

海富通中证 500 指数增强型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
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
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§9 开放式基金份额变动	53
§10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
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	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	56
§12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
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	海富通中证 500 指数增强型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	15,478,609.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通中证 500 增强 A	海富通中证 500 增强 C
下属分级基金的交易代码	519034	009004
报告期末下属分级基金的份额总额	13,616,709.71 份	1,861,899.33 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的投资策略模型进行积极的指数组合管理与风险控制，力求实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数基金，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。 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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	岳冲	王小飞
	联系电话	021-38650788	021-60637103

负责人	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		40088-40099	021-60637228
传真		021-33830166	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		杨仓兵	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.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（2023年1月1日至2023年6月30日）	
	海富通中证500增强A	海富通中证500增强C
本期已实现收益	-246,590.70	-41,456.14
本期利润	657,883.25	95,516.43
加权平均基金份额本期利润	0.0470	0.0441
本期加权平均净值利润率	2.56%	2.42%
本期基金份额净值增长率	2.79%	2.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	

	海富通中证 500 增强 A	海富通中证 500 增强 C
期末可供分配利润	10,673,179.16	1,432,192.90
期末可供分配基金份额利润	0.7838	0.7692
期末基金资产净值	24,289,888.87	3,294,092.23
期末基金份额净值	1.7838	1.7692
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	海富通中证 500 增强 A	海富通中证 500 增强 C
基金份额累计净值增长率	18.92%	16.34%

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

海富通中证 500 增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.54%	0.79%	-0.77%	0.89%	0.23%	-0.10%
过去三个月	-5.03%	0.71%	-5.10%	0.78%	0.07%	-0.07%
过去六个月	2.79%	0.68%	2.20%	0.75%	0.59%	-0.07%
过去一年	-11.56%	0.95%	-6.65%	0.91%	-4.91%	0.04%
过去三年	8.98%	1.24%	2.48%	1.13%	6.50%	0.11%
自基金合同生效起至今	18.92%	1.27%	5.05%	1.16%	13.87%	0.11%

海富通中证 500 增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.56%	0.79%	-0.77%	0.89%	0.21%	-0.10%
过去三个月	-5.09%	0.71%	-5.10%	0.78%	0.01%	-0.07%
过去六个月	2.67%	0.68%	2.20%	0.75%	0.47%	-0.07%
过去一年	-11.78%	0.95%	-6.65%	0.91%	-5.13%	0.04%
过去三年	8.16%	1.24%	2.48%	1.13%	5.68%	0.11%
自基金合同生效起至今	16.34%	1.27%	5.05%	1.16%	11.29%	0.11%

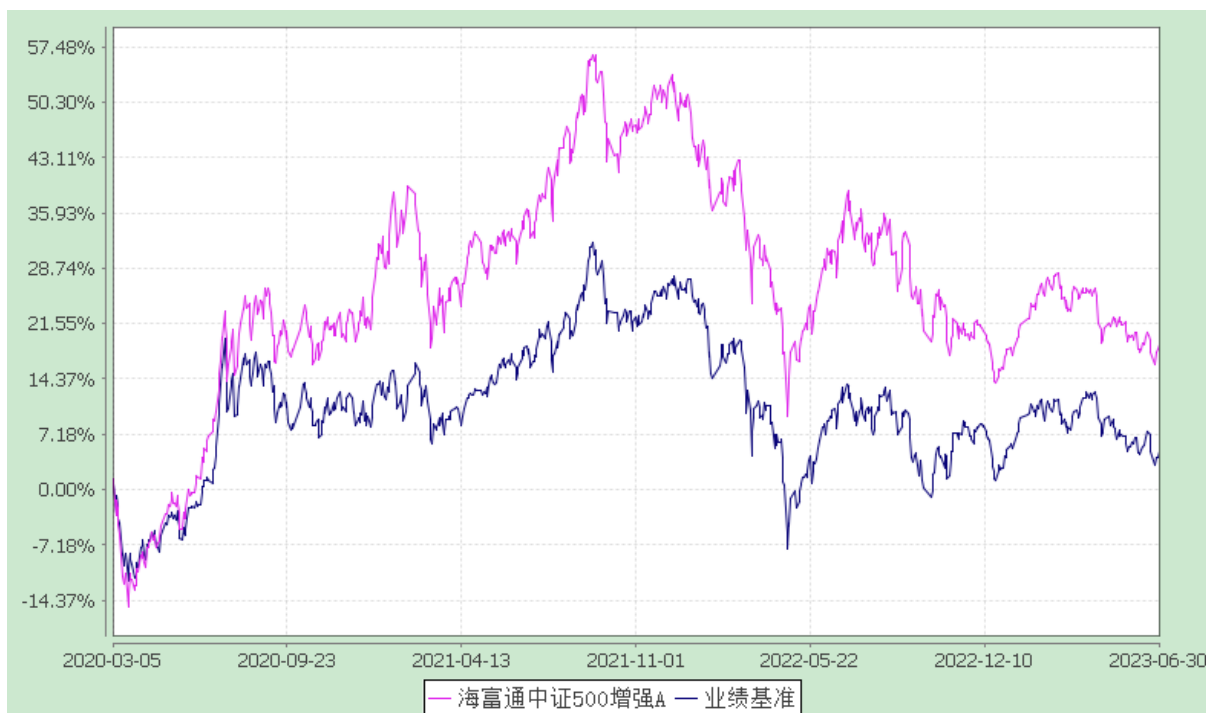
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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历史走势对比图

(2020 年 3 月 5 日至 2023 年 6 月 30 日)

海富通中证 500 增强 A



海富通中证 500 增强 C



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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通欣润混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱斌全	本基金的基金经理	2022-12-13	-	16 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。
林立禾	本基金的基金经理助理	2022-12-06	-	4 年	美国密歇根大学定量金融与风险管理硕士。历任中欧基金管理有限公司风险管理部量化风控岗。2020 年 8 月加入海富通基金管理有限公司，任量化研究员。2022 年 10 月起任海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金的基金经理助理。2022 年 12 月起兼任海富通中证 500 增强型证券投资基金、海富通量化先锋股票型证券投资基金的基金经理助理。2023 年 3 月起兼任海富通富利三个月持有基金经理助理。
李自悟	本基金的基金经理	2023-02-15	-	15 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2008 年 4 月至 2010 年 1 月任 MNJ Capital Management 交易员，2010 年 7 月至 2011 年 6 月任 BlackRock 研究员，2011 年 7 月至 2016 年 3 月任国家外汇管理局中央外汇业务中心基金经理，2016 年 3 月至 2019 年 8 月任上海均直资产管理有限公司基金经理，2019 年 9 月至 2022 年 8 月任野村东方国际证券量化投资主管。2022 年 8 月加入海富通基金管理有限公司。2023 年 2 月起任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。2023 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合基金经理。

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、交易占比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

上半年 A 股主要指数表现方面，上证指数上涨 3.65%，沪深 300 下跌 0.75%，中证 800 上涨 0.02%，中小综指上涨 2.25%，创业板指下跌 5.61%。分行业看，成长板块表现较强，通信、传媒、计算机行业分别上涨 50.7%、42.8%、27.6%；顺周期与消费板块相对落后，房地产和建筑材料行业分别下跌 14.3%、10.5%，商贸零售、美容护理、食品饮料行业分别下跌 23.4%、13.6%、9.1%。

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

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 and 个股偏离，并通过风险模型控制组合的风格暴露，在控制组合跟踪对标基准的同时获取超额收益。

4.4.2 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 2.79%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.59 个百分点。海富通中证 500 增强 C 净值增长率为 2.67%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.47 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

2023 年上半年的权益市场经历了不小的波动，其中起主导作用的是市场对经济复苏预期的变化和反复，投资人的期望也随之经历了波峰到波谷的震荡调整。但经济运行自有其规律，很多时候并不以市场参与者的意志而改变，经济复苏既不会因为预期乐观而加速，也不会因为预期悲观而缺席。在行业层面也是如此，市场对特定行业的高预期会阶段性的拔高其估值，但行业利润的修复还是会遵循自身的周期。

对应到量化策略上，由于其反应的是市场长期的普遍的运行规律，所以往往在市场处于正常状态下时表现会更符合预期。今年上半年量化策略的整体表现也是如此，当市场较为极致时表现较差，

但当市场恢复常态时，超额收益也如期回归。对于下半年的市场，我们认为在经历了上半年喧嚣的震荡后，终将回归更为理性的常态，寻找到和经济基本面更为相符的主线逻辑，而量化策略也将进入更为适宜的策略环境。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红。法律法规或监管机构另有规定的或在基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自 2020 年 3 月 5 日至 2023 年 6 月 30 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 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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

行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§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：海富通中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	1,746,117.13	2,219,387.47
结算备付金		410,998.67	93,214.36
存出保证金		13,133.51	11,755.24
交易性金融资产	6.4.7.2	25,817,153.15	25,725,339.27
其中：股票投资		25,817,153.15	25,725,339.27
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		134,510.18	-
应收股利		-	-
应收申购款		8,545.61	20,752.50
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		28,130,458.25	28,070,448.84
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		185,150.01	-
应付赎回款		44,897.95	29,477.09
应付管理人报酬		18,430.23	19,249.88
应付托管费		4,607.57	4,812.50
应付销售服务费		765.80	814.47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	292,625.59	203,324.79
负债合计		546,477.15	257,678.73
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	15,478,609.04	16,042,966.93
未分配利润	6.4.7.8	12,105,372.06	11,769,803.18
净资产合计		27,583,981.10	27,812,770.11
负债和净资产总计		28,130,458.25	28,070,448.84

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.7838 元，C 类基金份额净值 1.7692 元。基金份额总额 15,478,609.04 份，其中 A 类基金份额 13,616,709.71 份，C 类基金份额 1,861,899.33 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,040,277.11	-3,529,996.74
1.利息收入		6,515.00	6,477.93
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,943.68	6,477.93
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		571.32	-

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-11,477.33	-3,868,812.50
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-289,201.56	-4,251,921.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	-	-
股利收益	6.4.7.14	277,724.23	383,108.61
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	1,041,446.52	320,348.99
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	3,792.92	11,988.84
减：二、营业总支出		286,877.43	306,027.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	117,552.48	121,165.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	29,388.19	30,291.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,899.22	4,805.36
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		2.05	-
8. 其他费用	6.4.7.17	135,035.49	149,765.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		753,399.68	-3,836,024.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		753,399.68	-3,836,024.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		753,399.68	-3,836,024.45

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海富通中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产（基金净值）	16,042,966.93	-	11,769,803.18	27,812,770.11
二、本期期初净资产（基金净值）	16,042,966.93	-	11,769,803.18	27,812,770.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-564,357.89	-	335,568.88	-228,789.01
（一）、综合收益总额	-	-	753,399.68	753,399.68
（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）	-564,357.89	-	-417,830.80	-982,188.69
其中：1.基金申购款	2,219,076.00	-	1,912,364.47	4,131,440.47
2.基金赎回款	-2,783,433.89	-	-2,330,195.27	-5,113,629.16
（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）	15,478,609.04	-	12,105,372.06	27,583,981.10
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	15,633,848.77	-	19,833,028.73	35,466,877.50
二、本期期初净资产（基金净值）	15,633,848.77	-	19,833,028.73	35,466,877.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	8,418.22	-	-3,949,653.26	-3,941,235.04
（一）、综合收益总额	-	-	-3,836,024.45	-3,836,024.45
（二）、本期基金份额交易产生	8,418.22	-	-113,628.81	-105,210.59

的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)				
其中: 1.基金申购款	3,689,241.59	-	3,582,180.81	7,271,422.40
2.基金赎回款	-3,680,823.37	-	-3,695,809.62	-7,376,632.99
(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)	15,642,266.99	-	15,883,375.47	31,525,642.46

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

海富通中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金转型而来。原基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]1801 号文核准,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《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 756,109,208.17 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 154 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 756,241,204.93 份基金份额,其中认购资金利息折合 131,996.76 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同》的有关规定,海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,于 2020 年 3 月 3 日表决通过了《关于海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同转型有关事项的议案》。根据《海富通基金管理有限公司关于海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同基金份额持有人大会表

决结果暨决议生效的公告》，《海富通中证 500 增强指数型证券投资基金基金合同》自 2020 年 3 月 5 日起正式生效，原《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同》自同日起失效。于 2020 年 3 月 5 日起，海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同的基金份额全部转换为海富通中证 500 增强指数型证券投资基金的基金份额。

根据《海富通中证 500 增强指数型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中证 500 增强指数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，以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可投资于国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(包含可分离交易可转换债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、股指期货、国债期货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相关规定)。本基金持有的股票及存托凭证投资占基金资产的比例为不低于 80%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中

国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通中证 500 指数增强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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。自 2020 年 3 月 5 日至 2023 年 6 月 30 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。故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	1,746,117.13
等于：本金	1,745,938.15
加：应计利息	178.98
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	1,746,117.13

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	25,859,332.94	-	25,817,153.15	-42,179.79
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	25,859,332.94	-	25,817,153.15	-42,179.79

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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4.10
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	207,806.00
其中：交易所市场	207,806.00
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	34,815.49
应付指数使用费	50,000.00
合计	292,625.59

6.4.7.7 实收基金

海富通中证 500 增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,867,765.24	13,867,765.24
本期申购	2,031,193.54	2,031,193.54
本期赎回（以“-”号填列）	-2,282,249.07	-2,282,249.07
本期末	13,616,709.71	13,616,709.71

海富通中证 500 增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,175,201.69	2,175,201.69
本期申购	187,882.46	187,882.46
本期赎回（以“-”号填列）	-501,184.82	-501,184.82
本期末	1,861,899.33	1,861,899.33

6.4.7.8 未分配利润

海富通中证 500 增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,702,080.42	-8,505,451.75	10,196,628.67
本期利润	-246,590.70	904,473.95	657,883.25
本期基金份额交易产生的变动数	-342,290.45	160,957.69	-181,332.76
其中：基金申购款	2,869,227.76	-1,112,944.96	1,756,282.80
基金赎回款	-3,211,518.21	1,273,902.65	-1,937,615.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,113,199.27	-7,440,020.11	10,673,179.16

海富通中证 500 增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,905,497.00	-1,332,322.49	1,573,174.51
本期利润	-41,456.14	136,972.57	95,516.43
本期基金份额交易产生的变动数	-415,162.28	178,664.24	-236,498.04
其中：基金申购款	261,399.50	-105,317.83	156,081.67
基金赎回款	-676,561.78	283,982.07	-392,579.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,448,878.58	-1,016,685.68	1,432,192.90

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,387.37
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	2,445.08
其他	111.23
合计	5,943.68

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	229,121,318.79
减：卖出股票成本总额	228,813,437.04

减：交易费用	597,083.31
买卖股票差价收入	-289,201.56

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	277,724.23
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	277,724.23

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	1,041,446.52
——股票投资	1,041,446.52
——债券投资	-
——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	1,041,446.52

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	3,792.92
合计	3,792.92

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	12,500.00
证券出借违约金	-
银行划款手续费	220.00
指数使用费	100,000.00
合计	135,035.49

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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

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股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	117,552.48	121,165.56
其中：支付销售机构的客户维护费	50,347.84	51,674.12

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 0.80% 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 x0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	29,388.19	30,291.41

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通中证 500 增强 A	海富通中证 500 增强 C	合计

海通证券	-	2.30	2.30
海富通基金	-	282.90	282.90
合计	-	285.20	285.20
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通中证500增强 A	海富通中证500增强C	合计
海富通基金	-	20.55	20.55
合计	-	20.55	20.55

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.25%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.25% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。销售服务费的计算方法如下：日销售服务费 = 前一日 C 类份额的基金资产净值 \times 0.25% / 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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,746,117.13	3,387.37	2,082,291.38	5,767.90

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
601298	青岛港	2023-06-28	重大事项停牌	6.97	2023-07-03	7.40	6,400	45,814.00	44,608.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资的金融工具主要为股票投资。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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有债券和资产支持证券（2022 年 12 月 31 日：无）。

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上述比例限制)。

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足

额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,746,117.13	-	-	-	1,746,117.13
结算备付金	410,998.67	-	-	-	410,998.67
存出保证金	13,133.51	-	-	-	13,133.51
交易性金融资产	-	-	-	25,817,153.15	25,817,153.15
应收清算款	-	-	-	134,510.18	134,510.18
应收申购款	9.99	-	-	8,535.62	8,545.61
资产总计	2,170,259.30	-	-	25,960,198.95	28,130,458.25
负债					
应付清算款	-	-	-	185,150.01	185,150.01
应付赎回款	-	-	-	44,897.95	44,897.95
应付管理人报酬	-	-	-	18,430.23	18,430.23
应付托管费	-	-	-	4,607.57	4,607.57

应付销售服务费	-	-	-	765.80	765.80
其他负债	-	-	-	292,625.59	292,625.59
负债总计	-	-	-	546,477.15	546,477.15
利率敏感度缺口	2,170,259.30	-	-	25,413,721.80	27,583,981.10
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,219,387.47	-	-	-	2,219,387.47
结算备付金	93,214.36	-	-	-	93,214.36
存出保证金	11,755.24	-	-	-	11,755.24
交易性金融资产	-	-	-	25,725,339.27	25,725,339.27
应收申购款	-	-	-	20,752.50	20,752.50
资产总计	2,324,357.07	-	-	25,746,091.77	28,070,448.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	29,477.09	29,477.09
应付管理人报酬	-	-	-	19,249.88	19,249.88
应付托管费	-	-	-	4,812.50	4,812.50
应付销售服务费	-	-	-	814.47	814.47
其他负债	-	-	-	203,324.79	203,324.79
负债总计	-	-	-	257,678.73	257,678.73
利率敏感度缺口	2,324,357.07	-	-	25,488,413.04	27,812,770.11

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	25,817,153.1 5	93.59	25,725,339.27	92.49
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	25,817,153.1 5	93.59	25,725,339.27	92.49

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	1,010,759.70	1,043,097.64
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-1,010,759.70	-1,043,097.64

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	25,772,545.15	25,725,339.27
第二层次	44,608.00	-
第三层次	-	-
合计	25,817,153.15	25,725,339.27

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	25,817,153.15	91.78
	其中：股票	25,817,153.15	91.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	2,157,115.80	7.67
8	其他各项资产	156,189.30	0.56
9	合计	28,130,458.25	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	173,978.00	0.63
B	采矿业	736,226.00	2.67
C	制造业	17,305,643.84	62.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	937,076.00	3.40
E	建筑业	259,832.15	0.94
F	批发和零售业	546,317.46	1.98
G	交通运输、仓储和邮政业	402,262.00	1.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,531,436.70	5.55
J	金融业	2,661,818.00	9.65
K	房地产业	203,905.00	0.74
L	租赁和商务服务业	209,570.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	224,440.00	0.81
N	水利、环境和公共设施管理业	533,064.00	1.93
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	40,890.00	0.15
S	综合	50,694.00	0.18
	合计	25,817,153.15	93.59

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	300088	长信科技	63,000	379,890.00	1.38
2	002745	木林森	41,200	379,040.00	1.37
3	002340	格林美	54,600	377,286.00	1.37
4	002273	水晶光电	31,500	376,110.00	1.36
5	600707	彩虹股份	77,800	370,328.00	1.34

6	300136	信维通信	17,500	351,400.00	1.27
7	601139	深圳燃气	47,000	342,630.00	1.24
8	002465	海格通信	32,200	332,948.00	1.21
9	002500	山西证券	59,300	330,894.00	1.20
10	000050	深天马 A	35,900	329,562.00	1.19
11	600095	湘财股份	42,100	328,380.00	1.19
12	002138	顺络电子	13,600	325,176.00	1.18
13	600517	国网英大	57,000	324,900.00	1.18
14	000559	万向钱潮	58,400	318,280.00	1.15
15	600166	福田汽车	92,300	313,820.00	1.14
16	002032	苏泊尔	6,200	310,000.00	1.12
17	002195	二三四五	106,600	308,074.00	1.12
18	300618	寒锐钴业	9,300	301,413.00	1.09
19	002266	浙富控股	70,000	289,100.00	1.05
20	600582	天地科技	49,500	288,585.00	1.05
21	002203	海亮股份	23,400	281,034.00	1.02
22	600967	内蒙一机	27,700	279,770.00	1.01
23	688185	康希诺	3,400	277,100.00	1.00
24	601577	长沙银行	35,700	277,032.00	1.00
25	600143	金发科技	31,100	271,503.00	0.98
26	000869	张裕 A	8,800	269,808.00	0.98
27	300677	英科医疗	10,900	239,800.00	0.87
28	603218	日月股份	12,400	235,476.00	0.85
29	002078	太阳纸业	20,500	219,145.00	0.79
30	002185	华天科技	23,800	218,960.00	0.79
31	002600	领益智造	31,600	218,356.00	0.79
32	000338	潍柴动力	17,500	218,050.00	0.79
33	600637	东方明珠	27,800	217,396.00	0.79
34	002223	鱼跃医疗	6,000	215,940.00	0.78
35	600198	大唐电信	31,400	215,090.00	0.78
36	002423	中粮资本	25,900	207,200.00	0.75
37	300741	华宝股份	9,400	201,348.00	0.73
38	600380	健康元	15,400	195,734.00	0.71
39	300595	欧普康视	6,400	193,216.00	0.70
40	000783	长江证券	32,500	188,500.00	0.68
41	002008	大族激光	7,100	186,020.00	0.67
42	002563	森马服饰	29,900	185,978.00	0.67
43	002690	美亚光电	6,900	177,675.00	0.64
44	002155	湖南黄金	14,300	174,460.00	0.63
45	002926	华西证券	20,500	170,355.00	0.62
46	601077	渝农商行	46,000	165,140.00	0.60
47	601666	平煤股份	21,800	164,372.00	0.60
48	601568	北元集团	30,800	162,316.00	0.59
49	600959	江苏有线	47,900	161,902.00	0.59

50	002156	通富微电	7,100	160,460.00	0.58
51	000967	盈峰环境	31,500	159,075.00	0.58
52	688779	长远锂科	13,912	156,788.24	0.57
53	000513	丽珠集团	4,000	155,640.00	0.56
54	000785	居然之家	40,500	154,305.00	0.56
55	002925	盈趣科技	7,500	145,500.00	0.53
56	002152	广电运通	11,300	132,436.00	0.48
57	002705	新宝股份	7,100	128,013.00	0.46
58	002075	沙钢股份	31,400	125,914.00	0.46
59	002468	申通快递	11,600	125,512.00	0.46
60	688819	天能股份	3,400	125,256.00	0.45
61	601966	玲珑轮胎	5,600	124,432.00	0.45
62	600516	方大炭素	19,700	122,140.00	0.44
63	688289	圣湘生物	7,000	117,880.00	0.43
64	000623	吉林敖东	7,200	115,488.00	0.42
65	603212	赛伍技术	5,400	112,374.00	0.41
66	000930	中粮科技	13,700	110,970.00	0.40
67	000725	京东方 A	27,000	110,430.00	0.40
68	300433	蓝思科技	9,300	109,368.00	0.40
69	600598	北大荒	8,100	107,973.00	0.39
70	601158	重庆水务	19,300	107,308.00	0.39
71	600718	东软集团	9,900	105,534.00	0.38
72	600170	上海建工	38,100	102,489.00	0.37
73	000027	深圳能源	15,500	102,145.00	0.37
74	002128	电投能源	7,500	99,150.00	0.36
75	002249	大洋电机	16,600	94,620.00	0.34
76	002382	蓝帆医疗	13,100	94,058.00	0.34
77	002080	中材科技	4,500	92,340.00	0.33
78	002221	东华能源	10,100	87,365.00	0.32
79	600863	内蒙华电	20,700	85,905.00	0.31
80	600271	航天信息	6,200	84,878.00	0.31
81	000898	鞍钢股份	30,500	84,790.00	0.31
82	002429	兆驰股份	14,400	79,200.00	0.29
83	300682	朗新科技	3,400	79,152.00	0.29
84	688777	中控技术	1,215	76,277.70	0.28
85	300487	蓝晓科技	1,200	74,904.00	0.27
86	600655	豫园股份	10,800	74,088.00	0.27
87	000570	苏常柴 A	13,300	74,081.00	0.27
88	600511	国药股份	1,900	73,815.00	0.27
89	601231	环旭电子	4,900	73,304.00	0.27
90	600879	航天电子	8,600	73,014.00	0.26
91	300037	新宙邦	1,400	72,646.00	0.26
92	002900	哈三联	5,400	72,198.00	0.26
93	688521	芯原股份	1,000	71,920.00	0.26

94	002952	亚世光电	4,000	70,920.00	0.26
95	300832	新产业	1,200	70,800.00	0.26
96	603937	丽岛新材	6,100	70,699.00	0.26
97	600161	天坛生物	2,600	70,590.00	0.26
98	603776	永安行	4,900	70,560.00	0.26
99	000519	中兵红箭	3,900	70,551.00	0.26
100	002361	神剑股份	17,400	70,470.00	0.26
101	688009	中国通号	12,100	70,180.00	0.25
102	002028	思源电气	1,500	70,080.00	0.25
103	600642	申能股份	10,000	69,900.00	0.25
104	605358	立昂微	1,900	69,787.00	0.25
105	002631	德尔未来	12,900	69,660.00	0.25
106	000709	河钢股份	30,500	68,930.00	0.25
107	600867	通化东宝	6,600	68,904.00	0.25
108	002966	苏州银行	10,500	68,775.00	0.25
109	003036	泰坦股份	5,100	68,748.00	0.25
110	600563	法拉电子	500	68,650.00	0.25
111	002376	新北洋	8,500	68,595.00	0.25
112	002373	千方科技	5,000	68,200.00	0.25
113	600663	陆家嘴	6,900	68,103.00	0.25
114	002518	科士达	1,700	68,017.00	0.25
115	002322	理工能科	6,500	67,600.00	0.25
116	002939	长城证券	8,300	67,479.00	0.24
117	300558	贝达药业	1,400	67,242.00	0.24
118	002956	西麦食品	4,300	67,209.00	0.24
119	300146	汤臣倍健	2,800	67,144.00	0.24
120	300690	双一科技	4,200	67,074.00	0.24
121	002595	豪迈科技	1,900	66,747.00	0.24
122	300888	稳健医疗	1,600	66,672.00	0.24
123	300289	利德曼	11,900	66,640.00	0.24
124	600000	浦发银行	9,200	66,608.00	0.24
125	600096	云天化	3,900	66,573.00	0.24
126	000417	合肥百货	14,200	66,456.00	0.24
127	688030	山石网科	3,100	66,433.00	0.24
128	600980	北矿科技	4,200	66,360.00	0.24
129	600521	华海药业	3,600	66,276.00	0.24
130	601233	桐昆股份	5,000	66,250.00	0.24
131	600704	物产中大	13,400	66,196.00	0.24
132	002985	北摩高科	1,500	66,180.00	0.24
133	000959	首钢股份	18,900	66,150.00	0.24
134	601058	赛轮轮胎	5,800	66,062.00	0.24
135	000705	浙江震元	8,200	66,010.00	0.24
136	000998	隆平高科	4,300	66,005.00	0.24
137	000630	铜陵有色	22,800	65,892.00	0.24

138	601958	金铂股份	5,900	65,785.00	0.24
139	002797	第一创业	11,500	65,780.00	0.24
140	000629	钒钛股份	16,800	65,688.00	0.24
141	600985	淮北矿业	5,700	65,664.00	0.24
142	300003	乐普医疗	2,900	65,569.00	0.24
143	002673	西部证券	10,300	65,405.00	0.24
144	600909	华安证券	14,000	65,380.00	0.24
145	002422	科伦药业	2,200	65,296.00	0.24
146	300257	开山股份	4,300	65,231.00	0.24
147	600498	烽火通信	3,200	65,184.00	0.24
148	601108	财通证券	9,000	65,160.00	0.24
149	300683	海特生物	1,700	65,127.00	0.24
150	600489	中金黄金	6,300	65,079.00	0.24
151	600820	隧道股份	10,815	64,998.15	0.24
152	002969	嘉美包装	16,600	64,906.00	0.24
153	603689	皖天然气	7,400	64,898.00	0.24
154	600377	宁沪高速	6,600	64,878.00	0.24
155	002511	中顺洁柔	5,800	64,670.00	0.23
156	601866	中远海发	26,100	64,467.00	0.23
157	300012	华测检测	3,300	64,350.00	0.23
158	603156	养元饮品	2,600	64,220.00	0.23
159	002531	天顺风能	4,200	63,966.00	0.23
160	300357	我武生物	1,900	63,897.00	0.23
161	600566	济川药业	2,200	63,888.00	0.23
162	600995	南网储能	5,800	63,858.00	0.23
163	600315	上海家化	2,200	63,822.00	0.23
164	002653	海思科	2,700	63,720.00	0.23
165	000066	中国长城	4,600	63,618.00	0.23
166	300941	创识科技	3,100	63,054.00	0.23
167	000932	华菱钢铁	13,200	62,964.00	0.23
168	000807	云铝股份	4,900	62,377.00	0.23
169	600350	山东高速	9,700	61,789.00	0.22
170	601555	东吴证券	8,900	61,766.00	0.22
171	600859	王府井	3,100	61,349.00	0.22
172	600167	联美控股	8,800	61,336.00	0.22
173	688385	复旦微电	1,200	60,120.00	0.22
174	300771	智莱科技	5,500	59,895.00	0.22
175	600619	海立股份	9,200	59,708.00	0.22
176	688063	派能科技	300	59,475.00	0.22
177	000423	东阿阿胶	1,100	58,795.00	0.21
178	002368	太极股份	1,400	57,638.00	0.21
179	000937	冀中能源	9,000	57,420.00	0.21
180	603127	昭衍新药	1,400	57,260.00	0.21
181	002439	启明星辰	1,900	56,544.00	0.20

182	300724	捷佳伟创	500	56,175.00	0.20
183	600862	中航高科	2,200	55,682.00	0.20
184	603707	健友股份	4,100	55,350.00	0.20
185	601888	中国中免	500	55,265.00	0.20
186	688082	盛美上海	500	55,200.00	0.20
187	688295	中复神鹰	1,500	55,020.00	0.20
188	002625	光启技术	3,600	54,936.00	0.20
189	000960	锡业股份	3,500	54,425.00	0.20
190	002056	横店东磁	2,900	52,809.00	0.19
191	600352	浙江龙盛	5,600	52,360.00	0.19
192	600535	天士力	3,600	52,236.00	0.19
193	605288	凯迪股份	1,200	51,648.00	0.19
194	601611	中国核建	6,100	51,545.00	0.19
195	000958	电投产融	11,800	51,094.00	0.19
196	600998	九州通	4,917	51,038.46	0.19
197	300601	康泰生物	2,000	50,780.00	0.18
198	000009	中国宝安	4,200	50,694.00	0.18
199	600066	宇通客车	3,400	50,116.00	0.18
200	002364	中恒电气	5,900	49,501.00	0.18
201	601162	天风证券	16,600	49,468.00	0.18
202	300177	中海达	7,300	49,421.00	0.18
203	300692	中环环保	6,700	48,977.00	0.18
204	002065	东华软件	6,900	48,714.00	0.18
205	600372	中航电子	3,200	48,576.00	0.18
206	600079	人福医药	1,800	48,492.00	0.18
207	000031	大悦城	13,200	48,312.00	0.18
208	600848	上海临港	4,000	47,800.00	0.17
209	000060	中金岭南	10,000	47,500.00	0.17
210	601298	青岛港	6,400	44,608.00	0.16
211	002072	凯瑞德	7,100	44,446.00	0.16
212	600499	科达制造	3,900	44,304.00	0.16
213	600348	华阳股份	5,600	44,296.00	0.16
214	300395	菲利华	900	44,280.00	0.16
215	603626	科森科技	6,300	44,226.00	0.16
216	300647	超频三	6,000	43,080.00	0.16
217	002333	罗普斯金	7,100	42,955.00	0.16
218	600390	五矿资本	7,900	42,502.00	0.15
219	688299	长阳科技	2,700	42,309.00	0.15
220	002486	嘉麟杰	14,300	42,185.00	0.15
221	000538	云南白药	800	41,984.00	0.15
222	000895	双汇发展	1,700	41,633.00	0.15
223	600177	雅戈尔	6,500	41,015.00	0.15
224	601598	中国外运	8,800	41,008.00	0.15
225	000156	华数传媒	4,700	40,890.00	0.15

226	603755	日辰股份	1,300	40,807.00	0.15
227	600970	中材国际	3,200	40,800.00	0.15
228	002244	滨江集团	4,500	39,690.00	0.14
229	000598	兴蓉环境	7,200	39,096.00	0.14
230	300009	安科生物	3,800	38,000.00	0.14
231	688188	柏楚电子	200	37,712.00	0.14
232	002732	燕塘乳业	1,700	36,754.00	0.13
233	300070	碧水源	6,700	35,912.00	0.13
234	688015	交控科技	2,000	34,940.00	0.13
235	603589	口子窖	700	34,545.00	0.13
236	300347	泰格医药	500	32,270.00	0.12
237	688029	南微医学	85	6,932.60	0.03
238	002153	石基信息	60	840.00	0.00

注：根据上海二三四五网络控股集团股份有限公司于 2023 年 8 月 5 日发布的《关于变更公司名称及证券简称的公告》，自 2023 年 8 月 7 日起，公司的证券简称由“二三四五”变更为“岩山科技”，证券代码“002195”保持不变。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603613	国联股份	1,488,026.14	5.35
2	002465	海格通信	1,375,429.00	4.95
3	688819	天能股份	1,329,285.34	4.78
4	600376	首开股份	1,316,783.00	4.73
5	600707	彩虹股份	1,243,360.00	4.47
6	002385	大北农	1,141,794.00	4.11
7	300146	汤臣倍健	1,140,095.04	4.10
8	002511	中顺洁柔	1,095,379.00	3.94
9	002078	太阳纸业	1,058,779.00	3.81
10	002056	横店东磁	1,056,962.00	3.80
11	600998	九州通	1,028,733.00	3.70
12	601108	财通证券	1,015,084.74	3.65
13	600655	豫园股份	977,730.00	3.52
14	600517	国网英大	934,691.00	3.36
15	600909	华安证券	925,532.00	3.33
16	688185	康希诺	922,053.66	3.32
17	688116	天奈科技	921,922.12	3.31
18	601139	深圳燃气	915,872.00	3.29

19	002966	苏州银行	912,462.00	3.28
20	600143	金发科技	900,270.00	3.24
21	002340	格林美	897,275.00	3.23
22	002563	森马服饰	894,133.00	3.21
23	600637	东方明珠	892,655.00	3.21
24	000997	新大陆	889,503.00	3.20
25	688777	中控技术	881,570.81	3.17
26	600390	五矿资本	879,100.00	3.16
27	300776	帝尔激光	872,685.00	3.14
28	601665	齐鲁银行	862,905.00	3.10
29	603218	日月股份	859,647.00	3.09
30	600808	马钢股份	857,423.00	3.08
31	600885	宏发股份	855,871.80	3.08
32	600582	天地科技	849,445.00	3.05
33	601869	长飞光纤	843,854.00	3.03
34	688390	固德威	842,483.47	3.03
35	002925	盈趣科技	833,196.00	3.00
36	600859	王府井	827,097.00	2.97
37	002500	山西证券	823,734.00	2.96
38	002273	水晶光电	823,443.00	2.96
39	600079	人福医药	822,280.00	2.96
40	000967	盈峰环境	820,968.00	2.95
41	600161	天坛生物	816,175.00	2.93
42	601187	厦门银行	813,426.00	2.92
43	002396	星网锐捷	809,603.00	2.91
44	002242	九阳股份	804,337.00	2.89
45	000563	陕国投 A	787,531.00	2.83
46	600598	北大荒	784,403.00	2.82
47	000869	张裕 A	781,454.00	2.81
48	002138	顺络电子	778,001.00	2.80
49	603056	德邦股份	775,180.00	2.79
50	002268	电科网安	769,822.00	2.77
51	300618	寒锐钴业	769,035.00	2.77
52	300888	稳健医疗	761,882.00	2.74
53	600064	南京高科	761,443.00	2.74
54	600258	首旅酒店	761,153.00	2.74
55	600516	方大炭素	759,795.00	2.73
56	000623	吉林敖东	753,901.00	2.71
57	002745	木林森	748,592.00	2.69
58	300088	长信科技	748,431.00	2.69
59	601866	中远海发	744,433.00	2.68
60	002603	以岭药业	741,785.00	2.67
61	601158	重庆水务	738,621.00	2.66
62	002673	西部证券	729,285.00	2.62

63	600398	海澜之家	720,953.00	2.59
64	600170	上海建工	716,913.00	2.58
65	300136	信维通信	705,017.00	2.53
66	000027	深圳能源	703,809.00	2.53
67	600208	新湖中宝	697,368.00	2.51
68	002926	华西证券	697,158.00	2.51
69	600871	石化油服	694,292.00	2.50
70	300850	新强联	694,169.00	2.50
71	002250	联化科技	693,539.00	2.49
72	603605	珀莱雅	690,328.00	2.48
73	000629	钒钛股份	689,925.00	2.48
74	603317	天味食品	688,546.00	2.48
75	600597	光明乳业	677,601.00	2.44
76	002152	广电运通	677,092.00	2.43
77	600980	北矿科技	671,764.00	2.42
78	002223	鱼跃医疗	667,302.00	2.40
79	002434	万里扬	666,918.00	2.40
80	002124	天邦食品	666,798.00	2.40
81	002948	青岛银行	665,901.00	2.39
82	600848	上海临港	663,776.00	2.39
83	600489	中金黄金	663,551.00	2.39
84	002080	中材科技	657,316.00	2.36
85	002048	宁波华翔	652,265.00	2.35
86	600967	内蒙一机	652,097.00	2.34
87	002444	巨星科技	651,716.00	2.34
88	600038	中直股份	651,283.00	2.34
89	002192	融捷股份	649,642.00	2.34
90	600704	物产中大	643,691.00	2.31
91	600580	卧龙电驱	638,396.00	2.30
92	600315	上海家化	632,348.00	2.27
93	002081	金螳螂	626,270.00	2.25
94	300296	利亚德	624,197.00	2.24
95	300003	乐普医疗	620,296.00	2.23
96	300357	我武生物	615,080.00	2.21
97	600298	安琪酵母	613,524.00	2.21
98	688289	圣湘生物	603,448.84	2.17
99	600167	联美控股	601,245.23	2.16
100	688009	中国通号	598,921.61	2.15
101	600959	江苏有线	597,071.00	2.15
102	688779	长远锂科	597,028.56	2.15
103	600567	山鹰国际	588,082.00	2.11
104	300144	宋城演艺	587,964.00	2.11
105	000062	深圳华强	582,535.00	2.09
106	603026	胜华新材	579,713.01	2.08

107	603858	步长制药	579,668.55	2.08
108	000898	鞍钢股份	577,380.00	2.08
109	603156	养元饮品	575,019.00	2.07
110	601577	长沙银行	573,706.00	2.06
111	603866	桃李面包	573,263.66	2.06
112	000050	深天马 A	573,169.00	2.06
113	600820	隧道股份	570,093.00	2.05
114	600663	陆家嘴	568,505.00	2.04
115	600879	航天电子	566,356.00	2.04
116	603233	大参林	564,553.00	2.03
117	002244	滨江集团	561,518.00	2.02
118	002797	第一创业	560,748.00	2.02
119	002203	海亮股份	560,186.00	2.01

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	603613	国联股份	1,472,485.00	5.29
2	601108	财通证券	1,421,051.00	5.11
3	300776	帝尔激光	1,358,896.00	4.89
4	600376	首开股份	1,284,783.00	4.62
5	601869	长飞光纤	1,281,596.00	4.61
6	688116	天奈科技	1,218,074.26	4.38
7	600885	宏发股份	1,177,298.80	4.23
8	688819	天能股份	1,167,909.81	4.20
9	600637	东方明珠	1,157,969.00	4.16
10	600064	南京高科	1,154,037.10	4.15
11	002385	大北农	1,152,798.00	4.14
12	002673	西部证券	1,126,899.00	4.05
13	600597	光明乳业	1,112,051.90	4.00
14	688390	固德威	1,095,988.33	3.94
15	000967	盈峰环境	1,093,886.00	3.93
16	300146	汤臣倍健	1,081,897.70	3.89
17	002465	海格通信	1,079,401.00	3.88
18	600170	上海建工	1,071,092.00	3.85
19	600998	九州通	1,019,132.00	3.66
20	600928	西安银行	1,013,818.00	3.65
21	002511	中顺洁柔	1,012,926.00	3.64
22	002056	横店东磁	998,863.00	3.59

23	600820	隧道股份	990,607.10	3.56
24	000997	新大陆	989,007.00	3.56
25	601198	东兴证券	966,467.50	3.47
26	603156	养元饮品	961,104.00	3.46
27	002958	青农商行	960,272.00	3.45
28	601098	中南传媒	930,082.00	3.34
29	600655	豫园股份	886,401.80	3.19
30	600390	五矿资本	880,889.00	3.17
31	600707	彩虹股份	877,158.00	3.15
32	000869	张裕A	873,198.00	3.14
33	600377	宁沪高速	872,232.00	3.14
34	002595	豪迈科技	859,728.00	3.09
35	002250	联化科技	856,320.00	3.08
36	002268	电科网安	841,974.00	3.03
37	002078	太阳纸业	840,728.00	3.02
38	601665	齐鲁银行	836,583.80	3.01
39	000513	丽珠集团	832,397.91	2.99
40	600808	马钢股份	827,577.00	2.98
41	600909	华安证券	823,223.85	2.96
42	601187	厦门银行	822,416.10	2.96
43	002396	星网锐捷	821,845.00	2.95
44	600901	江苏金租	818,014.20	2.94
45	600398	海澜之家	813,519.00	2.92
46	600258	首旅酒店	811,563.55	2.92
47	603228	景旺电子	811,297.00	2.92
48	688777	中控技术	804,734.38	2.89
49	600380	健康元	802,852.00	2.89
50	002966	苏州银行	782,556.00	2.81
51	600373	中文传媒	779,246.00	2.80
52	002242	九阳股份	774,570.00	2.78
53	600598	北大荒	774,098.00	2.78
54	600161	天坛生物	773,323.00	2.78
55	002603	以岭药业	767,804.00	2.76
56	600079	人福医药	767,538.00	2.76
57	000563	陕国投A	759,840.00	2.73
58	603605	珀莱雅	746,736.20	2.68
59	300115	长盈精密	743,091.00	2.67
60	600271	航天信息	738,149.80	2.65
61	002563	森马服饰	735,161.75	2.64
62	600859	王府井	731,561.00	2.63
63	600967	内蒙一机	712,791.00	2.56
64	603056	德邦股份	708,063.00	2.55
65	600871	石化油服	707,881.00	2.55
66	600566	济川药业	700,409.00	2.52

67	600208	新湖中宝	677,644.00	2.44
68	300888	稳健医疗	673,877.80	2.42
69	002925	盈趣科技	673,042.00	2.42
70	601866	中远海发	671,055.00	2.41
71	600299	安迪苏	668,616.00	2.40
72	300850	新强联	661,870.00	2.38
73	002192	融捷股份	656,113.00	2.36
74	002299	圣农发展	655,580.00	2.36
75	603317	天味食品	653,518.80	2.35
76	002124	天邦食品	652,594.00	2.35
77	002948	青岛银行	652,015.00	2.34
78	600109	国金证券	649,251.00	2.33
79	000623	吉林敖东	648,952.00	2.33
80	002434	万里扬	647,313.00	2.33
81	300296	利亚德	645,059.00	2.32
82	000598	兴蓉环境	641,963.00	2.31
83	601158	重庆水务	640,190.00	2.30
84	600038	中直股份	639,453.00	2.30
85	600549	厦门钨业	638,934.00	2.30
86	600980	北矿科技	633,861.00	2.28
87	600580	卧龙电驱	633,135.00	2.28
88	601298	青岛港	629,477.00	2.26
89	603658	安图生物	628,057.00	2.26
90	600517	国网英大	626,536.00	2.25
91	002048	宁波华翔	624,251.25	2.24
92	600516	方大炭素	620,382.00	2.23
93	600848	上海临港	618,580.60	2.22
94	600143	金发科技	612,868.00	2.20
95	000027	深圳能源	611,889.00	2.20
96	603218	日月股份	609,894.12	2.19
97	002444	巨星科技	605,479.80	2.18
98	603858	步长制药	604,067.81	2.17
99	600489	中金黄金	602,867.00	2.17
100	000062	深圳华强	599,323.40	2.15
101	000739	普洛药业	599,163.00	2.15
102	603444	吉比特	597,793.00	2.15
103	601128	常熟银行	597,279.00	2.15
104	688185	康希诺	595,846.81	2.14
105	000629	钒钛股份	595,835.00	2.14
106	002081	金螳螂	594,103.00	2.14
107	600704	物产中大	590,738.75	2.12
108	001872	招商港口	588,483.00	2.12
109	600642	申能股份	585,493.00	2.11
110	600298	安琪酵母	582,140.30	2.09

111	300604	长川科技	578,160.00	2.08
112	300144	宋城演艺	572,125.00	2.06
113	603233	大参林	569,862.00	2.05
114	002152	广电运通	569,785.00	2.05
115	600567	山鹰国际	569,364.00	2.05
116	601139	深圳燃气	568,935.40	2.05
117	300866	安克创新	567,845.00	2.04
118	600582	天地科技	563,124.00	2.02
119	002080	中材科技	563,098.00	2.02
120	600315	上海家化	560,376.00	2.01
121	603026	胜华新材	558,542.00	2.01

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	227,863,804.40
卖出股票的收入（成交）总额	229,121,318.79

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

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

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。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,133.51
2	应收清算款	134,510.18
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,545.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	156,189.30
---	----	------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通中证 500 增强 A	2,820	4,828.62	50,299.94	0.37%	13,566,409.77	99.63%
海富通中证 500 增强 C	519	3,587.47	-	-	1,861,899.33	100.00%
合计	3,339	4,635.70	50,299.94	0.32%	15,428,309.10	99.68%

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	海富通中证 500 增强 A	75,325.38	0.5532%
	海富通中证 500 增强 C	74.13	0.0040%
	合计	75,399.51	0.4871%

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	海富通中证 500 增强 A	0

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海富通中证 500 增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通中证 500 增强 A	0
	海富通中证 500 增强 C	0
	合计	0

§9 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
基金合同生效日（2020 年 3 月 5 日）基金份额总额	17,367,521.34	-
本报告期期初基金份额总额	13,867,765.24	2,175,201.69
本报告期基金总申购份额	2,031,193.54	187,882.46
减：本报告期基金总赎回份额	2,282,249.07	501,184.82
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,616,709.71	1,861,899.33

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	218,102,855.03	47.73%	157,318.03	47.39%	-
国泰君安	1	204,652,194.84	44.79%	149,663.31	45.08%	-
国信证券	2	32,523,455.92	7.12%	23,785.12	7.16%	-
银河证券	1	1,664,207.04	0.36%	1,217.07	0.37%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

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	成交金额	占当期回	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		购成交总 额的比例		证成交总 额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	5,196,000. 00	100.00%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-06
2	海富通中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-16
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通期货股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-17
4	海富通基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-22
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增新华信通基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
7	海富通基金管理有限公司关于终止部分代销	中国证券报、基金管理人	2023-03-30

	机构办理旗下基金相关销售业务的公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国工商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-18

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 109 只公募基金。截至 2023 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1649 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国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。

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”。

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

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获“IAMAC 推介·2021

年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会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他文件

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇二三年八月三十一日