

海富通量化先锋股票型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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：二〇二二年八月三十一日

§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 2022 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 2022 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	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.....	13
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
§5 托管人报告	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.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	49
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.....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§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	100,690,197.75 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	61,316,836.84 份	39,373,360.91 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	95566
	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	http://www.hffund.com
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（2022年1月1日至2022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	-50,791,903.15	-25,905,081.32
本期利润	-50,578,276.11	-16,218,045.77
加权平均基金份额本期利润	-0.4268	-0.2932
本期加权平均净值利润率	-27.65%	-18.93%
本期基金份额净值增长率	-9.09%	-9.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022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	19,646,708.39	12,656,587.88
期末可供分配基金份额利润	0.3204	0.3215
期末基金资产净值	97,696,943.89	62,887,775.33
期末基金份额净值	1.5933	1.5972
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022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	87.53%	87.86%

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	9.47%	1.27%	5.72%	0.89%	3.75%	0.38%
过去三个月	5.83%	1.76%	2.04%	1.38%	3.79%	0.38%
过去六个月	-9.09%	1.64%	-9.27%	1.29%	0.18%	0.35%
过去一年	-1.08%	1.38%	-2.91%	1.05%	1.83%	0.33%
过去三年	90.44%	1.36%	27.64%	1.08%	62.80%	0.28%
自基金合同生效起至今	87.53%	1.31%	16.32%	1.15%	71.21%	0.16%

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	9.43%	1.27%	5.72%	0.89%	3.71%	0.38%
过去三个月	5.73%	1.76%	2.04%	1.38%	3.69%	0.38%
过去六个月	-9.28%	1.64%	-9.27%	1.29%	-0.01%	0.35%
过去一年	-1.47%	1.38%	-2.91%	1.05%	1.44%	0.33%
过去三年	88.21%	1.36%	27.64%	1.08%	60.57%	0.28%
自基金合同生效起至今	87.86%	1.32%	16.32%	1.15%	71.54%	0.17%

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2022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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 94 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通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、海富通添益货币基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基

金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通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、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通惠鑫混合型证券投资基金、海富通欣润混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
纪君凯	本基金的基金经理	2020-07-03	-	5 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：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

2022 年上半年，中美经济与政策周期继续错位。中国面临经济下行压力，叠加疫情的冲击，导致二季度经济出现快速下探，宏观政策迅速转向宽松，推出稳增长一揽子措施，随着疫情受控、政策发力，中国经济在 5、6 月份快速修复。海外方面，在不断的货币宽松刺激下，美国通胀水平持续抬升，俄乌冲突又进一步加剧了本就高企的通胀，同时 4 月受中国疫情冲击全球供应链受到较大影响，种种因素导致大宗商品价格暴涨，美国、欧洲通胀水平持续上升。美联储加息路径不断上修，带来

美债收益率的大幅上升，全球资本市场在美联储收紧、俄乌冲突、中国疫情等冲击下出现剧烈波动。

A 股市场整体走势如同 V 字型态势，风格出现明显变化。1 月-4 月底前，逆周期、稳增长、通胀交易的相关资产表现较好，成长、消费风格的资产快速下行。随着 4 月底政治局会议明确稳增长，以及上海疫情初步得到控制、充裕的流动性发挥作用，权益市场出现大幅反弹。市场风格向成长板块明显偏移。上半年 A 股主要指数方面，上证指数下跌 6.63%，沪深 300 下跌 9.22%，中证 800 下跌 9.97%，中小综指下跌 10.77%，创业板指下跌 15.41%。分行业看，周期行业表现相对较好，煤炭上涨 31.38%，交通运输、综合、美容护理和房地产分别下跌 0.71%、1.46%、1.81% 和 2.31%；成长明显落后，电子、计算机、传媒、国防军工和环保分别下跌 24.46%、23.64%、22.25%、20.05% 和 16.42%。

从上半年市场内部的结构看，逆周期的建筑地产和通胀交易的煤炭等大宗商品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，尤其在俄乌冲突加剧全球通胀走势的背景下，与此匹配的是相关行业上半年的业绩表现。上游价格的大幅上行部分侵蚀了中下游行业的利润。成长行业内部，高景气的新能源汽车、光伏、风电等反弹幅度明显高于景气度偏弱的半导体、计算机等。消费领域的疫后复苏主线演绎非常充分，包括白酒以及航空、酒店、免税等。市场 1-4 月亏钱效应明显，5、6 月份赚钱效应明显，但前后风格差异明显。整个市场反映出宏观大变局下的产业升级高景气带来的红利，优势产业成为市场配置热点。

报告期内，本基金权益部分以中证 500 为基准，适度超配景气度高、估值合理、位置较低的子板块，在中证 500 成分股中挖掘了风电产业链，汽车整车和零部件等未来一年基本面景气度向上的板块和个股，在小市值板块，我们依据量化模型挖掘新能源加的投资机会，在二季度取得了不错的结果。

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-9.09%，同期业绩比较基准收益率为-9.27%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.18 个百分点。海富通量化先锋股票 C 净值增长率为-9.28%，同期业绩比较基准收益率为-9.27%，基金净值跑输业绩比较基准 0.01 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，但幅度可能偏弱。内需、外需均有隐忧，流动性将继续维持在相对宽松的状态。出口与制造业将逐步面临外需下行的压力，地产压力仍需更多的政策智慧解决，消费的恢复继续分化，基建将是确定性最高的支撑领域。货币政策将保持相对宽松的状态，但受制于通胀上行、内外均衡等可能难以更加宽松，但剩余流动性对 A 股依然偏正面。

下半年，回归业绩确定性，从上游到下游，从短久期到长久期。上游原材料价格压力下半年将逐步明显，中下游盈利或将改善。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、光伏、风电、储能、半导体等受益于产业趋势政策导向的行业投资机会，或更加容易把握。

后续我们将继续努力寻找自身细分行业景气向上，且具备估值差和预期差的股票，等待价值回归。希望在未来一年，我们能够在控制好回撤的前提下，努力争取跑赢中证 500 指数。

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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,692,032.61	62,927,269.27
结算备付金		1,755,039.65	12,676,193.17
存出保证金		207,669.86	145,141.02
交易性金融资产	6.4.7.2	152,849,958.46	352,246,847.09
其中：股票投资		146,701,438.50	352,243,885.83
基金投资		-	-
债券投资		6,148,519.96	2,961.26
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	17,969,631.46
应收股利		-	-
应收申购款		5,157,428.48	7,697.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	10,371.11
资产总计		163,662,129.06	445,983,151.10
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021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		2,244,919.99	-
应付赎回款		15,552.63	69,623,213.62
应付管理人报酬		182,970.11	662,265.60
应付托管费		30,495.03	110,377.59
应付销售服务费		18,084.45	56,602.14
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,251.41	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	576,136.22	995,374.93
负债合计		3,077,409.84	71,447,833.88
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	100,690,197.75	213,408,345.25
未分配利润	6.4.7.8	59,894,521.47	161,126,971.97
净资产合计		160,584,719.22	374,535,317.22
负债和净资产总计		163,662,129.06	445,983,151.10

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.5933 元，C 类基金份额净值 1.5972 元。

基金份额总额 100,690,197.75 份，其中 A 类基金份额 61,316,836.84 份，C 类基金份额 39,373,360.91 份。

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年1月1日至 2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至 2021年6月30日

一、营业总收入		-64,173,521.74	34,832,146.89
1.利息收入		113,143.22	79,673.08
其中：存款利息收入	6.4.7.9	112,539.08	75,329.44
债券利息收入		-	79.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		604.14	4,264.11
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-74,352,463.99	46,218,241.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-76,037,274.61	44,936,162.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	50,747.40	197,879.28
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	312,423.61	-921,320.00
股利收益	6.4.7.14	1,321,639.61	2,005,519.44
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	9,900,662.59	-11,480,588.50
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	165,136.44	14,821.19
减：二、营业总支出		2,622,800.14	3,748,680.03
1. 管理人报酬		2,018,222.04	1,980,124.91
2. 托管费		336,370.31	330,020.80
3. 销售服务费		172,574.66	190,982.89
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		1,129.37	0.06
8. 其他费用	6.4.7.17	94,503.76	1,247,551.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-66,796,321.88	31,083,466.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-66,796,321.88	31,083,466.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-66,796,321.88	31,083,466.86

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	213,408,345.25	-	161,126,971.97	374,535,317.22
二、本期期初净资产（基金净值）	213,408,345.25	-	161,126,971.97	374,535,317.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-112,718,147.50	-	-101,232,450.50	-213,950,598.00
（一）、综合收益总额	-	-	-66,796,321.88	-66,796,321.88
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-112,718,147.50	-	-34,436,128.62	-147,154,276.12
其中：1.基金申购款	21,200,784.38	-	13,414,034.50	34,614,818.88
2.基金赎回款	-133,918,931.88	-	-47,850,163.12	-181,769,095.00
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	100,690,197.75	-	59,894,521.47	160,584,719.22
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	151,302,984.97	-	104,433,913.68	255,736,898.65
二、本期期初净资产（基金净值）	151,302,984.97	-	104,433,913.68	255,736,898.65
三、本期增减变动	1,777,006.96	-	33,335,690.00	35,112,696.96

动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	31,083,466.86	31,083,466.86
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,777,006.96	-	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
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	153,079,991.93	-	137,769,603.68	290,849,595.61

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 2022 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 2022 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。金融资产减值计量方式的变更对于本基金的影响不重大。

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 62,927,269.27 元、12,676,193.17 元、145,141.02 元、10,371.11 元、17,969,631.46 元和 7,697.98 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行

存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 62,930,666.87 元、12,682,380.05 元、145,206.32 元、0.00 元、17,969,631.46 元和 8,417.94 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 352,246,847.09 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 352,246,848.46 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债，金额分别为 69,623,213.62 元、662,265.60 元、110,377.59 元、56,602.14 元、825,374.93 元和 170,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债，金额分别为 69,623,213.62 元、662,265.60 元、110,377.59 元、56,602.14 元、825,374.93 元和 170,000.00 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 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 2022年6月30日
活期存款	3,692,032.61
等于：本金	3,691,575.12
加：应计利息	457.49

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	3,692,032.61

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	140,218,585.56	-	146,701,438.50	6,482,852.94
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	139,744.11		
	市场	6,016,700.00	6,148,519.96	-7,924.15
	银行间		-	
	市场	-	-	-
合计	6,016,700.00	139,744.11	6,148,519.96	-7,924.15
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	146,235,285.56	139,744.11	152,849,958.46	6,474,928.79

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产 / 负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5.66
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	366,870.41
其中：交易所市场	366,870.41
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	209,260.15
合计	576,136.22

6.4.7.7 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 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	151,200,372.28	151,200,372.28
本期申购	761,101.70	761,101.70
本期赎回（以“-”号填列）	-90,644,637.14	-90,644,637.14
本期末	61,316,836.84	61,316,836.84

海富通量化先锋股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	62,207,972.97	62,207,972.97
本期申购	20,439,682.68	20,439,682.68
本期赎回（以“-”号填列）	-43,274,294.74	-43,274,294.74
本期末	39,373,360.91	39,373,360.91

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	117,054,321.40	-3,238,524.88	113,815,796.52
本期利润	-50,791,903.15	213,627.04	-50,578,276.11
本期基金份额交易产生的变动数	-46,615,709.86	19,758,296.50	-26,857,413.36
其中：基金申购款	532,357.94	-59,696.69	472,661.25
基金赎回款	-47,148,067.80	19,817,993.19	-27,330,074.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,646,708.39	16,733,398.66	36,380,107.05

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	48,510,799.96	-1,199,624.51	47,311,175.45
本期利润	-25,905,081.32	9,687,035.55	-16,218,045.77
本期基金份额交易产生的变动数	-9,949,130.76	2,370,415.50	-7,578,715.26
其中：基金申购款	13,909,228.49	-967,855.24	12,941,373.25
基金赎回款	-23,858,359.25	3,338,270.74	-20,520,088.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,656,587.88	10,857,826.54	23,514,414.42

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	36,495.95
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	71,308.87

其他	4,734.26
合计	112,539.08

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	822,603,202.74
减：卖出股票成本总额	896,684,532.49
减：交易费用	1,955,944.86
买卖股票差价收入	-76,037,274.61

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 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	31,275.13
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	19,472.27
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	50,747.40

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	127,504.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	108,000.00
减：应计利息总额	26.28
减：交易费用	6.25
买卖债券差价收入	19,472.27

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 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益（税前）	322,480.00
股指期货差价收入应缴纳增值税额	-9,392.62
减：交易费用	663.77
合计	312,423.61

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,321,639.61
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	1,321,639.61

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	9,900,662.59
——股票投资	9,909,248.00
——债券投资	-8,585.41
——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	9,900,662.59

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	165,136.44
合计	165,136.44

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	5,243.61
合计	94,503.76

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股	成交金额	占当期股

		票成交总 额的比例		票成交总 额的比例
海通证券	166,492,839.04	11.11%	24,161,246.96	2.54%

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 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
海通证券	119,969.99	12.15%	22,732.59	6.20%
关联方名称	上年度可比期间 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%	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,018,222.04	1,980,124.91
其中：支付销售机构的客户维护费	58,512.81	50,228.70

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 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
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	336,370.31	330,020.80

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		
	2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C	合计
中国银行	-	321.96	321.96
海通证券	-	75.22	75.22
海富通基金	-	162,240.06	162,240.06
合计	-	162,637.24	162,637.24
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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

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 \times 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	3,692,032.61	36,495.95	28,288,068.98	35,938.88

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 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券	688234	天岳先进	网下发行	2,559	211,859.61
海通证券	688259	创耀科技	网下发行	1,595	106,227.00
海通证券	301228	实朴检测	网下发行	3,721	74,717.68
上年度可比期间 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：股/张）	总金额

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

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（2022 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
300834	星辉环材	2022-01-06	6 个月以上	新股锁定	55.57	30.03	301	16,726.57	9,039.03	-
301116	益客食品	2022-01-10	6 个月以上	新股锁定	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6 个月以上	新股锁定	37.23	25.39	350	13,030.50	8,886.50	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6 个月以上	新股锁定	22.49	27.42	289	6,499.61	7,924.38	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6 个月以上	新股锁定	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	6 个月以上	新股锁定	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301151	冠龙节能	2022-03-30	6 个月以上	新股锁定	30.82	21.46	413	12,728.66	8,862.98	-
301155	中科	2022-0	6 个月	新股	33.68	43.98	323	10,878	14,205	-

3	江南	5-10	以上	锁定				.64	.54	
301158	德石股份	2022-01-07	6个月以上	新股锁定	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6个月以上	新股锁定	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6个月以上	新股锁定	3.80	6.39	4,195	15,941.00	26,806.05	-
301216	万凯新材	2022-03-21	6个月以上	新股锁定	35.68	29.84	374	13,344.32	11,160.16	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6个月以上	新股锁定	17.27	14.83	1,068	18,444.36	15,838.44	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月以上	新股锁定	173.98	87.82	86	8,351.04	7,552.52	-
301222	浙江恒威	2022-03-02	6个月以上	新股锁定	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301228	实朴检测	2022-01-21	6个月以上	新股锁定	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301237	和顺科技	2022-03-16	6个月以上	新股锁定	56.69	41.86	248	14,059.12	10,381.28	-
301256	华融化学	2022-03-14	6个月以上	新股锁定	8.05	10.08	1,587	12,775.35	15,996.96	-
301258	富士莱	2022-03-21	6个月以上	新股锁定	48.30	41.68	243	11,736.90	10,128.24	-
301263	泰恩康	2022-03-22	6个月以上	新股锁定	19.93	31.38	530	10,562.90	16,631.40	-
301268	铭利达	2022-03-29	6个月以上	新股锁定	28.50	34.87	403	11,485.50	14,052.61	-
301279	金道科技	2022-04-06	6个月以上	新股锁定	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301288	清研环境	2022-04-14	6个月以上	新股锁定	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
688115	思林杰	2022-03-07	6个月以上	新股锁定	65.65	38.46	2,153	141,344.45	82,804.38	-

注：1、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，锁定期限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。

2、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。

3、[301219]腾远钴业于2022年3月10日中签新股数量480股，其中锁定流通受限数量48股，

成本 8,351.04 元；于 2022 年 5 月 24 日送股，数量 38 股。因此总数量 86 股，总成本 8,351.04 元。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

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

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

靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2022 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%（2021 年 12 月 31 日：0.00%）。

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	2,780.78	2,961.26
未评级	6,145,739.18	-
合计	6,148,519.96	2,961.26

注：未评级部分为国债。

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 2022 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 0.22%。

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 2022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	3,692,032.61	-	-	-	3,692,032.61
结算备付金	1,755,039.65	-	-	-	1,755,039.65
存出保证金	207,669.86	-	-	-	207,669.86
交易性金融资产	6,145,739.18	2,780.78	-	146,701,438.50	152,849,958.46
应收申购款	-	-	-	5,157,428.48	5,157,428.48
资产总计	11,800,481.30	2,780.78	-	151,858,866.98	163,662,129.06
负债					
应付清算款	-	-	-	2,244,919.99	2,244,919.99
应付赎回款	-	-	-	15,552.63	15,552.63
应付管理人报酬	-	-	-	182,970.11	182,970.11
应付托管费	-	-	-	30,495.03	30,495.03
应付销售服务费	-	-	-	18,084.45	18,084.45
应交税费	-	-	-	9,251.41	9,251.41
其他负债	-	-	-	576,136.22	576,136.22
负债总计	-	-	-	3,077,409.84	3,077,409.8

					4
利率敏感度缺口	11,800,481.30	2,780.78	-	148,781,457.14	160,584,719.22
上年度末					
2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	62,927,269.27	-	-	-	62,927,269.27
结算备付金	12,676,193.17	-	-	-	12,676,193.17
存出保证金	145,141.02	-	-	-	145,141.02
交易性金融资产	-	2,961.26	-	352,243,885.83	352,246,847.09
应收清算款	-	-	-	17,969,631.46	17,969,631.46
应收申购款	-	-	-	7,697.98	7,697.98
其他资产	-	-	-	10,371.11	10,371.11
资产总计	75,748,603.46	2,961.26	-	370,231,586.38	445,983,151.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	69,623,213.62	69,623,213.62
应付管理人报酬	-	-	-	662,265.60	662,265.60
应付托管费	-	-	-	110,377.59	110,377.59
应付销售服务费	-	-	-	56,602.14	56,602.14
其他负债	-	-	-	995,374.93	995,374.93
负债总计	-	-	-	71,447,833.88	71,447,833.88
利率敏感度缺口	75,748,603.46	2,961.26	-	298,783,752.50	374,535,317.22

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变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末

		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-1,813.98	-35.76
	市场利率下降 25 个基点	1,819.32	36.29

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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	146,701,438.50	91.35	352,243,885.83	94.05

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	146,701,438.	91.35	352,243,885.8	94.05
	50		3	

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	7,286,602.99	15,090,379.59
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-7,286,602.99	-15,090,379.59

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	146,358,417.19	344,242,918.06
第二层次	6,145,739.18	8,003,929.03
第三层次	345,802.09	-

合计	152,849,958.46	352,246,847.09
----	----------------	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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(2021 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应收款项和其他金融负债，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	146,701,438.50	89.64
	其中：股票	146,701,438.50	89.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,148,519.96	3.76
	其中：债券	6,148,519.96	3.76
	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	5,447,072.26	3.33
8	其他各项资产	5,365,098.34	3.28
9	合计	163,662,129.06	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	1,929,900.00	1.20
B	采矿业	5,582,168.10	3.48
C	制造业	106,120,492.28	66.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,362,437.00	2.09
E	建筑业	3,848,613.00	2.40
F	批发和零售业	3,754,929.40	2.34
G	交通运输、仓储和邮政业	3,599,119.00	2.24
H	住宿和餐饮业	461,280.00	0.29
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,514,057.09	2.19
J	金融业	4,420,622.20	2.75
K	房地产业	3,117,965.00	1.94
L	租赁和商务服务业	3,562,002.00	2.22
M	科学研究和技术服务业	306,353.43	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	1,111,221.00	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,263,015.00	0.79
R	文化、体育和娱乐业	747,264.00	0.47
S	综合	-	-
	合计	146,701,438.50	91.35

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	600522	中天科技	110,000	2,541,000.00	1.58
2	300850	新强联	27,090	2,411,822.70	1.50
3	002756	永兴材料	15,200	2,313,592.00	1.44
4	300747	锐科激光	59,200	2,302,880.00	1.43
5	600153	建发股份	174,800	2,284,636.00	1.42
6	300059	东方财富	89,100	2,263,140.00	1.41
7	600765	中航重机	66,300	2,133,534.00	1.33
8	300196	长海股份	112,700	2,128,903.00	1.33
9	601888	中国中免	9,000	2,096,370.00	1.31
10	603338	浙江鼎力	40,200	2,038,140.00	1.27
11	601615	明阳智能	60,000	2,028,000.00	1.26
12	002180	纳思达	40,000	2,024,800.00	1.26
13	600456	宝钛股份	33,400	1,983,960.00	1.24
14	002430	杭氧股份	62,100	1,941,246.00	1.21
15	300363	博腾股份	24,800	1,934,152.00	1.20
16	601898	中煤能源	186,000	1,930,680.00	1.20
17	603392	万泰生物	12,200	1,894,660.00	1.18
18	603198	迎驾贡酒	28,300	1,843,462.00	1.15
19	000887	中鼎股份	100,100	1,825,824.00	1.14
20	002585	双星新材	100,000	1,809,000.00	1.13
21	601677	明泰铝业	76,000	1,808,800.00	1.13
22	002459	晶澳科技	22,720	1,792,608.00	1.12
23	002460	赣锋锂业	12,000	1,784,400.00	1.11
24	600048	保利发展	101,100	1,765,206.00	1.10
25	688559	海目星	23,983	1,743,564.10	1.09
26	300014	亿纬锂能	17,836	1,739,010.00	1.08
27	603456	九洲药业	33,600	1,737,120.00	1.08
28	603077	和邦生物	392,000	1,669,920.00	1.04
29	002850	科达利	10,400	1,653,600.00	1.03
30	300911	亿田智能	21,500	1,652,275.00	1.03
31	688356	键凯科技	6,795	1,643,098.95	1.02
32	600938	中国海油	93,200	1,626,340.00	1.01
33	002241	歌尔股份	46,000	1,545,600.00	0.96
34	300628	亿联网络	20,100	1,530,615.00	0.95
35	605080	浙江自然	23,800	1,520,582.00	0.95
36	688521	芯原股份	30,209	1,492,324.60	0.93
37	000983	山西焦煤	110,390	1,478,122.10	0.92
38	603816	顾家家居	26,000	1,472,380.00	0.92

39	300776	帝尔激光	8,500	1,468,800.00	0.91
40	600546	山煤国际	74,700	1,453,662.00	0.91
41	601717	郑煤机	100,000	1,441,000.00	0.90
42	002920	德赛西威	9,700	1,435,600.00	0.89
43	000498	山东路桥	148,600	1,435,476.00	0.89
44	000683	远兴能源	136,000	1,429,360.00	0.89
45	600919	江苏银行	200,000	1,424,000.00	0.89
46	688066	航天宏图	18,000	1,418,400.00	0.88
47	605123	派克新材	10,000	1,407,200.00	0.88
48	600328	中盐化工	59,000	1,389,450.00	0.87
49	605111	新洁能	10,900	1,371,329.00	0.85
50	601689	拓普集团	20,000	1,368,600.00	0.85
51	600782	新钢股份	270,300	1,362,312.00	0.85
52	600325	华发股份	178,700	1,352,759.00	0.84
53	603938	三孚股份	26,500	1,309,895.00	0.82
54	603260	合盛硅业	11,100	1,309,356.00	0.82
55	000733	振华科技	9,600	1,305,312.00	0.81
56	300373	扬杰科技	18,200	1,296,750.00	0.81
57	603882	金域医学	15,300	1,263,015.00	0.79
58	600905	三峡能源	200,000	1,258,000.00	0.78
59	600233	圆通速递	60,000	1,223,400.00	0.76
60	300638	广和通	46,150	1,222,513.50	0.76
61	002311	海大集团	20,122	1,207,521.22	0.75
62	600089	特变电工	44,000	1,205,160.00	0.75
63	600873	梅花生物	104,900	1,183,272.00	0.74
64	605376	博迁新材	20,000	1,166,000.00	0.73
65	002299	圣农发展	60,000	1,150,800.00	0.72
66	603568	伟明环保	33,300	1,111,221.00	0.69
67	300122	智飞生物	10,000	1,110,100.00	0.69
68	600863	内蒙华电	300,000	1,095,000.00	0.68
69	600057	厦门象屿	120,800	1,061,832.00	0.66
70	605366	宏柏新材	34,900	1,039,671.00	0.65
71	688122	西部超导	11,177	1,030,519.40	0.64
72	600803	新奥股份	54,300	1,009,437.00	0.63
73	688016	心脉医疗	5,016	977,166.96	0.61
74	000932	华菱钢铁	191,300	973,717.00	0.61
75	003022	联泓新科	29,200	970,316.00	0.60
76	002985	北摩高科	16,380	959,540.40	0.60
77	000090	天健集团	137,700	948,753.00	0.59
78	603565	中谷物流	59,200	939,504.00	0.59
79	603596	伯特利	11,000	881,980.00	0.55
80	600582	天地科技	183,500	877,130.00	0.55
81	002541	鸿路钢构	26,000	868,400.00	0.54
82	002049	紫光国微	4,500	853,740.00	0.53

83	002812	恩捷股份	3,400	851,530.00	0.53
84	002897	意华股份	19,200	846,720.00	0.53
85	601390	中国中铁	135,600	832,584.00	0.52
86	600438	通威股份	13,700	820,082.00	0.51
87	600096	云天化	25,200	793,296.00	0.49
88	603707	健友股份	28,000	789,600.00	0.49
89	300390	天华超净	9,000	786,600.00	0.49
90	002353	杰瑞股份	19,500	785,850.00	0.49
91	300761	立华股份	19,600	779,100.00	0.49
92	688598	金博股份	2,610	769,167.00	0.48
93	002013	中航机电	62,100	766,935.00	0.48
94	002705	新宝股份	34,400	756,456.00	0.47
95	601021	春秋航空	12,900	752,715.00	0.47
96	300413	芒果超媒	22,400	747,264.00	0.47
97	601128	常熟银行	96,000	733,440.00	0.46
98	600885	宏发股份	17,360	726,516.00	0.45
99	688516	奥特维	2,695	719,430.25	0.45
100	603688	石英股份	5,400	716,094.00	0.45
101	688303	大全能源	10,472	715,447.04	0.45
102	002444	巨星科技	36,300	683,892.00	0.43
103	603713	密尔克卫	5,000	683,500.00	0.43
104	600039	四川路桥	60,000	631,800.00	0.39
105	603444	吉比特	1,500	582,000.00	0.36
106	600507	方大特钢	80,000	559,200.00	0.35
107	600256	广汇能源	51,900	547,026.00	0.34
108	002539	云图控股	30,300	484,497.00	0.30
109	002557	洽洽食品	8,300	472,519.00	0.29
110	002371	北方华创	1,700	471,104.00	0.29
111	600258	首旅酒店	18,600	461,280.00	0.29
112	600399	抚顺特钢	25,000	447,500.00	0.28
113	603026	石大胜华	3,000	436,050.00	0.27
114	002027	分众传媒	60,000	403,800.00	0.25
115	688248	南网科技	11,763	271,960.56	0.17
116	002372	伟星新材	10,100	242,804.00	0.15
117	600141	兴发集团	4,000	175,960.00	0.11
118	605117	德业股份	500	139,945.00	0.09
119	688115	思林杰	2,153	82,804.38	0.05
120	301215	中汽股份	4,195	26,806.05	0.02
121	301263	泰恩康	530	16,631.40	0.01
122	301256	华融化学	1,587	15,996.96	0.01
123	301217	铜冠铜箔	1,068	15,838.44	0.01
124	301153	中科江南	323	14,205.54	0.01
125	301268	铭利达	403	14,052.61	0.01
126	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.01

127	301116	益客食品	577	11,805.42	0.01
128	301216	万凯新材	374	11,160.16	0.01
129	301237	和顺科技	248	10,381.28	0.01
130	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.01
131	301258	富士莱	243	10,128.24	0.01
132	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.01
133	300834	星辉环材	301	9,039.03	0.01
134	301288	清研环境	452	9,030.96	0.01
135	301123	奕东电子	350	8,886.50	0.01
136	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.01
137	301151	冠龙节能	413	8,862.98	0.01
138	301125	腾亚精工	289	7,924.38	0.00
139	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
140	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
141	301219	腾远钴业	86	7,552.52	0.00
142	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
143	002475	立讯精密	171	5,778.09	0.00
144	600276	恒瑞医药	115	4,265.35	0.00
145	300525	博思软件	147	3,153.15	0.00
146	300226	上海钢联	112	2,536.80	0.00
147	002867	周大生	150	2,329.50	0.00
148	002624	完美世界	100	1,437.00	0.00
149	600779	水井坊	1	92.54	0.00
150	600036	招商银行	1	42.20	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	002756	永兴材料	11,305,130.00	3.02
2	603198	迎驾贡酒	10,959,369.00	2.93
3	000498	山东路桥	9,538,787.38	2.55
4	300059	东方财富	9,382,880.00	2.51
5	300014	亿纬锂能	9,311,066.04	2.49
6	600546	山煤国际	8,859,833.93	2.37
7	601001	晋控煤业	8,764,036.72	2.34
8	300260	新莱应材	8,735,665.86	2.33
9	002459	晶澳科技	8,604,554.00	2.30
10	603596	伯特利	8,040,474.00	2.15
11	002487	大金重工	7,334,403.00	1.96

12	601669	中国电建	7,048,279.00	1.88
13	300316	晶盛机电	7,039,059.00	1.88
14	601677	明泰铝业	6,917,506.54	1.85
15	300363	博腾股份	6,769,737.72	1.81
16	605123	派克新材	6,748,243.00	1.80
17	300438	鹏辉能源	6,745,530.00	1.80
18	000887	中鼎股份	6,594,183.00	1.76
19	600256	广汇能源	6,326,140.26	1.69
20	600153	建发股份	6,070,631.00	1.62

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	300260	新莱应材	12,235,256.00	3.27
2	300014	亿纬锂能	11,269,163.25	3.01
3	603198	迎驾贡酒	10,088,542.16	2.69
4	601001	晋控煤业	9,667,963.00	2.58
5	000498	山东路桥	9,611,157.60	2.57
6	600132	重庆啤酒	9,090,885.40	2.43
7	002756	永兴材料	9,089,660.00	2.43
8	300316	晶盛机电	8,860,613.00	2.37
9	603596	伯特利	8,752,305.00	2.34
10	000733	振华科技	8,467,953.00	2.26
11	002487	大金重工	8,239,320.25	2.20
12	002459	晶澳科技	8,104,053.20	2.16
13	600803	新奥股份	8,015,855.00	2.14
14	600546	山煤国际	7,604,623.00	2.03
15	300088	长信科技	7,440,905.00	1.99
16	300122	智飞生物	7,424,282.00	1.98
17	300363	博腾股份	7,383,473.00	1.97
18	600219	南山铝业	7,339,127.00	1.96
19	000887	中鼎股份	7,213,362.00	1.93
20	002557	洽洽食品	7,065,859.00	1.89

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	681,232,837.16
---------------	----------------

卖出股票的收入（成交）总额	822,603,202.74
---------------	----------------

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	6,145,739.18	3.83
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）	2,780.78	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,148,519.96	3.83

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	019641	20 国债 11	60,000	6,145,739.18	3.83
2	128135	洽洽转债	11	1,408.04	0.00
3	128136	立讯转债	12	1,372.74	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 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的中天科技（600522），因时任董事会秘书、时任副总经理等公司工作人员在机构调研会上透露公司重要业务板块订单量和预测性数据等信息，且公司董事会秘书未勤勉尽责，未能及时发现、阻止上述行为，公司相关信息披露不公平，信息披露管理制度存在缺陷，于 2022 年 1 月 11 日上海证券交易所对其予以监管警示。因前期部分会计核算和会计处理存在差错，导致多期定期报告相关财务信息披露不准确，违反了《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 15 号——财务报告的一般规定》、《上海证券交易所股票上市规则》等规定，2022 年 6 月 17 日上海证券交易所对江苏中天科技股份有限公司及时任财务总监予以监管警示。

对该证券的投资决策程序的说明：公司主营光纤通信和电力传输，在国内率先建成海底光缆完整生产线，拥有海底光缆制造的核心技术，旗下子公司中天科技海缆有限公司是我国第一家拥有完全自主知识产权的海底光缆厂商。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	207,669.86
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,157,428.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,365,098.34

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	128135	洽洽转债	1,408.04	0.00
2	128136	立讯转债	1,372.74	0.00

§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	291	210,710.78	53,945,285.96	87.98%	7,371,550.88	12.02%

股票 A						
海富通量化先锋 股票 C	219	179,787.04	37,316,476.86	94.78%	2,056,884.05	5.22%
合计	510	197,431.76	91,261,762.82	90.64%	9,428,434.93	9.36%

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	83,261.40	0.1358%
	海富通量化先锋股票 C	846.39	0.0021%
	合计	84,107.79	0.0835%

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	151,200,372.28	62,207,972.97
本报告期基金总申购份额	761,101.70	20,439,682.68
减：本报告期基金总赎回份额	90,644,637.14	43,274,294.74
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	61,316,836.84	39,373,360.91

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	
中信证券	2	477,214,088.98	31.86%	344,063.45	34.85%	-
国金证券	1	331,657,204.49	22.14%	176,208.70	17.85%	-
天风证券	2	234,442,320.56	15.65%	166,759.19	16.89%	-
海通证券	2	166,492,839.04	11.11%	119,969.99	12.15%	-
国盛证券	2	106,727,188.68	7.13%	78,046.48	7.91%	-
华创证券	1	98,890,196.17	6.60%	41,663.79	4.22%	-
国泰君安	2	75,105,834.67	5.01%	53,589.43	5.43%	-
上海证券	1	7,384,096.22	0.49%	6,876.41	0.70%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

民生证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
野村东方国际 证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

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
中信证券	-	-	7,900,000.00	100.00%	-	-
国金证券	127,504.80	2.08%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	6,014,400.00	97.92%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

渤海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际 证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	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	2022-01-04
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万联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	2022-01-06
3	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	2022-01-07
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	2022-01-07
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	2022-01-25
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增广发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	2022-03-01
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商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	2022-03-29
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中邮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	2022-04-01
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波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	2022-04-13

10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	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	2022-04-14
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行招赢通为销售平台的公告	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	2022-05-09
12	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增英大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	2022-05-10
13	海富通基金管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司销售合作关系的公告	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	2022-05-30
14	海富通基金管理有限公司关于调整公募基金产品适当性风险等级划分方法的公告	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	2022-06-16

§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	2022/4/27-2022/6/30	32,751,836.70	-	-	32,751,836.70	32.53%
	2	2022/4/27-2022/6/30	26,036,191.92	-	-	26,036,191.92	25.86%
	3	2022/5/9-2022/6/30	20,168,965.90	-	-	20,168,965.90	20.03%
	4	2022/1/1-2022/4/26	50,425,596.29	-	50,425,596.29	-	-

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 109 只公募基金。截至 2022 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1473 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国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奖名单揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金基金·股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

§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)法律法规及中国证监会规定的其他文件

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

二〇二二年八月三十一日