

海富通中证 500 指数增强型证券投资基金
2022 年第 4 季度报告
2022 年 12 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通中证 500 增强
基金主代码	519034
交易代码	519034
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 5 日
报告期末基金份额总额	16,042,966.93 份
投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的投资策略模型进行积极的指数组合管理与风险控制，力求实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金为增强型指数基金，在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数基础上通过数量化模型进行投资组合优化，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。</p> <p>本基金股票资产跟踪的标的指数为中证 500 指数。本基金主要策略为复制目标指数，投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础，利用海富通定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。一方面将严格控制</p>

	组合跟踪误差，避免大幅偏离目标指数，另一方面在指数跟踪的同时力求超越指数。	
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通中证 500 增强 A	海富通中证 500 增强 C
下属两级基金的交易代码	519034	009004
报告期末下属两级基金的份额总额	13,867,765.24 份	2,175,201.69 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日)	
	海富通中证 500 增强 A	海富通中证 500 增强 C
1.本期已实现收益	-2,124,877.91	-329,334.15
2.本期利润	-1,004,405.53	-160,979.86
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0728	-0.0746
4.期末基金资产净值	24,064,393.91	3,748,376.20
5.期末基金份额净值	1.7353	1.7232

注：(1)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。

(2)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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、海富通中证 500 增强 A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.08%	0.92%	2.52%	0.97%	-6.60%	-0.05%
过去六个月	-13.96%	1.15%	-8.66%	1.04%	-5.30%	0.11%
过去一年	-23.56%	1.34%	-19.30%	1.31%	-4.26%	0.03%
自基金合同生效起至今	15.69%	1.35%	2.79%	1.21%	12.90%	0.14%

2、海富通中证 500 增强 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.14%	0.92%	2.52%	0.97%	-6.66%	-0.05%
过去六个月	-14.07%	1.14%	-8.66%	1.04%	-5.41%	0.10%
过去一年	-23.75%	1.34%	-19.30%	1.31%	-4.45%	0.03%
自基金合同生效起至今	13.32%	1.35%	2.79%	1.21%	10.53%	0.14%

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通中证 500 指数增强型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1. 海富通中证 500 增强 A

(2020 年 3 月 5 日至 2022 年 12 月 31 日)



2. 海富通中证 500 增强 C

(2020 年 3 月 5 日至 2022 年 12 月 31 日)



注：本基金转型日期为 2020 年 3 月 5 日。按照本基金合同规定，本基金建仓期为自基金合同转型生效起六个月。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱斌全	本基金的基金经理	2022-12-13	-	15 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018 年 11 月至 2022 年 8 月任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月至 2022 年 12 月兼任海富通富祥混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通沪深 300 增强（原海富通富睿混合）、海富通量化多因子混合及海富通欣益混合的基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通欣享混合的基金经理。2020 年 10 月至 2022 年 8 月兼任海富通新内需混合基金经理。2022 年 8 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2022 年 12 月起兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。
纪君凯	本基金的基金经理	2020-07-03	2022-12-13	6 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 月至 2022 年 12 月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 公平交易专项说明

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（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度，人民币汇率大幅波动带来人民币计价风险资产的大幅波动，指数层面基本都出现探底回升的表象。以万得全 A 指数来看，当季度涨幅 2.89%。分市场看，沪深 300 指数涨幅为 1.75%、中证 500 指数涨幅为 2.63%、创业板综涨幅为 3.40%、中小综指涨幅为 2.89%、红利指数下跌 1.78%。分行业看，根据申万一级行业分类，涨幅前五的行业分别为社会服务、食品饮料、传媒、商贸零售、美容护理，分别上涨 27.59%、18.03%、16.93%、16.44%、15.26%；下跌的行业分别是煤炭、家电、有色金属，跌幅

分别为-13.63%、-0.71%、-0.65%。

四季度影响 A 股市场的主要因素出现在 11 月。伴随出口增速转负，国内稳增长和疫情管控政策出现明显的拐点，扩内需也成为中央经济工作会议的关键词，内需修复的预期是四季度市场交易的主线。消费板块反弹幅度最为可观，强劲的预期主导估值修复。虽然疫情管控的变化带来短期需求的二次下探，但 2023 年美林时钟已经指向复苏。市场似乎很快消化了短期盈利的波动，即使短期经济数据会再次下行。经过三年疫情，消费恢复程度值得关注，尤其是其中结构性的变化和趋势。值得注意的是，过去一年居民活期或定期储蓄占比不断提升，消费能力有所积蓄，相关投资机会有待挖掘和跟踪。

海外来看，G20 峰会各国领导的会晤取得一定的成果，急剧的割裂和分歧有所缓解。这种缓解也带来全球资本市场的回暖。美联储偏鹰派的言论一直持续到年底，但伴随利率终点的不断临近，市场对于美债利率上行出现了一定的免疫。美元指数在四季度出现较为明显的回调，日央行意外转向加息也值得关注。我们预计中美经济增速的剪刀差会在未来两个季度收窄，有利于国内权益市场的估值修复。

因子方面，价值因子本季度表现强于成长因子，市值因子波动较大，10 月份，小市值股票超额收益明显，而从 11 月开始到 12 月底，小市值股票连续跑输，我们的组合风格相对均衡，在业绩和估值匹配的公司中寻找投资机会。

回顾本报告期的投资操作，我们用量化方法构建以中证 500 为基准的股票组合，严格限制行业和个股偏离，并通过风险模型适当控制组合的风格暴露，在现有的市场环境下，尽量控制组合的下行风险。

展望后市，随着资金面、政策面和基本面的逐步改善，一季度可能机会大于风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通中证 500 增强 A 净值增长率为-4.08%，同期业绩比较基准收益率为 2.52%，基金净值跑输业绩比较基准 6.60 个百分点。海富通中证 500 增强 C 净值增长率为-4.14%，同期业绩比较基准收益率为 2.52%，基金净值跑输业绩比较基准 6.66 个百分点。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自 2020 年 3 月 5 日至 2022 年 12 月 31 日，本基金已连续超过六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人已根据法规要求向中国证券监督管理委员会进行了报告。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	25,725,339.27	91.65
	其中：股票	25,725,339.27	91.65
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,312,601.83	8.24
7	其他资产	32,507.74	0.12
8	合计	28,070,448.84	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	576,702.00	2.07
B	采矿业	457,056.00	1.64
C	制造业	14,958,539.58	53.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	879,333.00	3.16
E	建筑业	871,870.00	3.13
F	批发和零售业	152,356.00	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	1,626,422.00	5.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,084,791.69	3.90
J	金融业	3,660,697.00	13.16
K	房地产业	393,295.00	1.41

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	399,974.00	1.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	664,303.00	2.39
S	综合	-	-
	合计	25,725,339.27	92.49

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601128	常熟银行	64,200	484,710.00	1.74
2	601108	财通证券	65,500	466,360.00	1.68
3	000739	普洛药业	21,500	463,110.00	1.67
4	000975	银泰黄金	41,400	457,056.00	1.64
5	603156	养元饮品	20,500	456,535.00	1.64
6	600642	申能股份	82,500	452,925.00	1.63
7	002673	西部证券	74,300	452,487.00	1.63
8	002299	圣农发展	19,000	450,110.00	1.62
9	300776	帝尔激光	3,500	441,000.00	1.59
10	600820	隧道股份	83,000	437,410.00	1.57

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。并利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与研判，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	11,755.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,752.50
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	32,507.74

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通中证500增强 A	海富通中证500增强 C
本报告期期初基金份额总额	13,690,797.14	2,079,655.79
本报告期基金总申购份额	945,393.43	243,758.66
减：本报告期基金总赎回份额	768,425.33	148,212.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,867,765.24	2,175,201.69

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 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 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1410 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”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获“IAMAC 推介·2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会准予海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金变更注册的文件

(二)海富通中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同

(三)海富通中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书

(四)海富通中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议

(五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

(六)法律法规及中国证监会规定的其它文件

9.2 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。

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇二三年一月二十一日