

海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月三十日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 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 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	57
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	57
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	57
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	海富通沪深 300 增强	
基金主代码	004512	
交易代码	004512	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2019 年 10 月 9 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,689,470,712.16 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码	004513	004512
报告期末下属分级基金的份额总额	1,900,391,331.27 份	1,789,079,380.89 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	本基金为增强型股票指数基金，以沪深 300 指数为标的指数。本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在跟踪目标指数的基础上一定程度地调整投资组合，力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率×5%（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、债券型基金与货币市场基金。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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	许俊
	联系电话	021-38650788	010-66596688
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		40088-40099	95566

传真	021-33830166	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街1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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	谢乐斌	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）	
	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C
本期已实现收益	70,199,162.77	64,257,941.12
本期利润	87,475,544.24	73,813,985.17
加权平均基金份额本期利润	0.0565	0.0491
本期加权平均净值利润率	4.75%	3.97%
本期基金份额净值增长率	3.79%	3.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C
期末可供分配利润	-234,093,137.16	-151,423,329.10
期末可供分配基金份额利润	-0.1232	-0.0846

期末基金资产净值	2,338,833,779.46	2,294,268,487.73
期末基金份额净值	1.2307	1.2824
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C
基金份额累计净值增长率	36.81%	36.10%

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

海富通沪深 300 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	3.07%	0.51%	2.37%	0.55%	0.70%	-0.04%
过去三个月	2.59%	1.11%	1.21%	1.04%	1.38%	0.07%
过去六个月	3.79%	1.00%	0.07%	0.97%	3.72%	0.03%
过去一年	20.08%	1.29%	13.12%	1.32%	6.96%	-0.03%
过去三年	1.81%	1.04%	-11.43%	1.05%	13.24%	-0.01%
自基金合同生效起至今	36.81%	1.16%	3.03%	1.14%	33.78%	0.02%

海富通沪深 300 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	3.06%	0.51%	2.37%	0.55%	0.69%	-0.04%
过去三个月	2.57%	1.11%	1.21%	1.04%	1.36%	0.07%
过去六个月	3.74%	1.00%	0.07%	0.97%	3.67%	0.03%
过去一年	19.96%	1.29%	13.12%	1.32%	6.84%	-0.03%
过去三年	1.52%	1.04%	-11.43%	1.05%	12.95%	-0.01%
自基金合同生效起至今	36.10%	1.16%	3.03%	1.14%	33.07%	0.02%

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

海富通沪深 300 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

(2019 年 10 月 9 日至 2025 年 6 月 30 日)

海富通沪深 300 增强 A



海富通沪深 300 增强 C



注：本基金转型日期为 2019 年 10 月 9 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之日起六个月。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，于 2003 年 4 月 1 日发起设立。目前，公司的股东为国泰海通证券股份有限公司、法国巴黎资产管理 BE 控股公司，注册资本为 3 亿元人民币。

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下运作的公募基金共有 98 只，分别是：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 A100 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、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、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、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、海富通量化选股混合型证券投资基金、海富通上证基准做市公司债交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、海富通远见回报混合型证券投资基金、海富通配置优选三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、海富通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、海富通致远量化选股股票型发起式证券投资基金。

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	2019-10-15	-	18 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

					<p>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)、海富通欣益混合的基金经理。2019 年 10 月至 2025 年 5 月兼任海富通量化多因子混合基金经理。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 增强基金经理。2024 年 3 月至 2025 年 6 月兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。2025 年 3 月起兼任海富通中证 A500 指数增强基金经理。</p>
林立禾	本基金的基金经理	2023-11-23	-	6 年	<p>美国密歇根大学定量金融与风险管理硕士,持有基金从业人员资格证书。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,历任量化研究员、量化投资部基金经理助理。2023 年 11 月起任海富通富利三个月持有、海富通沪深 300 增强的基金经理。2023 年 11 月至 2025 年 3 月兼任海富通欣益混合的基金经理。2024 年 10 月至 2025 年 5 月兼任海富通量化多因子混合基金经理。2025 年 1 月起兼任海富通中证 500 指数增强基金经理。2025 年 3 月起兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 A500 指数增强基金经理。2025 年 6 月起兼任海富通致远量化选股股票发起基金经理。</p>
孙恂	本基金的基金经理助理	2024-10-11	-	3 年	<p>统计学硕士,持有基金从业人员资格证书。历任 Dataline Inc.数据科</p>

					学家、Freedom Mortgage Inc.数据科学家、摩根大通银行资深数据科学家、支付宝网络技术有限公司风险策略专家。2022 年 5 月加入海富通基金管理有限公司,任量化研究员。2024 年 10 月起兼任海富通安益对冲混合、海富通沪深 300 增强基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的样本，对其进行了 95%置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国内方面，上半年经济运行稳中向好，实现了实际 GDP 增速 5.3%。节奏上，今年一季度经济

实现开门红，实际 GDP 同比增长 5.4%，二季度在关税战扰动下，经济增长仍有韧性，实际 GDP 同比增长 5.2%。结构上，在抢出口影响下上半年国内生产和出口保持强势，在消费补贴支撑下上半年社零稳健增长，但国内地产仍在寻底，固定资产投资增速走低；政策上，今年 3 月两会财政目标赤字率提高至 4.0% 左右，5 月央行降准降息，财政政策靠前发力，有力支撑经济增长。同时，国内坚持高质量发展，因地制宜发展新质生产力，把科技创新作为经济复苏与重塑竞争优势的战略方向。

海外方面，一季度美国抢进口导致 GDP 负增，降息预期不断延后。美国 OBBB 减税法案已经通过，财政赤字率温和扩张，对美国经济起到托底作用。6 月美国通胀数据显示关税推升商品通胀，美联储更倾向于等待关税扰动结束后再采取行动。

从 A 股市场运行来看，上半年上证指数涨幅为 2.76%，沪深 300 为 0.03%，中证 800 为 0.87%，创业板指为 0.53%。行业板块方面，根据申万一级行业分类，表现靠前的板块是有色金属、银行、国防军工、传媒、通信，而煤炭、食品饮料、房地产、石油石化、建筑装饰等板块则表现靠后。从行情节奏看，年初市场在 DeepSeek 催化下持续上涨，但 4 月初在特朗普对等关税冲击下市场迎来调整；后续，随着中央汇金等公告增持中国股票资产，积极入市呵护市场流动性，特朗普新政引发全球恐慌加速去美元化，5 月 7 日央行宣布降准降息，5 月 12 日中美宣布日内瓦联合声明，国内市场风险偏好明显回暖，市场结构性机会不断。

回顾本报告期的投资操作，行业上，一季度因为尝试捕捉“春季躁动”和 AI 主题机会带来的 BETA 收益，所以多数时间在科技为主的成长行业上超配，而二季度则更多在科技和周期进行轮动；风格上，一二季度差距不大，总体相比去年同期，因为策略更加多样，持仓相对更分散，各项风险因子的平均暴露更小，模型也更专注于个股 alpha 上的捕捉，个股 alpha 贡献占比的提升有助于提升超额收益稳定性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通沪深 300 增强 A 净值增长率为 3.79%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%。海富通沪深 300 增强 C 净值增长率为 3.74%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从国内经济来看，今年上半年 GDP 增速略超预期，全年 GDP 增速实现 5% 的难度不大。海外经济方面，特朗普发动的关税战抑制全球需求，降低了全球经济增长预期。目前市场比较关注美联储的降息节奏，一旦美联储启动降息，将对全球金融市场、各类资产产生显著影响，外部金融环境有望改善。但是，由于特朗普发动的关税战持续扰动通胀，美联储降息路径有不确定性。

从资本市场看，今年两会再提了“稳住楼市股市”，7 月中共中央政治局会议强调“增强国内资本

市场的吸引力和包容性,巩固资本市场回稳向好势头”,在监管层的积极呵护下,市场信心得到提振,资本市场有望实现震荡向上。从投资机会看,市场主线或更丰富,呈现多点开花的局面。

投资策略上,我们拥抱以机器学习和深度学习算法构建的 AI 策略,策略以超额稳定和客户持有体验为首要目标。展望未来,本基金将延续“以稳为主”的理念,在以基准指数成份内选股为主要 alpha 来源的基础上,力求提供具有较高胜率、超额回撤幅度较低和回撤修复周期较短的指数增强产品。

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

- 一、本基金本报告期内无应分配的收益。
- 二、已实施的利润分配:无。
- 三、不存在应分配但尚未实施的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、

基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	24,891,415.85	91,497,053.72
结算备付金		56,891,327.31	23,986,108.60
存出保证金		18,991,331.02	15,137,909.90
交易性金融资产	6.4.7.2	4,465,468,222.47	2,454,360,088.74
其中：股票投资		4,242,437,634.26	2,325,317,696.07
基金投资		-	-
债券投资		223,030,588.21	129,042,392.67
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	95,500,000.00	35,999,055.14
应收清算款		65,668,861.74	18,125,635.63

应收股利		-	-
应收申购款		15,381,940.32	93,601,469.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		4,742,793,098.71	2,732,707,321.35
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		-	-2,046.17
应付清算款		7,178,583.77	69,346,038.49
应付赎回款		96,893,721.61	74,748,966.34
应付管理人报酬		2,992,266.41	1,518,947.39
应付托管费		673,259.95	341,763.17
应付销售服务费		187,990.03	127,990.93
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,311.24	904.85
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,757,698.51	1,161,545.17
负债合计		109,690,831.52	147,244,110.17
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	3,689,470,712.16	2,122,697,834.03
未分配利润	6.4.7.8	943,631,555.03	462,765,377.15
净资产合计		4,633,102,267.19	2,585,463,211.18
负债和净资产总计		4,742,793,098.71	2,732,707,321.35

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.2307 元，C 类基金份额净值 1.2824 元。

基金份额总额 3,689,470,712.16 份，其中 A 类基金份额 1,900,391,331.27 份，C 类基金份额 1,789,079,380.89 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		180,366,533.23	12,162,889.39
1.利息收入		932,761.07	66,872.73

其中：存款利息收入	6.4.7.9	395,549.06	39,575.47
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		537,212.01	27,297.26
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		151,384,940.42	291,098.70
其中：股票投资收益	6.4.7.10	97,449,115.99	-3,442,938.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,051,555.60	116,990.69
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	-378,669.13	-625,411.25
股利收益	6.4.7.14	53,262,937.96	4,242,458.10
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	26,832,425.52	11,793,158.52
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	1,216,406.22	11,759.44
减：二、营业总支出		19,077,003.82	1,546,521.24
1. 管理人报酬		14,569,139.74	1,041,464.93
2. 托管费		3,278,056.42	234,329.57
3. 销售服务费		917,455.65	58,668.24
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		83,117.81	7,195.19
其中：卖出回购金融资产支出		83,117.81	7,195.19
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		1,933.97	98.23
8. 其他费用	6.4.7.17	227,300.23	204,765.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		161,289,529.41	10,616,368.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		161,289,529.41	10,616,368.15
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		161,289,529.41	10,616,368.15

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 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	2,122,697,834.03	-	462,765,377.15	2,585,463,211.18
二、本期期初净资产	2,122,697,834.03	-	462,765,377.15	2,585,463,211.18
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	1,566,772,878.13	-	480,866,177.88	2,047,639,056.01
(一)、综合收益总额	-	-	161,289,529.41	161,289,529.41
(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)	1,566,772,878.13	-	319,576,648.47	1,886,349,526.60
其中: 1.基金申购款	2,620,355,438.27	-	563,288,174.08	3,183,643,612.35
2.基金赎回款	-1,053,582,560.14	-	-243,711,525.61	-1,297,294,085.75
(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	3,689,470,712.16	-	943,631,555.03	4,633,102,267.19
项目	上年度可比期间 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	152,219,924.99	-	-2,865,031.89	149,354,893.10
二、本期期初净资产	152,219,924.99	-	-2,865,031.89	149,354,893.10
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	275,683,188.76	-	24,678,118.38	300,361,307.14
(一)、综合收益总额	-	-	10,616,368.15	10,616,368.15
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净	275,683,188.76	-	14,061,750.23	289,744,938.99

资产减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	323,488,896.53	-	17,070,098.09	340,558,994.62
2.基金赎回款	-47,805,707.77	-	-3,008,347.86	-50,814,055.63
(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	427,903,113.75	-	21,813,086.49	449,716,200.24

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

海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原海富通富睿混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)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[2016]第 1173 号《关于准予海富通富睿混合型证券投资基金注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通富睿混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 337,844,741.50 元，已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 489 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通富睿混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 5 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 337,986,530.53 份，其中认购资金利息折合 141,789.03 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《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《海富通富睿混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，海富通富睿混合型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于 2019 年 9 月 17 日表决通过了《关于海富通富睿混合型证券投资基金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富睿混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，《海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合

同》将自 2019 年 10 月 9 日起正式生效，原《海富通富睿混合型证券投资基金基金合同》将自同日起失效。于 2019 年 10 月 9 日起，海富通富睿混合型证券投资基金的基金份额全部转换为海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金份额。

根据《海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和《海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购/申购费用、赎回费用和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为海富通沪深 300 指数增强 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为海富通沪深 300 指数增强 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券等）、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金股票资产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%；本基金在每个交易日日终在扣除股指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% 的现金或者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、存出保证金及应收申购款等。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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率 \times 5%（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 2025 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》、《海富通沪深 300 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 2025 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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5.差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《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 号文《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 号文《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》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作, 本基金适用的主要税项列示如下:

(a)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, 以管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

(b)对证券投资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，股权的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

(d)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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	24,891,415.85
等于：本金	24,885,876.31
加：应计利息	5,539.54
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	24,891,415.85

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	4,167,529,500.56	-	4,242,437,634.26	74,908,133.70
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	1,790,405.61		
	市场	221,301,516.68	223,030,588.21	-61,334.08
	银行间	-	-	-
	市场	-	-	-
合计	221,301,516.68	1,790,405.61	223,030,588.21	-61,334.08
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,388,831,017.24	1,790,405.61	4,465,468,222.47	74,846,799.62

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 2025 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	144,589,490.91	-	-	-
——股指期货	144,589,490.91	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	144,589,490.91	-	-	-
----	----------------	---	---	---

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
IF2507	IF2507	10.00	11,723,400.00	-3,600.00
IF2509	IF2509	101.00	117,776,100.00	2,346,801.50
IF2512	IF2512	15.00	17,354,700.00	-78,492.41
合计	-	-	-	2,264,709.09
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	2,264,709.09
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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	95,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	95,500,000.00	-

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	3,464.52
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,664,973.84
其中：交易所市场	1,664,973.84
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	1,757,698.51

6.4.7.7 实收基金

海富通沪深 300 增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	766,423,715.58	766,423,715.58
本期申购	1,328,517,384.38	1,328,517,384.38
本期赎回（以“-”号填列）	-194,549,768.69	-194,549,768.69
本期末	1,900,391,331.27	1,900,391,331.27

海富通沪深 300 增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,356,274,118.45	1,356,274,118.45
本期申购	1,291,838,053.89	1,291,838,053.89
本期赎回（以“-”号填列）	-859,032,791.45	-859,032,791.45
本期末	1,789,079,380.89	1,789,079,380.89

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

海富通沪深 300 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	-125,971,401.89	268,377,381.15	142,405,979.26
本期期初	-125,971,401.89	268,377,381.15	142,405,979.26
本期利润	70,199,162.77	17,276,381.47	87,475,544.24
本期基金份额交易产生的变动数	-178,320,898.04	386,881,822.73	208,560,924.69
其中：基金申购款	-206,141,294.69	454,149,592.57	248,008,297.88
基金赎回款	27,820,396.65	-67,267,769.84	-39,447,373.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-234,093,137.16	672,535,585.35	438,442,448.19

海富通沪深 300 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	-172,156,938.84	492,516,336.73	320,359,397.89
本期期初	-172,156,938.84	492,516,336.73	320,359,397.89
本期利润	64,257,941.12	9,556,044.05	73,813,985.17
本期基金份额交易产生的变动数	-43,524,331.38	154,540,055.16	111,015,723.78
其中：基金申购款	-140,438,955.42	455,718,831.62	315,279,876.20
基金赎回款	96,914,624.04	-301,178,776.46	-204,264,152.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-151,423,329.10	656,612,435.94	505,189,106.84

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	76,403.87
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	171,637.98
其他	147,507.21
合计	395,549.06

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	7,828,734,566.90
减：卖出股票成本总额	7,723,009,660.87
减：交易费用	8,275,790.04
买卖股票差价收入	97,449,115.99

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,265,606.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-214,051.33
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	1,051,555.60

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	79,419,958.39
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	78,477,336.23
减：应计利息总额	1,156,673.49
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-214,051.33

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益（税前）	-254,897.66
减：交易费用	123,771.47
合计	-378,669.13

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	53,262,937.96
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	53,262,937.96

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	22,947,047.86
——股票投资	22,970,046.63
——债券投资	-22,998.77
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	3,885,377.66
——权证投资	-
——股指期货	3,885,377.66
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	26,832,425.52

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	1,215,380.28
基金转换费收入	1,025.94
合计	1,216,406.22

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	107,006.71

银行划款手续费	12,433.37
债券托管账户维护费	18,000.00
上清所查询服务费	600.00
合计	227,300.23

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2025 年 1 月 17 日出具《关于同意国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司并募集配套资金注册、核准国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司、海富通基金管理有限公司变更主要股东及实际控制人、富国基金管理有限公司变更主要股东、海通期货股份有限公司变更主要股东及实际控制人的批复》（证监许可〔2025〕96 号）核准，国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安证券股份有限公司（后更名为“国泰海通证券股份有限公司”）承继及承接海通证券股份有限公司的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券股份有限公司所持海富通基金管理有限公司（以下简称“海富通基金”）股权亦归属于国泰海通证券股份有限公司，即国泰海通证券股份有限公司成为海富通基金的主要股东，上海国际集团有限公司成为海富通基金实际控制人。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司（“海富通”）	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通证券”）	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，与海通证券发生关联交易业务时间区间为 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 3 月 14 日，与国泰海通证券发生关联交易业务时间区间为 2025 年 3 月 15 日至 2025 年 6 月 30 日。

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 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,569,139.74	1,041,464.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,780,749.39	177,310.11
应支付基金管理人的净管理费	12,788,390.35	864,154.82

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 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,278,056.42	234,329.57

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.18% 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 × 0.18% / 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 2025年1月1日至2025年6月30日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C	合计
中国银行	-	2,023.80	2,023.80
海通证券	-	50.68	50.68
海富通	-	506,205.86	506,205.86
国泰海通证券	-	115.48	115.48
合计	-	508,395.82	508,395.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	海富通沪深300增强 A	海富通沪深300增强C	合计
中国银行	-	1,036.79	1,036.79
海通证券	-	120.61	120.61
海富通	-	14,575.21	14,575.21
合计	-	15,732.61	15,732.61

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 0.10%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.10% 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 0.10% / 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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

份额单位：份

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	海富通沪深300增强 A	海富通沪深300增强 C	海富通沪深300增强 A	海富通沪深300增强 C
期初持有的基金份额	4,243,401.51	-	4,243,401.51	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	4,243,401.51	-	4,243,401.51	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.22%	-	2.42%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	24,891,415.85	76,403.87	3,827,660.34	10,068.49

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

本基金于本报告期内卖出持有的基金管理人股东国泰海通证券发行的股票——国泰海通（证券代码：601211）123,700.00 股，交易金额为人民币 2,103,102.00 元。于本报告期末，本基金未持有国泰海通证券发行的股票。

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（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月	新股锁定	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001382	新亚电缆	2025-03-13	6 个月	新股锁定	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025-06-24	一个月内(含)	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	新股未上市并锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月	新股锁定	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新股锁定	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新股锁定	39.92	45.22	350	9,620.72	15,827.00	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	新股锁定	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	新股锁定	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	新股锁定	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	新股锁定	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301666	泰禾	2025-0	6 个月	新股	10.27	22.39	393	4,036.	8,799.	-

5	股份	4-02		锁定				11	27	
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新股锁定	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股锁定	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中策橡胶	2025-05-27	6 个月	新股锁定	46.50	42.85	724	33,666.00	31,023.40	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新股锁定	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新股锁定	93.50	90.66	166	15,521.00	15,049.56	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	新股锁定	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	新股锁定	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	新股锁定	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月	新股锁定	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	新股锁定	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新股锁定	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-

注：[301501]恒鑫生活于 2025 年 3 月 11 日中签新股锁定流通受限数量 241 股，成本 9,620.72 元；于 2025 年 6 月 6 日送股，数量 109 股。因此总数量 350 股，总成本 9,620.72 元。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强型基金，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包括股票投资、债券投资及股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对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“相对收益高、风险适中”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 2025 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（2024 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	212,028,392.10	115,128,574.17
合计	212,028,392.10	115,128,574.17

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、无第三方评级机构评级的债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	11,002,196.11	13,913,818.50
合计	11,002,196.11	13,913,818.50

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、无第三方评级机构评级的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均能及时变现。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进

行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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

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、买入返售金融资产及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	24,891,415.85	-	-	-	24,891,415.85
结算备付金	56,891,327.31	-	-	-	56,891,327.31
存出保证金	1,368,827.02	-	-	17,622,504.00	18,991,331.02
交易性金融资产	223,030,588.21	-	-	4,242,437,634.26	4,465,468,222.47
买入返售金融资产	95,500,000.00	-	-	-	95,500,000.00
应收清算款	-	-	-	65,668,861.74	65,668,861.74
应收申购款	7,000,000.00	-	-	8,381,940.32	15,381,940.32
资产总计	408,682,158.39	-	-	4,334,110,940.32	4,742,793,098.71
负债					
应付清算款	-	-	-	7,178,583.77	7,178,583.77
应付赎回款	-	-	-	96,893,721.61	96,893,721.61
应付管理人报酬	-	-	-	2,992,266.41	2,992,266.41
应付托管费	-	-	-	673,259.95	673,259.95
应付销售服务费	-	-	-	187,990.03	187,990.03
应交税费	-	-	-	7,311.24	7,311.24
其他负债	-	-	-	1,757,698.51	1,757,698.51
负债总计	-	-	-	109,690,831.52	109,690,831.52
利率敏感度缺口	408,682,158.39	-	-	4,224,420,108.80	4,633,102,267.19
上年度末 2024 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
货币资金	91,497,053.72	-	-	-	91,497,053.72
结算备付金	23,986,108.60	-	-	-	23,986,108.60
存出保证金	978,447.50	-	-	14,159,462.40	15,137,909.90
交易性金融资产	129,042,392.67	-	-	2,325,317,696.07	2,454,360,088.74
买入返售金融资产	35,999,055.14	-	-	-	35,999,055.14
应收清算款	-	-	-	18,125,635.63	18,125,635.63
应收申购款	60,000,198.81	-	-	33,601,270.81	93,601,469.62
资产总计	341,503,256.44	-	-	2,391,204,064.91	2,732,707,321.35
负债					
卖出回购金融资产款	-2,046.17	-	-	-	-2,046.17
应付清算款	-	-	-	69,346,038.49	69,346,038.49
应付赎回款	-	-	-	74,748,966.34	74,748,966.34
应付管理人报酬	-	-	-	1,518,947.39	1,518,947.39
应付托管费	-	-	-	341,763.17	341,763.17
应付销售服务费	-	-	-	127,990.93	127,990.93
应交税费	-	-	-	904.85	904.85
其他负债	-	-	-	1,161,545.17	1,161,545.17
负债总计	-2,046.17	-	-	147,246,156.34	147,244,110.17
利率敏感度缺口	341,505,302.61	-	-	2,243,957,908.57	2,585,463,211.18

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日

市场利率上升 25 个基点	-220,618.28	-143,258.00
市场利率下降 25 个基点	221,458.31	143,828.15

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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资产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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	4,242,437,634.26	91.57	2,325,317,696.07	89.94

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	4,242,437,63 4.26	91.57	2,325,317,696 .07	89.94

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	221,113,055.52	122,340,419.77
2.业绩比较基准下降 5%	-221,113,055.52	-122,340,419.77	

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。

三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	4,242,235,235.86	2,311,225,469.33
第二层次	223,045,973.75	143,134,619.41
第三层次	187,012.86	-
合计	4,465,468,222.47	2,454,360,088.74

6.4.14.2 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等，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，本基金分别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不会将相关股票和债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2024 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括买入返售金融资产、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	4,242,437,634.26	89.45
	其中：股票	4,242,437,634.26	89.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	223,030,588.21	4.70
	其中：债券	223,030,588.21	4.70
	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	95,500,000.00	2.01
	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	81,782,743.16	1.72
8	其他各项资产	100,042,133.08	2.11
9	合计	4,742,793,098.71	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	83,268,376.00	1.80
B	采矿业	199,403,752.24	4.30
C	制造业	2,102,263,224.51	45.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	156,189,984.70	3.37
E	建筑业	96,794,828.28	2.09
F	批发和零售业	24,732,283.00	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	90,045,805.72	1.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	246,277,567.68	5.32
J	金融业	1,033,673,940.17	22.31
K	房地产业	4,347,053.59	0.09
L	租赁和商务服务业	29,409,548.40	0.63
M	科学研究和技术服务业	112,280,729.53	2.42
N	水利、环境和公共设施管理业	80,088.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	63,360,421.44	1.37
R	文化、体育和娱乐业	145,139.00	0.00
S	综合	164,892.00	0.00
	合计	4,242,437,634.26	91.57

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	300750	宁德时代	703,094	177,334,368.68	3.83
2	600519	贵州茅台	82,425	116,179,686.00	2.51
3	000333	美的集团	1,306,961	94,362,584.20	2.04
4	600900	长江电力	3,052,198	91,993,247.72	1.99
5	601318	中国平安	1,634,265	90,669,022.20	1.96
6	601288	农业银行	14,204,262	83,521,060.56	1.80
7	603259	药明康德	1,149,959	79,979,648.45	1.73
8	000858	五粮液	634,766	75,473,677.40	1.63
9	601398	工商银行	9,927,550	75,350,104.50	1.63
10	601668	中国建筑	12,884,794	74,345,261.38	1.60
11	000725	京东方 A	18,513,466	73,868,729.34	1.59
12	601857	中国石油	8,462,844	72,357,316.20	1.56
13	600016	民生银行	14,451,500	68,644,625.00	1.48
14	601688	华泰证券	3,775,349	67,238,965.69	1.45
15	300274	阳光电源	988,232	66,972,482.64	1.45
16	000063	中兴通讯	1,994,771	64,810,109.79	1.40
17	600887	伊利股份	2,286,300	63,742,044.00	1.38
18	300015	爱尔眼科	5,070,553	63,280,501.44	1.37
19	600036	招商银行	1,377,030	63,274,528.50	1.37
20	601600	中国铝业	8,834,062	62,191,796.48	1.34
21	600050	中国联通	11,611,169	62,003,642.46	1.34
22	300498	温氏股份	3,503,100	59,832,948.00	1.29
23	601766	中国中车	8,244,275	58,039,696.00	1.25
24	601658	邮储银行	10,434,437	57,076,370.39	1.23
25	600030	中信证券	2,032,438	56,135,937.56	1.21
26	000100	TCL 科技	12,449,420	53,905,988.60	1.16
27	603993	洛阳钼业	6,033,057	50,798,339.94	1.10
28	600690	海尔智家	1,990,700	49,329,546.00	1.06
29	601360	三六零	4,779,131	48,747,136.20	1.05
30	601995	中金公司	1,311,000	46,356,960.00	1.00
31	002475	立讯精密	1,275,000	44,229,750.00	0.95
32	002415	海康威视	1,553,492	43,078,333.16	0.93
33	002241	歌尔股份	1,767,008	41,206,626.56	0.89
34	600372	中航机载	3,408,045	41,101,022.70	0.89
35	002236	大华股份	2,462,220	39,100,053.60	0.84
36	002001	新和成	1,818,934	38,688,726.18	0.84
37	000166	申万宏源	7,428,859	37,292,872.18	0.80
38	000938	紫光股份	1,508,180	36,181,238.20	0.78

39	601169	北京银行	5,262,500	35,942,875.00	0.78
40	000001	平安银行	2,953,739	35,651,629.73	0.77
41	600989	宝丰能源	2,179,300	35,173,902.00	0.76
42	601009	南京银行	2,945,600	34,227,872.00	0.74
43	000792	盐湖股份	1,993,714	34,052,635.12	0.73
44	601899	紫金矿业	1,684,696	32,851,572.00	0.71
45	601818	光大银行	7,806,800	32,398,220.00	0.70
46	600219	南山铝业	8,141,316	31,181,240.28	0.67
47	603799	华友钴业	820,100	30,360,102.00	0.66
48	300433	蓝思科技	1,319,799	29,431,517.70	0.64
49	300759	康龙化成	1,089,223	26,729,532.42	0.58
50	002352	顺丰控股	525,609	25,628,694.84	0.55
51	000776	广发证券	1,443,920	24,272,295.20	0.52
52	600104	上汽集团	1,509,700	24,230,685.00	0.52
53	600699	均胜电子	1,353,200	23,599,808.00	0.51
54	002714	牧原股份	556,000	23,357,560.00	0.50
55	002179	中航光电	577,900	23,324,044.00	0.50
56	002625	光启技术	566,405	22,644,871.90	0.49
57	601728	中国电信	2,871,006	22,250,296.50	0.48
58	600958	东方证券	2,206,472	21,358,648.96	0.46
59	002230	科大讯飞	439,780	21,056,666.40	0.45
60	600015	华夏银行	2,653,270	20,987,365.70	0.45
61	300413	芒果超媒	953,778	20,811,435.96	0.45
62	600703	三安光电	1,657,053	20,580,598.26	0.44
63	300124	汇川技术	309,100	19,958,587.00	0.43
64	601919	中远海控	1,217,107	18,305,289.28	0.40
65	002027	分众传媒	2,449,650	17,882,445.00	0.39
66	600406	国电南瑞	761,464	17,064,408.24	0.37
67	601166	兴业银行	715,325	16,695,685.50	0.36
68	000895	双汇发展	679,825	16,594,528.25	0.36
69	603806	福斯特	1,251,100	16,214,256.00	0.35
70	600028	中国石化	2,769,115	15,617,808.60	0.34
71	000651	格力电器	340,221	15,282,727.32	0.33
72	000538	云南白药	269,469	15,033,675.51	0.32
73	000338	潍柴动力	960,635	14,774,566.30	0.32
74	002594	比亚迪	44,426	14,745,433.66	0.32
75	600893	航发动力	373,104	14,379,428.16	0.31
76	600905	三峡能源	3,282,800	13,984,728.00	0.30
77	002493	荣盛石化	1,650,930	13,669,700.40	0.30
78	300628	亿联网络	384,198	13,354,722.48	0.29
79	601138	工业富联	622,989	13,319,504.82	0.29
80	002600	领益智造	1,492,900	12,824,011.00	0.28
81	002939	长城证券	1,517,600	12,717,488.00	0.27
82	600941	中国移动	112,148	12,622,257.40	0.27

83	688169	石头科技	78,126	12,230,625.30	0.26
84	300699	光威复材	377,900	11,968,093.00	0.26
85	600115	中国东航	2,960,500	11,930,815.00	0.26
86	600886	国投电力	802,100	11,822,954.00	0.26
87	600109	国金证券	1,321,847	11,592,598.19	0.25
88	600999	招商证券	624,200	10,979,678.00	0.24
89	603659	璞泰来	545,606	10,246,480.68	0.22
90	601111	中国国航	1,287,600	10,159,164.00	0.22
91	002142	宁波银行	370,653	10,141,066.08	0.22
92	603501	豪威集团	78,768	10,054,735.20	0.22
93	000977	浪潮信息	196,700	10,008,096.00	0.22
94	002839	张家港行	2,216,900	9,976,050.00	0.22
95	000630	铜陵有色	2,965,600	9,905,104.00	0.21
96	601788	光大证券	525,600	9,450,288.00	0.20
97	600188	兖矿能源	760,400	9,254,068.00	0.20
98	600760	中航沈飞	157,200	9,215,064.00	0.20
99	600011	华能国际	1,277,559	9,121,771.26	0.20
100	601985	中国核电	954,400	8,895,008.00	0.19
101	002007	华兰生物	532,500	8,344,275.00	0.18
102	600031	三一重工	461,649	8,286,599.55	0.18
103	000625	长安汽车	645,560	8,237,345.60	0.18
104	000800	一汽解放	1,200,059	8,232,404.74	0.18
105	601868	中国能建	3,685,534	8,218,740.82	0.18
106	600000	浦发银行	579,900	8,049,012.00	0.17
107	601669	中国电建	1,590,400	7,745,248.00	0.17
108	688363	华熙生物	149,200	7,661,420.00	0.17
109	601328	交通银行	921,422	7,371,376.00	0.16
110	601128	常熟银行	995,360	7,335,803.20	0.16
111	600919	江苏银行	604,650	7,219,521.00	0.16
112	600704	物产中大	1,367,500	7,206,725.00	0.16
113	600674	川投能源	437,700	7,020,708.00	0.15
114	603195	公牛集团	144,946	6,993,644.50	0.15
115	600588	用友网络	521,300	6,969,781.00	0.15
116	601377	兴业证券	1,114,350	6,897,826.50	0.15
117	601901	方正证券	870,700	6,887,237.00	0.15
118	600196	复星医药	272,000	6,824,480.00	0.15
119	000568	泸州老窖	58,600	6,645,240.00	0.14
120	300896	爱美客	37,936	6,631,592.16	0.14
121	605117	德业股份	124,200	6,540,372.00	0.14
122	600745	闻泰科技	186,700	6,260,051.00	0.14
123	601319	中国人保	708,000	6,166,680.00	0.13
124	601336	新华保险	103,100	6,031,350.00	0.13
125	300782	卓胜微	83,918	5,989,227.66	0.13
126	000963	华东医药	146,400	5,908,704.00	0.13

127	300661	圣邦股份	80,800	5,879,816.00	0.13
128	002709	天赐材料	324,400	5,878,128.00	0.13
129	601939	建设银行	619,800	5,850,912.00	0.13
130	601998	中信银行	686,000	5,831,000.00	0.13
131	601989	中国重工	1,251,618	5,807,507.52	0.13
132	002056	横店东磁	404,884	5,729,108.60	0.12
133	601168	西部矿业	343,500	5,712,405.00	0.12
134	603989	艾华集团	366,600	5,645,640.00	0.12
135	300996	普联软件	373,080	5,607,392.40	0.12
136	601877	正泰电器	241,611	5,477,321.37	0.12
137	603833	欧派家居	96,900	5,470,005.00	0.12
138	002624	完美世界	351,600	5,333,772.00	0.12
139	600926	杭州银行	313,800	5,278,116.00	0.11
140	601808	中海油服	383,000	5,270,080.00	0.11
141	600362	江西铜业	224,800	5,267,064.00	0.11
142	603369	今世缘	133,800	5,208,834.00	0.11
143	002803	吉宏股份	362,900	5,174,954.00	0.11
144	600873	梅花生物	476,826	5,097,269.94	0.11
145	601838	成都银行	250,800	5,041,080.00	0.11
146	301486	致尚科技	71,100	4,910,877.00	0.11
147	603338	浙江鼎力	101,900	4,830,060.00	0.10
148	601555	东吴证券	550,800	4,819,500.00	0.10
149	003816	中国广核	1,322,000	4,812,080.00	0.10
150	002466	天齐锂业	150,000	4,806,000.00	0.10
151	601888	中国中免	78,500	4,786,145.00	0.10
152	600335	国机汽车	732,800	4,726,560.00	0.10
153	300017	网宿科技	439,000	4,706,080.00	0.10
154	300059	东方财富	197,497	4,568,105.61	0.10
155	001289	龙源电力	279,500	4,522,310.00	0.10
156	300979	华利集团	78,400	4,121,488.00	0.09
157	601916	浙商银行	1,197,900	4,060,881.00	0.09
158	601066	中信建投	165,700	3,985,085.00	0.09
159	600584	长电科技	113,800	3,833,922.00	0.08
160	600276	恒瑞医药	73,045	3,791,035.50	0.08
161	600198	大唐电信	437,600	3,737,104.00	0.08
162	600585	海螺水泥	173,900	3,733,633.00	0.08
163	600938	中国海油	139,600	3,644,956.00	0.08
164	002889	东方嘉盛	241,320	3,622,213.20	0.08
165	002682	龙洲股份	748,200	3,583,878.00	0.08
166	300418	昆仑万维	104,200	3,504,246.00	0.08
167	603816	顾家家居	136,600	3,486,032.00	0.08
168	688295	中复神鹰	167,236	3,478,508.80	0.08
169	000768	中航西飞	126,700	3,463,978.00	0.07
170	300825	阿尔特	319,500	3,453,795.00	0.07

171	688009	中国通号	667,057	3,428,672.98	0.07
172	002555	三七互娱	196,300	3,394,027.00	0.07
173	600741	华域汽车	191,000	3,371,150.00	0.07
174	001965	招商公路	275,300	3,303,600.00	0.07
175	002925	盈趣科技	183,700	3,302,926.00	0.07
176	002129	TCL 中环	426,600	3,276,288.00	0.07
177	300101	振芯科技	142,100	3,215,723.00	0.07
178	000708	中信特钢	271,600	3,194,016.00	0.07
179	600085	同仁堂	86,800	3,130,008.00	0.07
180	603730	岱美股份	537,900	3,060,651.00	0.07
181	688187	时代电气	70,700	3,015,355.00	0.07
182	603566	普莱柯	221,200	3,010,532.00	0.06
183	300735	光弘科技	119,116	2,989,811.60	0.06
184	688188	柏楚电子	22,538	2,967,353.08	0.06
185	601006	大秦铁路	444,307	2,932,426.20	0.06
186	600795	国电电力	585,516	2,833,897.44	0.06
187	001979	招商蛇口	322,300	2,826,571.00	0.06
188	600676	交运股份	595,500	2,816,715.00	0.06
189	000157	中联重科	389,000	2,812,470.00	0.06
190	300999	金龙鱼	94,872	2,801,570.16	0.06
191	301229	纽泰格	145,400	2,787,318.00	0.06
192	603218	日月股份	215,000	2,728,350.00	0.06
193	002284	亚太股份	226,900	2,507,245.00	0.05
194	000425	徐工机械	315,400	2,450,658.00	0.05
195	600009	上海机场	77,100	2,449,467.00	0.05
196	601088	中国神华	59,775	2,423,278.50	0.05
197	605111	新洁能	77,300	2,376,202.00	0.05
198	600597	光明乳业	282,400	2,374,984.00	0.05
199	002938	鹏鼎控股	72,175	2,311,765.25	0.05
200	601018	宁波港	622,000	2,276,520.00	0.05
201	300232	洲明科技	309,598	2,241,489.52	0.05
202	605305	中际联合	79,000	2,194,620.00	0.05
203	600826	兰生股份	266,600	2,186,120.00	0.05
204	002841	视源股份	62,000	2,145,200.00	0.05
205	601618	中国中冶	719,500	2,144,110.00	0.05
206	600332	白云山	80,400	2,119,344.00	0.05
207	600352	浙江龙盛	204,500	2,077,720.00	0.04
208	600061	国投资本	274,300	2,062,736.00	0.04
209	000869	张裕 A	96,466	2,047,973.18	0.04
210	002728	特一药业	237,800	1,999,898.00	0.04
211	002463	沪电股份	46,210	1,967,621.80	0.04
212	300010	豆神教育	236,100	1,957,269.00	0.04
213	002507	涪陵榨菜	149,300	1,909,547.00	0.04
214	002761	浙江建投	210,700	1,868,909.00	0.04

215	002572	索菲亚	132,200	1,852,122.00	0.04
216	001308	康冠科技	80,100	1,811,862.00	0.04
217	601238	广汽集团	241,900	1,811,831.00	0.04
218	601698	中国卫通	86,400	1,768,608.00	0.04
219	002695	煌上煌	184,400	1,733,360.00	0.04
220	300978	东箭科技	153,400	1,711,944.00	0.04
221	600305	恒顺醋业	218,690	1,690,473.70	0.04
222	601816	京沪高铁	290,300	1,669,225.00	0.04
223	688711	宏微科技	94,700	1,665,773.00	0.04
224	000999	华润三九	52,290	1,635,631.20	0.04
225	001219	青岛食品	117,700	1,603,074.00	0.03
226	000553	安道麦 A	215,300	1,554,466.00	0.03
227	600183	生益科技	49,800	1,501,470.00	0.03
228	300686	智动力	150,070	1,499,199.30	0.03
229	603027	千禾味业	124,700	1,447,767.00	0.03
230	601886	江河集团	230,800	1,419,420.00	0.03
231	300416	苏试试验	98,500	1,411,505.00	0.03
232	688223	晶科能源	268,200	1,391,958.00	0.03
233	300408	三环集团	41,300	1,379,420.00	0.03
234	603949	雪龙集团	70,700	1,336,230.00	0.03
235	688586	江航装备	118,000	1,327,500.00	0.03
236	601456	国联民生	124,600	1,289,610.00	0.03
237	688007	光峰科技	89,000	1,286,940.00	0.03
238	603191	望变电气	101,800	1,284,716.00	0.03
239	603687	大胜达	168,800	1,254,184.00	0.03
240	600918	中泰证券	191,700	1,232,631.00	0.03
241	600897	厦门空港	84,200	1,228,478.00	0.03
242	300994	久祺股份	74,000	1,157,360.00	0.02
243	003022	联泓新科	73,000	1,155,590.00	0.02
244	600601	方正科技	215,600	1,151,304.00	0.02
245	600029	南方航空	194,407	1,147,001.30	0.02
246	601083	锦江航运	98,100	1,089,891.00	0.02
247	688256	寒武纪	1,800	1,082,700.00	0.02
248	300296	利亚德	177,000	1,079,700.00	0.02
249	002419	天虹股份	198,000	1,061,280.00	0.02
250	002202	金风科技	102,300	1,048,575.00	0.02
251	000726	鲁泰 A	160,500	1,017,570.00	0.02
252	002587	奥拓电子	155,400	1,002,330.00	0.02
253	000677	恒天海龙	175,800	993,270.00	0.02
254	002283	天润工业	165,900	988,764.00	0.02
255	600073	光明肉业	132,800	980,064.00	0.02
256	688981	中芯国际	10,508	926,490.36	0.02
257	603917	合力科技	67,800	918,012.00	0.02
258	001379	腾达科技	43,700	905,464.00	0.02

259	603006	黎明股份	74,200	903,756.00	0.02
260	600429	三元股份	197,000	888,470.00	0.02
261	002810	山东赫达	73,200	874,740.00	0.02
262	605299	舒华体育	97,600	867,664.00	0.02
263	600616	金枫酒业	152,300	862,018.00	0.02
264	600189	泉阳泉	117,400	849,976.00	0.02
265	002405	四维图新	98,000	836,920.00	0.02
266	002030	达安基因	135,000	816,750.00	0.02
267	301039	中集车辆	100,400	816,252.00	0.02
268	603529	爱玛科技	23,700	815,280.00	0.02
269	601800	中国交建	90,900	808,101.00	0.02
270	001380	华纬科技	39,100	800,768.00	0.02
271	603329	上海雅仕	70,400	792,000.00	0.02
272	002016	世荣兆业	143,400	785,832.00	0.02
273	600408	安泰集团	378,200	779,092.00	0.02
274	600748	上实发展	237,751	734,650.59	0.02
275	002885	京泉华	49,300	697,595.00	0.02
276	601236	红塔证券	78,900	668,283.00	0.01
277	300481	濮阳惠成	45,800	655,398.00	0.01
278	603010	万盛股份	64,100	637,154.00	0.01
279	300928	华安鑫创	19,000	635,550.00	0.01
280	603170	宝立食品	50,300	627,241.00	0.01
281	603128	华贸物流	99,700	618,140.00	0.01
282	603288	海天味业	15,300	595,323.00	0.01
283	688625	呈和科技	18,297	559,522.26	0.01
284	601225	陕西煤业	28,700	552,188.00	0.01
285	300014	亿纬锂能	12,000	549,720.00	0.01
286	002480	新筑股份	88,600	545,776.00	0.01
287	002736	国信证券	46,146	531,601.92	0.01
288	605186	健麾信息	24,600	515,124.00	0.01
289	603916	苏博特	56,700	513,702.00	0.01
290	001208	华菱线缆	47,200	502,680.00	0.01
291	688475	萤石网络	15,800	498,016.00	0.01
292	002953	日丰股份	46,300	480,594.00	0.01
293	600479	千金药业	46,000	478,400.00	0.01
294	600346	恒力石化	33,400	476,284.00	0.01
295	000987	越秀资本	69,100	474,026.00	0.01
296	600348	华阳股份	69,500	462,870.00	0.01
297	301072	中捷精工	21,500	461,605.00	0.01
298	600075	新疆天业	106,400	450,072.00	0.01
299	300833	浩洋股份	13,300	444,619.00	0.01
300	603019	中科曙光	6,200	436,480.00	0.01
301	603889	新澳股份	72,169	418,580.20	0.01
302	002508	老板电器	21,500	408,715.00	0.01

303	003016	欣贺股份	53,500	401,250.00	0.01
304	000531	穗恒运 A	64,800	398,520.00	0.01
305	300032	金龙机电	74,900	393,974.00	0.01
306	688092	爱科科技	17,400	388,020.00	0.01
307	002996	顺博合金	52,300	384,928.00	0.01
308	600740	山西焦化	103,300	383,243.00	0.01
309	600758	辽宁能源	102,400	382,976.00	0.01
310	601298	青岛港	41,200	358,028.00	0.01
311	000953	河化股份	49,800	344,616.00	0.01
312	600233	圆通速递	25,500	328,695.00	0.01
313	300088	长信科技	53,300	317,668.00	0.01
314	002511	中顺洁柔	45,700	307,104.00	0.01
315	002479	富春环保	58,300	292,083.00	0.01
316	300893	松原安全	11,600	284,432.00	0.01
317	300305	裕兴股份	43,100	274,978.00	0.01
318	600056	中国医药	25,900	267,806.00	0.01
319	002935	天奥电子	16,603	265,648.00	0.01
320	300821	东岳硅材	33,200	260,952.00	0.01
321	600062	华润双鹤	13,800	257,508.00	0.01
322	002911	佛燃能源	24,800	254,448.00	0.01
323	600167	联美控股	42,300	237,726.00	0.01
324	300160	秀强股份	41,450	232,949.00	0.01
325	600998	九州通	44,000	226,160.00	0.00
326	300658	延江股份	31,000	200,570.00	0.00
327	603679	华体科技	13,800	196,236.00	0.00
328	603309	维力医疗	15,200	193,344.00	0.00
329	300449	汉邦高科	21,900	179,580.00	0.00
330	300811	铂科新材	3,600	167,076.00	0.00
331	301046	能辉科技	8,400	166,740.00	0.00
332	600620	天宸股份	30,200	164,892.00	0.00
333	002367	康力电梯	22,800	160,284.00	0.00
334	600018	上港集团	25,110	143,378.10	0.00
335	002686	亿利达	20,900	136,059.00	0.00
336	600875	东方电气	7,700	128,898.00	0.00
337	300595	欧普康视	8,100	123,687.00	0.00
338	300902	国安达	5,400	101,628.00	0.00
339	603025	大豪科技	6,500	91,130.00	0.00
340	688002	睿创微纳	1,200	83,664.00	0.00
341	600166	福田汽车	30,100	81,571.00	0.00
342	688697	纽威数控	6,100	81,374.00	0.00
343	301363	美好医疗	4,600	81,144.00	0.00
344	600522	中天科技	5,600	80,976.00	0.00
345	688121	卓然股份	6,700	80,936.00	0.00
346	603588	高能环境	14,200	80,088.00	0.00

347	600312	平高电气	5,200	80,028.00	0.00
348	601608	中信重工	18,300	79,971.00	0.00
349	301103	何氏眼科	3,600	79,920.00	0.00
350	003031	中瓷电子	1,500	79,815.00	0.00
351	688208	道通科技	2,600	79,560.00	0.00
351	600487	亨通光电	5,200	79,560.00	0.00
352	300642	透景生命	5,400	79,488.00	0.00
353	000034	神州数码	2,100	79,044.00	0.00
354	600733	北汽蓝谷	10,700	78,859.00	0.00
355	000501	武商集团	9,100	78,806.00	0.00
356	002396	星网锐捷	3,500	78,575.00	0.00
357	601801	皖新传媒	11,500	78,545.00	0.00
358	688261	东微半导	1,900	78,375.00	0.00
359	002081	金螳螂	22,800	78,204.00	0.00
360	603313	梦百合	9,200	78,200.00	0.00
361	601599	浙文影业	20,900	78,166.00	0.00
362	000789	万年青	14,300	78,078.00	0.00
363	600552	凯盛科技	6,900	77,970.00	0.00
364	600598	北大荒	5,400	77,868.00	0.00
365	300009	安科生物	9,300	77,841.00	0.00
366	600038	中直股份	2,000	77,620.00	0.00
367	301316	慧博云通	1,800	77,544.00	0.00
368	601231	环旭电子	5,300	77,539.00	0.00
369	002746	仙坛股份	13,300	77,406.00	0.00
370	002100	天康生物	12,500	77,375.00	0.00
371	002299	圣农发展	5,400	77,166.00	0.00
372	605369	拱东医疗	4,060	77,099.40	0.00
373	600582	天地科技	12,800	76,672.00	0.00
374	603565	中谷物流	8,000	76,400.00	0.00
375	600583	海油工程	13,900	75,894.00	0.00
376	000700	模塑科技	9,400	73,790.00	0.00
377	000513	丽珠集团	2,000	72,080.00	0.00
378	688106	金宏气体	4,000	71,560.00	0.00
379	002706	良信股份	8,000	71,280.00	0.00
380	605168	三人行	2,400	70,632.00	0.00
381	688589	力合微	3,300	70,587.00	0.00
382	605183	确成股份	4,000	70,000.00	0.00
383	603876	鼎胜新材	7,700	69,993.00	0.00
384	600498	烽火通信	3,300	69,399.00	0.00
385	600517	国网英大	13,600	69,360.00	0.00
386	300684	中石科技	2,900	69,252.00	0.00
387	688232	新点软件	2,300	69,092.00	0.00
388	002242	九阳股份	7,200	68,400.00	0.00
389	601126	四方股份	4,200	68,334.00	0.00

390	002206	海利得	13,300	67,963.00	0.00
391	688315	诺禾致源	4,800	67,776.00	0.00
392	600497	驰宏锌锗	12,800	67,712.00	0.00
393	000156	华数传媒	8,500	67,490.00	0.00
394	601216	君正集团	12,200	67,344.00	0.00
395	002532	天山铝业	8,100	67,311.00	0.00
396	603466	风语筑	6,600	66,594.00	0.00
397	300482	万孚生物	3,100	66,185.00	0.00
398	002815	崇达技术	5,800	65,714.00	0.00
399	603898	好莱客	5,700	62,643.00	0.00
400	603938	三孚股份	4,200	60,396.00	0.00
401	600299	安迪苏	6,000	57,900.00	0.00
402	688777	中控技术	1,200	53,892.00	0.00
403	002661	克明食品	4,500	45,045.00	0.00
404	002344	海宁皮城	9,900	42,966.00	0.00
405	300613	富瀚微	800	39,104.00	0.00
406	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
407	300058	蓝色光标	4,120	27,027.20	0.00
408	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
409	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
410	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
411	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
412	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
413	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
414	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
415	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
416	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
417	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
418	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
419	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
420	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
421	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
422	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
423	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
424	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
425	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
426	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
427	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
428	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
429	601689	拓普集团	29	1,370.25	0.00
430	300767	震安科技	36	469.08	0.00
431	001286	陕西能源	45	391.50	0.00
432	002687	乔治白	63	292.32	0.00
433	300539	横河精密	16	219.04	0.00

434	603628	清源股份	16	195.36	0.00
435	688568	中科星图	4	144.04	0.00
436	600333	长春燃气	23	111.78	0.00
437	000498	山东路桥	16	94.08	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	173,842,246.24	6.72
2	600900	长江电力	140,641,839.68	5.44
3	600030	中信证券	131,254,384.70	5.08
4	601360	三六零	123,696,887.00	4.78
5	300015	爱尔眼科	121,175,789.20	4.69
6	601899	紫金矿业	107,585,054.47	4.16
7	002594	比亚迪	106,363,320.97	4.11
8	601318	中国平安	104,701,652.09	4.05
9	000858	五粮液	96,192,454.99	3.72
10	600690	海尔智家	95,857,243.50	3.71
11	600519	贵州茅台	95,321,087.24	3.69
12	603259	药明康德	85,501,682.48	3.31
13	300433	蓝思科技	84,403,452.00	3.26
14	600276	恒瑞医药	83,652,296.96	3.24
15	300498	温氏股份	82,218,026.00	3.18
16	000333	美的集团	82,181,670.79	3.18
17	300059	东方财富	81,873,916.38	3.17
18	000625	长安汽车	79,945,770.41	3.09
19	601857	中国石油	79,641,819.99	3.08
20	601398	工商银行	78,195,584.00	3.02
21	600016	民生银行	78,146,404.29	3.02
22	002415	海康威视	76,266,086.75	2.95
23	002352	顺丰控股	75,133,932.14	2.91
24	601919	中远海控	75,035,716.10	2.90
25	601138	工业富联	74,461,861.60	2.88
26	600406	国电南瑞	73,962,045.33	2.86
27	002236	大华股份	69,995,932.52	2.71
28	601668	中国建筑	69,904,351.40	2.70
29	002241	歌尔股份	69,880,939.28	2.70
30	603799	华友钴业	66,904,000.15	2.59
31	000063	中兴通讯	66,756,413.92	2.58

32	600028	中国石化	66,355,288.00	2.57
33	601728	中国电信	65,558,837.38	2.54
34	000338	潍柴动力	65,488,348.76	2.53
35	300274	阳光电源	65,322,915.92	2.53
36	300896	爱美客	65,244,082.14	2.52
37	600570	恒生电子	62,500,190.16	2.42
38	300124	汇川技术	60,901,543.00	2.36
39	000100	TCL 科技	59,553,832.20	2.30
40	601009	南京银行	59,448,107.17	2.30
41	601766	中国中车	59,118,321.99	2.29
42	600941	中国移动	58,733,096.03	2.27
43	601658	邮储银行	57,066,693.00	2.21
44	300759	康龙化成	56,799,198.89	2.20
45	002475	立讯精密	56,395,836.50	2.18
46	603993	洛阳钼业	56,372,706.00	2.18
47	601288	农业银行	54,238,066.00	2.10
48	000725	京东方 A	53,945,258.97	2.09
49	601600	中国铝业	53,494,219.00	2.07
50	600703	三安光电	53,403,405.32	2.07
51	601995	中金公司	53,171,874.00	2.06
52	600958	东方证券	52,496,923.42	2.03

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	002594	比亚迪	121,210,469.10	4.69
2	601138	工业富联	109,523,554.31	4.24
3	601899	紫金矿业	91,306,832.66	3.53
4	300433	蓝思科技	87,925,353.18	3.40
5	600276	恒瑞医药	87,190,677.93	3.37
6	601360	三六零	86,809,086.18	3.36
7	601318	中国平安	86,043,957.50	3.33
8	600406	国电南瑞	84,497,953.67	3.27
9	300059	东方财富	81,671,304.86	3.16
10	600030	中信证券	81,592,752.35	3.16
11	000625	长安汽车	73,434,942.88	2.84
12	600900	长江电力	72,762,524.94	2.81
13	600570	恒生电子	70,651,454.22	2.73
14	002236	大华股份	70,167,083.59	2.71

15	600031	三一重工	69,757,059.78	2.70
16	601728	中国电信	68,175,124.97	2.64
17	601919	中远海控	67,195,964.23	2.60
18	000858	五粮液	66,678,502.37	2.58
19	002415	海康威视	65,764,006.36	2.54
20	300015	爱尔眼科	64,533,324.08	2.50
21	002352	顺丰控股	61,586,950.22	2.38
22	000333	美的集团	59,983,389.26	2.32
23	601398	工商银行	59,479,842.00	2.30
24	600690	海尔智家	58,882,045.50	2.28
25	300896	爱美客	58,798,751.65	2.27
26	601319	中国人保	57,720,142.09	2.23
27	002027	分众传媒	57,191,205.64	2.21
28	002475	立讯精密	56,578,898.85	2.19
29	300750	宁德时代	54,575,266.32	2.11
30	000338	潍柴动力	54,548,334.74	2.11
31	000001	平安银行	52,817,243.29	2.04
32	300408	三环集团	52,579,153.71	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	9,617,159,552.43
卖出股票的收入（成交）总额	7,828,734,566.90

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	223,030,588.21	4.81
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	223,030,588.21	4.81

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	019766	25 国债 01	705,000	70,810,721.51	1.53
2	019758	24 国债 21	618,740	62,429,204.73	1.35
3	019749	24 国债 15	465,000	47,090,817.53	1.02
4	019773	25 国债 08	316,000	31,697,648.33	0.68
5	019723	23 国债 20	90,000	9,172,523.84	0.20

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建筑股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到北京市住房和城乡建设委员会的处罚，中国农业银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	18,991,331.02
2	应收清算款	65,668,861.74
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,381,940.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	100,042,133.08

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
海富通沪深 300 增强 A	91,436	20,783.84	1,727,171,010.63	90.89%	173,220,320.64	9.11%
海富通沪深 300 增强 C	127,991	13,978.17	1,474,845,844.82	82.44%	314,233,536.07	17.56%
合计	219,427	16,814.11	3,202,016,855.45	86.79%	487,453,856.71	13.21%

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	海富通沪深 300 增强 A	733,616.39	0.0386%
	海富通沪深 300 增强 C	333,310.68	0.0186%
	合计	1,066,927.07	0.0289%

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	海富通沪深 300 增强 A	10~50
	海富通沪深 300 增强 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通沪深 300 增强 A	10~50
	海富通沪深 300 增强 C	0

	合计	10~50
--	----	-------

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C
基金合同生效日（2019 年 10 月 9 日）基金份额总额	6,889,756.32	1,555,113.21
本报告期期初基金份额总额	766,423,715.58	1,356,274,118.45
本报告期基金总申购份额	1,328,517,384.38	1,291,838,053.89
减：本报告期基金总赎回份额	194,549,768.69	859,032,791.45
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,900,391,331.27	1,789,079,380.89

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

2025 年 4 月 23 日，海富通基金管理有限公司发布公告，谢乐斌先生自 2025 年 4 月 21 日起担任公司董事长，路颖女士因工作调整不再担任公司董事长。

基金托管人：

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及本基金基金管理人基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	7,923,614,282.84	45.42%	1,472,959.31	45.42%	-
银河证券	1	5,938,590,780.61	34.04%	1,104,006.02	34.04%	-
招商证券	2	2,001,961,326.04	11.48%	372,168.95	11.48%	-
国泰君安	2	1,580,490,579.75	9.06%	293,821.71	9.06%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。上述租用海通证券、国泰君安证券交易单元进行交易时间区间为 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 3 月 14 日，租用国泰海通证券交易单元进行交易时间区间为 2025 年 3 月 15 日至 2025 年 6 月 30 日。

2、交易单元的选择标准：

基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司，租用其交易单元供本基金证券交易。

3、交易单元的选择程序：

(1) 由牵头部门依据上述交易单元选择标准及公司内控制度要求，对候选券商开展尽职调查，

综合评估其财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力。

(2) 经评估, 牵头部门将符合公司制度要求的券商相关材料提交督察长进行合规性审查, 再提交基金管理人的总经理办公会审议。

(3) 基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
中信证券	141,631,085.90	65.97%	7,545,679,000.00	86.14%	-	-
银河证券	-	-	229,280,000.00	2.62%	-	-
招商证券	73,048,006.00	34.03%	943,827,000.00	10.77%	-	-
国泰君安	-	-	41,130,000.00	0.47%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际 证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

注: 上述租用海通证券、国泰君安证券交易单元进行交易时间区间为2025年1月1日至2025年3月14日, 租用国泰海通证券交易单元进行交易区间为2025年3月15日至2025年6月30日。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华林证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-15
2	海富通基金管理有限公司关于变更主要股东及实际控制人事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-21
3	海富通基金管理有限公司关于海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金新增泰信财富基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-13
4	海富通基金管理有限公司关于海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金新增销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-27
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华福证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-17
6	海富通基金管理有限公司关于公司主要股东和实际控制人变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-18
7	关于海富通基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-20
8	海富通基金管理有限公司关于海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金新增销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-26
9	海富通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况 (2024 年下半年度)	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海浦东发展银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-01
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国邮政储蓄银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-07
12	海富通基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-23
13	海富通基金管理有限公司关于董事长变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-23
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金	证券时报、基金管理人网	2025-04-30

	新增南京银行股份有限公司为销售机构的公告	站及中国证监会基金电	
		子披露网站	

§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 131 只公募基金。截至 2025 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 2161 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”。

2024 年 12 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“债券型 ETF 典型精品案例”。

§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富睿混合型证券投资基金变更注册的文件
- (二)海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同
- (三)海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通沪深 300 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

二〇二五年八月三十日