

海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金
2026 年中期报告
2026 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 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 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	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
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
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	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59
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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	62
§9 开放式基金份额变动	62
§10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	64
10.8 其他重大事件	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息	67
§12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	68

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金		
基金简称	海富通沪深 300 增强		
基金主代码	004512		
交易代码	004512		
基金运作方式	契约型、开放式		
基金合同生效日	2019 年 10 月 9 日		
基金管理人	海富通基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,105,596,714.23 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C	海富通沪深 300 增强 Y
下属分级基金的交易代码	004513	004512	026275
报告期末下属分级基金的份额总额	646,076,152.33 份	459,437,051.38 份	83,510.52 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，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的投资策略模型进行积极的指数组合管理与风险控制，力求实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型股票指数基金，以沪深 300 指数为标的指数。本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在跟踪目标指数的基础上一定程度地调整投资组合，力争控制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%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	沪深 300 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。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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	许俊
	联系电话	021-38650788	010-66596688
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com

客户服务电话	40088-40099	95566
传真	021-33830166	010-66594942
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1 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1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	谢乐斌	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金中期报告置备地点	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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）		
	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C	海富通沪深 300 增强 Y
本期已实现收益	86,313,683.96	74,488,405.31	4,677.14
本期利润	93,817,182.02	92,255,754.63	8,054.23
加权平均基金份额本期利润	0.1025	0.1208	0.1249
本期加权平均净值利润率	7.10%	8.04%	8.60%
本期基金份额净值增长率	8.62%	8.56%	8.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C	海富通沪深 300 增强 Y

期末可供分配利润	99,574,533.72	93,139,001.75	13,234.60
期末可供分配基金份额利 润	0.1541	0.2027	0.1585
期末基金资产净值	988,001,275.37	731,340,216.19	128,053.59
期末基金份额净值	1.5292	1.5918	1.5334
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C	海富通沪深 300 增强 Y
基金份额累计净值增长率	69.99%	68.93%	9.73%

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)。

4、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金于 2025 年 12 月 18 日发布公告，自 2025 年 12 月 19 日起增设 Y 类基金份额。

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

海富通沪深 300 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
过去三个月	11.70%	1.31%	11.30%	1.19%	0.40%	0.12%
过去六个月	8.62%	1.16%	7.20%	1.07%	1.42%	0.09%
过去一年	24.25%	1.00%	25.13%	0.97%	-0.88%	0.03%
过去三年	45.15%	1.05%	28.26%	1.06%	16.89%	-0.01%
过去五年	15.10%	1.09%	-4.03%	1.06%	19.13%	0.03%
自基金合同生 效起至今	69.99%	1.14%	28.91%	1.11%	41.08%	0.03%

海富通沪深 300 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
过去三个月	11.67%	1.31%	11.30%	1.19%	0.37%	0.12%
过去六个月	8.56%	1.16%	7.20%	1.07%	1.36%	0.09%
过去一年	24.13%	1.00%	25.13%	0.97%	-1.00%	0.03%
过去三年	44.72%	1.05%	28.26%	1.06%	16.46%	-0.01%
过去五年	14.54%	1.09%	-4.03%	1.06%	18.57%	0.03%

自基金合同生效起至今	68.93%	1.14%	28.91%	1.11%	40.02%	0.03%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

海富通沪深 300 增强 Y

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
过去三个月	11.85%	1.31%	11.30%	1.19%	0.55%	0.12%
过去六个月	8.88%	1.16%	7.20%	1.07%	1.68%	0.09%
自基金合同生效起至今	9.73%	1.13%	8.58%	1.04%	1.15%	0.09%

3.2.2 自基金转型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

海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019 年 10 月 9 日至 2026 年 6 月 30 日)

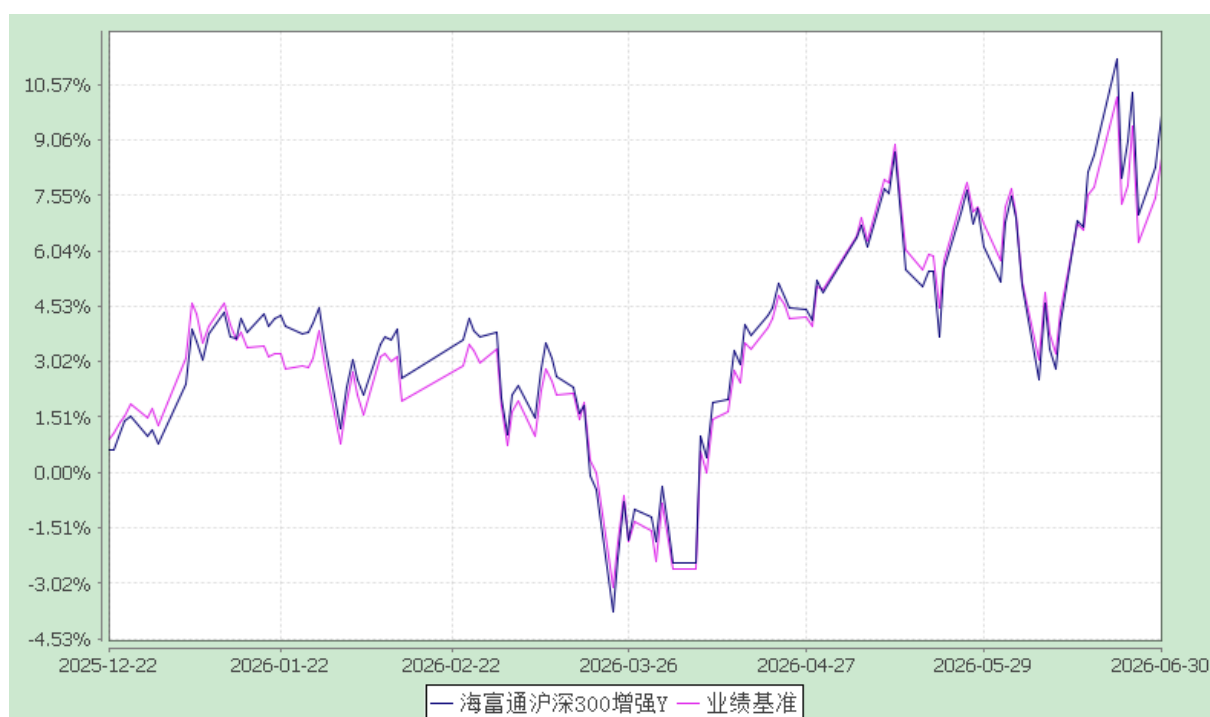
海富通沪深 300 增强 A



海富通沪深 300 增强 C



海富通沪深 300 增强 Y



注：本基金转型日期为 2019 年 10 月 9 日。按照本基金合同规定，本基金建仓期为自基金合同转型生效之日起六个月。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。

84 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，于 2003 年 4 月 1 日发起设立。目前，公司的股东为国泰海通证券股份有限公司、法国巴黎资产管理 BE 控股公司，注册资本为 3 亿元人民币。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下运作的公募基金共有 100 只，分别是：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 A100 指数证券投资基金(LOF)、海富通中小盘混合型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、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、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、海富通盈丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资基金、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、海富通红利优选混合型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通量化选股混合型证券投资基金、海富通上证基准做市公司债交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、海富通远见回报混合型证券投资基金、海富通配置优选三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、海富通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、海富通致远量化选股股票型发起式证券投资基金、海富通添合收益债券型证券投资基金、海富通聚益优选三个月持有期债券型基金中基金（FOF）、海富通瑞颐 30 天滚动持有债券型证券投资基金、海富通瑞泽 90 天持有期债券型发起式证券投资基金、海富通沪港深医疗创新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		
李自悟	本基金的基金经理；量化投	2026-05-12	-	18 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2008 年 4 月至 2010 年 1 月任

	资部副总监 (主持工作)。				MNJ Capital Management 交易员，2010 年 7 月至 2011 年 6 月任 BlackRock 研究员，2011 年 7 月至 2016 年 3 月任国家外汇管理局中央外汇业务中心基金经理，2016 年 3 月至 2019 年 8 月任上海均直资产管理有限公司基金经理，2019 年 9 月至 2022 年 8 月任野村东方国际证券量化投资主管。2022 年 8 月加入海富通基金管理有限公司，现任量化投资部副总监（主持工作）。2023 年 2 月起任海富通中证 500 增强基金经理。2023 年 2 月至 2025 年 3 月兼任海富通量化先锋股票基金经理。2023 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。2024 年 7 月起兼任海富通量化选股混合基金经理。2025 年 3 月起兼任海富通欣益混合基金经理。2025 年 12 月起兼任海富通中证 A500 指数增强基金经理。2026 年 5 月起兼任海富通沪深 300 指数增强基金经理。
朱斌全	本基金的基金 经理	2019-10-1 5	-	19 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018 年 11 月至 2022 年 8 月任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月至 2022 年 12 月兼任海富通富祥混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通沪深 300 增强(原海富通富睿混合)、海富通欣益混合的基金经理。2019 年 10 月至 2025 年 5 月兼任海富通量化多因子混合基金经理。2020 年 10 月至 2025 年 8 月兼任海富通欣享混合的基金经理。2020 年 10 月至 2022 年 8 月兼任海富通新内需混合基金经理。2022 年 8 月起兼任海富通安益对

					冲混合基金经理。2022 年 12 月至 2024 年 4 月兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。2024 年 3 月至 2025 年 6 月兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。2025 年 3 月起兼任海富通中证 A500 指数增强基金经理。
林立禾	本基金的基金经理	2023-11-23	-	7 年	美国密歇根大学定量金融与风险管理硕士,持有基金从业人员资格证书。历任中欧基金管理有限公司风险管理部量化风控岗。2020 年 8 月加入海富通基金管理有限公司,历任量化研究员、量化投资部基金经理助理。2023 年 11 月至 2026 年 1 月任海富通富利三个月持有的基金经理。2023 年 11 月起任海富通沪深 300 增强的基金经理。2023 年 11 月至 2025 年 3 月兼任海富通欣益混合的基金经理。2024 年 10 月至 2025 年 5 月兼任海富通量化多因子混合基金经理。2025 年 1 月起兼任海富通中证 500 指数增强基金经理。2025 年 3 月起兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 A500 指数增强基金经理。2025 年 6 月起兼任海富通致远量化选股股票发起基金经理。2025 年 8 月起兼任海富通欣享混合、海富通安益对冲混合基金经理。
孙恂	本基金的基金经理助理	2024-10-11	2026-02-24	4 年	统计学硕士,持有基金从业人员资格证书。历任 Dataline Inc.数据科学家、Freedom Mortgage Inc.数据科学家、摩根大通银行资深数据科学家、支付宝网络技术有限公司风险策略专家。2022 年 5 月加入海富通基金管理有限公司,任量化研究员。2024 年 10 月至 2026 年 2 月兼任海富通安益对冲混合、海富通沪深 300 增强基金经理助理。2025 年 7 月至 2026 年 2 月兼任海富通致远量化选股股票发起、海富通量化先锋股票基金经理助理。

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

非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

3、本公司于 2026 年 8 月 29 日发布公告，自 2026 年 8 月 28 日起林立禾先生不再担任本基金的基金经理。

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。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

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

宏观经济方面，上半年国内经济总体平稳、结构持续优化。根据初步核算，上半年国内生产总值 69.6 万亿元，同比增长 4.7%，基本运行在全年目标区间。经济运行基本盘稳固。物价温和回升，CPI 同比上涨，工业领域通缩压力则得到缓解。流动性保持合理充裕。结构上，高端制造与出口成

为主要亮点。以高端制造、数智经济、现代服务为代表的新动能对上半年经济增长贡献率超四成，经济向新向优特征鲜明。上半年出口金额同比增长显著，贸易顺差持续扩大；高技术制造业增加值同比增长明显，特别是新能源汽车、工业机器人等行业。

A 股市场方面，上半年指数走势分化，科技成长板块全面占优。上证指数上涨 3.16%，沪深 300 涨 7.55%，中证 500 涨 20.97%，创业板指涨 35.58%，科创 50 涨 64.25%。申万一级行业中，电子、通信、建筑材料、机械设备涨幅居前，商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料表现落后。年初在美联储宽松预期和美国财政脉冲带动下，市场聚焦流动性宽松及经济复苏受益方向。2 月下旬美伊冲突爆发，国际油价飙升，通胀预期强化逆转了美联储的宽松预期。随后，美国科技巨头集中上修 2026 年资本开支，AI 基础设施周期全面启动，AI 主线贯穿二季度并成为核心驱动因素。整体看，上半年市场呈现极致科技成长风格，AI 算力、半导体等细分赛道领涨，结构分化显著。

报告期内，本基金坚持通过多因子量化模型优选个股，通过风险模型控制组合在风格及行业层面相对基准指数的暴露。上半年沪深 300 指数上涨 7.55%，特别是在指数权重调整后大盘蓝筹中 AI 占比不断提升。从因子表现看，动量因子与成长因子表现突出，而低估值因子则出现阶段性回撤。在因子配置上，组合通过因子择时模型适度调整了相关因子的权重，以适应大盘、成长、动量等风格占主导的市场环境。策略层面，我们提升了景气度驱动的基本面量化策略权重，降低了单纯依赖估值回归的深度价值策略占比。风险模型则持续监控组合在各风格上的偏离幅度，在市场风格高度集中于成长方向的环境下，重点防范风格反转可能带来的回撤风险，保持组合的稳健运行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通沪深 300 增强 A 净值增长率为 8.62%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。海富通沪深 300 增强 C 净值增长率为 8.56%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。海富通沪深 300 增强 Y 净值增长率为 8.88%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前的宏观环境来看，全球 AI 投资浪潮仍在延续，我国相关产业链高景气的现状有望维持。但是相关股票涨幅较大，积累的获利盘需要认真应对。地缘政治方面，美伊关系的不确定性对油价的影响仍需紧密跟踪。国内经济方面，向新向优趋势不变，企业盈利具备持续改善的基础。流动性方面，国内货币政策维持宽松基调，叠加监管持续引导中长期资金入市，整体流动性环境偏稳定，市场具备震荡上行的条件。我们将继续跟踪国内政策与经济动能变化，把握结构性机会与市场节奏。对于量化策略而言，上半年极致的市场风格并不是最理想的市场环境。随着市场逐步回归理性，我们认为下半年相关策略的表现将更值得期待。

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，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金报告期内未进行过利润分配，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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、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：海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	62,469,454.77	11,467,848.62
结算备付金		13,528,648.95	63,833,900.47
存出保证金		6,839,735.73	10,440,740.88
交易性金融资产	6.4.7.2	1,641,962,282.41	3,420,884,439.13
其中：股票投资		1,579,295,888.43	3,239,578,955.23
基金投资		-	-
债券投资		62,666,393.98	181,305,483.90
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	-	51,493,784.20
应收清算款		4,172,906.38	31,770,493.48
应收股利		-	-
应收申购款		2,246,684.88	7,282,152.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,731,219,713.12	3,597,173,359.65
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
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		372,789.16	-
应付赎回款		8,489,609.11	44,811,729.68
应付管理人报酬		1,107,461.08	2,511,327.14
应付托管费		249,178.75	565,048.62
应付销售服务费		63,172.60	157,339.59
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,163.72	1,766.40
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,466,793.55	2,456,379.36
负债合计		11,750,167.97	50,503,590.79
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,105,596,714.23	2,469,464,740.84
未分配利润	6.4.7.8	613,872,830.92	1,077,205,028.02
净资产合计		1,719,469,545.15	3,546,669,768.86
负债和净资产总计		1,731,219,713.12	3,597,173,359.65

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.5292 元，C 类基金份额净值 1.5918 元，Y 类基金份额净值 1.5334 元。基金份额总额 1,105,596,714.23 份，其中 A 类基金份额 646,076,152.33 份，C 类基金份额 459,437,051.38 份，Y 类基金份额 83,510.52 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		198,852,993.59	180,366,533.23
1.利息收入		393,910.34	932,761.07
其中：存款利息收入	6.4.7.9	225,654.31	395,549.06
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		168,256.03	537,212.01
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		171,174,098.07	151,384,940.42
其中：股票投资收益	6.4.7.10	147,237,409.09	97,449,115.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	855,979.10	1,051,555.60

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	6,113,745.41	-378,669.13
股利收益	6.4.7.14	16,966,964.47	53,262,937.96
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	25,274,224.47	26,832,425.52
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	2,010,760.71	1,216,406.22
减：二、营业总支出		12,772,002.71	19,077,003.82
1. 管理人报酬		9,839,330.54	14,569,139.74
2. 托管费		2,213,849.39	3,278,056.42
3. 销售服务费		571,565.68	917,455.65
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		3,316.43	83,117.81
其中：卖出回购金融资产支出		3,316.43	83,117.81
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		28,632.84	1,933.97
8. 其他费用	6.4.7.17	115,307.83	227,300.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		186,080,990.88	161,289,529.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		186,080,990.88	161,289,529.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		186,080,990.88	161,289,529.41

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	2,469,464,740.84	-	1,077,205,028.02	3,546,669,768.86
二、本期期初净资产	2,469,464,740.84	-	1,077,205,028.02	3,546,669,768.86
三、本期增减变动额（减少以“-”	-1,363,868,026.61	-	-463,332,197.10	-1,827,200,223.71

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	186,080,990.88	186,080,990.88
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-1,363,868,026.61	-	-649,413,187.98	-2,013,281,214.59
其中: 1.基金申购款	702,232,452.18	-	338,025,603.45	1,040,258,055.63
2.基金赎回款	-2,066,100,478.79	-	-987,438,791.43	-3,053,539,270.22
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,105,596,714.23	-	613,872,830.92	1,719,469,545.15
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	2,122,697,834.03	-	462,765,377.15	2,585,463,211.18
二、本期期初净资产	2,122,697,834.03	-	462,765,377.15	2,585,463,211.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,566,772,878.13	-	480,866,177.88	2,047,639,056.01
(一)、综合收益总额	-	-	161,289,529.41	161,289,529.41
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,566,772,878.13	-	319,576,648.47	1,886,349,526.60
其中: 1.基金申购款	2,620,355,438.27	-	563,288,174.08	3,183,643,612.35
2.基金赎回款	-1,053,582,560.14	-	-243,711,525.61	-1,297,294,085.75
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产	3,689,470,712.16	-	943,631,555.03	4,633,102,267.19

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

海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原海富通富睿混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原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[2016]1173 号《关于准予海富通富睿混合型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《海富通富睿混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 337,844,741.50 元，已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(2017)第 489 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通富睿混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 5 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 337,986,530.53 份，其中认购资金利息折合 141,789.03 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《海富通富睿混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，海富通富睿混合型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于 2019 年 9 月 17 日表决通过了《关于海富通富睿混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。根据《海富通基金管理有限公司关于海富通富睿混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，《海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》将自 2019 年 10 月 9 日起正式生效，原《海富通富睿混合型证券投资基金基金合同》将自同日起失效。于 2019 年 10 月 9 日起，海富通富睿混合型证券投资基金的基金份额全部转换为海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金份额。

根据《海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和《海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购/申购费用、赎回费用和销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从

本类别基金资产中计提销售服务费的，称为海富通沪深 300 指数增强 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为海富通沪深 300 指数增强 C 类基金份额。

根据《海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的相关约定及本基金管理人海富通基金管理有限公司 2025 年 12 月 18 日发布的《海富通基金管理有限公司关于海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金增设 Y 类基金份额并修改法律文件的公告》，经与基金托管人协商一致并报中国证券监督管理委员会备案，自 2025 年 12 月 19 日起，在原有份额的基础上增设 Y 类基金份额，并相应修改基金合同等法律文件。增加上述份额后，本基金将分设海富通沪深 300 增强 A、海富通沪深 300 增强 C、海富通沪深 300 增强 Y 基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金为增强型股票指数基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的投资策略模型进行积极的指数组合管理与风险控制，力求实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。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、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券等）、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的 80%，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。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。本基金业绩比较基准：沪深 300 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 2026 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会

会（以下简称“基金业协会”）发布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、2026 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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 号文《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 号文《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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a)本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入,截至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

d)本基金卖出股票按 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e)对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	62,469,454.77
等于：本金	62,464,595.91
加：应计利息	4,858.86

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	62,469,454.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,475,279,247.73	-	1,579,295,888.43	104,016,640.70
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所		635,593.98		
	市场	62,027,458.88		62,666,393.98	3,341.12
	银行间		-		
	市场	-		-	-
合计		62,027,458.88	635,593.98	62,666,393.98	3,341.12
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,537,306,706.61	635,593.98	1,641,962,282.41	104,019,981.82

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	43,467,960.00	-	-	-
——股指期货	43,467,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	43,467,960.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2609	IF2609	30.00	43,648,200.00	180,240.00
合计	-	-	-	180,240.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	180,240.00
净额	-	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,479.24
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,377,533.86
其中：交易所市场	1,377,533.86

银行间市场	
应付利息	
预提费用	86,780.45
合计	1,466,793.55

6.4.7.7 实收基金

海富通沪深 300 增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,273,730,883.53	1,273,730,883.53
本期申购	345,005,167.98	345,005,167.98
本期赎回（以“-”号填列）	-972,659,899.18	-972,659,899.18
本期末	646,076,152.33	646,076,152.33

海富通沪深 300 增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,195,717,849.78	1,195,717,849.78
本期申购	357,128,691.21	357,128,691.21
本期赎回（以“-”号填列）	-1,093,409,489.61	-1,093,409,489.61
本期末	459,437,051.38	459,437,051.38

海富通沪深 300 增强 Y

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,007.53	16,007.53
本期申购	98,592.99	98,592.99
本期赎回（以“-”号填列）	-31,090.00	-31,090.00

本期末	83,510.52	83,510.52
-----	-----------	-----------

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

海富通沪深 300 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	75,820,576.56	443,797,293.72	519,617,870.28
本期期初	75,820,576.56	443,797,293.72	519,617,870.28
本期利润	86,313,683.96	7,503,498.06	93,817,182.02
本期基金份额交易产生的变动数	-62,559,726.80	-208,950,202.46	-271,509,929.26
其中：基金申购款	43,743,819.33	115,477,870.94	159,221,690.27
基金赎回款	-106,303,546.13	-324,428,073.40	-430,731,619.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	99,574,533.72	242,350,589.32	341,925,123.04

海富通沪深 300 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	125,539,037.40	432,041,584.91	557,580,622.31
本期期初	125,539,037.40	432,041,584.91	557,580,622.31
本期利润	74,488,405.31	17,767,349.32	92,255,754.63
本期基金份额交易产生的变动数	-106,888,440.96	-271,044,771.17	-377,933,212.13
其中：基金申购款	53,258,270.16	125,500,963.41	178,759,233.57
基金赎回款	-160,146,711.12	-396,545,734.58	-556,692,445.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	93,139,001.75	178,764,163.06	271,903,164.81

海富通沪深 300 增强 Y

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	963.09	5,572.34	6,535.43
本期期初	963.09	5,572.34	6,535.43
本期利润	4,677.14	3,377.09	8,054.23
本期基金份额交易产生的变动数	7,594.37	22,359.04	29,953.41
其中：基金申购款	11,458.39	33,221.22	44,679.61
基金赎回款	-3,864.02	-10,862.18	-14,726.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,234.60	31,308.47	44,543.07

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	58,871.78
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	150,208.25
其他	16,574.28
合计	225,654.31

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	9,067,525,179.23
减：卖出股票成本总额	8,911,681,223.00
减：交易费用	8,606,547.14
买卖股票差价收入	147,237,409.09

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	738,612.76
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	117,366.34
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	855,979.10

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	194,241,415.67

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	192,126,372.54
减：应计利息总额	1,997,676.79
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	117,366.34

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 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益（税前）	6,407,391.73
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	228,310.15
减：交易费用	65,336.17
合计	6,113,745.41

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	16,966,964.47
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	16,966,964.47

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	25,498,916.20
——股票投资	25,645,068.66
——债券投资	-146,152.46
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-224,691.73
——权证投资	-
——股指期货	-224,691.73

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	25,274,224.47

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	2,009,833.80
基金转换费收入	926.91
合计	2,010,760.71

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	9,927.38
债券托管账户维护费	18,000.00
上清所查询服务费	600.00
合计	115,307.83

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

截至财务报表报出日，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、关联关系

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

中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通证券”）	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。关联方国泰海通证券股份有限公司（简称“国泰海通证券”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原关联方海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

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		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025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
国泰海通证券	1,834,642,952.67	11.26%	-	-

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			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 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
国泰海通证券	341,065.92	11.26%	-	-
关联方名称	上年度可比期间			
	2025年1月1日至2025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
国泰海通证券	-	-	-	-

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金管理人提供的证券投资研究服务等。

2.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务

费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。公司的该类佣金协议符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

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 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,839,330.54	14,569,139.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,246,946.66	1,780,749.39
应支付基金管理人的净管理费	7,592,383.88	12,788,390.35

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一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

海富通沪深 300 增强 A 类基金日管理人报酬=前一日 A 类份额对应的基金资产净值 $\times 0.80\%$ / 当年天数。

海富通沪深 300 增强 C 类基金日管理人报酬=前一日 C 类份额对应的基金资产净值 $\times 0.80\%$ / 当年天数。

海富通沪深 300 增强 Y 类基金日管理人报酬=前一日 Y 类份额对应的基金资产净值 $\times 0.40\%$ / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,213,849.39	3,278,056.42

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

海富通沪深 300 增强 A 类基金日基金托管费=前一日 A 类份额对应的基金资产净值 $\times 0.18\%$ / 当年天数。

海富通沪深 300 增强 C 类基金日基金托管费=前一日 C 类份额对应的基金资产净值 $\times 0.18\%$ / 当年天数。

海富通沪深 300 增强 Y 类基金日基金托管费=前一日 Y 类份额对应的基金资产净值 x0.09%/ 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 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C	海富通沪深 300 增强 Y	合计
中国银行	-	19,562.46	-	19,562.46
国泰海通证券	-	293.32	-	293.32
海富通	-	179,075.46	-	179,075.46
合计	-	198,931.24	-	198,931.24
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C	海富通沪深 300 增强 Y	合计
中国银行	-	2,023.80	-	2,023.80
海通证券	-	50.68	-	50.68
海富通	-	506,205.86	-	506,205.86
国泰海通证券	-	115.48	-	115.48
合计	-	508,395.82	-	508,395.82

注：本基金 A 类份额和本基金 Y 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 0.10%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.10% 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 x0.10%/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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	海富通沪深300 增强A	海富通沪深300 增强C	海富通沪深300 增强Y	海富通沪深300 增强A	海富通沪深300 增强C	海富通沪深300 增强Y
期初持有的基金份额	4,243,401.51	-	-	4,243,401.51	-	-
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	4,243,401.51	-	-	4,243,401.51	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.66%	-	-	0.22%	-	-

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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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
中国银行	62,469,454.7	58,871.78	24,891,415.8	76,403.87

	7		5	
--	---	--	---	--

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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
国泰海通证券	688781	视涯科技	网下申购	9,746	221,039.28
国泰海通证券	688818	电科蓝天	网下申购	17,168	162,580.96
国泰海通证券	301599	理奇智能	网下申购	4,325	60,160.75
国泰海通证券	301696	三瑞智能	网下申购	2,157	53,234.76
国泰海通证券	688635	长进光子	网下申购	1,271	52,085.58
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
-	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

本基金于上年度可比期间卖出持有的基金管理人股东国泰海通证券发行的股票——国泰海通（证券代码：601211）123,700.00 股，交易金额为人民币 2,103,102.00 元。于本报告期末及上年度末，本基金未持有国泰海通证券发行的股票。

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（2026 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
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内(含)	新股未上市	10.11	10.11	25,113	253,892.43	253,892.43	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新股未上市并锁定	10.11	10.11	58,598	592,425.78	592,425.78	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股锁定	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股锁定	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股锁定	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股锁定	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股锁定	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股锁定	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股锁定	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股锁定	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
60328	林平	2026-0	6 个月	新股	37.88	34.87	46	1,742.	1,604.	-

4	发展	2-03		锁定				48	02	
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股锁定	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股锁定	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项	879.53	2026-07-13	890.99	4,020	2,599,358.98	3,535,710.60	-

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。

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	62,666,393.98	180,487,110.20
合计	62,666,393.98	180,487,110.20

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、无第三方评级机构评级的债券。

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	818,373.70
合计	-	818,373.70

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、无第三方评级机构评级的债券。

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公司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该比例限制)。

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、买入返售金融资产及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	62,469,454.77	-	-	-	62,469,454.77
结算备付金	13,528,648.95	-	-	-	13,528,648.95
存出保证金	1,601,951.73	-	-	5,237,784.00	6,839,735.73
交易性金融资产	62,666,393.98	-	-	1,579,295,888.43	1,641,962,282.41
应收清算款	-	-	-	4,172,906.38	4,172,906.38
应收申购款	698.81	-	-	2,245,986.07	2,246,684.88
资产总计	140,267,148.24	-	-	1,590,952,564.88	1,731,219,713.12
负债					
应付清算款	-	-	-	372,789.16	372,789.16
应付赎回款	-	-	-	8,489,609.11	8,489,609.11
应付管理人报酬	-	-	-	1,107,461.08	1,107,461.08
应付托管费	-	-	-	249,178.75	249,178.75
应付销售服务费	-	-	-	63,172.60	63,172.60
应交税费	-	-	-	1,163.72	1,163.72
其他负债	-	-	-	1,466,793.55	1,466,793.55
负债总计	-	-	-	11,750,167.97	11,750,167.97
利率敏感度缺口	140,267,148.24	-	-	1,579,202,396.91	1,719,469,545.15
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2025 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	11,467,848.62	-	-	-	11,467,848.62
结算备付金	63,833,900.47	-	-	-	63,833,900.47
存出保证金	880,919.28	-	-	9,559,821.60	10,440,740.88
交易性金融资产	181,305,483.90	-	-	3,239,578,955.23	3,420,884,439.13
买入返售金融资产	51,493,784.20	-	-	-	51,493,784.20
应收清算款	-	-	-	31,770,493.48	31,770,493.48
应收申购款	500.00	-	-	7,281,652.87	7,282,152.87
资产总计	308,982,436.47	-	-	3,288,190,923.18	3,597,173,359.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	44,811,729.68	44,811,729.68
应付管理人报酬	-	-	-	2,511,327.14	2,511,327.14
应付托管费	-	-	-	565,048.62	565,048.62
应付销售服务费	-	-	-	157,339.59	157,339.59
应交税费	-	-	-	1,766.40	1,766.40
其他负债	-	-	-	2,456,379.36	2,456,379.36
负债总计	-	-	-	50,503,590.79	50,503,590.79
利率敏感度缺口	308,982,436.47	-	-	3,237,687,332.39	3,546,669,768.86

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-35,995.32	-142,733.22
	市场利率下降 25 个基点	36,117.50	143,246.42

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及存托凭证投资比例不低于基金资产的 80%，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		上年度末	
	2026 年 6 月 30 日		2025 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	1,579,295,888.43	91.85	3,239,578,955.23	91.34
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	1,579,295,888.43	91.85	3,239,578,955.23	91.34

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	107,381,501.70	185,918,501.76
	2.业绩比较基准下降 5%	-107,381,501.70	-185,918,501.76

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1,573,448,241.62	3,215,069,878.15
第二层次	67,048,422.79	203,550,093.24
第三层次	1,465,618.00	2,264,467.74
合计	1,641,962,282.41	3,420,884,439.13

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等，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，本基金分别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不会将相关股票和债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2025 年 12 月 31 日：无)。

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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

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	1,579,295,888.43	91.22
	其中：股票	1,579,295,888.43	91.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	62,666,393.98	3.62
	其中：债券	62,666,393.98	3.62
	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	75,998,103.72	4.39
8	其他各项资产	13,259,326.99	0.77
9	合计	1,731,219,713.12	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	77,700.00	0.00
B	采矿业	72,604,832.85	4.22
C	制造业	1,058,110,186.89	61.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	38,301,919.49	2.23
E	建筑业	21,391,917.51	1.24
F	批发和零售业	9,799,444.00	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	23,689,781.33	1.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	110,818,392.61	6.44
J	金融业	222,501,099.42	12.94
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,738,503.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	17,635,415.33	1.03
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	129,984.00	0.01
Q	卫生和社会工作	1,496,712.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,579,295,888.43	91.85

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	300308	中际旭创	67,800	86,106,000.00	5.01
2	300750	宁德时代	143,073	56,229,119.73	3.27
3	603986	兆易创新	50,700	41,320,500.00	2.40
4	300502	新易盛	58,724	35,645,468.00	2.07
5	601318	中国平安	627,741	29,968,355.34	1.74
6	600519	贵州茅台	25,032	29,675,185.68	1.73
7	688008	澜起科技	93,950	29,115,105.00	1.69
8	002384	东山精密	109,600	28,753,560.00	1.67
9	688256	寒武纪	17,971	28,673,629.05	1.67
10	601899	紫金矿业	840,356	21,126,549.84	1.23
11	300408	三环集团	121,500	20,278,350.00	1.18
12	000725	京东方 A	2,198,554	19,083,448.72	1.11
13	000333	美的集团	251,656	19,007,577.68	1.11
14	002371	北方华创	21,200	18,752,672.00	1.09
15	300476	胜宏科技	53,715	18,608,487.45	1.08
16	603259	药明康德	141,600	17,630,616.00	1.03
17	601138	工业富联	235,250	16,973,287.50	0.99
18	300394	天孚通信	54,220	16,411,309.60	0.95
19	601398	工商银行	2,311,231	16,340,403.17	0.95
20	600900	长江电力	616,445	16,317,299.15	0.95
21	301308	江波龙	22,800	16,046,640.00	0.93
22	600036	招商银行	425,880	15,118,740.00	0.88
23	600030	中信证券	498,720	14,328,225.60	0.83
24	600150	中国船舶	414,635	14,010,516.65	0.81
25	600522	中天科技	224,600	13,628,728.00	0.79
26	600919	江苏银行	1,233,176	13,293,637.28	0.77
27	600183	生益科技	75,600	13,109,040.00	0.76
28	603993	洛阳钼业	744,157	13,059,955.35	0.76
29	300442	润泽科技	152,400	12,659,868.00	0.74
30	688012	中微公司	25,724	12,051,694.00	0.70
31	002475	立讯精密	163,375	11,501,600.00	0.67
32	688041	海光信息	30,625	11,340,437.50	0.66
33	000938	紫光股份	383,800	11,076,468.00	0.64
34	688981	中芯国际	67,775	10,764,025.50	0.63
35	002415	海康威视	305,500	10,448,100.00	0.61
36	002049	紫光国微	115,800	10,277,250.00	0.60
37	600276	恒瑞医药	195,688	10,183,603.52	0.59
38	601601	中国太保	356,000	10,153,120.00	0.59

39	002142	宁波银行	338,500	10,050,065.00	0.58
40	600941	中国移动	109,300	9,414,009.00	0.55
41	600031	三一重工	528,500	9,132,480.00	0.53
42	002028	思源电气	52,600	9,099,800.00	0.53
43	300059	东方财富	446,017	9,089,826.46	0.53
44	600089	特变电工	398,300	8,961,750.00	0.52
45	000100	TCL 科技	1,525,476	8,878,270.32	0.52
46	002015	协鑫能科	520,868	8,500,565.76	0.49
47	000425	徐工机械	1,047,800	8,476,702.00	0.49
48	000977	浪潮信息	120,400	8,428,000.00	0.49
49	002916	深南电路	18,100	8,287,990.00	0.48
50	603893	瑞芯微	43,800	8,250,168.00	0.48
51	601166	兴业银行	488,175	8,084,178.00	0.47
52	601009	南京银行	814,297	8,053,397.33	0.47
53	603296	华勤技术	96,260	7,149,230.20	0.42
54	688396	华润微	71,808	7,004,870.40	0.41
55	002460	赣锋锂业	105,900	6,925,860.00	0.40
56	603929	亚翔集成	25,400	6,909,308.00	0.40
57	300014	亿纬锂能	105,089	6,833,937.67	0.40
58	688521	芯原股份	18,100	6,717,634.00	0.39
59	600406	国电南瑞	293,942	6,716,574.70	0.39
60	601117	中国化学	909,000	6,681,150.00	0.39
61	601688	华泰证券	319,800	6,594,276.00	0.38
62	600489	中金黄金	360,500	6,507,025.00	0.38
63	600000	浦发银行	727,400	6,262,914.00	0.36
64	301165	锐捷网络	77,600	6,242,920.00	0.36
65	600160	巨化股份	117,400	6,223,374.00	0.36
66	601766	中国中车	1,191,617	6,196,408.40	0.36
67	600111	北方稀土	126,800	6,092,740.00	0.35
68	600958	东方证券	643,477	6,074,422.88	0.35
69	002352	顺丰控股	190,989	5,970,316.14	0.35
70	300628	亿联网络	176,490	5,968,891.80	0.35
71	002202	金风科技	249,100	5,953,490.00	0.35
72	300661	圣邦股份	41,200	5,911,376.00	0.34
73	000338	潍柴动力	216,100	5,888,725.00	0.34
74	000988	华工科技	31,700	5,852,137.00	0.34
75	300458	全志科技	148,300	5,851,918.00	0.34
76	603283	赛腾股份	70,760	5,730,144.80	0.33
77	600875	东方电气	195,600	5,627,412.00	0.33
78	600926	杭州银行	385,700	5,573,365.00	0.32
79	688200	华峰测控	10,508	5,517,750.80	0.32
80	600660	福耀玻璃	108,600	5,477,784.00	0.32
81	600547	山东黄金	233,804	5,398,534.36	0.31
82	601225	陕西煤业	264,000	5,372,400.00	0.31

83	601628	中国人寿	150,000	5,302,500.00	0.31
84	601939	建设银行	545,900	5,257,017.00	0.31
85	000792	盐湖股份	170,000	5,132,300.00	0.30
86	688111	金山办公	23,600	5,027,980.00	0.29
87	002463	沪电股份	32,700	4,996,560.00	0.29
88	002600	领益智造	282,500	4,898,550.00	0.28
89	002518	科士达	89,200	4,780,228.00	0.28
90	002236	大华股份	288,600	4,759,014.00	0.28
91	600887	伊利股份	192,400	4,609,904.00	0.27
92	001287	中电港	147,800	4,603,970.00	0.27
93	600482	中国动力	140,000	4,592,000.00	0.27
94	000617	中油资本	685,700	4,518,763.00	0.26
95	300857	协创数据	13,200	4,486,680.00	0.26
96	600019	宝钢股份	822,300	4,465,089.00	0.26
97	600233	圆通速递	279,300	4,398,975.00	0.26
98	603501	豪威集团	46,300	4,391,555.00	0.26
99	002517	恺英网络	269,800	4,384,250.00	0.25
100	601995	中金公司	120,700	4,363,305.00	0.25
101	601998	中信银行	628,659	4,356,606.87	0.25
102	002001	新和成	151,700	4,311,314.00	0.25
103	600989	宝丰能源	209,600	4,261,168.00	0.25
104	002709	天赐材料	82,400	4,237,832.00	0.25
105	000975	山金国际	246,300	4,187,100.00	0.24
106	601872	招商轮船	238,200	4,185,174.00	0.24
107	000895	双汇发展	183,700	4,114,880.00	0.24
108	002532	天山铝业	381,400	4,092,422.00	0.24
109	605020	永和股份	100,300	4,084,216.00	0.24
110	601825	沪农商行	544,500	4,078,305.00	0.24
111	603799	华友钴业	82,600	3,986,276.00	0.23
112	000157	中联重科	571,700	3,984,749.00	0.23
113	300124	汇川技术	59,800	3,966,534.00	0.23
114	300418	昆仑万维	97,800	3,947,208.00	0.23
115	688536	思瑞浦	10,820	3,939,453.80	0.23
116	600176	中国巨石	54,000	3,935,520.00	0.23
117	601077	渝农商行	642,600	3,926,286.00	0.23
118	300274	阳光电源	23,993	3,815,366.86	0.22
119	600893	航发动力	98,600	3,780,324.00	0.22
120	688047	龙芯中科	24,400	3,773,948.00	0.22
121	600886	国投电力	282,300	3,757,413.00	0.22
122	603288	海天味业	110,900	3,677,444.00	0.21
123	000408	藏格矿业	53,000	3,673,960.00	0.21
124	000651	格力电器	97,650	3,661,875.00	0.21
125	601360	三六零	413,700	3,595,053.00	0.21
126	002195	岩山科技	542,300	3,546,642.00	0.21

127	688072	拓荆科技	4,020	3,535,710.60	0.21
128	300913	兆龙互连	73,400	3,516,594.00	0.20
129	002466	天齐锂业	56,890	3,488,494.80	0.20
130	003031	中瓷电子	18,900	3,407,670.00	0.20
131	002648	卫星化学	144,600	3,396,654.00	0.20
132	600026	中远海能	188,100	3,374,514.00	0.20
133	688578	艾力斯	30,530	3,333,876.00	0.19
134	000657	中钨高新	34,700	3,321,484.00	0.19
135	601096	宏盛华源	761,000	3,302,740.00	0.19
136	000001	平安银行	327,429	3,290,661.45	0.19
137	003816	中国广核	839,200	3,281,272.00	0.19
138	600039	四川路桥	416,500	3,257,030.00	0.19
139	601857	中国石油	374,876	3,253,923.68	0.19
140	601328	交通银行	503,100	3,234,933.00	0.19
141	601288	农业银行	532,662	3,233,258.34	0.19
142	601100	恒立液压	29,700	3,194,532.00	0.19
143	600196	复星医药	141,600	3,181,752.00	0.19
144	688498	源杰科技	1,687	3,181,682.00	0.19
145	688469	芯联集成	293,400	3,112,974.00	0.18
146	600114	东睦股份	81,500	3,077,440.00	0.18
147	688692	达梦数据	12,300	3,004,767.00	0.17
148	301603	乔锋智能	20,800	2,991,040.00	0.17
149	600938	中国海油	109,000	2,959,350.00	0.17
150	002379	宏桥控股	199,200	2,942,184.00	0.17
151	300580	贝斯特	145,600	2,928,016.00	0.17
152	300760	迈瑞医疗	21,500	2,920,345.00	0.17
153	603305	旭升集团	240,100	2,910,012.00	0.17
154	600028	中国石化	643,830	2,871,481.80	0.17
155	300001	特锐德	75,500	2,856,165.00	0.17
156	688213	思特威	26,400	2,826,648.00	0.16
157	300496	中科创达	45,700	2,823,803.00	0.16
158	600066	宇通客车	104,700	2,807,007.00	0.16
159	603129	春风动力	10,900	2,788,220.00	0.16
160	601319	中国人保	408,600	2,762,136.00	0.16
161	601877	正泰电器	107,000	2,682,490.00	0.16
162	600845	宝信软件	158,900	2,642,507.00	0.15
163	601298	青岛港	326,700	2,629,935.00	0.15
164	603997	继峰股份	221,000	2,614,430.00	0.15
165	603979	金诚信	44,000	2,597,320.00	0.15
166	000543	皖能电力	340,500	2,577,585.00	0.15
167	688568	中科星图	61,800	2,562,846.00	0.15
168	601728	中国电信	492,104	2,554,019.76	0.15
169	600517	国网英大	534,200	2,500,056.00	0.15
170	688182	灿勤科技	57,300	2,467,911.00	0.14

171	002128	电投能源	104,400	2,413,728.00	0.14
172	300341	麦克奥迪	179,700	2,381,025.00	0.14
173	000612	焦作万方	224,300	2,375,337.00	0.14
174	000538	云南白药	50,000	2,368,500.00	0.14
175	002318	久立特材	99,100	2,368,490.00	0.14
176	300433	蓝思科技	43,280	2,322,404.80	0.14
177	688472	阿特斯	214,100	2,316,562.00	0.13
178	603508	思维列控	107,100	2,287,656.00	0.13
179	603025	大豪科技	167,500	2,284,700.00	0.13
180	601061	中信金属	197,500	2,127,075.00	0.12
181	002841	视源股份	61,500	2,123,595.00	0.12
182	688065	凯赛生物	43,900	2,100,615.00	0.12
183	688036	传音控股	35,543	2,095,259.85	0.12
184	688387	信科移动	105,000	2,083,200.00	0.12
185	600016	民生银行	632,500	2,036,650.00	0.12
186	601818	光大银行	692,900	2,002,481.00	0.12
187	000708	中信特钢	155,500	1,962,410.00	0.11
188	688271	联影医疗	18,700	1,893,001.00	0.11
189	300687	赛意信息	59,500	1,844,500.00	0.11
190	603538	美诺华	56,600	1,842,330.00	0.11
191	601390	中国中铁	440,900	1,838,553.00	0.11
192	688183	生益电子	13,800	1,827,120.00	0.11
193	600426	华鲁恒升	75,900	1,815,528.00	0.11
194	300475	香农芯创	6,000	1,800,000.00	0.10
195	601888	中国中免	33,300	1,788,543.00	0.10
196	002716	湖南白银	220,500	1,783,845.00	0.10
197	002531	天顺风能	211,200	1,780,416.00	0.10
198	601916	浙商银行	673,600	1,771,568.00	0.10
199	002847	盐津铺子	39,500	1,761,700.00	0.10
200	600050	中国联通	437,070	1,748,280.00	0.10
201	601868	中国能建	650,000	1,735,500.00	0.10
202	002487	大金重工	29,800	1,727,506.00	0.10
203	600816	建元信托	704,600	1,719,224.00	0.10
204	600460	士兰微	31,300	1,710,858.00	0.10
205	600585	海螺水泥	100,300	1,700,085.00	0.10
206	000807	云铝股份	76,600	1,695,924.00	0.10
207	601788	光大证券	117,100	1,689,753.00	0.10
208	600309	万华化学	24,500	1,676,045.00	0.10
209	301396	宏景科技	5,000	1,658,000.00	0.10
210	300573	兴齐眼药	40,400	1,646,704.00	0.10
211	601399	国机重装	463,500	1,622,250.00	0.09
212	601600	中国铝业	195,896	1,610,265.12	0.09
213	688126	沪硅产业	40,200	1,603,578.00	0.09
214	603806	福斯特	94,860	1,592,699.40	0.09

215	603638	艾迪精密	66,600	1,561,770.00	0.09
216	002493	荣盛石化	143,598	1,543,678.50	0.09
217	600584	长电科技	14,894	1,542,273.70	0.09
218	600549	厦门钨业	18,100	1,542,120.00	0.09
219	600011	华能国际	203,000	1,540,770.00	0.09
220	002138	顺络电子	20,700	1,513,170.00	0.09
221	300015	爱尔眼科	181,200	1,496,712.00	0.09
222	600362	江西铜业	34,100	1,476,530.00	0.09
223	300450	先导智能	36,100	1,469,992.00	0.09
224	600346	恒力石化	81,000	1,434,510.00	0.08
225	000301	东方盛虹	119,300	1,365,985.00	0.08
226	601336	新华保险	22,500	1,342,350.00	0.08
227	601658	邮储银行	269,400	1,328,142.00	0.08
228	002594	比亚迪	16,600	1,323,020.00	0.08
229	301200	大族数控	3,600	1,298,340.00	0.08
230	601069	西部黄金	58,900	1,295,800.00	0.08
231	601229	上海银行	148,000	1,284,640.00	0.07
232	688525	佰维存储	2,580	1,276,403.40	0.07
233	600690	海尔智家	62,100	1,267,461.00	0.07
234	688002	睿创微纳	8,100	1,252,989.00	0.07
235	000690	宝新能源	258,900	1,216,830.00	0.07
236	600219	南山铝业	299,000	1,193,010.00	0.07
237	601127	赛力斯	18,900	1,157,625.00	0.07
238	300903	科翔股份	11,400	1,154,934.00	0.07
239	301328	维峰电子	16,000	1,139,200.00	0.07
240	600487	亨通光电	10,200	1,115,268.00	0.06
241	600809	山西汾酒	9,900	1,082,763.00	0.06
242	600104	上汽集团	109,739	1,071,052.64	0.06
243	601808	中海油服	96,300	1,041,003.00	0.06
244	601919	中远海控	75,980	1,007,494.80	0.06
245	000568	泸州老窖	12,400	961,248.00	0.06
246	601727	上海电气	136,274	953,918.00	0.06
247	688019	安集科技	2,800	950,488.00	0.06
248	000776	广发证券	40,400	945,360.00	0.05
249	600499	科达制造	68,200	941,160.00	0.05
250	601212	白银有色	185,100	940,308.00	0.05
251	600741	华域汽车	58,700	911,024.00	0.05
252	000063	中兴通讯	24,800	897,512.00	0.05
253	300255	常山药业	38,100	892,302.00	0.05
254	002050	三花智控	19,600	859,068.00	0.05
255	001248	华润新能源	83,711	846,318.21	0.05
256	600372	中航机载	75,400	818,090.00	0.05
257	000999	华润三九	36,200	814,138.00	0.05
258	002304	洋河股份	20,900	797,335.00	0.05

259	601668	中国建筑	179,600	779,464.00	0.05
260	600699	均胜电子	35,900	775,799.00	0.05
261	601006	大秦铁路	167,200	770,792.00	0.04
262	601607	上海医药	48,900	753,060.00	0.04
263	603019	中科曙光	6,600	707,718.00	0.04
264	601816	京沪高铁	156,081	707,046.93	0.04
265	300033	同花顺	2,600	626,600.00	0.04
266	002353	杰瑞股份	4,000	610,000.00	0.04
267	688766	普冉股份	700	536,620.00	0.03
268	605117	德业股份	5,000	530,900.00	0.03
269	002027	分众传媒	101,600	491,744.00	0.03
270	000426	兴业银锡	14,700	484,512.00	0.03
271	600415	小商品城	45,100	458,216.00	0.03
272	300037	新宙邦	4,500	417,825.00	0.02
273	002222	福晶科技	4,500	415,260.00	0.02
274	688127	蓝特光学	4,200	409,920.00	0.02
275	688331	荣昌生物	3,100	403,806.00	0.02
276	603061	金海通	800	401,776.00	0.02
277	688308	欧科亿	2,200	399,982.00	0.02
278	300769	德方纳米	6,000	399,000.00	0.02
279	600999	招商证券	18,900	398,790.00	0.02
280	605305	中际联合	9,500	398,240.00	0.02
281	001316	润贝航科	11,800	389,164.00	0.02
282	002179	中航光电	8,396	387,895.20	0.02
283	601869	长飞光纤	700	382,130.00	0.02
284	688235	百济神州	1,500	381,915.00	0.02
285	000680	山推股份	37,900	380,895.00	0.02
286	600885	宏发股份	11,000	379,390.00	0.02
287	001309	德明利	400	377,160.00	0.02
288	002606	大连电瓷	28,000	375,480.00	0.02
289	603198	迎驾贡酒	12,500	370,000.00	0.02
290	002170	芭田股份	34,000	369,240.00	0.02
291	002956	西麦食品	17,600	365,376.00	0.02
292	688392	骄成超声	1,600	363,488.00	0.02
293	000933	神火股份	17,100	362,520.00	0.02
294	601066	中信建投	12,000	348,840.00	0.02
295	002850	科达利	1,800	340,740.00	0.02
296	600109	国金证券	38,700	339,786.00	0.02
297	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.02
298	002558	巨人网络	12,100	333,476.00	0.02
299	600029	南方航空	63,600	329,448.00	0.02
300	601021	春秋航空	6,900	314,502.00	0.02
301	002653	海思科	4,700	311,798.00	0.02
302	300832	新产业	7,300	306,600.00	0.02

303	300803	指南针	3,300	302,511.00	0.02
304	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.02
305	300054	鼎龙股份	2,300	243,731.00	0.01
306	300277	汽轮科技	12,900	194,016.00	0.01
307	603163	圣晖集成	1,300	190,450.00	0.01
308	688378	奥来德	3,000	186,000.00	0.01
309	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
310	600674	川投能源	12,400	175,708.00	0.01
311	688809	强一股份	259	161,357.00	0.01
312	002422	科伦药业	4,100	157,932.00	0.01
313	603697	有友食品	16,200	155,358.00	0.01
314	601377	兴业证券	24,800	149,792.00	0.01
315	601058	赛轮轮胎	12,200	140,666.00	0.01
316	600061	国投资本	20,800	136,240.00	0.01
317	605098	行动教育	2,400	129,984.00	0.01
318	603196	璞源材料	5,200	127,088.00	0.01
319	688257	新锐股份	1,226	124,929.40	0.01
320	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
321	001227	兰州银行	56,100	112,200.00	0.01
322	688617	惠泰医疗	600	108,936.00	0.01
323	688609	九联科技	9,600	105,696.00	0.01
324	002645	华宏科技	3,700	101,787.00	0.01
325	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
326	600186	莲花控股	6,900	96,600.00	0.01
327	000958	电投产融	15,600	87,984.00	0.01
328	300975	商络电子	1,700	87,975.00	0.01
329	605060	联德股份	1,500	85,110.00	0.00
330	688475	萤石网络	3,000	82,050.00	0.00
331	688610	埃科光电	300	79,020.00	0.00
332	300331	苏大维格	1,100	78,221.00	0.00
333	002458	益生股份	10,000	77,700.00	0.00
334	688629	华丰科技	400	75,004.00	0.00
335	002636	金安国纪	600	71,982.00	0.00
336	301366	一博科技	1,100	67,287.00	0.00
337	688549	中巨芯	1,700	62,577.00	0.00
338	300626	华瑞股份	1,600	55,808.00	0.00
339	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
340	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
341	001339	智微智能	520	53,185.60	0.00
342	688807	优迅股份	131	52,718.33	0.00
343	002668	TCL 智家	4,560	50,524.80	0.00
344	603868	飞科电器	1,600	49,280.00	0.00
345	600015	华夏银行	7,500	47,925.00	0.00
346	301280	珠城科技	900	45,513.00	0.00

347	002948	青岛银行	8,900	45,212.00	0.00
348	688403	汇成股份	1,100	43,670.00	0.00
349	002936	郑州银行	26,000	42,900.00	0.00
350	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
351	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
352	301099	雅创电子	400	38,200.00	0.00
353	300666	江丰电子	100	36,860.00	0.00
354	600353	旭光电子	800	36,480.00	0.00
355	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
356	603075	热威股份	1,600	35,776.00	0.00
357	603195	公牛集团	900	35,235.00	0.00
358	688548	广钢气体	600	31,260.00	0.00
359	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
360	688478	晶升股份	300	26,565.00	0.00
361	605198	安德利	400	25,344.00	0.00
362	300223	北京君正	100	24,890.00	0.00
363	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
364	002515	金字火腿	2,200	22,022.00	0.00
365	003000	劲仔食品	2,200	21,692.00	0.00
366	000636	风华高科	300	21,672.00	0.00
367	301607	富特科技	400	20,900.00	0.00
368	601901	方正证券	2,900	20,880.00	0.00
369	300319	麦捷科技	700	20,741.00	0.00
370	301439	泓淋电力	1,200	18,864.00	0.00
371	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
372	605499	东鹏饮料	150	18,514.50	0.00
373	300590	移为通信	1,200	17,220.00	0.00
374	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
375	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
376	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
377	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
378	301307	美利信	200	15,058.00	0.00
379	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
380	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
381	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
382	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
383	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
384	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
385	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
386	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
387	300005	探路者	400	9,040.00	0.00
388	300842	帝科股份	100	8,917.00	0.00
389	002119	康强电子	200	7,984.00	0.00
390	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00

391	603738	泰晶科技	100	6,005.00	0.00
392	002965	祥鑫科技	100	5,095.00	0.00
393	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
394	601689	拓普集团	65	3,667.30	0.00
395	688513	苑东生物	80	3,516.80	0.00
396	688391	钜泉科技	90	3,228.30	0.00
397	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
398	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
399	688179	阿拉丁	85	2,355.35	0.00
400	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
401	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
402	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
403	601633	长城汽车	68	1,026.12	0.00
404	688597	煜邦电力	126	819.00	0.00
405	688153	唯捷创芯	20	642.40	0.00
406	601108	财通证券	58	501.70	0.00
407	601800	中国交建	81	462.51	0.00
408	688728	格科微	20	420.80	0.00
409	688009	中国通号	77	366.52	0.00
410	688077	大地熊	13	344.37	0.00
411	600905	三峡能源	47	174.37	0.00

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	300308	中际旭创	106,777,646.48	3.01
2	603986	兆易创新	89,411,418.50	2.52
3	601138	工业富联	81,716,753.43	2.30
4	300274	阳光电源	79,313,581.65	2.24
5	600519	贵州茅台	64,904,236.83	1.83
6	002460	赣锋锂业	59,862,634.00	1.69
7	300502	新易盛	58,699,332.88	1.66
8	601600	中国铝业	57,846,589.00	1.63
9	600415	小商品城	56,960,885.00	1.61
10	603993	洛阳钼业	56,108,813.00	1.58
11	603799	华友钴业	55,592,662.63	1.57
12	688256	寒武纪	55,316,667.08	1.56
13	300750	宁德时代	54,479,111.32	1.54
14	600309	万华化学	52,808,938.00	1.49

15	601888	中国中免	48,996,966.00	1.38
16	600183	生益科技	48,011,912.92	1.35
17	600150	中国船舶	46,418,284.71	1.31
18	688041	海光信息	45,494,026.32	1.28
19	002352	顺丰控股	44,222,146.43	1.25
20	688008	澜起科技	43,849,151.32	1.24

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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	162,842,296.91	4.59
2	300750	宁德时代	155,402,658.16	4.38
3	603986	兆易创新	123,482,901.32	3.48
4	600519	贵州茅台	113,161,689.40	3.19
5	300502	新易盛	107,914,173.84	3.04
6	601318	中国平安	105,596,257.00	2.98
7	601899	紫金矿业	100,349,216.00	2.83
8	688041	海光信息	97,983,520.39	2.76
9	300274	阳光电源	95,756,548.86	2.70
10	600036	招商银行	92,658,953.98	2.61
11	603993	洛阳钼业	89,330,012.00	2.52
12	603259	药明康德	88,583,885.00	2.50
13	601138	工业富联	87,312,378.55	2.46
14	002475	立讯精密	83,929,299.88	2.37
15	601166	兴业银行	81,869,286.08	2.31
16	600406	国电南瑞	81,177,581.12	2.29
17	000333	美的集团	77,831,292.30	2.19
18	600900	长江电力	77,001,728.00	2.17
19	601857	中国石油	76,492,806.40	2.16
20	600309	万华化学	73,266,066.32	2.07
21	300433	蓝思科技	71,860,216.30	2.03
22	000063	中兴通讯	71,779,355.07	2.02
23	000338	潍柴动力	71,746,336.29	2.02

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	7,225,753,087.54
---------------	------------------

卖出股票的收入（成交）总额	9,067,525,179.23
---------------	------------------

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	62,666,393.98	3.64
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	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	62,666,393.98	3.64

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	019785	25 国债 13	300,000	30,378,764.39	1.77
2	019792	25 国债 19	200,000	20,209,846.58	1.18
3	019827	26 国债 01	120,000	12,077,783.01	0.70

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投资。

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

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，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

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约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	6,839,735.73
2	应收证券清算款	4,172,906.38
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,246,684.88
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,259,326.99

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
海富通沪深 300 增强 A	73,693	8,767.13	437,410,200.09	67.70%	208,665,952.24	32.30%
海富通沪深 300 增强 C	136,285	3,371.15	134,506,018.46	29.28%	324,931,032.92	70.72%
海富通沪深 300 增强 Y	18	4,639.47	-	-	83,510.52	100.00%
合计	209,996	5,264.85	571,916,218.55	51.73%	533,680,495.68	48.27%

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、Y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	海富通沪深 300 增强 A	387,712.82	0.0600%
	海富通沪深 300 增强 C	427,633.44	0.0931%
	海富通沪深 300 增强 Y	70.85	0.0848%
	合计	815,417.11	0.0738%

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	海富通沪深 300 增强 A	10~50
	海富通沪深 300 增强 C	0~10
	海富通沪深 300 增强 Y	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通沪深 300 增强 A	0~10
	海富通沪深 300 增强 C	0~10
	海富通沪深 300 增强 Y	0
	合计	0~10

89 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C	海富通沪深 300 增强 Y
基金合同生效日（2019 年 10 月 9 日）基金份额总额	6,889,756.32	1,555,113.21	-
本报告期期初基金份额总额	1,273,730,883.53	1,195,717,849.78	16,007.53
本报告期基金总申购份额	345,005,167.98	357,128,691.21	98,592.99
减：本报告期基金总赎回份额	972,659,899.18	1,093,409,489.61	31,090.00

本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	646,076,152.33	459,437,051.38	83,510.52

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

基金管理人：

2026 年 4 月 30 日，海富通基金管理有限公司发布公告，魏峻先生不再担任公司副总经理。

2026 年 5 月 23 日，海富通基金管理有限公司发布公告，总经理任志强先生自 2026 年 5 月 22 日起兼任公司首席信息官，陶网雄先生不再担任公司首席信息官。

基金托管人：

本报告期内，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

报告期内，无涉及本基金基金管理人基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人无受调查或处罚情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况**10.7.1 基金租用或者通过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	
中信证券	2	3,958,724,944.85	24.30%	735,900.48	24.30%	-
申万宏源	2	2,960,881,091.16	18.18%	550,424.59	18.18%	-
招商证券	2	2,840,191,365.02	17.44%	527,992.47	17.44%	-
银河证券	1	2,691,603,684.94	16.52%	500,388.01	16.52%	-
华泰证券	2	2,004,039,240.23	12.30%	372,559.61	12.30%	-
国泰海通证券	3	1,834,642,952.67	11.26%	341,065.92	11.26%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金新增华泰证券二个交易单元。

2、交易单元的选择标准：

基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司，租用其交易单元供本基金证券交易。

3、交易单元的选择程序：

(1) 由牵头部门依据上述交易单元选择标准及公司内控制度要求，对候选券商开展尽职调查，综合评估其财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力。

(2) 经评估，牵头部门将符合公司制度要求的券商相关材料提交督察长进行合规性审查，再提交基金管理人的总经理办公会审议。

(3) 基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》。

10.7.2 基金租用或者通过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
中信证券	114,260,577.88	53.12%	1,477,357,000.00	55.95%	-	-
申万宏源	84,342,940.00	39.21%	1,077,832,000.00	40.82%	-	-
招商证券	16,510,936.00	7.68%	71,000,000.00	2.69%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	14,290,000.00	0.54%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

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海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金 Y 类份额新增销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-08
2	海富通基金管理有限公司关于海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金 Y 类份额新增销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-14
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华创证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-27
4	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资	证券时报、基金管理人网	2026-02-04

	关联方承销期内承销证券的公告	站及中国证监会基金电子披露网站	
5	海富通基金管理有限公司关于调整基金经理助理的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-25
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增珠海盈米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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-04
7	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-19
8	海富通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
9	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-01
10	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中欧财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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-28
12	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-30
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增易方达财富管理基金销售(广州)有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-13
14	海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-13
15	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-21
16	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
17	海富通基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-10
18	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所上市股票及相关风险	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电	2026-06-13

	提示的公告	子披露网站	
19	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-16
20	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-30

§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 137 只公募基金。截至 2026 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 3108 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。2008 年 3 月，海富通获批从事特定客户资产管理业务。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保险监督管理委员会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会准予海富通富睿混合型证券投资基金变更注册的文件
- (二)海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同
- (三)海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

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

二〇二六年八月三十一日