

海富通中证 500 指数增强型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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：二〇二四年八月三十日

§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 2024 年 8 月 29 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 2024 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合规守信情况的说明	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合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	50
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	52
§ 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	53
10.8 其他重大事件	55
§ 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	35,198,340.26 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	12,569,372.26 份	22,628,968.00 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	张金良

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（2024年1月1日至2024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	-1,115,461.69	-435,706.02
本期利润	-2,014,136.94	-187,005.80
加权平均基金份额本期利润	-0.1568	-0.0604
本期加权平均净值利润率	-10.06%	-3.93%
本期基金份额净值增长率	-9.50%	-9.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024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	6,243,401.76	10,879,922.28
期末可供分配基金份额利润	0.4967	0.4808
期末基金资产净值	18,812,774.02	33,508,890.28
期末基金份额净值	1.4967	1.4808
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 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	-0.22%	-2.62%

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	-4.99%	0.78%	-6.55%	0.91%	1.56%	-0.13%
过去三个月	-3.05%	0.93%	-6.16%	1.09%	3.11%	-0.16%
过去六个月	-9.50%	1.49%	-8.46%	1.53%	-1.04%	-0.04%
过去一年	-16.09%	1.16%	-16.71%	1.21%	0.62%	-0.05%
过去三年	-26.75%	1.15%	-26.01%	1.14%	-0.74%	0.01%
自基金合同生效起至今	-0.22%	1.25%	-12.51%	1.17%	12.29%	0.08%

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	-5.01%	0.78%	-6.55%	0.91%	1.54%	-0.13%
过去三个月	-3.11%	0.93%	-6.16%	1.09%	3.05%	-0.16%
过去六个月	-9.61%	1.49%	-8.46%	1.53%	-1.15%	-0.04%
过去一年	-16.30%	1.16%	-16.71%	1.21%	0.41%	-0.05%
过去三年	-27.29%	1.15%	-26.01%	1.14%	-1.28%	0.01%
自基金合同生效起至今	-2.62%	1.25%	-12.51%	1.17%	9.89%	0.08%

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 2024 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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 97 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、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、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、海富通盈丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资基金、海富通瑞鑫 30 天持有期债券型证券投资基金、海富通优势驱动混合型证券投资基金、海富通 ESG 领先股票型证券投资基金、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金、海富通红利优选混合型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通数字经济混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李自悟	本基金的基金经理；量化投资部副总监。	2023-02-15	-	16 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, 现任量化投资部副总监。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。2024 年 3 月起兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。
朱斌全	本基金的基金经理	2022-12-13	2024-04-17	17 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 月至 2024 年 4 月兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 指数增强基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。

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

2024 年上半年国内经济温和复苏，但修复力度有待增强。经济数据在 3、4 月份改善以后，5、6 月份重新放缓，二季度 GDP 增速弱于预期，同时 PMI 制造业采购经理指数在 5、6 月份重新回到荣枯线下方。从经济动能来看，对外出口仍然是增长的主要动力，6 月份单月贸易顺差更是达到 990 亿美元，创历史新高。与之对比，受收入端影响，国内需求有所下降，社会消费品零售数据增幅放缓。房地产投资方面，降幅基本企稳，但反弹的势能仍在积蓄。金融数据方面，人民币贷款和社融增速双双放缓，从去年的 10% 以上回落至 8-9% 的区间。价格数据中 CPI 较为稳定，同时 PPI 降幅明显放缓，预计下半年转正概率较大。海外方面，美国经济数据较好，但 6 月以来就业数据有所走弱，叠加近期 CPI 数据回落，市场对 9 月份开启降息的预期逐步增强。

从金融市场来看，权益市场主要指数以下跌为主，上证指数为-0.25%，沪深 300 为 0.89%，创业板指为-10.99%。风格方面偏向防守，中证红利、上证 50 等指数涨幅居前，中小市值的中证 1000、

中证 2000 等跌幅较大。行业方面同样如此，表现靠前的板块是银行、煤炭、石油石化、家电、电力及公用事业，跌幅较大的板块是消费者服务、计算机、商品零售、传媒、医药。

基金投资方面，本基金在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，以实现超越业绩比较基准的投资收益为主要目标。在策略方面，本基金以量化多因子选股体系为框架，以人工智能深度学习模型为核心，采用多维度历史数据构建选股模型，并通过组合优化的方式构建符合基金持仓风格的投资组合。在运作方面，本基金严格约束行业和个股权重，并通过风险模型保持投资组合的风格暴露在合理范围之内。

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-9.50%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%。海富通中证 500 增强 C 净值增长率为-9.61%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年市场，宏观层面仍将保持战略定力，为明年外部环境可能发生的变化预留足够的政策储备。特别是结合当前对于发展质量的追求高于对规模的追求的现状，财政政策有倾向性的发力概率更高，推出大规模经济刺激政策的概率则较小。在此基础上，随着美联储降息周期的临近，人民币汇率上的压力将有所缓解，这在一定程度上将打开货币政策逆周期调节的政策空间。预计央行将灵活运用多样化的货币工具，保持较为宽松的利率环境。

从经济活动来看，目前国内经济正在经历一轮总需求和总产能的再平衡过程，部分行业和企业正在经历上下游产业链重塑的冲击。但另一方面，我们也看到产业结构的升级正在孕育出新的机遇，手机、新能源车和芯片等正在成为新的出口主力，在量和质两方面同步提升国内经济的含金量。

回到下半年权益市场的机会，我们认为需要让组合更好地契合目前经济发展的大方向。一方面在经济筑底的过程中做好防守，在风格配置上要管理好组合收益的下限。但另一方面，也要积极捕捉新旧经济切换过程中的不断涌现的新机遇，积极布局新经济方向，为经济和市场的双重复苏做好准备。

从量化投资的角度，上半年市场风格的剧烈变化给所有的量化管理人上了很好的一堂课。我们对模型也做了很多调整和迭代。特别是在对市场风格的判断上，量化模型具有一些独特的优势，视野更长、覆盖面更广，使其有机会在复杂多变的市场中更好地把握市场热点的切换。我们也将依托优化后的模型，力争更好地回报投资者。

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

本基金自 2023 年 10 月 10 日至 2024 年 3 月 28 日，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；自 2024 年 4 月 2 日至 2024 年 6 月 27 日，连续五十七个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人拟持续运作本基金，解决方案已根据法规要求向中国证券监督管理委员会上海监管局进行了报告。

§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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	19,057,862.49	1,958,208.76
结算备付金		551,166.08	264,496.28
存出保证金		245,900.38	17,458.62
交易性金融资产	6.4.7.2	39,287,634.11	26,930,126.87
其中：股票投资		37,064,026.60	26,930,126.87
基金投资		-	-
债券投资		2,223,607.51	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		12,006,307.54	40,960.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		71,148,870.60	29,211,250.77

负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		18,621,750.75	-
应付赎回款		3,500.42	19,642.71
应付管理人报酬		16,218.43	19,635.69
应付托管费		4,054.62	4,908.93
应付销售服务费		1,109.73	1,491.36
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	180,572.35	283,106.23
负债合计		18,827,206.30	328,784.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	35,198,340.26	17,503,822.30
未分配利润	6.4.7.8	17,123,324.04	11,378,643.55
净资产合计		52,321,664.30	28,882,465.85
负债和净资产总计		71,148,870.60	29,211,250.77

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.4967 元，C 类基金份额净值 1.4808 元。基金份额总额 35,198,340.26 份，其中 A 类基金份额 12,569,372.26 份，C 类基金份额 22,628,968.00 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,932,720.73	1,040,277.11
1.利息收入		11,111.80	6,515.00
其中：存款利息收入	6.4.7.9	10,259.96	5,943.68
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		851.84	571.32
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,710,519.08	-11,477.33
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,080,550.45	-289,201.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	3,057.70	-
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	25,677.84	-
股利收益	6.4.7.14	341,295.83	277,724.23
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	-649,975.03	1,041,446.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	416,661.58	3,792.92
减：二、营业总支出		268,422.01	286,877.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	97,997.77	117,552.48
2. 托管费	6.4.10.2.2	24,499.47	29,388.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,702.95	4,899.22
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		96.04	2.05
8. 其他费用	6.4.7.17	140,125.78	135,035.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,201,142.74	753,399.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,201,142.74	753,399.68
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,201,142.74	753,399.68

6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	17,503,822.30	-	11,378,643.55	28,882,465.85

二、本期期初净资产	17,503,822.30	-	11,378,643.55	28,882,465.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	17,694,517.96	-	5,744,680.49	23,439,198.45
（一）、综合收益总额	-	-	-2,201,142.74	-2,201,142.74
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	17,694,517.96	-	7,945,823.23	25,640,341.19
其中：1.基金申购款	40,576,734.91	-	20,333,169.04	60,909,903.95
2.基金赎回款	-22,882,216.95	-	-12,387,345.81	-35,269,562.76
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	35,198,340.26	-	17,123,324.04	52,321,664.30
项目	上年度可比期间 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	16,042,966.93	-	11,769,803.18	27,812,770.11
二、本期期初净资产	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净资产变动数（净资产减少以“-”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	-2,783,433.89	-	-2,330,195.27	-5,113,629.16

款				
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	15,478,609.04	-	12,105,372.06	27,583,981.10

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 2024 年 8 月 29 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》及其他相关规定(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。

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 2024 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	19,057,862.49
等于：本金	19,057,262.42
加：应计利息	600.07
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	19,057,862.49

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	37,926,303.21	-	37,064,026.60	-862,276.61
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所		18,547.51		
	市场	2,205,204.00		2,223,607.51	-144.00
	银行间		-		
	市场	-		-	-
	合计	2,205,204.00	18,547.51	2,223,607.51	-144.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		40,131,507.21	18,547.51	39,287,634.11	-862,420.61

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
资产		负债		
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,972,880.00	-	-	-
——股指期货	1,972,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,972,880.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2407	IC2407	2.00	1,967,040.00	-5,840.00
合计	-	-	-	-5,840.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-5,840.00
净额	-	-	-	-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	90,681.57
其中：交易所市场	90,681.57
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	39,890.78
应付指数使用费	50,000.00
合计	180,572.35

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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,221,016.32	13,221,016.32
本期申购	2,278,505.59	2,278,505.59
本期赎回（以“-”号填列）	-2,930,149.65	-2,930,149.65
本期末	12,569,372.26	12,569,372.26

海富通中证 500 增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,282,805.98	4,282,805.98
本期申购	38,298,229.32	38,298,229.32
本期赎回（以“-”号填列）	-19,952,067.30	-19,952,067.30
本期末	22,628,968.00	22,628,968.00

注：赎回含转换出份额。

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	15,986,058.89	-7,341,017.13	8,645,041.76
本期期初	15,986,058.89	-7,341,017.13	8,645,041.76
本期利润	-1,115,461.69	-898,675.25	-2,014,136.94
本期基金份额交易产生的变动数	-757,056.39	369,553.33	-387,503.06
其中：基金申购款	2,557,674.64	-1,325,860.92	1,231,813.72
基金赎回款	-3,314,731.03	1,695,414.25	-1,619,316.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,113,540.81	-7,870,139.05	6,243,401.76

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	5,110,018.86	-2,376,417.07	2,733,601.79
本期期初	5,110,018.86	-2,376,417.07	2,733,601.79
本期利润	-435,706.02	248,700.22	-187,005.80
本期基金份额交易产生的变动数	20,350,021.10	-12,016,694.81	8,333,326.29
其中：基金申购款	42,451,621.54	-23,350,266.22	19,101,355.32
基金赎回款	-22,101,600.44	11,333,571.41	-10,768,029.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,024,333.94	-14,144,411.66	10,879,922.28

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,912.30
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	3,346.91
其他	2,000.75
合计	10,259.96

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	181,625,163.74
减：卖出股票成本总额	183,323,576.51
减：交易费用	382,137.68
买卖股票差价收入	-2,080,550.45

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	2,797.70
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	260.00
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	3,057.70

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,011,303.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）	2,003,740.00

成本总额	
减：应计利息总额	7,303.01
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	260.00

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益（税前）	26,600.00
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	774.76
减：交易费用	147.40
合计	25,677.84

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	341,295.83
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	341,295.83

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-644,135.03
——股票投资	-643,991.03
——债券投资	-144.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-5,840.00
——权证投资	-
——股指期货	-5,840.00
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	-649,975.03

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	416,641.94
基金转换费收入	19.64
合计	416,661.58

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	20,000.00
证券出借违约金	-
银行划款手续费	235.00
指数使用费	100,000.00
合计	140,125.78

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
海通证券	52,844,785.40	14.06%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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	38,888.76	14.55%	2,539.82	2.80%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	-	-	-	-

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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	97,997.77	117,552.48
其中：应支付销售机构的客户维护费	39,408.85	50,347.84
应支付基金管理人的净管理费	58,588.92	67,204.64

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 × 0.80% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	24,499.47	29,388.19

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 × 0.20% / 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		
	2024年1月1日至2024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	-	1.82	1.82
海富通	-	1,234.94	1,234.94
合计	-	1,236.76	1,236.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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	-	282.90	282.90
合计	-	285.20	285.20

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023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	19,057,862.49	4,912.30	1,746,117.13	3,387.37

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（2024 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

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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券（2023 年 12 月 31 日：无）。

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 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,223,607.51	-
合计	2,223,607.51	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	19,057,862.49	-	-	-	19,057,862.49
结算备付金	551,166.08	-	-	-	551,166.08
存出保证金	9,855.58	-	-	236,044.80	245,900.38
交易性金融资产	2,223,607.51	-	-	37,064,026.60	39,287,634.11
应收申购款	12,000,009.99	-	-	6,297.55	12,006,307.54
资产总计	33,842,501.65	-	-	37,306,368.95	71,148,870.60
负债					
应付清算款	-	-	-	18,621,750.75	18,621,750.75
应付赎回款	-	-	-	3,500.42	3,500.42
应付管理人报酬	-	-	-	16,218.43	16,218.43
应付托管费	-	-	-	4,054.62	4,054.62
应付销售服务费	-	-	-	1,109.73	1,109.73

其他负债	-	-	-	180,572.35	180,572.35
负债总计	-	-	-	18,827,206.30	18,827,206.30
利率敏感度缺口	33,842,501.65	-	-	18,479,162.65	52,321,664.30
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,958,208.76	-	-	-	1,958,208.76
结算备付金	264,496.28	-	-	-	264,496.28
存出保证金	17,458.62	-	-	-	17,458.62
交易性金融资产	-	-	-	26,930,126.87	26,930,126.87
应收申购款	-	-	-	40,960.24	40,960.24
资产总计	2,240,163.66	-	-	26,971,087.11	29,211,250.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	19,642.71	19,642.71
应付管理人报酬	-	-	-	19,635.69	19,635.69
应付托管费	-	-	-	4,908.93	4,908.93
应付销售服务费	-	-	-	1,491.36	1,491.36
其他负债	-	-	-	283,106.23	283,106.23
负债总计	-	-	-	328,784.92	328,784.92
利率敏感度缺口	2,240,163.66	-	-	26,642,302.19	28,882,465.85

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-3,135.55	-
	市场利率下降 25 个基点	3,147.77	-

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	37,064,026.60	70.84	26,930,126.87	93.24
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	37,064,026.6 0	70.84	26,930,126.87	93.24
----	-------------------	-------	---------------	-------

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	1,967,046.60	1,078,969.03
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-1,967,046.60	-1,078,969.03

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	37,064,026.60	26,930,126.87
第二层次	2,223,607.51	-
第三层次	-	-
合计	39,287,634.11	26,930,126.87

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 2024 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(2023 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	37,064,026.60	52.09
	其中:股票	37,064,026.60	52.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,223,607.51	3.13
	其中:债券	2,223,607.51	3.13
	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	19,609,028.57	27.56
8	其他各项资产	12,252,207.92	17.22
9	合计	71,148,870.60	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	458,383.00	0.88
B	采矿业	2,022,022.00	3.86
C	制造业	23,306,439.60	44.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,476,187.00	4.73
E	建筑业	446,142.00	0.85
F	批发和零售业	86,212.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	1,056,303.00	2.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,471,665.00	2.81
J	金融业	3,444,324.00	6.58
K	房地产业	667,148.00	1.28
L	租赁和商务服务业	523,206.00	1.00
M	科学研究和技术服务业	65,408.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	244,902.00	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	70,660.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	451,873.00	0.86
S	综合	273,152.00	0.52
	合计	37,064,026.60	70.84

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002128	电投能源	25,800	544,380.00	1.04
2	601198	东兴证券	66,800	531,728.00	1.02
3	601717	郑煤机	35,300	522,440.00	1.00
4	600299	安迪苏	53,600	519,920.00	0.99
5	600177	雅戈尔	71,600	509,792.00	0.97
6	600901	江苏金租	96,600	487,830.00	0.93
7	300383	光环新网	56,600	478,270.00	0.91
8	002138	顺络电子	17,300	475,058.00	0.91
9	600282	南钢股份	94,500	470,610.00	0.90
10	002078	太阳纸业	33,100	461,745.00	0.88
11	600598	北大荒	36,700	458,383.00	0.88
12	000021	深科技	30,200	456,624.00	0.87
13	600008	首创环保	164,100	439,788.00	0.84
14	601577	长沙银行	53,400	436,812.00	0.83
15	600755	厦门国贸	59,400	425,898.00	0.81
16	000513	丽珠集团	11,400	424,194.00	0.81
17	600380	健康元	37,700	421,109.00	0.80
18	002625	光启技术	24,200	419,870.00	0.80
19	600663	陆家嘴	46,100	406,602.00	0.78
20	002019	亿帆医药	32,600	402,936.00	0.77
21	600873	梅花生物	39,500	395,790.00	0.76
22	000630	铜陵有色	108,800	392,768.00	0.75
23	000921	海信家电	12,000	386,880.00	0.74
24	002831	裕同科技	15,100	386,409.00	0.74
25	002152	广电运通	36,500	381,790.00	0.73
26	601168	西部矿业	21,100	378,745.00	0.72
27	688348	昱能科技	6,401	377,659.00	0.72
28	600879	航天电子	47,500	369,075.00	0.71
29	300088	长信科技	78,400	368,480.00	0.70
30	002595	豪迈科技	9,600	366,432.00	0.70
31	000878	云南铜业	29,300	365,078.00	0.70
32	000027	深圳能源	49,800	363,540.00	0.69
33	002064	华峰化学	50,700	363,519.00	0.69
34	600968	海油发展	83,700	344,844.00	0.66
35	603156	养元饮品	16,000	340,320.00	0.65
36	601608	中信重工	89,100	339,471.00	0.65
37	600529	山东药玻	13,300	337,022.00	0.64
38	600458	时代新材	32,800	331,280.00	0.63
39	300373	扬杰科技	8,500	330,650.00	0.63
40	000830	鲁西化工	28,000	324,520.00	0.62
41	600521	华海药业	18,700	318,835.00	0.61

42	000636	风华高科	24,400	318,664.00	0.61
43	300031	宝通科技	22,000	316,140.00	0.60
44	000887	中鼎股份	24,800	303,552.00	0.58
45	002966	苏州银行	40,400	303,000.00	0.58
46	000883	湖北能源	49,600	298,096.00	0.57
47	000703	恒逸石化	42,000	297,780.00	0.57
48	600062	华润双鹤	15,200	297,616.00	0.57
49	600377	宁沪高速	23,600	297,360.00	0.57
50	601298	青岛港	30,800	294,448.00	0.56
51	601077	渝农商行	57,800	290,156.00	0.55
52	600820	隧道股份	44,100	287,973.00	0.55
53	601928	凤凰传媒	26,000	284,960.00	0.54
54	688533	上声电子	11,000	284,570.00	0.54
55	002532	天山铝业	34,900	283,039.00	0.54
56	600673	东阳光	38,800	273,152.00	0.52
57	300003	乐普医疗	17,700	262,668.00	0.50
58	600848	上海临港	28,600	260,546.00	0.50
59	603611	诺力股份	15,200	259,008.00	0.50
60	002185	华天科技	31,200	254,280.00	0.49
61	000598	兴蓉环境	33,300	250,416.00	0.48
62	603568	伟明环保	11,900	244,902.00	0.47
63	600582	天地科技	34,900	240,461.00	0.46
64	300296	利亚德	52,800	237,600.00	0.45
65	002507	涪陵榨菜	19,000	232,750.00	0.44
66	601990	南京证券	30,100	231,168.00	0.44
67	600096	云天化	11,900	231,098.00	0.44
68	600000	浦发银行	27,900	229,617.00	0.44
69	601997	贵阳银行	42,400	223,448.00	0.43
70	300001	特锐德	11,100	223,332.00	0.43
71	600580	卧龙电驱	17,900	217,485.00	0.42
72	601000	唐山港	45,900	215,730.00	0.41
73	600483	福能股份	18,500	215,710.00	0.41
74	601216	君正集团	58,000	214,020.00	0.41
75	001872	招商港口	10,900	209,825.00	0.40
76	600967	内蒙一机	29,100	209,520.00	0.40
77	000728	国元证券	32,900	199,374.00	0.38
78	688553	汇宇制药	15,600	193,752.00	0.37
79	600863	内蒙华电	39,400	182,816.00	0.35
80	603444	吉比特	1,000	178,010.00	0.34
81	002782	可立克	15,900	176,172.00	0.34
82	600352	浙江龙盛	20,100	172,659.00	0.33
83	002984	森麒麟	6,900	166,221.00	0.32
84	300861	美畅股份	8,400	162,540.00	0.31
85	600941	中国移动	1,500	161,250.00	0.31

86	000937	冀中能源	23,600	158,120.00	0.30
87	600038	中直股份	3,800	156,218.00	0.30
88	600497	驰宏锌锗	29,200	155,928.00	0.30
89	600315	上海家化	8,600	152,908.00	0.29
90	001203	大中矿业	15,900	152,799.00	0.29
91	600988	赤峰黄金	9,300	151,962.00	0.29
92	300136	信维通信	7,600	148,808.00	0.28
93	002563	森马服饰	25,100	145,831.00	0.28
94	300253	卫宁健康	24,700	145,730.00	0.28
95	300502	新易盛	1,300	137,215.00	0.26
96	600098	广州发展	21,400	136,960.00	0.26
97	002472	双环传动	6,200	136,524.00	0.26
98	601615	明阳智能	13,800	130,272.00	0.25
99	603317	天味食品	10,900	124,369.00	0.24
100	600237	铜峰电子	23,500	122,670.00	0.23
101	600566	济川药业	3,800	120,498.00	0.23
102	002340	格林美	18,800	119,756.00	0.23
103	300908	仲景食品	4,300	119,454.00	0.23
104	600066	宇通客车	4,600	118,680.00	0.23
105	002519	银河电子	23,200	113,912.00	0.22
106	600577	精达股份	28,300	112,351.00	0.21
107	000960	锡业股份	6,900	106,881.00	0.20
108	603299	苏盐井神	11,100	105,450.00	0.20
109	300207	欣旺达	6,900	104,673.00	0.20
110	601611	中国核建	12,700	102,743.00	0.20
111	603337	杰克股份	3,900	102,648.00	0.20
112	601016	节能风电	34,100	101,959.00	0.19
113	000563	陕国投 A	36,500	100,375.00	0.19
114	300153	科泰电源	16,700	99,365.00	0.19
115	688028	沃尔德	6,000	98,580.00	0.19
116	600900	长江电力	3,400	98,328.00	0.19
117	688779	长远锂科	21,200	98,156.00	0.19
118	300805	电声股份	15,300	97,308.00	0.19
119	688078	龙软科技	4,200	96,726.00	0.18
120	002035	华帝股份	15,500	96,565.00	0.18
121	688371	菲沃泰	9,600	96,384.00	0.18
122	600699	均胜电子	6,500	96,330.00	0.18
123	688510	航亚科技	5,100	93,891.00	0.18
124	000683	远兴能源	13,500	93,285.00	0.18
125	601058	赛轮轮胎	6,600	92,400.00	0.18
126	600021	上海电力	9,300	91,977.00	0.18
127	600141	兴发集团	4,700	89,676.00	0.17
128	603160	汇顶科技	1,300	89,375.00	0.17
129	000423	东阿阿胶	1,400	87,640.00	0.17

130	000017	深中华 A	14,600	86,870.00	0.17
131	600511	国药股份	2,800	86,212.00	0.16
132	601179	中国西电	10,600	85,224.00	0.16
133	300251	光线传媒	10,100	84,941.00	0.16
134	601098	中南传媒	6,600	81,972.00	0.16
135	601128	常熟银行	10,500	79,485.00	0.15
136	300173	福能东方	20,300	76,531.00	0.15
137	600219	南山铝业	20,000	76,200.00	0.15
138	600642	申能股份	8,600	75,938.00	0.15
139	002252	上海莱士	9,700	75,854.00	0.14
140	600362	江西铜业	3,200	75,776.00	0.14
141	002267	陕天然气	10,000	75,600.00	0.14
142	000612	焦作万方	11,600	75,400.00	0.14
143	000915	华特达因	2,500	75,400.00	0.14
144	002048	宁波华翔	5,800	75,052.00	0.14
145	002008	大族激光	3,600	74,880.00	0.14
146	002001	新和成	3,900	74,880.00	0.14
147	600480	凌云股份	7,600	74,708.00	0.14
148	002577	雷柏科技	6,000	74,220.00	0.14
149	600346	恒力石化	5,300	73,935.00	0.14
150	600348	华阳股份	7,400	73,704.00	0.14
151	002773	康弘药业	3,400	73,610.00	0.14
152	688281	华秦科技	880	73,321.60	0.14
153	000848	承德露露	9,300	73,098.00	0.14
154	002736	国信证券	8,400	72,996.00	0.14
155	601963	重庆银行	9,300	72,075.00	0.14
156	688516	奥特维	1,700	71,077.00	0.14
157	600549	厦门钨业	4,100	70,725.00	0.14
158	002543	万和电气	7,100	70,716.00	0.14
159	301239	普瑞眼科	2,000	70,660.00	0.14
160	603379	三美股份	1,800	70,452.00	0.13
161	300724	捷佳伟创	1,300	70,213.00	0.13
162	002025	航天电器	1,500	69,570.00	0.13
163	002958	青农商行	24,700	66,196.00	0.13
164	688046	药康生物	6,400	65,408.00	0.13
165	002368	太极股份	2,900	65,395.00	0.12
166	300953	震裕科技	1,200	65,040.00	0.12
167	603658	安图生物	1,400	64,498.00	0.12
168	000576	甘化科工	10,600	63,600.00	0.12
169	002155	湖南黄金	3,400	61,540.00	0.12
170	300279	和晶科技	14,600	60,882.00	0.12
171	000533	顺钠股份	18,400	60,536.00	0.12
172	301063	海锅股份	4,200	60,228.00	0.12
173	600369	西南证券	16,800	60,144.00	0.11

174	600241	时代万恒	10,800	60,048.00	0.11
175	688737	中自科技	3,700	59,940.00	0.11
176	002423	中粮资本	8,000	59,920.00	0.11
177	600956	新天绿能	7,300	59,641.00	0.11
178	688468	科美诊断	9,400	59,502.00	0.11
179	000559	万向钱潮	13,100	58,426.00	0.11
180	600126	杭钢股份	13,800	56,718.00	0.11
181	000032	深桑达 A	3,700	55,426.00	0.11
182	002043	兔宝宝	5,200	53,924.00	0.10
183	002164	宁波东力	14,000	53,760.00	0.10
184	601139	深圳燃气	8,000	53,440.00	0.10
185	300595	欧普康视	3,400	53,312.00	0.10
186	002358	森源电气	15,500	53,010.00	0.10
187	002223	鱼跃医疗	1,400	52,640.00	0.10
188	002137	实益达	10,800	51,408.00	0.10
189	688107	安路科技	2,000	50,840.00	0.10
190	688560	明冠新材	4,600	48,990.00	0.09
191	688231	隆达股份	2,900	41,354.00	0.08
192	600350	山东高速	4,400	38,940.00	0.07
193	300978	东箭科技	4,100	37,843.00	0.07
194	600486	扬农化工	600	33,870.00	0.06
195	600157	永泰能源	27,100	31,978.00	0.06
196	000156	华数传媒	4,800	30,144.00	0.06
197	000709	河钢股份	12,200	23,668.00	0.05
198	688425	铁建重工	5,500	20,240.00	0.04
199	300009	安科生物	1,500	12,810.00	0.02
200	002028	思源电气	100	6,690.00	0.01
201	600435	北方导航	700	6,034.00	0.01
202	002925	盈趣科技	400	5,068.00	0.01
203	000623	吉林敖东	300	4,020.00	0.01

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	002128	电投能源	1,366,171.00	4.73
2	600566	济川药业	1,155,416.00	4.00
3	600582	天地科技	1,116,272.00	3.86
4	600497	驰宏锌锗	1,112,783.00	3.85
5	600377	宁沪高速	1,054,500.00	3.65

6	600282	南钢股份	1,038,463.00	3.60
7	603160	汇顶科技	1,000,562.00	3.46
8	601168	西部矿业	982,209.00	3.40
9	000513	丽珠集团	970,475.00	3.36
10	600863	内蒙华电	949,620.00	3.29
11	000598	兴蓉环境	949,531.00	3.29
12	601077	渝农商行	948,286.00	3.28
13	000021	深科技	936,506.00	3.24
14	600299	安迪苏	920,182.78	3.19
15	002019	亿帆医药	917,570.32	3.18
16	002138	顺络电子	902,430.00	3.12
17	600901	江苏金租	895,225.06	3.10
18	300383	光环新网	883,216.00	3.06
19	300001	特锐德	882,730.00	3.06
20	603267	鸿远电子	880,948.00	3.05
21	600177	雅戈尔	880,563.00	3.05
22	600755	厦门国贸	876,997.00	3.04
23	600062	华润双鹤	863,430.00	2.99
24	601717	郑煤机	861,476.00	2.98
25	002223	鱼跃医疗	848,646.00	2.94
26	601608	中信重工	845,390.00	2.93
27	600157	永泰能源	842,387.00	2.92
28	600161	天坛生物	836,311.00	2.90
29	300296	利亚德	836,283.00	2.90
30	688772	珠海冠宇	828,885.73	2.87
31	300253	卫宁健康	827,305.00	2.86
32	600820	隧道股份	818,920.00	2.84
33	600380	健康元	813,215.00	2.82
34	001872	招商港口	809,075.00	2.80
35	002958	青农商行	805,894.00	2.79
36	002192	融捷股份	804,843.00	2.79
37	601298	青岛港	802,556.00	2.78
38	600598	北大荒	797,722.00	2.76
39	688348	昱能科技	795,530.27	2.75
40	000027	深圳能源	791,111.20	2.74
41	002152	广电运通	790,440.00	2.74
42	603444	吉比特	769,774.00	2.67
43	601577	长沙银行	768,354.00	2.66
44	600873	梅花生物	761,762.00	2.64
45	600008	首创环保	753,496.00	2.61
46	300244	迪安诊断	751,848.00	2.60
47	002497	雅化集团	750,562.00	2.60
48	300088	长信科技	745,342.00	2.58
49	000630	铜陵有色	739,826.00	2.56

50	603228	景旺电子	739,391.00	2.56
51	601058	赛轮轮胎	736,990.00	2.55
52	600348	华阳股份	733,833.50	2.54
53	002532	天山铝业	732,177.00	2.54
54	002078	太阳纸业	723,772.00	2.51
55	601997	贵阳银行	720,623.00	2.50
56	002064	华峰化学	714,635.00	2.47
57	688105	诺唯赞	707,608.35	2.45
58	600529	山东药玻	700,127.00	2.42
59	300850	新强联	699,407.00	2.42
60	000563	陕国投 A	691,650.00	2.39
61	601958	金钼股份	689,867.00	2.39
62	000878	云南铜业	688,827.00	2.38
63	600546	山煤国际	674,917.00	2.34
64	600350	山东高速	674,849.00	2.34
65	002595	豪迈科技	663,967.00	2.30
66	000883	湖北能源	659,338.30	2.28
67	600126	杭钢股份	659,070.00	2.28
68	600637	东方明珠	639,681.00	2.21
69	000039	中集集团	636,152.00	2.20
70	000997	新大陆	634,836.00	2.20
71	600968	海油发展	629,626.00	2.18
72	002195	岩山科技	609,599.00	2.11
73	601666	平煤股份	603,725.00	2.09
74	300136	信维通信	600,075.00	2.08
75	000830	鲁西化工	597,016.00	2.07
76	600985	淮北矿业	593,145.00	2.05
77	603156	养元饮品	589,708.00	2.04
78	000960	锡业股份	588,601.00	2.04
79	002273	水晶光电	588,443.00	2.04
80	000975	银泰黄金	584,873.00	2.03
81	601000	唐山港	579,122.00	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	600566	济川药业	1,113,672.00	3.86
2	600497	驰宏锌锗	1,052,213.00	3.64
3	002128	电投能源	1,043,549.00	3.61

4	603160	汇顶科技	998,428.00	3.46
5	002223	鱼跃医疗	936,481.00	3.24
6	601077	渝农商行	914,703.00	3.17
7	600863	内蒙华电	901,568.00	3.12
8	600582	天地科技	900,066.00	3.12
9	603228	景旺电子	882,801.00	3.06
10	688772	珠海冠宇	876,151.22	3.03
11	600377	宁沪高速	849,897.00	2.94
12	600161	天坛生物	843,599.00	2.92
13	000598	兴蓉环境	830,031.00	2.87
14	300244	迪安诊断	829,623.00	2.87
15	002192	融捷股份	828,494.00	2.87
16	300001	特锐德	823,972.00	2.85
17	603267	鸿远电子	820,493.00	2.84
18	600737	中粮糖业	807,416.00	2.80
19	601958	金钼股份	803,728.00	2.78
20	600637	东方明珠	794,095.00	2.75
21	000997	新大陆	793,447.00	2.75
22	600157	永泰能源	775,261.00	2.68
23	300253	卫宁健康	760,417.00	2.63
24	002497	雅化集团	758,934.00	2.63
25	001872	招商港口	754,728.00	2.61
26	601168	西部矿业	743,275.00	2.57
27	002195	岩山科技	738,043.00	2.56
28	002958	青农商行	735,128.00	2.55
29	601298	青岛港	734,221.00	2.54
30	000960	锡业股份	729,306.00	2.53
31	601058	赛轮轮胎	725,244.00	2.51
32	300296	利亚德	722,070.00	2.50
33	600126	杭钢股份	714,001.00	2.47
34	600282	南钢股份	705,125.00	2.44
35	688002	睿创微纳	702,295.35	2.43
36	601666	平煤股份	699,645.00	2.42
37	601233	桐昆股份	695,420.00	2.41
38	002273	水晶光电	694,177.00	2.40
39	600546	山煤国际	693,238.00	2.40
40	000563	陕国投 A	682,623.00	2.36
41	300850	新强联	682,599.00	2.36
42	600398	海澜之家	682,441.00	2.36
43	600348	华阳股份	669,876.00	2.32
44	600350	山东高速	668,989.00	2.32
45	601608	中信重工	667,509.00	2.31
46	000513	丽珠集团	662,506.00	2.29
47	601139	深圳燃气	662,502.00	2.29

48	600066	宇通客车	660,464.00	2.29
49	300136	信维通信	658,845.00	2.28
50	000039	中集集团	656,477.00	2.27
51	688105	诺唯赞	652,014.52	2.26
52	600959	江苏有线	650,642.00	2.25
53	002019	亿帆医药	644,093.00	2.23
54	601128	常熟银行	634,115.00	2.20
55	600859	王府井	632,278.00	2.19
56	300558	贝达药业	627,413.00	2.17
57	600642	申能股份	623,979.00	2.16
58	600109	国金证券	612,739.00	2.12
59	603866	桃李面包	611,480.00	2.12
60	000975	银泰黄金	608,419.00	2.11
61	601187	厦门银行	606,861.00	2.10
62	600985	淮北矿业	598,054.00	2.07
63	000967	盈峰环境	598,028.00	2.07
64	002138	顺络电子	592,537.00	2.05
65	600901	江苏金租	585,483.00	2.03

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	194,101,467.27
卖出股票的收入（成交）总额	181,625,163.74

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	2,223,607.51	4.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,223,607.51	4.25

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	019733	24 国债 02	22,000	2,223,607.51	4.25

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	245,900.38
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,006,307.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,252,207.92

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	2,486	5,056.06	50,436.47	0.40%	12,518,935.79	99.60%
海富通中证 500 增强 C	495	45,715.09	20,861,297.22	92.19%	1,767,670.78	7.81%
合计	2,981	11,807.56	20,911,733.69	59.41%	14,286,606.57	40.59%

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	115,483.97	0.9188%
	海富通中证 500 增强 C	2,803.18	0.0124%
	合计	118,287.15	0.3361%

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	海富通中证 500 增强 A	0
	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	13,221,016.32	4,282,805.98
本报告期基金总申购份额	2,278,505.59	38,298,229.32
减：本报告期基金总赎回份额	2,930,149.65	19,952,067.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	12,569,372.26	22,628,968.00

注：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

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	
国泰君安	1	124,484,360.99	33.13%	86,827.40	32.49%	-

招商证券	1	112,979,237.44	30.07%	83,141.51	31.11%	-
国投证券	2	62,242,791.73	16.57%	46,427.19	17.37%	-
海通证券	2	52,844,785.40	14.06%	38,888.76	14.55%	-
中金公司	1	13,627,804.25	3.63%	10,165.40	3.80%	-
华泰证券	1	9,547,651.20	2.54%	1,774.54	0.66%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

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、研究水平和综合服务支持三个部分进行评议，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，经投资部部门内部讨论，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会审议。

<2> 核准。在完成对证券公司的评估和审核后，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
国泰君安	6,212,944.00	100.00%	15,000,000.00	100.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

财信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

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	2024-04-18

§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

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	2024/3/28-2024/4/1,2024/6/27-2024/6/30	-	25,963,532.36	13,215,276.86	12,748,255.50	36.22%

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 123 只公募基金。截至 2024 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1613 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。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联《上海证券报》颁发的“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，海富通荣获中国保险资产管理业协会颁发的“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《上海证券报》颁发的“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”。2023 年 8 月，海富通荣获《上海证券报》颁发的“上证·中国基金投教创新案例奖”。

§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

二〇二四年八月三十日