	蓝思科技	9,000	105,840.00	0.10
211	002046	国机精工	8,200	104,632.00	0.10
212	301256	华融化学	11,800	104,548.00	0.10
213	000589	贵州轮胎	18,600	104,160.00	0.10
214	688128	中国电研	4,068	103,734.00	0.10
215	300491	通合科技	3,600	103,320.00	0.10
216	301035	润丰股份	1,300	102,141.00	0.09
217	300661	圣邦股份	1,235	101,430.55	0.09
218	301167	建研设计	5,700	100,890.00	0.09
219	600582	天地科技	17,300	100,859.00	0.09
220	605133	嵘泰股份	2,900	100,804.00	0.09
221	300863	卡倍亿	1,600	100,656.00	0.09
222	300795	米奥会展	2,400	100,104.00	0.09
223	002674	兴业科技	8,100	100,035.00	0.09
224	300509	新美星	13,200	99,660.00	0.09
225	002011	盾安环境	7,200	99,576.00	0.09

226	301161	唯万密封	4,300	99,373.00	0.09
227	601369	陕鼓动力	10,900	99,299.00	0.09
228	300369	绿盟科技	8,000	98,960.00	0.09
229	002790	瑞尔特	10,300	98,880.00	0.09
230	002533	金杯电工	12,100	98,736.00	0.09
231	300395	菲利华	2,000	98,400.00	0.09
232	600458	时代新材	8,200	98,318.00	0.09
233	300041	回天新材	8,320	98,176.00	0.09
234	000960	锡业股份	6,300	97,965.00	0.09
235	600612	老凤祥	1,400	97,832.00	0.09
236	300390	天华新能	2,730	97,734.00	0.09
237	688588	凌志软件	6,284	97,716.20	0.09
238	300596	利安隆	2,400	97,608.00	0.09
239	603279	景津装备	3,100	97,216.00	0.09
240	300629	新劲刚	4,680	96,548.40	0.09
241	688626	翔宇医疗	2,119	96,435.69	0.09
242	601333	广深铁路	24,300	96,228.00	0.09
243	300439	美康生物	8,500	96,135.00	0.09
244	603920	世运电路	4,900	95,697.00	0.09
245	300664	鹏鹞环保	16,900	95,654.00	0.09
246	002334	英威腾	7,500	95,550.00	0.09
247	601117	中国化学	11,500	95,220.00	0.09
248	603338	浙江鼎力	1,700	95,217.00	0.09
249	002266	浙富控股	23,000	94,990.00	0.09
250	300003	乐普医疗	4,200	94,962.00	0.09
251	600426	华鲁恒升	3,100	94,953.00	0.09
252	600004	白云机场	6,600	94,644.00	0.09
253	600267	海正药业	8,300	94,454.00	0.09
254	002984	森麒麟	3,000	94,380.00	0.09
255	000921	海信家电	3,500	94,325.00	0.09
256	301109	军信股份	5,700	94,107.00	0.09
257	300457	赢合科技	5,300	93,598.00	0.09
258	002937	兴瑞科技	3,800	93,480.00	0.09
259	600674	川投能源	6,200	93,310.00	0.09
260	603035	常熟汽饰	4,800	93,264.00	0.09
261	600572	康恩贝	13,600	93,160.00	0.09
262	600570	恒生电子	2,100	93,009.00	0.09
263	688009	中国通号	16,023	92,933.40	0.09
264	600861	北京人力	4,000	92,800.00	0.09
265	000938	紫光股份	2,900	92,365.00	0.09
266	301301	川宁生物	10,300	92,288.00	0.09
267	601899	紫金矿业	8,100	92,097.00	0.09
268	002832	比音勒芬	2,600	92,066.00	0.09
269	603690	至纯科技	2,640	91,977.60	0.09



270	600970	中材国际	7,200	91,800.00	0.09
271	601390	中国中铁	12,100	91,718.00	0.09
272	002035	华帝股份	12,900	91,590.00	0.09
273	300896	爱美客	205	91,214.75	0.08
274	002276	万马股份	7,500	90,825.00	0.08
275	603043	广州酒家	3,200	90,432.00	0.08
276	300790	宇瞳光学	5,900	89,916.00	0.08
277	000933	神火股份	6,900	89,700.00	0.08
278	301102	兆讯传媒	3,335	89,611.45	0.08
279	301063	海锅股份	3,200	89,152.00	0.08
280	600027	华电国际	13,300	88,977.00	0.08
281	600248	陕建股份	18,600	88,722.00	0.08
282	601877	正泰电器	3,200	88,480.00	0.08
283	002990	盛视科技	2,400	88,320.00	0.08
284	603345	安井食品	600	88,080.00	0.08
285	300182	捷成股份	13,900	87,709.00	0.08
286	600138	中青旅	7,000	87,570.00	0.08
287	603507	振江股份	2,400	87,024.00	0.08
288	000997	新大陆	4,600	86,940.00	0.08
289	300423	昇辉科技	7,100	86,762.00	0.08
290	000733	振华科技	900	86,265.00	0.08
291	300132	青松股份	15,200	86,184.00	0.08
292	300450	先导智能	2,380	86,084.60	0.08
293	688385	复旦微电	1,711	85,721.10	0.08
294	600977	中国电影	6,100	85,705.00	0.08
295	300525	博思软件	5,581	85,612.54	0.08
296	300915	海融科技	2,300	85,399.00	0.08
297	603986	兆易创新	800	85,000.00	0.08
298	688589	力合微	2,079	84,698.46	0.08
299	600941	中国移动	900	83,970.00	0.08
300	600325	华发股份	8,500	83,725.00	0.08
301	688012	中微公司	533	83,387.85	0.08
302	300349	金卡智能	6,000	83,280.00	0.08
303	300761	立华股份	4,500	82,935.00	0.08
304	600600	青岛啤酒	800	82,904.00	0.08
305	300791	仙乐健康	2,850	82,764.00	0.08
306	300251	光线传媒	10,200	82,518.00	0.08
307	300705	九典制药	3,120	82,461.60	0.08
308	688099	晶晨股份	976	82,296.32	0.08
309	301188	力诺特玻	4,800	81,984.00	0.08
310	002015	协鑫能科	6,100	81,923.00	0.08
311	301069	凯盛新材	3,200	81,408.00	0.08
312	002410	广联达	2,500	81,225.00	0.08
313	300253	卫宁健康	7,500	81,150.00	0.08

314	601689	拓普集团	1,000	80,700.00	0.07
315	300855	图南股份	2,275	80,353.00	0.07
316	600803	新奥股份	4,200	79,716.00	0.07
317	003006	百亚股份	4,600	79,488.00	0.07
318	301267	华夏眼科	1,300	79,235.00	0.07
319	688425	铁建重工	16,472	79,230.32	0.07
320	600309	万华化学	900	79,056.00	0.07
321	300575	中旗股份	7,600	78,888.00	0.07
322	000400	许继电气	3,400	78,370.00	0.07
323	300451	创业慧康	9,317	78,076.46	0.07
324	002345	潮宏基	9,900	77,814.00	0.07
325	301236	软通动力	2,850	77,548.50	0.07
326	300565	科信技术	4,600	77,372.00	0.07
327	300438	鹏辉能源	1,600	76,864.00	0.07
328	300759	康龙化成	2,000	76,560.00	0.07
329	301235	华康医疗	2,400	76,368.00	0.07
330	603590	康辰药业	2,300	76,360.00	0.07
331	300723	一品红	2,600	76,180.00	0.07
332	688019	安集科技	450	74,173.50	0.07
333	300357	我武生物	2,200	73,986.00	0.07
334	300763	锦浪科技	710	73,911.00	0.07
335	300882	万胜智能	2,600	73,788.00	0.07
336	300373	扬杰科技	1,800	73,026.00	0.07
337	300115	长盈精密	6,100	72,651.00	0.07
338	300285	国瓷材料	2,650	72,610.00	0.07
339	300418	昆仑万维	1,800	72,504.00	0.07
340	000988	华工科技	1,900	72,219.00	0.07
341	300682	朗新科技	3,100	72,168.00	0.07
342	300421	力星股份	6,020	71,878.80	0.07
343	300601	康泰生物	2,800	71,092.00	0.07
344	301117	佳缘科技	1,100	71,082.00	0.07
345	600475	华光环能	5,900	70,092.00	0.07
346	300968	格林精密	7,700	68,453.00	0.06
347	300511	雪榕生物	9,000	68,400.00	0.06
348	601126	四方股份	4,500	68,355.00	0.06
349	300911	亿田智能	1,800	68,346.00	0.06
350	300040	九洲集团	10,900	68,343.00	0.06
351	300822	贝仕达克	5,000	68,200.00	0.06
352	301216	万凯新材	4,068	67,650.84	0.06
353	688621	阳光诺和	1,140	67,054.80	0.06
354	300259	新天科技	16,700	66,967.00	0.06
355	603187	海容冷链	3,300	65,967.00	0.06
356	301080	百普赛斯	1,050	65,961.00	0.06
357	301135	瑞德智能	2,400	65,808.00	0.06

358	300689	澄天伟业	2,800	65,436.00	0.06
359	300414	中光防雷	6,600	65,340.00	0.06
360	300994	久祺股份	4,200	64,848.00	0.06
361	300534	陇神戎发	6,400	64,768.00	0.06
362	300388	节能国祯	9,600	64,416.00	0.06
363	300770	新媒股份	1,400	64,204.00	0.06
364	300824	北鼎股份	6,100	63,928.00	0.06
365	600210	紫江企业	12,000	63,840.00	0.06
366	300878	维康药业	2,800	63,560.00	0.06
367	300030	阳普医疗	8,500	63,495.00	0.06
368	301009	可靠股份	5,400	62,802.00	0.06
369	300737	科顺股份	6,820	62,471.20	0.06
370	605009	豪悦护理	1,300	62,400.00	0.06
371	300231	银信科技	7,000	62,370.00	0.06
372	300852	四会富仕	1,500	62,190.00	0.06
373	300468	四方精创	5,800	62,118.00	0.06
374	000062	深圳华强	5,400	61,668.00	0.06
375	002322	理工能科	5,900	61,360.00	0.06
376	300976	达瑞电子	1,200	60,840.00	0.06
377	300546	雄帝科技	3,300	60,819.00	0.06
378	300074	华平股份	14,100	60,771.00	0.06
379	300645	正元智慧	2,200	60,104.00	0.06
380	002027	分众传媒	8,800	59,928.00	0.06
381	300523	辰安科技	2,500	59,650.00	0.06
382	300884	狄耐克	4,500	59,580.00	0.06
383	300528	幸福蓝海	6,300	56,763.00	0.05
384	300910	瑞丰新材	1,110	55,833.00	0.05
385	601728	中国电信	9,900	55,737.00	0.05
386	600637	东方明珠	7,000	54,740.00	0.05
387	002130	沃尔核材	6,400	51,968.00	0.05
388	002648	卫星化学	3,400	50,864.00	0.05
389	300279	和晶科技	8,900	49,751.00	0.05
390	688596	正帆科技	1,142	49,448.60	0.05
391	603444	吉比特	100	49,111.00	0.05
392	000858	五粮液	300	49,071.00	0.05
393	600415	小商品城	5,700	48,621.00	0.05
394	002429	兆驰股份	8,800	48,400.00	0.04
395	603171	税友股份	1,200	47,976.00	0.04
396	300277	海联讯	6,100	47,824.00	0.04
397	600765	中航重机	1,800	47,718.00	0.04
398	603699	纽威股份	3,200	47,616.00	0.04
399	000156	华数传媒	5,400	46,980.00	0.04
400	300543	朗科智能	4,700	46,483.00	0.04
401	601012	隆基绿能	1,600	45,872.00	0.04

402	601098	中南传媒	3,900	45,240.00	0.04
403	301322	绿通科技	800	44,920.00	0.04
404	688390	固德威	264	44,051.04	0.04
405	688110	东芯股份	1,196	43,175.60	0.04
406	601975	招商南油	15,000	42,900.00	0.04
407	688301	奕瑞科技	147	41,517.21	0.04
408	002179	中航光电	890	40,361.50	0.04
409	002987	京北方	1,840	40,332.80	0.04
410	300679	电连技术	1,200	39,660.00	0.04
411	603309	维力医疗	2,400	37,128.00	0.03
412	600497	驰宏锌锗	7,300	36,646.00	0.03
413	300741	华宝股份	1,700	36,414.00	0.03
414	301292	海科新源	1,786	35,702.14	0.03
415	301222	浙江恒威	1,200	35,340.00	0.03
416	300838	浙江力诺	1,900	34,713.00	0.03
417	300771	智莱科技	3,000	32,670.00	0.03
418	300107	建新股份	6,400	31,296.00	0.03
419	300808	久量股份	2,300	31,050.00	0.03
420	300519	新光药业	1,900	30,438.00	0.03
421	000650	仁和药业	4,200	25,788.00	0.02
422	301202	朗威股份	984	25,406.88	0.02
423	603230	内蒙新华	1,900	24,510.00	0.02
424	300900	广联航空	800	23,048.00	0.02
425	300105	龙源技术	3,300	22,143.00	0.02
426	002867	周大生	1,200	21,336.00	0.02
427	002839	张家港行	5,000	21,150.00	0.02
428	600613	神奇制药	3,100	20,832.00	0.02
429	301191	菲菱科思	200	20,684.00	0.02
430	603508	思维列控	1,200	20,460.00	0.02
431	603156	养元饮品	800	19,760.00	0.02
432	300709	精研科技	720	17,762.40	0.02
433	002317	众生药业	1,000	16,990.00	0.02
434	301115	建科股份	700	16,002.00	0.01
435	300893	松原股份	600	15,438.00	0.01
436	301077	星华新材	700	15,001.00	0.01
437	300630	普利制药	721	14,095.55	0.01
438	300568	星源材质	746	12,823.74	0.01
439	301269	华大九天	96	11,792.64	0.01
440	300428	立中集团	500	11,530.00	0.01
441	301297	富乐德	495	11,142.45	0.01
442	300174	元力股份	700	11,039.00	0.01
443	301026	浩通科技	300	10,716.00	0.01
444	300193	佳士科技	1,400	10,696.00	0.01
445	300815	玉禾田	700	10,416.00	0.01

446	300558	贝达药业	200	9,606.00	0.01
447	600048	保利发展	700	9,121.00	0.01
448	301293	三博脑科	97	6,927.74	0.01
449	688378	奥来德	140	6,916.00	0.01
450	301165	锐捷网络	112	6,912.64	0.01
451	601827	三峰环境	900	6,660.00	0.01
452	300001	特锐德	300	6,234.00	0.01
453	301382	蜂助手	173	5,942.32	0.01
454	301320	豪江智能	287	5,917.94	0.01
455	301419	阿莱德	127	5,568.95	0.01
456	688550	瑞联新材	140	5,544.00	0.01
457	301358	湖南裕能	123	5,275.47	0.00
458	301260	格力博	193	4,560.59	0.00
459	301315	威士顿	87	4,447.44	0.00
460	301291	明阳电气	139	4,313.17	0.00
461	301360	荣旗科技	41	3,796.60	0.00
462	301225	恒勃股份	111	3,691.86	0.00
463	301387	光大同创	77	3,492.72	0.00
464	301210	金杨股份	70	3,441.90	0.00
465	301141	中科磁业	77	3,287.13	0.00
466	301232	飞沃科技	54	3,154.68	0.00
467	301337	亚华电子	100	3,145.81	0.00
468	301376	致欧科技	137	3,083.87	0.00
469	001287	中电港	130	2,732.60	0.00
470	301170	锡南科技	78	2,724.54	0.00
471	301373	凌玮科技	83	2,643.55	0.00
472	301357	北方长龙	54	2,613.06	0.00
473	301323	新莱福	66	2,597.76	0.00
474	603730	岱美股份	162	2,559.60	0.00
475	301428	世纪恒通	81	2,478.60	0.00
476	301319	唯特偶	40	2,394.00	0.00
477	301157	华塑科技	45	2,381.85	0.00
478	301386	未来电器	97	2,307.63	0.00
479	300894	火星人	89	2,273.06	0.00
480	301439	泓淋电力	130	2,197.00	0.00
481	300776	帝尔激光	32	2,076.80	0.00
482	001380	华纬科技	61	1,877.58	0.00
483	300825	阿尔特	100	1,829.00	0.00
484	301345	涛涛车业	34	1,585.76	0.00
485	300632	光莆股份	100	1,278.00	0.00
486	300088	长信科技	200	1,206.00	0.00
487	300200	高盟新材	100	851.00	0.00
488	300047	天源迪科	100	814.00	0.00
489	300190	维尔利	200	798.00	0.00

490	001367	海森药业	20	789.60	0.00
491	300230	永利股份	200	708.00	0.00
492	300420	五洋停车	200	656.00	0.00
493	300296	利亚德	100	653.00	0.00
494	300164	通源石油	100	436.00	0.00

注：根据天壕环境股份有限公司于 2023 年 7 月 27 日发布的《关于变更公司名称、证券简称、经营范围暨完成工商变更登记的公告》，自 2023 年 7 月 28 日起，公司的证券简称由“天壕环境”变更为“天壕能源”，证券代码“300332”保持不变。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	2,942,372.00	3.16
2	300760	迈瑞医疗	2,834,848.00	3.04
3	300274	阳光电源	2,290,948.00	2.46
4	300118	东方日升	2,162,373.00	2.32
5	300416	苏试试验	1,724,231.80	1.85
6	300059	东方财富	1,251,569.00	1.34
7	300124	汇川技术	1,191,082.00	1.28
8	300887	谱尼测试	1,106,170.00	1.19
9	300674	宇信科技	1,069,879.00	1.15
10	300682	朗新科技	1,002,672.00	1.08
11	300773	拉卡拉	956,475.00	1.03
12	300476	胜宏科技	918,839.00	0.99
13	300130	新国都	918,188.00	0.99
14	300146	汤臣倍健	912,325.00	0.98
15	300982	苏文电能	804,895.00	0.86
16	300360	炬华科技	804,016.00	0.86
17	300223	北京君正	803,491.00	0.86
18	300407	凯发电气	802,369.00	0.86
19	300630	普利制药	778,012.00	0.83
20	300308	中际旭创	747,085.00	0.80

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产
----	------	------	----------	---------

				产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	1,886,012.60	2.02
2	300682	朗新科技	1,591,518.00	1.71
3	300014	亿纬锂能	1,544,589.00	1.66
4	300118	东方日升	1,534,754.00	1.65
5	300347	泰格医药	1,439,612.04	1.54
6	300124	汇川技术	1,251,429.93	1.34
7	300416	苏试试验	1,208,203.00	1.30
8	300059	东方财富	1,206,263.00	1.29
9	300476	胜宏科技	1,182,265.00	1.27
10	300498	温氏股份	1,115,722.00	1.20
11	300760	迈瑞医疗	1,109,272.00	1.19
12	300680	隆盛科技	1,034,185.40	1.11
13	300438	鹏辉能源	891,688.00	0.96
14	300428	立中集团	874,990.00	0.94
15	300628	亿联网络	870,288.00	0.93
16	300122	智飞生物	858,437.00	0.92
17	300724	捷佳伟创	844,541.00	0.91
18	300982	苏文电能	818,409.14	0.88
19	300258	精锻科技	800,103.90	0.86
20	300496	中科创达	752,299.00	0.81

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	131,381,426.18
卖出股票的收入（成交）总额	122,911,625.27

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比 例(%)
1	国家债券	5,055,482.19	4.70
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）	8,000.16	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,063,482.35	4.70

#### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019694	23 国债 01	50,000	5,055,482.19	4.70
2	118036	力合转债	80	8,000.16	0.01

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 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。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货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。



**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

7.12.1 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。

7.12.2 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。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15,825.67
2	应收清算款	407,969.41
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	304,003.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	727,798.56

**7.12.4 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。

**7.12.5 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。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通创业板增强 A	1,858	14,482.60	10,674,060.90	39.67%	16,234,612.75	60.33%
海富通创业板增强 C	1,954	19,645.71	8,962,905.48	23.35%	29,424,814.33	76.65%
合计	3,812	17,129.17	19,636,966.38	30.07%	45,659,427.08	69.93%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,A、C级比例分母为各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通创业板增强 A	228,744.77	0.8501%
	海富通创业板增强 C	55,497.13	0.1446%
	合计	284,241.90	0.4353%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海富通创业板增强 A	10~50
	海富通创业板增强 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通创业板增强 A	0~10
	海富通创业板增强 C	0
	合计	0~10

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总	持有份额占	发起份额总	发起份额占	发起份额承

	数	基金总份额 比例	数	基金总份额 比例	诺持有期限
基金管理人固有资金	10,493,445.94	16.07%	4,802,250.22	7.35%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,493,445.94	16.07%	4,802,250.22	7.35%	-

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计 1,000.10 万元认购了本基金，其中，认购费用为 1,000.00 元，符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有不少于 3 年。

2、2021 年 4 月 7 日，本基金管理人运用固有资金总计 1000.10 万元申购本基金，其中，申购费为 1,000.00 元。

3、2021 年 5 月 26 日，本基金管理人赎回发起资金持有份额 520.00 万份，本基金合同于 2018 年 4 月 8 日生效，发起份额持有期限自基金合同生效之日已超过 3 年。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 8 日）基金份额总额	23,917,653.02	15,869,752.12
本报告期期初基金份额总额	24,241,101.09	34,942,124.47
本报告期基金总申购份额	5,267,070.16	12,770,033.47
减：本报告期基金总赎回份额	2,599,497.60	9,324,438.13
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	26,908,673.65	38,387,719.81

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

报告期内本基金投资策略未发生改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况****10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

**10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	60,530,566.70	23.89%	43,661.47	26.30%	-
申万宏源	2	57,195,116.27	22.58%	24,097.04	14.51%	-
长江证券	2	32,808,716.89	12.95%	23,665.26	14.25%	-
太平洋证券	2	24,117,919.06	9.52%	17,395.82	10.48%	-
华泰证券	1	23,949,769.64	9.45%	17,513.29	10.55%	-
浙商证券	2	21,417,484.34	8.45%	15,457.18	9.31%	-
兴业证券	2	13,153,093.57	5.19%	9,615.10	5.79%	-
方正证券	3	11,625,133.99	4.59%	8,385.34	5.05%	-
中泰证券	2	6,707,172.08	2.65%	4,904.42	2.95%	-
东方证券	3	1,697,875.18	0.67%	1,242.31	0.75%	-
东吴证券	2	130,641.00	0.05%	94.23	0.06%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

德邦证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期新增国海证券 2 个交易单元。

#### 2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行主观性评议，形成证券公司交易单元租用意见。

#### (2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会核准。

<2> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	17,061.76	0.18%	-	-	-	-
华泰证券	8,914,741.74	93.72%	-	-	-	-
浙商证券	79,503.59	0.84%	-	-	-	-
兴业证券	199,920.00	2.10%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	300,426.00	3.16%	200,000.00	100.00%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-06
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-08
3	海富通基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-22
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增新华信通基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
6	海富通基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
7	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加兴业银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-19

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 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 109 只公募基金。截至 2023 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1649 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，海富通基金管理有限公司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，中国证监会公告确认海富通基金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，海富通基金管理有限公司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，海富通基金管理有限公司荣获“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，海富通基金管理有限公司荣获“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”。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金的文件

- (二)海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同
- (三)海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金招募说明书
- (四)海富通创业板综指增强型发起式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

## 12.2 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

## 12.3 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

二〇二三年八月三十一日