

# 海富通量化先锋股票型证券投资基金

## 2021 年中期报告

### 2021 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：二〇二一年八月三十一日

## §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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 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.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	53
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>58</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	60

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通量化先锋股票型证券投资基金	
基金简称	海富通量化先锋股票	
基金主代码	005188	
交易代码	005188	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2018年2月8日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	153,079,991.93 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C
下属分级基金的交易代码	005189	005188
报告期末下属分级基金的份额总额	92,830,324.70 份	60,249,667.23 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在严格控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金，在进行资产配置决策时，依据量化择时模型，对宏观经济、政策预期、市场情绪、投资者行为等指标进行监控，精确把握市场方向，在本基金的投资比例范围内对组合中股票、债券等资产的仓位进行调整。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 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	010-66594319
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石	北京西城区复兴门内大街1号

	桥路66号东亚银行金融大厦 36-37层	
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦 36-37层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	杨仓兵	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hffund.com">http://www.hffund.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（2021年1月1日至2021年6月30日）	
	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C
本期已实现收益	27,421,472.12	15,142,583.24
本期利润	19,340,727.92	11,742,738.94
加权平均基金份额本期利润	0.2035	0.2189
本期加权平均净值利润率	11.43%	12.21%
本期基金份额净值增长率	12.44%	12.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C
期末可供分配利润	75,146,248.05	49,266,462.78
期末可供分配基金份额利润	0.8095	0.8177
期末基金资产净值	175,978,757.09	114,870,838.52
期末基金份额净值	1.8957	1.9066
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C
基金份额累计净值增长率	89.57%	90.66%

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

##### 海富通量化先锋股票 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	2.41%	1.04%	0.97%	0.58%	1.44%	0.46%
过去三个月	11.51%	1.09%	7.23%	0.54%	4.28%	0.55%
过去六个月	12.44%	1.48%	5.88%	0.79%	6.56%	0.69%
过去一年	34.04%	1.44%	13.43%	1.01%	20.61%	0.43%
过去三年	92.89%	1.36%	27.99%	1.18%	64.90%	0.18%
自基金合同生效起至今	89.57%	1.30%	19.81%	1.18%	69.76%	0.12%

##### 海富通量化先锋股票 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	2.38%	1.04%	0.97%	0.58%	1.41%	0.46%
过去三个月	11.40%	1.09%	7.23%	0.54%	4.17%	0.55%
过去六个月	12.22%	1.48%	5.88%	0.79%	6.34%	0.69%
过去一年	33.51%	1.44%	13.43%	1.01%	20.08%	0.43%
过去三年	94.87%	1.36%	27.99%	1.18%	66.88%	0.18%
自基金合同生效起至今	90.66%	1.30%	19.81%	1.18%	70.85%	0.12%

#### 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

海富通量化先锋股票型证券投资基金

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

(2018年2月8日至2021年6月30日)

## 海富通量化先锋股票 A



## 海富通量化先锋股票 C



注：本基金合同于 2018 年 2 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 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 87 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、海富通可转债优选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、海富通富祥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、海富通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、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、海富通中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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。

#### 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		
纪君凯	本基金的基金经理	2020-07-03	-	4 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任天风证券上海自营分公司衍生品部投资研究、期权交易职位。2017 年 7 月加入海富通基金管理有限公司，历任投资经理、量化投资部基金经理助理。2020 年 6 月起兼任海富通上证非周期 ETF、海富通上证周期 ETF 的基金经理。2020 年 7 月起兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。

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为：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

2021 年上半年，全球各大经济体从疫情中逐渐复苏，虽然路径有所曲折但经济活力显著增加。由于全球供应链还在恢复中，全球流动性释放充分，大宗商品价格涨幅最为显著。海外需求强劲但海运费用涨幅惊人，出口企业盈利增长受到相当制约。相对外需，国内需求稍显疲弱，日益上涨的原材料压缩中游制造业利润。消费服务业复苏态势确立但强度较弱，新经济（新消费）增长态势显著高于旧经济。资本市场担忧的全球货币紧缩在上半年没有得到应验。

市场整体走势如同 N 字型态势，风格出现明显变化。春节前，核心资产为主的“茅指数”领涨，春节后担心美债利率上行和货币政策转向，核心资产领跌。五月以来，十年期国债利率继续下行带来成长股反弹。尤其是降准以来，市场风格向成长板块继续偏移。上半年 A 股主要指数方面，上证

指数上涨 3.40%，沪深 300 上涨 0.24%，中证 800 上涨 1.72%，中小综指上涨 5.19%，创业板指上涨 17.22%。分行业看，周期和医药行业领涨，钢铁、化工、煤炭、综合和医药分别上涨 26.34%、19.12%、18.33%、16.93%和 16.10%；非银金融和军工通信明显落后，非银金融、国防军工、农林牧渔、通信和综合金融分别下跌 11.02%、8.46%、7.84%、3.35%和 2.88%。

从上半年市场内部的结构看，周期和成长交相呼应成为市场两条主线。周期主线在一季度演绎得淋漓尽致，尤其在碳达峰的政策预期下，与此匹配的是相关行业上半年的业绩表现。同样是业绩靓丽的电动车产业链和半导体，五月以来行情同样演绎得如火如荼。消费领域除了医药 CXO 和次高端白酒，整体表现较弱。市场上半年赚钱效应明显，小盘股表现优于大盘股，核心资产相对疲弱。市场交易集中度有所下降，双创指数表现靓丽。整个市场反映出经济结构转型带来的红利，中国优势供应链成为市场配置热点。

本报告期，基金积极投资股票市场，力争在风险可控的基础上，跑赢市场。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通量化先锋股票 A 净值增长率为 12.44%，同期业绩比较基准收益率为 5.88%，基金净值跑赢业绩比较基准 6.56 个百分点；海富通量化先锋股票 C 净值增长率为 12.22%，同期业绩比较基准收益率为 5.88%，基金净值跑赢业绩比较基准 6.34 个百分点。

#### 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，经济复苏态势或依然延续，政策工具箱已经提前打开。经济韧性依旧，出口与地产投资扩张趋势或可延续。货币政策预期可能更加平稳，对整个市场的影响或弱于上半年。当然，信用风险事件可能还会持续发生，流动性条件或与上半年相仿。

不管是周期还是成长，上半年的主线就是业绩（分子端）。上游原材料价格压力下半年依然明显，上游盈利或依然强于中游。产业趋势变化将是权益市场的主要驱动力。经济结构变化带来的红利较为确定，电动车、半导体、光伏等受益于政策导向的行业投资机会，或更容易把握。行业格局较为良好的周期板块或可享受业绩增长带来的收益。

#### 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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。

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”）在海富通量化先锋股票型证券投资基金（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：海富通量化先锋股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	28,288,068.98	17,072,847.02
结算备付金		4,219,955.57	4,586,982.29
存出保证金		59,137.60	75,577.01
交易性金融资产	6.4.7.2	252,577,234.38	236,160,197.57
其中：股票投资		252,574,574.78	236,111,156.66
基金投资		-	-
债券投资		2,659.60	49,040.91
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		6,653,519.92	2,441,214.68
应收利息	6.4.7.5	4,085.01	4,152.99
应收股利		-	-
应收申购款		13,193.29	500.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		291,815,194.75	260,341,471.56
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		147,918.36	-
应付赎回款		3,219.80	3,822,035.85
应付管理人报酬		347,263.02	319,095.34

应付托管费		57,877.15	53,182.56
应付销售服务费		36,439.45	28,893.80
应付交易费用	6.4.7.7	288,578.79	253,031.90
应交税费		-	0.13
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	84,302.57	128,333.33
负债合计		965,599.14	4,604,572.91
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	153,079,991.93	151,302,984.97
未分配利润	6.4.7.10	137,769,603.68	104,433,913.68
所有者权益合计		290,849,595.61	255,736,898.65
负债和所有者权益总计		291,815,194.75	260,341,471.56

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 153,079,991.93 份，其中海富通量化先锋股票 A 类份额 92,830,324.70 份，海富通量化先锋股票 C 类份额 60,249,667.23 份。A 类份额净值 1.8957 元，C 类份额净值 1.9066 元。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通量化先锋股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>34,832,146.89</b>	<b>23,057,023.61</b>
1.利息收入		79,673.08	35,151.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	75,329.44	25,796.02
债券利息收入		79.53	7,999.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,264.11	1,356.16
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		46,218,241.12	6,964,062.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	44,936,162.40	6,007,591.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	197,879.28	8,102.95
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-921,320.00	218,723.99

股利收益	6.4.7.16	2,005,519.44	729,644.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-11,480,588.50	15,947,725.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	14,821.19	110,084.38
<b>减：二、费用</b>		<b>3,748,680.03</b>	<b>830,344.26</b>
1. 管理人报酬		1,980,124.91	414,438.68
2. 托管费		330,020.80	69,073.13
3. 销售服务费		190,982.89	45,867.60
4. 交易费用	6.4.7.19	1,159,041.66	247,449.91
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		0.06	787.53
7. 其他费用	6.4.7.20	88,509.71	52,727.41
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>31,083,466.86</b>	<b>22,226,679.35</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>31,083,466.86</b>	<b>22,226,679.35</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通量化先锋股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	151,302,984.97	104,433,913.68	255,736,898.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,083,466.86	31,083,466.86
三、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）	1,777,006.96	2,252,223.14	4,029,230.10
其中：1.基金申购款	12,484,374.94	9,693,662.61	22,178,037.55
2.基金赎回款	-10,707,367.98	-7,441,439.47	-18,148,807.45
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	153,079,991.93	137,769,603.68	290,849,595.61



项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	32,281,240.80	4,803,061.45	37,084,302.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,226,679.35	22,226,679.35
三、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）	124,704,183.65	38,811,741.14	163,515,924.79
其中：1.基金申购款	158,859,510.54	45,265,194.18	204,124,704.72
2.基金赎回款	-34,155,326.89	-6,453,453.04	-40,608,779.93
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	156,985,424.45	65,841,481.94	222,826,906.39

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

海富通量化先锋股票型证券投资基金(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]第 1210 号《关于准予海富通量化先锋股票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《海富通量化先锋股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本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 330,949,630.14 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(2018)第 0107 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通量化先锋股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 331,099,125.24 份，其中认购资金利息折合 149,495.10 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《海富通量化先锋股票型证券投资基金基金合同》和《海富通量化先锋股票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、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 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 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通量化先锋股票型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（包含中小板、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、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、地方政府债、中小企业私募债及其他经中国证监会允许投资的债券）、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）、同业存单、货币市场工具、权证、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例范围为 80-95%。在每个交易日日终，扣除股指期货合约须缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。股指期货投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

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 2021 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》、《海富通量化先锋股票型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 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 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 2021年6月30日
活期存款	28,288,068.98
定期存款	-
其他存款	-
合计	28,288,068.98

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	239,365,563.79	252,574,574.78	13,209,010.99
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,300.00	2,659.60
	银行间市场	-	-
	合计	2,300.00	2,659.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	239,367,863.79	252,577,234.38	13,209,370.59

### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,158.50
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,855.10
应收债券利息	2.47
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	45.00
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	23.94
合计	4,085.01

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	288,578.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	288,578.79

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.01
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,302.56
合计	84,302.57

**6.4.7.9 实收基金**

海富通量化先锋股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	102,059,547.20	102,059,547.20
本期申购	201,936.20	201,936.20
本期赎回（以“-”号填列）	-9,431,158.70	-9,431,158.70
本期末	92,830,324.70	92,830,324.70

海富通量化先锋股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	49,243,437.77	49,243,437.77
本期申购	12,282,438.74	12,282,438.74
本期赎回（以“-”号填列）	-1,276,209.28	-1,276,209.28
本期末	60,249,667.23	60,249,667.23

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

海富通量化先锋股票 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	53,483,416.98	16,528,527.19	70,011,944.17
本期利润	27,421,472.12	-8,080,744.20	19,340,727.92
本期基金份额交易产生的变动数	-5,758,641.05	-445,598.65	-6,204,239.70
其中：基金申购款	137,598.52	18,920.95	156,519.47
基金赎回款	-5,896,239.57	-464,519.60	-6,360,759.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	75,146,248.05	8,002,184.34	83,148,432.39

海富通量化先锋股票 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	26,288,802.38	8,133,167.13	34,421,969.51
本期利润	15,142,583.24	-3,399,844.30	11,742,738.94
本期基金份额交易产生的变动数	7,835,077.16	621,385.68	8,456,462.84
其中：基金申购款	8,747,928.80	789,214.34	9,537,143.14
基金赎回款	-912,851.64	-167,828.66	-1,080,680.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,266,462.78	5,354,708.51	54,621,171.29

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	35,938.88
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	36,275.95
其他	3,114.61
合计	75,329.44

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	489,295,742.94
减：卖出股票成本总额	444,359,580.54
买卖股票差价收入	44,936,162.40

## 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,629,938.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,429,240.91
减：应收利息总额	2,817.85
买卖债券差价收入	197,879.28

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益（税前）	-921,320.00
股指期货差价收入应缴纳增值税额	-
合计	-921,320.00

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,005,519.44
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	2,005,519.44

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-11,480,588.50
——股票投资	-11,478,207.19
——债券投资	-2,381.31
——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	-11,480,588.50

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	14,819.58
转换费收入	1.61
合计	14,821.19

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	1,159,041.66
银行间市场交易费用	-
合计	1,159,041.66

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,207.15
合计	88,509.71

### 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
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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	24,161,246.96	2.54%	102,989,746.79	40.40%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内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 2021年1月1日至2021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	17,668.89	3.12%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	74,300.90	43.50%	73,819.06	48.04%

#### 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
	2021年1月1日至2021年6月	2020年1月1日至2020年6月

	30日	月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,980,124.91	414,438.68
其中：支付销售机构的客户维护费	50,228.70	60,735.85

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 1.5% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

#### 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
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	330,020.80	69,073.13

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：日托管费 = 前一日基金资产净值  $\times$  0.25% / 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		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C	合计
中国银行	-	184.88	184.88
海通证券	-	85.32	85.32
海富通基金	-	187,833.17	187,833.17
合计	-	188,103.37	188,103.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C	合计
中国银行	-	287.35	287.35
海通证券	-	49.73	49.73
海富通	-	43,172.37	43,172.37
合计	-	43,509.45	43,509.45

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销

售机构。其计算公式为：日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金份额对应的资产净值 X 0.4% / 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固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	28,288,068.98	35,938.88	15,881,984.91	13,433.11

#### 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 2021年1月1日至2021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:)	总金额

				股/张)	
海通证券	300933	中辰股份	网下发行	11,117	37,464.29
海通证券	300940	南极光	网下发行	3,068	39,147.68
海通证券	300981	中红医疗	网下发行	1,844	89,599.96
海通证券	688092	爱科科技	网下发行	1,137	21,728.07
海通证券	688217	睿昂基因	网下发行	1,040	19,156.80
海通证券	688626	翔宇医疗	网下发行	2,009	57,899.38
海通证券	688630	芯碁微装	网下发行	3,397	51,736.31
海通证券	688665	四方光电	网下发行	1,687	49,817.11
海通证券	688680	海优新材	网下发行	1,337	93,509.78
海通证券	688682	霍莱沃	网下发行	946	43,251.12
海通证券	688687	凯因科技	网下发行	5,087	96,551.26
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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（2021 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	可流通日	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
300782	卓胜微	2021-05-25	2021-11-25	大宗交易	368.10	498.67	8,000	2,944,800.00	3,989,360.00	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股锁定流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-

				流通受限						
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股锁定流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股锁定流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股锁定流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	5
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股锁定流通	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-

				受限						
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股锁定流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股锁定流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股锁定流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股锁定流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股锁定流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股锁定流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股锁定流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股锁定流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股锁定流通受限	6.87	12.07	1,149	7,893.63	13,868.43	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股锁定流通受限	28.28	115.71	234	6,617.52	27,076.14	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股锁定流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-

300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股 锁定 流通 受限	48.59	90.39	185	8,989.15	16,722.15	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股 锁定 流通 受限	24.90	24.81	268	6,673.20	6,649.08	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股 锁定 流通 受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股 锁定 流通 受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股 锁定 流通 受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股 锁定 流通 受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股 锁定 流通 受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股 锁定 流通 受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股 锁定 流通 受限	4.94	13.05	915	4,520.10	11,940.75	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股 锁定 流通 受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股 锁定 流通 受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301011	晶雪	2021-0	2021-1	新股	7.83	17.61	218	1,706.	3,838.	-



0	节能	6-09	2-20	锁定 流通 受限				94	98	
30101 5	百洋 医药	2021-0 6-22	2021-1 2-30	新股 锁定 流通 受限	7.64	38.83	462	3,529. 68	17,939 .46	-
30101 6	雷尔 伟	2021-0 6-23	2021-1 2-30	新股 锁定 流通 受限	13.75	32.98	275	3,781. 25	9,069. 50	-
30101 8	申菱 环境	2021-0 6-28	2022-0 1-07	新股 未上 市并 锁定	8.29	8.29	782	6,482. 78	6,482. 78	-
30101 8	申菱 环境	2021-0 6-28	2021-0 7-07	新股 未上 市	8.29	8.29	7,029	58,270 .41	58,270 .41	-
30102 1	英诺 激光	2021-0 6-28	2022-0 1-06	新股 未上 市并 锁定	9.46	9.46	290	2,743. 40	2,743. 40	-
30102 1	英诺 激光	2021-0 6-28	2021-0 7-06	新股 未上 市	9.46	9.46	2,609	24,681 .14	24,681 .14	-
60350 1	韦尔 股份	2021-0 2-02	2021-0 8-02	大宗 交易	280.00	308.39	7,500	2,100, 000.00	2,312, 925.00	-
60516 2	新中 港	2021-0 6-29	2021-0 7-07	新股 未上 市	6.07	6.07	1,377	8,358. 39	8,358. 39	-
60528 7	德才 股份	2021-0 6-28	2021-0 7-06	新股 未上 市	31.56	31.56	349	11,014 .44	11,014 .44	-
68808 7	英科 再生	2021-0 6-30	2021-0 7-09	新股 未上 市	21.96	21.96	2,469	54,219 .24	54,219 .24	-
68818 3	生益 电子	2021-0 2-10	2021-0 8-25	新股 锁定 流通 受限	12.42	14.19	8,583	106.60 0.86	121,79 2.77	-
68819 1	智洋 创新	2021-0 3-30	2021-1 0-08	新股 锁定 流通 受限	11.38	17.74	3,203	36,450 .14	56,821 .22	-
68820	信安	2021-0	2021-1	新股	26.78	45.41	2,129	57,014	96,677	-

1	世纪	4-13	0-21	锁定 流通 受限				.62	.89	
68822 6	威腾 电气	2021-0 6-28	2021-0 7-07	新股 未上 市	6.42	6.42	2,693	17,289 .06	17,289 .06	-
68831 4	康拓 医疗	2021-0 5-11	2021-1 1-18	新股 锁定 流通 受限	17.34	74.48	1,085	18,813 .90	80,810 .80	-
68856 5	力源 科技	2021-0 5-06	2021-1 1-15	新股 锁定 流通 受限	9.39	14.00	2,464	23,136 .96	34,496 .00	-
68861 7	惠泰 医疗	2020-1 2-30	2021-0 7-07	新股 锁定 流通 受限	74.46	373.24	1,037	77,215 .02	387,04 9.88	-
68865 6	浩欧 博	2021-0 1-06	2021-0 7-13	新股 锁定 流通 受限	35.26	72.60	1,371	48,341 .46	99,534 .60	-
68866 1	和林 微纳	2021-0 3-19	2021-0 9-29	新股 锁定 流通 受限	17.71	84.01	1,452	25,714 .92	121,98 2.52	-
68869 0	纳微 科技	2021-0 6-16	2021-1 2-23	新股 锁定 流通 受限	8.07	79.89	3,477	28,059 .39	277,77 7.53	-
68870 0	东威 科技	2021-0 6-07	2021-1 2-15	新股 锁定 流通 受限	9.41	38.46	3,049	28,691 .09	117,26 4.54	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易

方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

3、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

5、[300948]冠中生态于 2021 年 2 月 18 日中签新股锁定流通受限数量 216 股，成本 2,808.00 元；于 2021 年 6 月 4 日送股，数量 108 股。因此总数量 324 股，总成本 2,808.00 元。

#### 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
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项	56.35	2021-07-01	59.49	80,000	4,035,555.00	4,508,000.00	-

注：本基金截至 2021 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 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

本基金是一只股票型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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以上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“风险和收益相匹配”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系统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在本基金的托管行中国银行，因而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 2021 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 0.00%(2020 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 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	2,659.60	49,040.91
未评级	-	-
合计	2,659.60	49,040.91

#### 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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期

现金流量。

#### 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上市公司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%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 4.39%。

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。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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 2021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	28,288,068.98	-	-	-	28,288,068.98
结算备付金	4,219,955.57	-	-	-	4,219,955.57
存出保证金	59,137.60	-	-	-	59,137.60
交易性金融资产	-	-	2,659.60	252,574,574.78	252,577,234.38
应收利息	-	-	-	4,085.01	4,085.01
应收申购款	-	-	-	13,193.29	13,193.29
应收证券清算款	-	-	-	6,653,519.92	6,653,519.92
资产总计	32,567,162.15	-	2,659.60	259,245,373.00	291,815,194.75
负债					
应付证券清算款	-	-	-	147,918.36	147,918.36
应付赎回款	-	-	-	3,219.80	3,219.80
应付管理人报酬	-	-	-	347,263.02	347,263.02
应付托管费	-	-	-	57,877.15	57,877.15
应付销售服务费	-	-	-	36,439.45	36,439.45
应付交易费用	-	-	-	288,578.79	288,578.79
其他负债	-	-	-	84,302.57	84,302.57

负债总计	-	-	-	965,599.14	965,599.14
利率敏感度缺口	32,567,162.15	-	2,659.60	258,279,773.86	290,849,595.61
<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	17,072,847.02	-	-	-	17,072,847.02
结算备付金	4,586,982.29	-	-	-	4,586,982.29
存出保证金	75,577.01	-	-	-	75,577.01
交易性金融资产	-	-	49,040.91	236,111,156.66	236,160,197.57
应收利息	-	-	-	4,152.99	4,152.99
应收申购款	-	-	-	500.00	500.00
应收证券清算款	-	-	-	2,441,214.68	2,441,214.68
资产总计	21,735,406.32	-	49,040.91	238,557,024.33	260,341,471.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,822,035.85	3,822,035.85
应付管理人报酬	-	-	-	319,095.34	319,095.34
应付托管费	-	-	-	53,182.56	53,182.56
应付销售服务费	-	-	-	28,893.80	28,893.80
应付交易费用	-	-	-	253,031.90	253,031.90
应交税费	-	-	-	0.13	0.13
其他负债	-	-	-	128,333.33	128,333.33
负债总计	-	-	-	4,604,572.91	4,604,572.91
利率敏感度缺口	21,735,406.32	-	49,040.91	233,952,451.42	255,736,898.65

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
市场利率上升 25 个基点	-34.64	-705.87
市场利率下降 25 个基点	35.18	718.02

#### 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其他价格风险。

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及存托凭证投资 80%-95%、权证投资 0%-3%。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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	252,574,574.	86.84	236,111,156.6	92.33

	78		6	
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	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>252,574,574.</b>	<b>86.84</b>	<b>236,111,156.6</b>	<b>92.33</b>
	78		6	

#### 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	12,822,766.74	13,145,210.37
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-12,822,766.74	-13,145,210.37

#### 6.4.14 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	252,574,574.78	86.55
	其中:股票	252,574,574.78	86.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,659.60	0.00
	其中:债券	2,659.60	0.00
	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	32,508,024.55	11.14
8	其他各项资产	6,729,935.82	2.31
9	合计	291,815,194.75	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	2,393,850.78	0.82
B	采矿业	3,915,000.00	1.35
C	制造业	208,676,691.03	71.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,994,220.39	0.69
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	46,404.58	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,663,153.20	4.01
J	金融业	12,767,273.59	4.39
K	房地产业	2,748,005.00	0.94
L	租赁和商务服务业	1,882,000.00	0.65
M	科学研究和技术服务业	941,729.04	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	3,327,632.73	1.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	835,600.00	0.29
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,372,000.00	0.47
S	综合	-	-

	合计	252,574,574.78	86.84
--	----	----------------	-------

### 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	300124	汇川技术	80,000	5,940,800.00	2.04
2	300122	智飞生物	30,000	5,601,900.00	1.93
3	600426	华鲁恒升	160,200	4,958,190.00	1.70
4	002653	海思科	230,000	4,949,600.00	1.70
5	002179	中航光电	60,000	4,741,200.00	1.63
6	600460	士兰微	80,000	4,508,000.00	1.55
7	002430	杭氧股份	120,000	4,150,800.00	1.43
8	300316	晶盛机电	80,000	4,040,000.00	1.39
9	000513	丽珠集团	80,000	4,001,600.00	1.38
10	300782	卓胜微	8,000	3,989,360.00	1.37
11	002138	顺络电子	100,000	3,877,000.00	1.33
12	603369	今世缘	70,000	3,791,200.00	1.30
13	300724	捷佳伟创	32,000	3,712,320.00	1.28
14	002080	中材科技	140,000	3,663,800.00	1.26
15	300777	中简科技	80,000	3,614,400.00	1.24
16	601799	星宇股份	16,000	3,611,520.00	1.24
17	603185	上机数控	20,000	3,579,000.00	1.23
18	600926	杭州银行	240,000	3,540,000.00	1.22
19	300653	正海生物	44,000	3,445,200.00	1.18
20	002241	歌尔股份	80,000	3,419,200.00	1.18
21	300408	三环集团	80,000	3,393,600.00	1.17
22	300628	亿联网络	40,000	3,352,000.00	1.15
23	000932	华菱钢铁	500,000	3,300,000.00	1.13
24	600323	瀚蓝环境	150,100	3,270,679.00	1.12
25	600309	万华化学	30,000	3,264,600.00	1.12
26	300014	亿纬锂能	30,046	3,122,680.78	1.07
27	300037	新宙邦	30,000	3,003,000.00	1.03
28	600958	东方证券	300,000	2,997,000.00	1.03
29	688002	睿创微纳	30,000	2,994,900.00	1.03
30	688526	科前生物	80,000	2,897,600.00	1.00
31	603113	金能科技	160,000	2,889,600.00	0.99

32	002867	周大生	145,150	2,869,615.50	0.99
33	000739	普洛药业	96,000	2,822,400.00	0.97
34	002690	美亚光电	49,997	2,787,832.72	0.96
35	603605	珀莱雅	14,000	2,753,940.00	0.95
36	002968	新大正	63,100	2,748,005.00	0.94
37	002444	巨星科技	80,000	2,726,400.00	0.94
38	600845	宝信软件	51,967	2,645,120.30	0.91
39	688208	道通科技	29,907	2,601,609.93	0.89
40	603267	鸿远电子	20,000	2,558,400.00	0.88
41	688006	杭可科技	30,000	2,550,000.00	0.88
42	603416	信捷电气	40,000	2,538,800.00	0.87
43	600779	水井坊	20,001	2,527,126.35	0.87
44	600219	南山铝业	700,000	2,520,000.00	0.87
45	600989	宝丰能源	180,000	2,462,400.00	0.85
46	601995	中金公司	40,000	2,460,000.00	0.85
47	000733	振华科技	40,000	2,442,800.00	0.84
48	002585	双星新材	120,000	2,415,600.00	0.83
49	002299	圣农发展	100,000	2,388,000.00	0.82
50	002812	恩捷股份	10,000	2,341,000.00	0.80
50	600183	生益科技	100,000	2,341,000.00	0.80
52	300168	万达信息	159,988	2,335,824.80	0.80
53	603501	韦尔股份	7,500	2,312,925.00	0.80
54	603156	养元饮品	80,000	2,286,400.00	0.79
55	603799	华友钴业	20,000	2,284,000.00	0.79
56	600298	安琪酵母	42,000	2,283,960.00	0.79
57	002507	涪陵榨菜	60,000	2,259,600.00	0.78
58	688099	晶晨股份	20,000	2,244,000.00	0.77
59	002258	利尔化学	80,000	2,064,000.00	0.71
60	600803	新奥股份	120,000	1,981,200.00	0.68
61	002318	久立特材	160,000	1,923,200.00	0.66
62	002027	分众传媒	200,000	1,882,000.00	0.65
63	000830	鲁西化工	100,000	1,873,000.00	0.64
64	600031	三一重工	60,000	1,744,200.00	0.60
65	300525	博思软件	98,147	1,742,109.25	0.60
66	002557	洽洽食品	40,000	1,724,000.00	0.59
67	603816	顾家家居	22,000	1,700,160.00	0.58
68	000983	山西焦煤	200,000	1,662,000.00	0.57
69	601966	玲珑轮胎	36,000	1,574,640.00	0.54
70	002028	思源电气	50,000	1,539,500.00	0.53
71	000799	酒鬼酒	6,000	1,533,600.00	0.53
72	600507	方大特钢	220,000	1,491,600.00	0.51
73	002821	凯莱英	4,000	1,490,400.00	0.51
74	300285	国瓷材料	30,000	1,462,500.00	0.50
75	600398	海澜之家	200,000	1,448,000.00	0.50

76	600919	江苏银行	200,000	1,420,000.00	0.49
77	603893	瑞芯微	10,000	1,394,600.00	0.48
78	300413	芒果超媒	20,000	1,372,000.00	0.47
79	600486	扬农化工	12,000	1,341,240.00	0.46
80	002078	太阳纸业	100,000	1,335,000.00	0.46
81	600038	中直股份	25,000	1,318,500.00	0.45
82	002056	横店东磁	100,000	1,300,000.00	0.45
83	688169	石头科技	1,000	1,261,000.00	0.43
84	002705	新宝股份	48,000	1,260,000.00	0.43
85	300737	科顺股份	40,000	1,257,600.00	0.43
86	600570	恒生电子	13,380	1,247,685.00	0.43
87	600985	淮北矿业	100,000	1,221,000.00	0.42
88	600171	上海贝岭	40,000	1,217,200.00	0.42
89	000807	云铝股份	100,000	1,190,000.00	0.41
90	002142	宁波银行	30,000	1,169,100.00	0.40
91	002979	雷赛智能	40,000	1,146,800.00	0.39
92	002920	德赛西威	9,900	1,089,792.00	0.37
93	600036	招商银行	20,001	1,083,854.19	0.37
94	603993	洛阳钼业	200,000	1,032,000.00	0.35
95	603613	国联股份	10,000	999,700.00	0.34
96	300207	欣旺达	30,000	976,800.00	0.34
97	601233	桐昆股份	40,000	963,600.00	0.33
98	601689	拓普集团	24,000	898,320.00	0.31
99	002706	良信股份	39,000	879,060.00	0.30
100	603517	绝味食品	10,000	842,900.00	0.29
101	002532	天山铝业	100,000	839,000.00	0.29
102	603010	万盛股份	40,000	838,800.00	0.29
103	002607	中公教育	40,000	835,600.00	0.29
104	600519	贵州茅台	400	822,680.00	0.28
105	000338	潍柴动力	40,000	714,800.00	0.25
106	603259	药明康德	4,056	635,129.04	0.22
107	600563	法拉电子	4,000	633,440.00	0.22
108	600690	海尔智家	20,000	518,200.00	0.18
109	688617	惠泰医疗	1,037	387,049.88	0.13
110	002539	云图控股	40,000	349,200.00	0.12
111	002967	广电计量	7,000	306,600.00	0.11
112	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.10
113	688109	品茗股份	3,061	237,656.04	0.08
114	000786	北新建材	5,600	219,800.00	0.08
115	600885	宏发股份	2,200	137,940.00	0.05
116	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.04
117	688183	生益电子	8,583	121,792.77	0.04
118	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.04
119	300577	开润股份	5,000	107,150.00	0.04

120	688656	浩欧博	1,371	99,534.60	0.03
121	688201	信安世纪	2,129	96,677.89	0.03
122	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.03
123	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
124	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.02
125	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.02
126	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
127	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
128	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
129	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.01
130	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
131	300973	立高食品	234	27,076.14	0.01
132	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
133	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
134	300941	创识科技	399	19,926.06	0.01
135	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
136	605077	华康股份	392	17,883.04	0.01
137	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
138	300981	中红医疗	185	16,722.15	0.01
139	300968	格林精密	1,149	13,868.43	0.00
140	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
141	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
142	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
143	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
144	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
145	300997	欢乐家	915	11,940.75	0.00
146	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
147	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
148	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
149	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
150	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
151	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
152	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
153	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
154	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
155	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
156	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
157	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
158	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
159	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
160	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
161	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
162	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
163	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00

164	002475	立讯精密	171	7,866.00	0.00
165	600276	恒瑞医药	115	7,816.55	0.00
166	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
167	300985	致远新能	268	6,649.08	0.00
168	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
169	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
170	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
171	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
172	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
173	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
174	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
175	300226	上海钢联	80	4,764.00	0.00
176	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
177	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
178	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
179	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
180	002624	完美世界	100	2,391.00	0.00
181	002372	伟星新材	100	2,067.00	0.00
182	002311	海大集团	22	1,795.20	0.00
183	002003	伟星股份	70	436.80	0.00
184	000852	石化机械	30	145.20	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	600989	宝丰能源	12,154,020.00	4.75
2	000932	华菱钢铁	11,531,345.99	4.51
3	601966	玲珑轮胎	9,507,145.11	3.72
4	300122	智飞生物	8,770,429.00	3.43
5	300782	卓胜微	8,641,584.00	3.38
6	603185	上机数控	7,376,809.00	2.88
7	002709	天赐材料	6,956,611.00	2.72
8	300124	汇川技术	6,903,057.33	2.70
9	002080	中材科技	6,418,909.31	2.51
10	002653	海思科	6,340,344.50	2.48
11	600779	水井坊	6,302,060.00	2.46
12	603799	华友钴业	5,833,622.00	2.28
13	601168	西部矿业	5,744,556.00	2.25
14	300014	亿纬锂能	5,701,549.45	2.23



15	002557	洽洽食品	5,650,573.00	2.21
16	601689	拓普集团	5,620,223.09	2.20
17	300724	捷佳伟创	5,612,551.00	2.19
18	600219	南山铝业	5,601,521.75	2.19
19	600507	方大特钢	5,445,023.00	2.13
20	000661	长春高新	5,351,617.00	2.09
21	603501	韦尔股份	5,334,892.00	2.09
22	601799	星宇股份	5,283,539.00	2.07
23	601166	兴业银行	5,120,058.00	2.00

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	601966	玲珑轮胎	14,326,496.02	5.60
2	600989	宝丰能源	10,589,101.05	4.14
3	000661	长春高新	10,419,474.40	4.07
4	601636	旗滨集团	10,211,328.00	3.99
5	600176	中国巨石	9,737,932.07	3.81
6	002709	天赐材料	9,660,486.60	3.78
7	300122	智飞生物	9,194,364.75	3.60
8	603218	日月股份	8,739,041.00	3.42
9	000932	华菱钢铁	8,446,894.79	3.30
10	603501	韦尔股份	6,861,612.53	2.68
11	603185	上机数控	6,756,667.00	2.64
12	600507	方大特钢	6,504,879.10	2.54
13	300316	晶盛机电	6,432,837.00	2.52
14	002557	洽洽食品	6,284,186.31	2.46
15	300782	卓胜微	6,275,019.52	2.45
16	601168	西部矿业	6,052,453.00	2.37
17	603882	金域医学	5,995,983.70	2.34
18	300014	亿纬锂能	5,980,877.70	2.34
19	600803	新奥股份	5,939,484.10	2.32
20	300699	光威复材	5,728,900.00	2.24
21	000656	金科股份	5,635,689.00	2.20
22	002705	新宝股份	5,440,140.20	2.13
23	002080	中材科技	5,250,571.25	2.05
24	600779	水井坊	5,247,172.00	2.05

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	472,301,205.85
卖出股票的收入（成交）总额	489,295,742.94

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	-	-
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）	2,659.60	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,659.60	0.00

## 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	128136	立讯转债	12	1,403.40	0.00
2	128135	洽洽转债	11	1,256.20	0.00

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 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海思科（002653）于 2020 年 10 月 13 日公告，因公司治理方面存在上市公司与控股股东在人员、资产、财务方面严重混同，内幕信息知情人登记管理不规范，公司董事、监事、高级管理人员报酬事项未履行决策程序；信息披露方面存在关联担保未及时披露，关联交易未及时披露，前五大供应商信息没有合并披露等违规问题。被西藏证监局采取出具警示函的行政监管措施，并记入证券期货市场诚信档案。

对该证券的投资决策程序的说明：公司是一家集新药研发、生产制造、销售等业务于一体的多元化、专业化医药集团。近十年的内生式研发，迄今已经打造丰富的全球创新药管线。经过本基金管理人

内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	59,137.60
2	应收证券清算款	6,653,519.92
3	应收股利	-
4	应收利息	4,085.01
5	应收申购款	13,193.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,729,935.82

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128136	立讯转债	1,403.40	0.00
2	128135	洽洽转债	1,256.20	0.00

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600460	士兰微	4,508,000.00	1.55	重大事项
2	300782	卓胜微	3,989,360.00	1.37	大宗交易

## §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
海富通量化先锋股票 A	170	546,060.73	85,490,683.63	92.09%	7,339,641.07	7.91%
海富通量化先锋股票 C	129	467,051.68	59,362,753.33	98.53%	886,913.90	1.47%
合计	299	511,973.22	144,853,436.96	94.63%	8,226,554.97	5.37%

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	海富通量化先锋股票 A	81,448.40	0.0877%
	海富通量化先锋股票 C	820.61	0.0014%
	合计	82,269.01	0.0537%

## 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	海富通量化先锋股票 A	0~10
	海富通量化先锋股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通量化先锋股票 A	0
	海富通量化先锋股票 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C
基金合同生效日（2018 年 2 月 8 日）基金份额总额	218,570,279.56	112,528,845.68
本报告期期初基金份额总额	102,059,547.20	49,243,437.77
本报告期基金总申购份额	201,936.20	12,282,438.74
减：本报告期基金总赎回份额	9,431,158.70	1,276,209.28
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	92,830,324.70	60,249,667.23

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

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关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	
华创证券	1	317,822,109.20	33.44%	130,720.54	23.09%	-
华西证券	1	151,577,940.90	15.95%	110,850.37	19.58%	-
国泰君安	2	125,459,362.09	13.20%	90,836.69	16.04%	-
国金证券	1	95,642,037.55	10.06%	50,814.36	8.98%	-

渤海证券	1	72,541,222.01	7.63%	51,598.64	9.11%	-
国盛证券	2	50,379,821.44	5.30%	36,842.40	6.51%	-
长江证券	1	47,425,830.94	4.99%	28,991.53	5.12%	-
天风证券	2	25,560,279.78	2.69%	18,722.68	3.31%	-
海通证券	2	24,161,246.96	2.54%	17,668.89	3.12%	-
西南证券	2	16,954,057.62	1.78%	12,398.73	2.19%	-
招商证券	2	13,216,634.76	1.39%	9,665.38	1.71%	-
开源证券	2	9,623,472.49	1.01%	7,037.53	1.24%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际 证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元没有发生变更。

#### 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
华创证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	5,129,978.85	92.95%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	9,418.02	0.17%	-	-	-	-
天风证券	48,967.20	0.89%	8,000,000.00	100.00%	-	-
海通证券	14,120.80	0.26%	-	-	-	-
西南证券	76,765.00	1.39%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	240,112.90	4.35%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际 证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

## 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旗下基金参加交通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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-01
2	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-01
3	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加平安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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-05
4	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-19
5	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-19
6	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2021-01-29



		电子披露网站	
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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-02
8	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-04
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒天明泽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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-26
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国盛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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-26
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东吴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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-05
12	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-16
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增甬兴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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-18
14	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台开通中国工商银行快捷支付业务并开展申购费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
15	海富通基金管理有限公司关于调整网上直销金账户业务并实施费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
16	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-25
17	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-29
18	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-15
19	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增蚂蚁（杭州）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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-21
20	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-21
21	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资	上海证券报、基金管理人	2021-05-11

	关联方承销期内承销证券的公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
22	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增平安银行股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-15
23	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国人寿保险股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-30

## §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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021/1/1-2021/6/30	37,929,752.69	-	-	37,929,752.69	24.78%
	2	2021/1/1-2021/6/30	39,820,802.80	-	-	39,820,802.80	26.01%

#### 产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。
- 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。
- 4、其他可能的风险。

另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

### 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 99 只公募基金。截至 2021 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1296 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。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 9 月，中国保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。

2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金再度被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·成长基金管理公司奖。

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获奖名单揭晓，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”。

## §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量化先锋股票型证券投资基金的文件
- （二）海富通量化先锋股票型证券投资基金基金合同
- （三）海富通量化先锋股票型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通量化先锋股票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）报告期内海富通量化先锋股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36—37 层本基金管理人办公地址。

### 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

二〇二一年八月三十一日