

海富通量化选股混合型证券投资基金  
2024 年年度报告  
2024 年 12 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司  
基金托管人：中信证券股份有限公司  
报告送出日期：二〇二五年三月三十一日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 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。

本报告期自 2024 年 7 月 23 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>§ 2 基金简介</b>	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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
<b>§ 4 管理人报告</b>	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 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	18
<b>§ 5 托管人报告</b>	18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
<b>§ 6 审计报告</b>	19
6.1 审计意见	19
6.2 形成审计意见的基础	19
6.3 其他信息	19
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	20
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	20
<b>§ 7 年度财务报表</b>	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	25
<b>§ 8 投资组合报告</b>	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	67
8.6 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 .....	67
8.7 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 .....	67
8.8 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 .....	67
8.9 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 .....	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
8.12 投资组合报告附注 .....	68
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>68</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	69
9.3 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 .....	69
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>69</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>70</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	70
11.2 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 .....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	70
11.4 基金投资策略的改变 .....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	71
11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	71
11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	71
11.8 其他重大事件 .....	72
<b>12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>73</b>
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>74</b>
13.1 备查文件目录 .....	74
13.2 存放地点 .....	74
13.3 查阅方式 .....	74

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通量化选股混合型证券投资基金	
基金简称	海富通量化选股混合	
基金主代码	021655	
交易代码	021655	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2024 年 7 月 23 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	19,668,504.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通量化选股混合 A	海富通量化选股混合 C
下属分级基金的交易代码	021655	021656
报告期末下属分级基金的份额总额	2,465,012.08 份	17,203,491.96 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过量化模型精选个股，力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	<p>具体包括：</p> <p>1、资产配置策略：本基金运用量化模型，结合对国内外宏观经济及证券市场整体走势的研究分析，对股票、债券等各类别资产之间的相对价值进行判断，确定各类资产之间的投资比例，并动态调整；</p> <p>2、股票投资策略：在大类资产配置的基础上，本基金采用量化模型构建股票投资组合，其中包括量化选股模型、投资组合优化及港股通标的股票的投资策略；</p> <p>3、存托凭证投资策略；</p> <p>4、债券投资组合策略：主要采取利率策略、信用策略、收益率曲线策略以及杠杆策略；</p>

	另外，本基金投资策略还包括资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资业务策略及流通受限证券投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率 $\times$ 75% + 银行活期存款利率（税后） $\times$ 20% + 中证港股通综合指数收益率 $\times$ 5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，但低于股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲
	联系电话	021-38650788
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com
客户服务电话	40088-40099	010-60836588
传真	021-33830166	010-60834004
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	广东省深圳市福田区中心三 路8号卓越时代广场（二期） 北座
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	北京市朝阳区亮马桥路48号 中信证券大厦5层
邮政编码	200120	100125
法定代表人	路颖	张佑君

### 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>

网址	
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	海富通基金管理有限公司	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

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2024 年 7 月 23 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	海富通量化选股混合 A	海富通量化选股混合 C
本期已实现收益	815,293.28	5,583,824.90
本期利润	675,534.81	5,242,347.32
加权平均基金份额本期利润	0.0694	0.0483
本期加权平均净值利润率	6.85%	4.80%
本期基金份额净值增长率	3.86%	3.62%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	
	海富通量化选股混合 A	海富通量化选股混合 C
期末可供分配利润	95,067.24	622,590.70
期末可供分配基金份额	0.0386	0.0362

总额利润		
期末基金资产净值	2,560,079.32	17,826,082.66
期末基金份额净值	1.0386	1.0362
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2024 年末</b>	
	海富通量化选股混合 A	海富通量化选股混合 C
基金份额累计净值增长率	3.86%	3.62%

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）。

4、本基金合同生效日为 2024 年 7 月 23 日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

## 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

1. 海富通量化选股混合 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
过去三个月	-3.04%	1.07%	-1.09%	1.37%	-1.95%	-0.30%
自基金合同生效起至今	3.86%	0.90%	10.92%	1.42%	-7.06%	-0.52%

2. 海富通量化选股混合 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	业绩比较基准收益	①—③	②—④

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去三个 月	-3.17%	1.07%	-1.09%	1.37%	-2.08%	-0.30%
自基金合 同生效起 至今	3.62%	0.90%	10.92%	1.42%	-7.30%	-0.52%

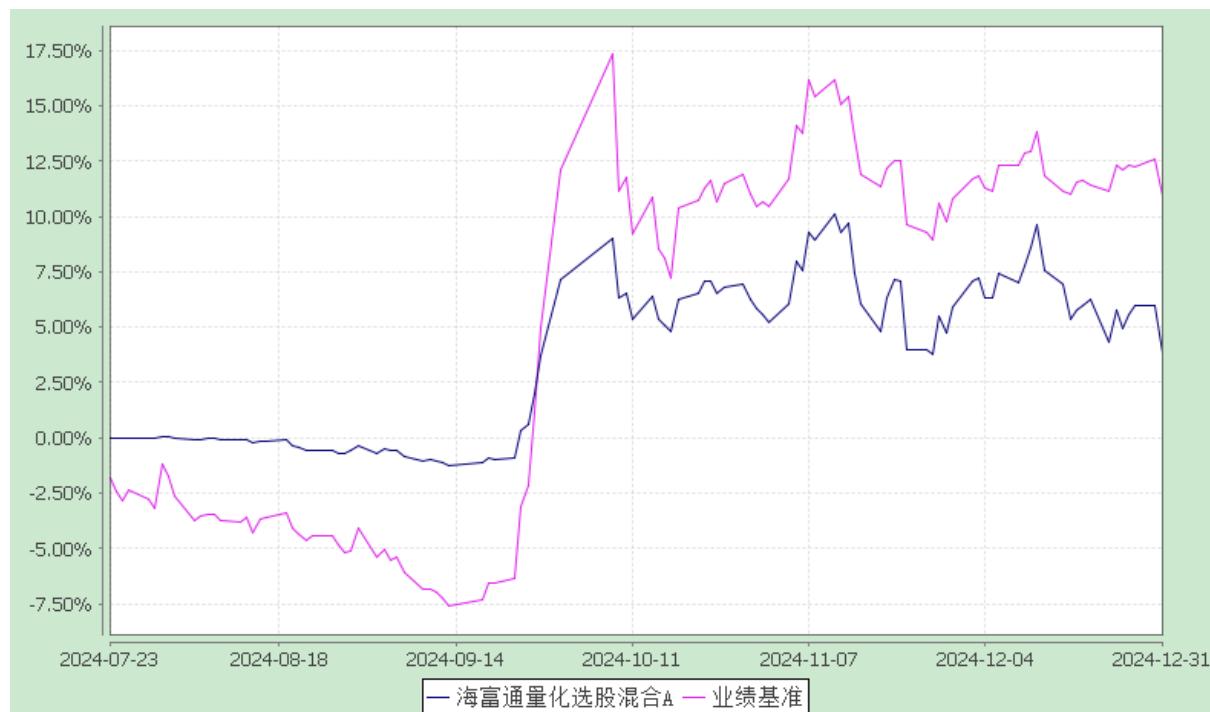
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通量化选股混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

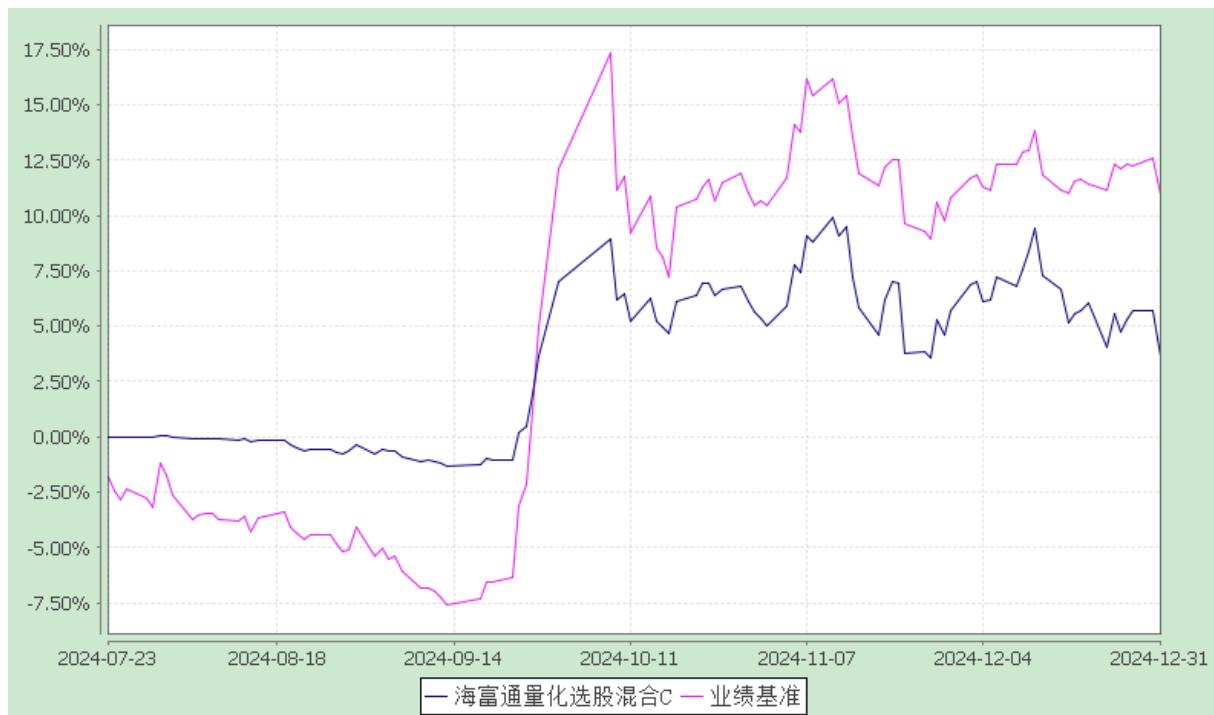
#### 1. 海富通量化选股混合 A

(2024 年 7 月 23 日至 2024 年 12 月 31 日)



#### 2. 海富通量化选股混合 C

(2024 年 7 月 23 日至 2024 年 12 月 31 日)



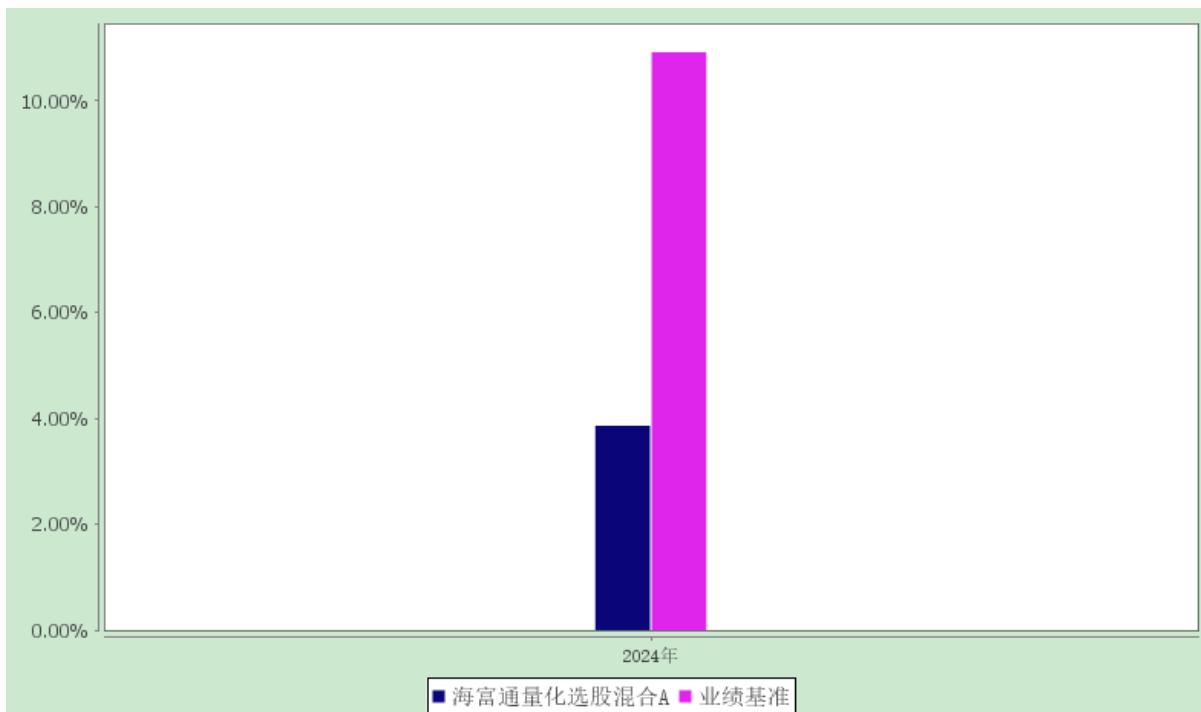
- 注：1、本基金合同于 2024 年 7 月 23 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。  
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

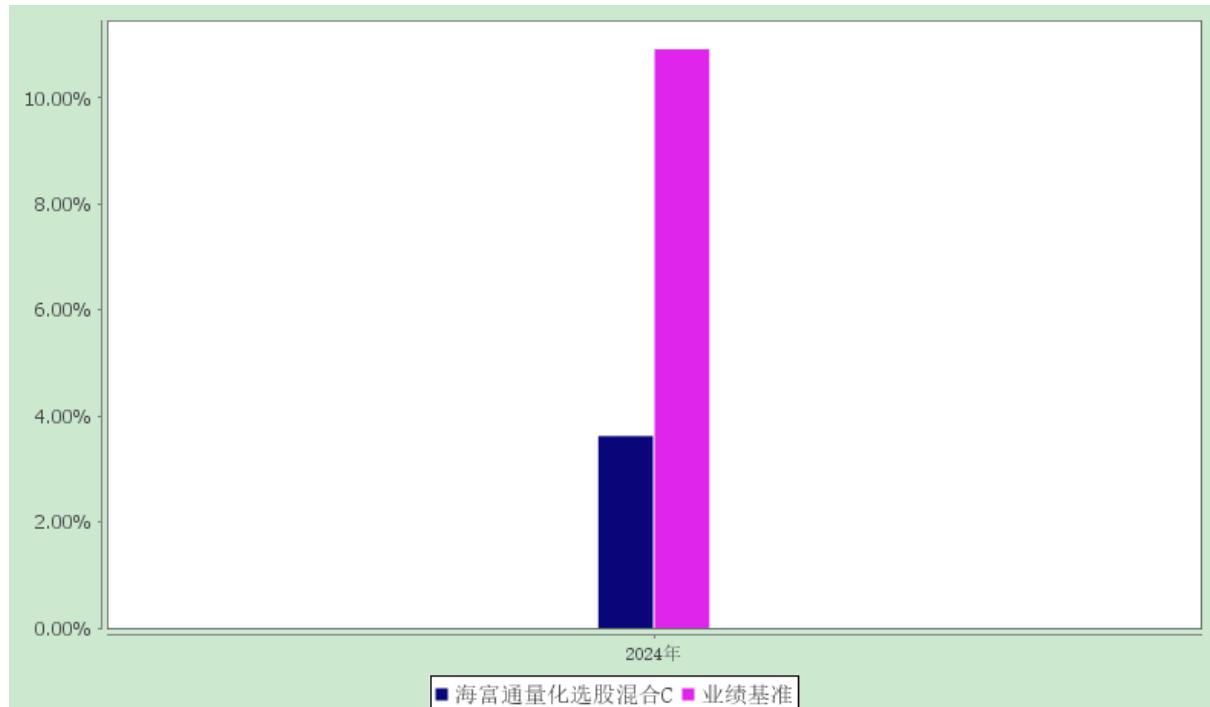
海富通量化选股混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

#### 1. 海富通量化选股混合 A



## 2. 海富通量化选股混合 C



注：图中列示的 2024 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 7 月 23 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

### 1、海富通量化选股混合 A:

单位：人民币元

年度	每 10 份基 金份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发放 总额	年度利润分配 合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

### 2、海富通量化选股混合 C:

单位：人民币元

年度	每 10 份基 金份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发放 总额	年度利润分配 合计	备注

2024 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金自基金合同生效日（2024 年 7 月 23 日）至本报告期末未发生利润分配。

## §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 12 月 31 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 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）、海富通量化前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。

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、海富通量化选股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。	2024-07-23	-	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月起任海富通量化前锋股票、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。2024年7月起兼任海富通量化选股混合基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了一级市场和二级市场的所有投资交易管理活动以及公司内部的证券分配，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

##### 4.3.2 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同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

### 4.3.3 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，中国经济呈现“政策驱动”的弱复苏特征。一季度财政前置发力实现“开门红”，二、三季度经济和市场进入磨底周期。随着三季度末一系列超预期的政策转向，四季度经济增速有所好转。全年我国实际 GDP 同比实现 5% 增长，高于 2022-2023 年的复合增速 4.3%，全年物价保持相对平稳，居民消费价格指数同比上涨 0.2%。特别是随着一系列宏观政策持续加码，市场信心开始回暖，房地产成交显著放量，居民消费开始好转，股市也震荡走强。

海外经济方面，随着通胀开始降温，美国在 2024 年 9 月开启降息周期，年内累计降幅 100 个基点。与此同时，美国维持了异常宽松的财政政策，赤字率超 6%，将美国债务水平推向了新的高度。但短期而言，积极的财政政策与宽松的货币政策共同作用，对美国股市起到了明显的支撑作用。后续随着新的总统任期开启，预计特朗普将积极调整现有政策导向，需重点关注相关政策带来的内外部影响。

从 A 股市场看，权益市场在 2024 年逐步震荡走高。指数方面，上证指数涨幅为 12.7%，沪深 300 为 14.7%，中证 800 为 12.2%，创业板指为 13.2%，中证 1000 为 1.2%。行业板块方面，根据中信一级行业分类，2024 年表现靠前的板块是银行、非银、家电、通信、交运，靠后的板块是医药、农林牧渔、消费者服务、房地产、食品饮料。总体而言，全年权益市场宽幅震荡，红利、成长、中小盘策略轮流表现占优，前期主要是偏防御的高股息红利相关行业表现强势，924 新政以后 TMT 相关科技板块表现更好。

具体投资策略方面，2024 年我们积极调整模型，特别是结合上半年市场的变化，逐步加入了行业和风格模型，以期从更多维度寻找投资机会。在风险控制方面，本基金通过风险模型限制行业和个股偏离，保持投资组合的风格暴露在合理范围之内。同时，在组合构建时加入动态的风险控制调整，以提升组合收益稳健性。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通量化选股混合 A 净值增长率为 3.86%，同期业绩比较基准收益率为 10.92%。海富通量化选股混合 C 净值增长率为 3.62%，同期业绩比较基准收益率为 10.92%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济来看，2025 年国内经济复苏的势头有望进一步增强。随着 2024 年三季度末一系列逆周期调节政策的推出，以及各部门积极和迅速的响应，官方对于扭转经济的决心和态度已经逐步明朗。在实体经济层面，四季度经济数据已经开始有所回暖，GDP 增速反弹至 5.4%，CPI 同比转正至 0.5%，贸易顺差创历史新高。多方面信息都反映出经济增速已经进入修复的过程中，这种趋势有望在 2025 年进一步加强。

海外经济方面，2025 年特朗普将开启第二任期，美国在各方面均将迎来较大幅度的政策转向，不管是在国际贸易、国内税收、还是政府开支等方面。这些政策调整的力度目前还较难估量，但可以预见的是对美国的通胀、政府支出、企业利润等都将有显著影响，这些调整对市场的潜在冲击是 2025 年的重要挑战。

年末之交，随着 DeepSeek 大模型、人形机器人和哪吒电影等现象级创新的涌现，全球投资者对中国科技和资产的关注度突飞猛进。结合我国在智能驾驶、半导体芯片等领域的不断突破，世界似乎正在重新评估国内经济的创新活力和增长潜力。这些变化充分体现了新质生产力对经济的促进能同时作用在实体和信心两个层面。对于股票市场而言，2025 年我们或也将迎来 A 股市场盈利和估值共同提升带来的戴维斯双击时刻。我们对 2025 年的市场充满信心，将积极跟踪国内政策和经济的变化，把握投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过业务审核、合规检查、系统监控、重点抽查、专项审计等一系列方式开展工作，强化基金运作和公司运营的合规性，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

##### 一、加强合规管理，持续完善公司的规章制度体系

报告期内，坚持以法律法规和公司制度为依据，对公司和基金运作的各项业务开展提供全面的合规咨询、审核、监测与检查，确保基金运作的合法合规性。根据法律法规、监管政策的变化，结合业务发展及公司管理需要，对公司内控制度体系进行了完善和全面梳理，新增和修订了多项内部制度和流程，提升了公司的合规管理水平。

##### 二、客观开展内外部内控评估，进一步优化内控措施

根据法规、监管要求并结合风险导向和全覆盖原则，公司继续通过日常业务的定期合规检查、不定期自查等方式，重点关注规章制度的执行情况、第一道防线风险控制的有效性和投资运作与产品合同约定的一致性。同时，对各部门的业务有重点的开展了多

项专项检查和内部审计。另外，根据法规和公司管理需要，公司聘请会计师事务所等外部专业机构对公司开展了内部控制评价等方面的审计。通过内外部审计及合规检查，审视法律法规和监管要求的落实情况、监督公司制度流程的执行情况，及时发现存在的问题，并通过加强跨部门的协作沟通，形成合力，认真整改，进一步健全完善了公司的内部控制体系。

### 三、有效推进反洗钱与反恐怖融资工作

报告期内，结合反洗钱法规及公司业务特点完善了反洗钱制度，组织多场反洗钱培训和宣传活动；基于风险为本的工作思路，继续开展客户信息数据治理工作，稳步推进代销机构分类管理工作，持续优化监测模型，强化可疑交易监控，并按时向中国反洗钱监测分析中心报送相关数据。报告期内，公司根据监管要求完成了各项洗钱固有风险评估及洗钱风险控制措施有效性调查工作，有效管控公司洗钱固有风险敞口。另外，公司加大反洗钱课题研习工作力度，组织反洗钱专兼职人员深入开展相关课题研究和投稿，提升反洗钱工作质效。

### 四、强化合规文化培训，提升员工的合规及风险意识

本报告期内，为提高公司全员的合规意识，加大了合规培训力度，强化主动合规意识培育。公司进一步加强组织各类合规培训频率，及时对法规、监管精神和公司要求进行宣导，并通过制作合规法务月刊、开展“合规文化宣传月”主题活动等多样化的合规宣传培训方式进一步提高法律法规宣导工作的及时性，丰富合规宣导工作的形式，激发全体员工学习合规内控政策的积极性，营造合规文化浓厚氛围。通过培训，增强了全体员工的合规意识和风险防范意识，提升了员工的主动识别和控制业务风险的积极性和能力。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金财产安全、合规、诚信运作。

## 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同规定，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自 2024 年 10 月 23 日至 2024 年 12 月 31 日，本基金连续五十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

### §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，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对海富通量化选股混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金管理法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，海富通基金管理有限公司在海富通量化选股混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通量化选股混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 审计报告

毕马威华振审字第 2501754 号

海富通量化选股混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了后附的海富通量化选股混合型证券投资基金(以下简称“该基金”) 财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2024 年 7 月 23 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2024 年 7 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

该基金管理人海富通基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金自 2024 年 7 月 23 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间和 2024 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事

实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

#### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

#### 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3)评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审

计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。

(5)评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师

王国蓓 何晨

北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2025 年 3 月 27 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：海富通量化选股混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
货币资金	7.4.7.1	2,265,498.37
结算备付金		66,240.03
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	18,609,661.86
其中：股票投资		18,609,661.86
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-

应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		20,941,400.26
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年12月31日</b>
<b>负债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		433,726.68
应付管理人报酬		24,399.46
应付托管费		4,066.59
应付销售服务费		9,045.55
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	7.4.7.6	84,000.00
负债合计		555,238.28
<b>净资产:</b>		
实收基金	7.4.7.7	19,668,504.04
未分配利润	7.4.7.8	717,657.94
净资产合计		20,386,161.98
负债和净资产总计		20,941,400.26

注：1、报告截止日 2024 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0386 元，C 类基金份额净值 1.0362 元。基金份额总额 19,668,504.04 份，其中 A 类基金份额 2,465,012.08 份，C 类基金份额 17,203,491.96 份。

2、基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

## 7.2 利润表

会计主体：海富通量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 7 月 23 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年7月23日（基金合同生效日）至 2024年12月31日
<b>一、营业收入</b>		6,975,903.46
1.利息收入		576,782.97
其中：存款利息收入	7.4.7.9	575,372.34
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		1,410.63
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,824,031.81
其中：股票投资收益	7.4.7.10	6,665,382.52
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-
股利收益	7.4.7.14	158,649.29
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-481,236.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	56,324.73
<b>减：二、营业总支出</b>		1,058,021.33
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	628,221.28
其中：暂估管理人报酬（若有）		-
2. 托管费	7.4.10.2. 2	104,703.60
3. 销售服务费		239,891.37
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		5.08
8. 其他费用	7.4.7.17	85,200.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>5,917,882.13</b>
<b>减：所得税费用</b>		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>5,917,882.13</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-

六、综合收益总额		5,917,882.13
----------	--	--------------

注：本财务报表的实际编制期间为 2024 年 7 月 23 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日，上年度可比期间无比较数据。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：海富通量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 7 月 23 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 7 月 23 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	232,487,520.92	-	-	232,487,520.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-212,819,016.88	-	717,657.94	-212,101,358.94
(一)、综合收益总额	-	-	5,917,882.13	5,917,882.13
(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）	-212,819,016.88	-	-5,200,224.19	-218,019,241.07
其中：1. 基金申购款	2,024,625.21	-	106,026.78	2,130,651.99
2. 基金赎回款	-214,843,642.09	-	-5,306,250.97	-220,149,893.06
(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	19,668,504.04	-	717,657.94	20,386,161.98
-----------	---------------	---	------------	---------------

注：本财务报表的实际编制期间为 2024 年 7 月 23 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日，上年度可比期间无比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

海富通量化选股混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可[2024]857 号《关于准予海富通量化选股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《海富通量化选股混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 232,394,870.36 元。经向中国证监会备案，《海富通量化选股混合型证券投资基金基金合同》于 2024 年 7 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 232,487,520.92 份基金份额，其中认购资金利息折合 92,650.56 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，基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《海富通量化选股混合型证券投资基金基金合同》和《海富通量化选股混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/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 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通量化选股混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权）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。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。在未来条件许可的情况下，本基金可根据相关法律法规，在履行适当程序后，参与融券业务和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投

资范围。基金的投资组合比例为：股票资产（包含存托凭证）占基金资产的比例为 60%-95%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率  $\times$  75% + 银行活期存款利率（税后） $\times$  20% + 中证港股通综合指数收益率  $\times$  5%。

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 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、自 2024 年 7 月 23 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2024 年 7 月 23 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (a)金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券投资、衍生工具等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b)金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### (a)金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

#### (b)后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

#### (c)金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### (d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

#### 预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

#### 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

#### 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的

报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

#### 投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

#### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《海富通量化选股混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)的规定，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金各类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；本基金不同份额类别的基金份额，其分红方式相互独立、互不影响；投资者不同基金交易账户设置的基金分红方式相互独立、互不影响；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别的每一基金份额享有同等分配权，由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金管理有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金管理政策的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继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》、财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、中投信(2021)20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税(2014)81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对证券投资基金从中国内地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。

(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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联交所”）上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

(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。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与香港联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2024 年 12 月 31 日
活期存款	402,752.72
等于：本金	402,590.49
加：应计利息	162.23
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	1,862,745.65
等于：本金	1,862,719.04
加：应计利息	26.61
合计	2,265,498.37

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	19,090,897.91	-	18,609,661.86	-481,236.05
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-

	合计	-	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-	-
基金	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	19,090,897.91	-	18,609,661.86	-	-481,236.05

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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。

##### 7.4.7.4.2 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从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,000.00
合计	84,000.00

### 7.4.7.7 实收基金

#### 海富通量化选股混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年7月23日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	17,320,781.55	17,320,781.55
本期申购	40,455.34	40,455.34
本期赎回（以“-”号填列）	-14,896,224.81	-14,896,224.81
本期末	2,465,012.08	2,465,012.08

#### 海富通量化选股混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年7月23日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	215,166,739.37	215,166,739.37
本期申购	1,984,169.87	1,984,169.87
本期赎回（以“-”号填列）	-199,947,417.28	-199,947,417.28
本期末	17,203,491.96	17,203,491.96

注：1. 申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2024 年 6 月 24 日至 2024 年 7 月 19 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 232,394,870.36 元，折合为 232,394,870.36 份基金份额（其中 A 类基金份额 17,313,088.88 份，C 类基金份额 215,081,781.48 份）。根据《海富通量化选股混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 92,650.56 元在本基金成立后，折合为 92,650.56 份基金份额（其中 A 类基金份额 7,692.67 份，C 类基金份额 84,957.89 份），划入基金份额持有人账户。

3. 据《海富通量化选股混合型证券投资基金基金合同》、《海富通量化选股混合型证券投资基金招募说明书》和《海富通量化选股混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告》的相关规定，本基金于 2024 年 7 月 23 日(基金合同生效日)至 2024 年 9 月 22 日止期间暂不向投资人开放申购、赎回、转换、定期定额投资业务，自 2024 年 9 月 23 日起开始办理。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 海富通量化选股混合 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
本期利润	815,293.28	-139,758.47	675,534.81
本期基金份额交易产生的变动数	-531,622.59	-48,844.98	-580,467.57
其中：基金申购款	125.69	1,448.61	1,574.30
基金赎回款	-531,748.28	-50,293.59	-582,041.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	283,670.69	-188,603.45	95,067.24

##### 海富通量化选股混合 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
本期利润	5,583,824.90	-341,477.58	5,242,347.32
本期基金份额交易产生的变动数	-3,647,301.73	-972,454.89	-4,619,756.62
其中：基金申购款	98,416.19	6,036.29	104,452.48
基金赎回款	-3,745,717.92	-978,491.18	-4,724,209.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,936,523.17	-1,313,932.47	622,590.70

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年7月23日（基金合同生效日）至2024年12月31日
活期存款利息收入	170,244.43
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	8,158.80
结算备付金利息收入	396,240.03
其他	729.08
合计	575,372.34

#### 7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年7月23日（基金合同生效日）至2024年12月31日
卖出股票成交总额	174,521,731.70
减：卖出股票成本总额	167,586,455.03
减：交易费用	269,894.15
买卖股票差价收入	6,665,382.52

#### 7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 7.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年7月23日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	158,649.29
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	158,649.29

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年7月23日（基金合同生效日）至2024年12月31日
1.交易性金融资产	-481,236.05
——股票投资	-481,236.05

——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-481,236.05

#### 7.4.7.16 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2024年7月23日（基金合同生效日）至2024年12月31日
基金赎回费收入	56,324.73
合计	56,324.73

#### 7.4.7.17 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2024年7月23日（基金合同生效日）至2024年12月31日
审计费用	24,000.00
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	-
开户费	1,200.00
合计	85,200.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

经中国证监会于 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（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持海富通基金管理有限公司股权亦归属于合并后的国泰君安，即合并后的国泰君安成为海富通基金管理有限公司的主要股东，上海国际集团有限公司成为海富通基金管理有限公司实际控制人。

### 7.4.9 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	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
法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东
上海富诚海富通资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中信证券（山东）有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金托管人关联方

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，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年7月23日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	254,150,777.42	70.36%
中信证券（山东）	107,048,307.22	29.64%

注：基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易，基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 7.4.10.1.3 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7月23日（基金合同生效日）至2024年12月31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
中信证券	112,179.40	70.35%	-	-
中信证券（山东）	47,285.00	29.65%	-	-

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金管理人提供的证券投资研究服务等。

2.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。公司的该类佣金协议符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

3.基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2024年7月23日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	628,221.28
其中：应支付销售机构的客户维护	294,036.35

费	
应支付基金管理人的净管理费	334,184.93

注：1、支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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：日管理人报酬=前一日基金资产净值  $\times$  1.20%/当年天数。

2、基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年7月23日（基金合同生效日）至2024年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	104,703.60

注：1、支付基金托管人中信证券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  $\times$  0.20%/当年天数。

2、基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 7.4.10.2.3 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7月23日（基金合同生效日）至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通量化选股混合 A	海富通量化选股混合 C	合计
中信证券	-	147,443.77	147,443.77
海富通	-	6,418.64	6,418.64
合计	-	153,862.41	153,862.41

注：1、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 0.50%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.50% 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  $\times$  0.50%/当年天数。

2、基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易，基金合同成

立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

#### **7.4.10.4 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**

##### **7.4.10.4.1 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，基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

##### **7.4.10.4.2 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，基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

#### **7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

##### **7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金，基金合同成立于 2024 年 07 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

##### **7.4.10.5.2 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**

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金，基金合同成立于 2024 年 07 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

#### **7.4.10.6 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	
	2024年7月23日（基金合同生效日）至2024年12月31日	当期利息收入
中信证券	2,265,498.37	178,403.23

注：1、本基金的活期存款 402,752.72 元由基金托管人中信证券保管，存放在具有基金托管资格的中国建设银行股份有限公司，按银行同业利率或约定利率计息。本基金的其他存款 1,862,745.65 元由基金结算机构中信证券保管，按协议约定利率计息。

2、基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

#### **7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券，基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项，基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比区间无比较数据。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期内无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期内未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期内无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期内无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。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员构成的多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。

#### 7.4.13.2 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 12 月 31 日，本基金未持有债券和资产支持证券。基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 7.4.13.3 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 7.4.12 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。

##### 7.4.13.3.1 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管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理规定》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时间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，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%，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 7.4.12。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。

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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分权益类金融资产和金融负债不计息，该部分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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种存在相应的利率风险，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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	2,265,498.37	-	-	-	2,265,498.37
结算备付金	66,240.03	-	-	-	66,240.03
交易性金融资产	-	-	-	18,609,661.86	18,609,661.86
资产总计	2,331,738.40	-	-	18,609,661.86	20,941,400.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	433,726.68	433,726.68
应付管理人报酬	-	-	-	24,399.46	24,399.46
应付托管费	-	-	-	4,066.59	4,066.59
应付销售服务费	-	-	-	9,045.55	9,045.55
其他负债	-	-	-	84,000.00	84,000.00
负债总计	-	-	-	555,238.28	555,238.28
利率敏感度缺口	2,331,738.40	-	-	18,054,423.58	20,386,161.98

注：1.表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

2.基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比

较数据。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

本基金运用量化模型，结合对国内外宏观经济及证券市场整体走势的研究分析，对股票、债券等各类别资产之间的相对价值进行判断，确定各类资产之间的投资比例，并动态调整。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	18,609,661.86	91.29
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	18,609,661.86	91.29

注：基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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12月31日
	1.业绩比较基准上升 5% 2.业绩比较基准下降 5%	-1,040,619.92

注：基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日
第一层次	18,609,661.86
第二层次	-
第三层次	-
合计	18,609,661.86

注：基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度末无比较数据。

###### 7.4.14.2.2 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等，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨停时的交易不活跃)、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。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。基金合同成立于 2024 年 7 月 23 日，上年度末无比较数据。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 7.4.15 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，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

### §8 投资组合报告

#### 8.1 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	18,609,661.86	88.87
	其中：股票	18,609,661.86	88.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,331,738.40	11.13
8	其他各项资产	-	-
9	合计	20,941,400.26	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	128,679.00	0.63
B	采矿业	603,316.00	2.96
C	制造业	10,807,730.11	53.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,229,186.00	6.03
E	建筑业	216,234.00	1.06
F	批发和零售业	355,152.00	1.74
G	交通运输、仓储和邮政业	815,472.00	4.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	133,357.75	0.65
J	金融业	2,886,191.00	14.16
K	房地产业	976,493.00	4.79
L	租赁和商务服务业	181,299.00	0.89
M	科学研究和技术服务业	112,141.00	0.55
N	水利、环境和公共设施管理业	124,570.00	0.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	19,020.00	0.09
S	综合	20,821.00	0.10
	合计	18,609,661.86	91.29

### 8.2.2 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。

## 8.3 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	601336	新华保险	4,700	233,590.00	1.15

2	601601	中国太保	5,800	197,664.00	0.97
3	600246	万通发展	26,400	196,680.00	0.96
4	601318	中国平安	3,700	194,805.00	0.96
5	601088	中国神华	4,200	182,616.00	0.90
6	603799	华友钴业	6,200	181,412.00	0.89
7	002532	天山铝业	22,900	180,223.00	0.88
8	002001	新和成	8,100	177,957.00	0.87
9	000776	广发证券	10,900	176,689.00	0.87
10	002128	电投能源	8,900	174,262.00	0.85
11	002594	比亚迪	600	169,596.00	0.83
12	300497	富祥药业	20,200	168,468.00	0.83
13	300337	银邦股份	14,900	165,688.00	0.81
14	600048	保利发展	18,400	163,024.00	0.80
15	300433	蓝思科技	7,400	162,060.00	0.79
16	000725	京东方 A	35,400	155,406.00	0.76
17	601628	中国人寿	3,700	155,104.00	0.76
18	688122	西部超导	3,535	151,368.70	0.74
19	002027	分众传媒	21,300	149,739.00	0.73
20	000661	长春高新	1,500	149,160.00	0.73
21	000807	云铝股份	10,800	146,124.00	0.72
22	688090	瑞松科技	4,000	142,080.00	0.70
23	600642	申能股份	14,500	137,605.00	0.67
24	601319	中国人保	18,000	137,160.00	0.67
25	601919	中远海控	8,800	136,400.00	0.67
26	600741	华域汽车	7,700	135,597.00	0.67
27	601138	工业富联	6,100	131,150.00	0.64
28	600584	长电科技	3,200	130,752.00	0.64
29	600036	招商银行	3,300	129,690.00	0.64
30	601668	中国建筑	21,600	129,600.00	0.64
31	000617	中油资本	18,800	129,532.00	0.64
32	002273	水晶光电	5,700	126,654.00	0.62
33	601012	隆基绿能	8,000	125,680.00	0.62
34	600887	伊利股份	4,000	120,720.00	0.59
35	600745	闻泰科技	3,100	120,218.00	0.59
36	000729	燕京啤酒	9,900	119,196.00	0.58
37	000651	格力电器	2,600	118,170.00	0.58
38	002179	中航光电	3,000	117,900.00	0.58
39	000338	潍柴动力	8,600	117,820.00	0.58
40	600027	华电国际	20,700	116,127.00	0.57
41	600522	中天科技	8,100	115,992.00	0.57
42	600848	上海临港	11,400	115,140.00	0.56
43	600111	北方稀土	5,400	114,588.00	0.56
44	600585	海螺水泥	4,800	114,144.00	0.56
45	600031	三一重工	6,900	113,712.00	0.56

46	600926	杭州银行	7,700	112,497.00	0.55
47	600383	金地集团	25,400	111,252.00	0.55
48	601633	长城汽车	4,200	110,586.00	0.54
49	603158	腾龙股份	13,600	109,888.00	0.54
50	600703	三安光电	8,700	105,879.00	0.52
51	000951	中国重汽	6,200	105,276.00	0.52
52	603501	韦尔股份	1,000	104,410.00	0.51
53	601006	大秦铁路	15,100	102,378.00	0.50
54	000538	云南白药	1,700	101,915.00	0.50
55	600218	全柴动力	12,900	101,910.00	0.50
56	002906	华阳集团	3,300	101,475.00	0.50
57	002463	沪电股份	2,400	95,160.00	0.47
58	000768	中航西飞	3,300	93,192.00	0.46
59	688015	交控科技	4,500	89,235.00	0.44
60	601677	明泰铝业	7,300	87,819.00	0.43
61	300373	扬杰科技	2,000	87,040.00	0.43
62	600995	南网储能	8,600	87,032.00	0.43
63	301219	腾远钴业	1,900	85,899.00	0.42
64	603055	台华新材	7,700	85,316.00	0.42
65	600704	物产中大	16,200	81,972.00	0.40
66	002454	松芝股份	12,200	81,130.00	0.40
67	300750	宁德时代	300	79,800.00	0.39
68	603008	喜临门	4,700	78,772.00	0.39
69	002371	北方华创	200	78,200.00	0.38
70	601877	正泰电器	3,300	77,253.00	0.38
71	688233	神工股份	3,200	75,040.00	0.37
72	601939	建设银行	8,500	74,715.00	0.37
73	688687	凯因科技	3,451	74,472.58	0.37
74	300274	阳光电源	1,000	73,830.00	0.36
75	601916	浙商银行	24,500	71,295.00	0.35
76	002423	中粮资本	5,300	70,967.00	0.35
77	600487	亨通光电	4,100	70,602.00	0.35
78	600098	广州发展	10,800	69,336.00	0.34
79	300012	华测检测	5,500	68,365.00	0.34
80	000897	津滨发展	28,800	68,256.00	0.33
81	600196	复星医药	2,700	67,095.00	0.33
82	002083	孚日股份	13,600	66,504.00	0.33
83	000783	长江证券	9,700	66,154.00	0.32
84	601058	赛轮轮胎	4,600	65,918.00	0.32
85	600064	南京高科	8,300	64,491.00	0.32
86	000030	富奥股份	12,400	63,612.00	0.31
87	601555	东吴证券	8,100	63,180.00	0.31
88	600648	外高桥	5,300	63,123.00	0.31
89	002422	科伦药业	2,100	62,853.00	0.31

90	600096	云天化	2,800	62,440.00	0.31
91	000726	鲁泰 A	9,500	61,940.00	0.30
92	603733	仙鹤股份	3,000	61,890.00	0.30
93	002807	江阴银行	14,000	60,900.00	0.30
94	002448	中原内配	9,700	60,722.00	0.30
95	601577	长沙银行	6,800	60,452.00	0.30
96	300207	欣旺达	2,700	60,237.00	0.30
97	601222	林洋能源	8,500	60,095.00	0.29
98	601211	国泰君安	3,200	59,680.00	0.29
99	002662	京威股份	15,400	59,598.00	0.29
100	300335	迪森股份	12,300	59,286.00	0.29
101	300304	云意电气	7,400	59,200.00	0.29
102	000090	天健集团	14,400	59,184.00	0.29
103	600958	东方证券	5,600	59,136.00	0.29
104	000700	模塑科技	8,400	58,968.00	0.29
105	002479	富春环保	12,400	58,776.00	0.29
106	000537	中绿电	6,400	58,368.00	0.29
107	603167	渤海轮渡	6,500	57,460.00	0.28
108	600256	广汇能源	8,500	57,205.00	0.28
109	600578	京能电力	16,200	57,024.00	0.28
110	002839	张家港行	13,000	56,810.00	0.28
111	600742	一汽富维	6,400	56,640.00	0.28
112	601168	西部矿业	3,500	56,245.00	0.28
113	002627	三峡旅游	11,200	56,224.00	0.28
114	600663	陆家嘴	5,700	56,088.00	0.28
115	300529	健帆生物	1,900	55,746.00	0.27
116	600641	万业企业	3,800	55,556.00	0.27
117	002745	木林森	6,300	54,936.00	0.27
118	600420	国药现代	4,600	54,924.00	0.27
119	002091	江苏国泰	7,500	54,900.00	0.27
120	603317	天味食品	4,100	54,694.00	0.27
121	002459	晶澳科技	3,900	53,625.00	0.26
122	000828	东莞控股	5,000	53,450.00	0.26
123	000088	盐田港	10,900	53,083.00	0.26
124	002601	龙佰集团	3,000	53,010.00	0.26
125	002101	广东鸿图	4,400	52,712.00	0.26
126	000048	京基智农	2,900	52,200.00	0.26
127	000612	焦作万方	8,100	52,002.00	0.26
128	000407	胜利股份	15,200	51,984.00	0.25
129	002787	华源控股	6,500	51,220.00	0.25
130	002218	拓日新能	12,900	51,213.00	0.25
131	300498	温氏股份	3,100	51,181.00	0.25
132	601016	节能风电	16,100	51,037.00	0.25
133	600863	内蒙华电	11,700	50,661.00	0.25

134	601156	东航物流	3,000	50,610.00	0.25
135	601966	玲珑轮胎	2,800	50,512.00	0.25
136	601997	贵阳银行	8,400	50,400.00	0.25
137	000554	泰山石油	8,400	49,896.00	0.24
138	300745	欣锐科技	3,100	49,352.00	0.24
139	601688	华泰证券	2,800	49,252.00	0.24
140	688658	悦康药业	3,400	48,994.00	0.24
141	600919	江苏银行	4,900	48,118.00	0.24
142	600021	上海电力	5,200	47,684.00	0.23
143	000002	万科 A	6,500	47,190.00	0.23
144	002409	雅克科技	800	46,360.00	0.23
145	300439	美康生物	4,400	45,980.00	0.23
146	600727	鲁北化工	6,200	45,942.00	0.23
147	002444	巨星科技	1,400	45,290.00	0.22
148	600517	国网英大	8,200	45,182.00	0.22
149	688425	铁建重工	10,200	44,880.00	0.22
150	603323	苏农银行	8,400	44,436.00	0.22
151	601225	陕西煤业	1,900	44,194.00	0.22
152	300447	全信股份	3,100	43,927.00	0.22
153	688680	海优新材	1,300	43,914.00	0.22
154	688133	泰坦科技	2,400	43,776.00	0.21
155	600660	福耀玻璃	700	43,680.00	0.21
156	600765	中航重机	2,100	42,987.00	0.21
157	600862	中航高科	1,700	42,942.00	0.21
158	688019	安集科技	300	41,808.00	0.21
159	002267	陕天然气	4,900	41,405.00	0.20
160	002565	顺灏股份	13,600	41,344.00	0.20
161	002284	亚太股份	5,300	41,022.00	0.20
162	301233	盛帮股份	900	40,905.00	0.20
163	601857	中国石油	4,500	40,230.00	0.20
164	600109	国金证券	4,600	40,158.00	0.20
165	301039	中集车辆	4,400	39,820.00	0.20
166	000686	东北证券	5,000	39,700.00	0.19
167	000913	钱江摩托	2,200	39,622.00	0.19
168	688553	汇宇制药	2,600	39,520.00	0.19
169	000425	徐工机械	4,900	38,857.00	0.19
170	000900	现代投资	8,800	38,808.00	0.19
171	600900	长江电力	1,300	38,415.00	0.19
172	688533	上声电子	1,100	38,302.00	0.19
173	600528	中铁工业	4,700	37,882.00	0.19
174	301503	智迪科技	1,100	37,752.00	0.19
175	002608	江苏国信	4,900	37,583.00	0.18
176	603013	亚普股份	2,500	37,450.00	0.18
177	002352	顺丰控股	900	36,270.00	0.18

178	300816	艾可蓝	1,400	35,910.00	0.18
179	300230	永利股份	8,000	35,600.00	0.17
180	688321	微芯生物	1,900	35,302.00	0.17
181	000001	平安银行	3,000	35,100.00	0.17
182	601169	北京银行	5,700	35,055.00	0.17
183	600016	民生银行	8,300	34,279.00	0.17
184	688419	耐科装备	1,100	34,188.00	0.17
185	601658	邮储银行	6,000	34,080.00	0.17
186	002142	宁波银行	1,400	34,034.00	0.17
187	688519	南亚新材	1,600	34,016.00	0.17
188	601991	大唐发电	11,900	33,915.00	0.17
189	605111	新洁能	1,000	33,910.00	0.17
190	301020	密封科技	1,800	33,750.00	0.17
191	301280	珠城科技	800	33,336.00	0.16
192	002920	德赛西威	300	33,033.00	0.16
193	002948	青岛银行	8,400	32,592.00	0.16
194	688103	国力股份	800	32,536.00	0.16
195	301209	联合化学	1,200	32,460.00	0.16
196	600475	华光环能	3,600	32,436.00	0.16
197	601528	瑞丰银行	5,700	32,091.00	0.16
198	688689	银河微电	1,500	31,785.00	0.16
199	603367	辰欣药业	2,300	31,602.00	0.16
200	600153	建发股份	3,000	31,560.00	0.15
201	300771	智莱科技	3,000	31,560.00	0.15
202	300435	中泰股份	2,600	31,408.00	0.15
203	002328	新朋股份	5,100	31,263.00	0.15
204	000591	太阳能	6,500	30,940.00	0.15
205	600531	豫光金铅	4,800	30,816.00	0.15
206	600266	城建发展	5,900	30,090.00	0.15
207	000333	美的集团	400	30,088.00	0.15
208	688508	芯朋微	700	30,079.00	0.15
209	601009	南京银行	2,800	29,820.00	0.15
210	301192	泰祥股份	1,700	29,597.00	0.15
211	603355	莱克电气	1,300	29,445.00	0.14
212	688175	高凌信息	1,700	29,291.00	0.14
213	301319	唯特偶	1,000	29,160.00	0.14
214	300151	昌红科技	1,700	28,900.00	0.14
215	600032	浙江新能	3,900	28,860.00	0.14
216	002456	欧菲光	2,400	28,752.00	0.14
217	300001	特锐德	1,300	28,535.00	0.14
218	002462	嘉事堂	2,200	28,424.00	0.14
219	600717	天津港	5,800	28,246.00	0.14
220	002688	金河生物	6,300	28,161.00	0.14
221	600017	日照港	8,800	28,160.00	0.14

222	600035	楚天高速	6,100	28,060.00	0.14
223	000858	五粮液	200	28,008.00	0.14
224	002736	国信证券	2,500	28,000.00	0.14
225	601665	齐鲁银行	5,000	27,950.00	0.14
226	601108	财通证券	3,400	27,778.00	0.14
227	300259	新天科技	7,900	27,650.00	0.14
228	300566	激智科技	1,400	27,608.00	0.14
229	605166	聚合顺	2,300	27,531.00	0.14
230	001914	招商积余	2,600	27,482.00	0.13
231	688391	钜泉科技	905	27,466.75	0.13
232	002060	广东建工	7,500	27,450.00	0.13
233	600469	风神股份	4,400	27,104.00	0.13
234	002120	韵达股份	3,600	27,072.00	0.13
235	300618	寒锐钴业	800	27,016.00	0.13
236	300415	伊之密	1,300	26,078.00	0.13
237	000935	四川双马	1,800	26,064.00	0.13
238	301258	富士莱	1,100	25,982.00	0.13
239	600219	南山铝业	6,600	25,806.00	0.13
240	601398	工商银行	3,700	25,604.00	0.13
241	300761	立华股份	1,300	25,298.00	0.12
242	300724	捷佳伟创	400	25,284.00	0.12
243	600023	浙能电力	4,400	24,904.00	0.12
244	002928	华夏航空	3,200	24,832.00	0.12
245	688651	盛邦安全	700	24,759.00	0.12
246	603987	康德莱	3,400	24,412.00	0.12
247	603699	纽威股份	1,100	24,387.00	0.12
248	300397	天和防务	2,200	24,178.00	0.12
249	002244	滨江集团	2,800	24,108.00	0.12
250	002788	鹭燕医药	2,900	23,809.00	0.12
251	688026	洁特生物	1,821	23,363.43	0.11
252	603871	嘉友国际	1,200	23,220.00	0.11
253	688117	圣诺生物	900	23,103.00	0.11
254	600033	福建高速	5,900	22,892.00	0.11
255	300429	强力新材	1,900	22,781.00	0.11
256	603339	四方科技	1,800	22,752.00	0.11
257	601018	宁波港	5,900	22,715.00	0.11
258	300095	华伍股份	3,300	22,407.00	0.11
259	601137	博威合金	1,100	22,330.00	0.11
260	000988	华工科技	500	21,650.00	0.11
261	600497	驰宏锌锗	3,800	21,166.00	0.10
262	002626	金达威	1,400	21,140.00	0.10
263	600805	悦达投资	4,700	20,821.00	0.10
264	002615	哈尔斯	2,600	20,670.00	0.10
265	002475	立讯精密	500	20,380.00	0.10

266	688061	灿瑞科技	700	20,216.00	0.10
267	002984	森麒麟	800	19,728.00	0.10
268	603788	宁波高发	1,400	19,362.00	0.09
269	600758	辽宁能源	5,600	19,264.00	0.09
270	000728	国元证券	2,300	19,228.00	0.09
271	688307	中润光学	800	19,200.00	0.09
272	300680	隆盛科技	800	19,168.00	0.09
273	600269	赣粤高速	3,400	19,074.00	0.09
274	603538	美诺华	1,500	19,065.00	0.09
275	601811	新华文轩	1,200	19,020.00	0.09
276	603105	芯能科技	2,100	18,921.00	0.09
277	601838	成都银行	1,100	18,821.00	0.09
278	600618	氯碱化工	1,900	18,734.00	0.09
279	000026	飞亚达	1,800	18,666.00	0.09
280	600739	辽宁成大	1,800	18,630.00	0.09
281	001286	陕西能源	2,000	18,560.00	0.09
282	601866	中远海发	7,100	18,531.00	0.09
283	601369	陕鼓动力	2,100	18,270.00	0.09
284	601619	嘉泽新能	5,500	18,260.00	0.09
285	688093	世华科技	900	18,171.00	0.09
286	300160	秀强股份	3,300	17,952.00	0.09
287	688566	吉贝尔	800	17,920.00	0.09
288	301359	东南电子	800	17,904.00	0.09
289	600521	华海药业	1,000	17,870.00	0.09
290	002537	海联金汇	3,100	17,825.00	0.09
291	002286	保龄宝	2,400	17,712.00	0.09
292	603080	新疆火炬	1,100	17,688.00	0.09
293	002190	成飞集成	900	17,406.00	0.09
294	600141	兴发集团	800	17,360.00	0.09
295	300092	科新机电	1,500	17,310.00	0.08
296	300320	海达股份	1,800	17,280.00	0.08
297	000036	华联控股	4,200	17,136.00	0.08
298	603179	新泉股份	400	17,080.00	0.08
299	600909	华安证券	2,800	16,968.00	0.08
300	002129	TCL 中环	1,900	16,853.00	0.08
301	601163	三角轮胎	1,100	16,577.00	0.08
302	600050	中国联通	3,100	16,461.00	0.08
303	688135	利扬芯片	800	16,056.00	0.08
304	301170	锡南科技	700	16,044.00	0.08
305	000652	泰达股份	3,800	15,732.00	0.08
306	300979	华利集团	200	15,730.00	0.08
307	002682	龙洲股份	3,700	15,651.00	0.08
308	600350	山东高速	1,500	15,420.00	0.08
309	605169	洪通燃气	1,500	15,255.00	0.07

310	301072	中捷精工	800	15,152.00	0.07
311	601958	金钼股份	1,500	15,090.00	0.07
312	002008	大族激光	600	15,000.00	0.07
313	603058	永吉股份	1,700	14,994.00	0.07
314	688697	纽威数控	900	14,976.00	0.07
315	000883	湖北能源	3,000	14,940.00	0.07
316	300611	美力科技	1,400	14,798.00	0.07
317	600573	惠泉啤酒	1,300	14,638.00	0.07
318	600351	亚宝药业	2,400	14,616.00	0.07
319	002958	青农商行	4,800	14,592.00	0.07
320	000100	TCL 科技	2,900	14,587.00	0.07
321	603035	常熟汽饰	1,000	14,390.00	0.07
322	688699	明微电子	400	14,376.00	0.07
323	688586	江航装备	1,500	14,355.00	0.07
324	002978	安宁股份	500	14,210.00	0.07
325	300971	博亚精工	700	14,210.00	0.07
326	300673	佩蒂股份	800	14,184.00	0.07
327	688070	纵横股份	400	14,120.00	0.07
328	688138	清溢光电	616	14,106.40	0.07
329	000153	丰原药业	2,300	14,099.00	0.07
330	002483	润邦股份	2,700	14,067.00	0.07
331	000830	鲁西化工	1,200	14,028.00	0.07
332	300014	亿纬锂能	300	14,022.00	0.07
333	300821	东岳硅材	1,800	13,968.00	0.07
334	600592	龙溪股份	1,400	13,832.00	0.07
335	300132	青松股份	2,800	13,804.00	0.07
336	000933	神火股份	800	13,520.00	0.07
337	688599	天合光能	700	13,510.00	0.07
338	002438	江苏神通	1,100	13,420.00	0.07
339	000738	航发控制	600	13,344.00	0.07
340	002282	博深股份	1,800	13,338.00	0.07
341	301225	恒勃股份	500	13,270.00	0.07
342	300174	元力股份	900	13,248.00	0.06
343	001331	胜通能源	1,200	13,212.00	0.06
344	301133	金钟股份	600	13,188.00	0.06
345	688126	沪硅产业	700	13,174.00	0.06
346	603515	欧普照明	800	13,160.00	0.06
347	002648	卫星化学	700	13,153.00	0.06
348	600428	中远海特	1,800	13,140.00	0.06
349	300515	三德科技	1,100	13,101.00	0.06
350	300428	立中集团	800	13,040.00	0.06
351	002961	瑞达期货	900	12,933.00	0.06
352	001311	多利科技	500	12,895.00	0.06
353	002138	顺络电子	400	12,592.00	0.06

354	601766	中国中车	1,500	12,570.00	0.06
355	300545	联得装备	400	12,532.00	0.06
356	300408	三环集团	300	11,553.00	0.06
357	000960	锡业股份	800	11,224.00	0.06
358	688596	正帆科技	300	10,665.00	0.05

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000729	燕京啤酒	1,032,164.99	5.06
2	002001	新和成	1,023,799.00	5.02
3	002241	歌尔股份	1,021,638.00	5.01
4	000651	格力电器	977,172.00	4.79
5	688608	恒玄科技	957,092.86	4.69
6	688676	金盘科技	932,939.22	4.58
7	000933	神火股份	914,439.00	4.49
8	601919	中远海控	910,100.00	4.46
9	605333	沪光股份	907,797.00	4.45
10	002532	天山铝业	899,331.00	4.41
11	000921	海信家电	891,588.00	4.37
12	600519	贵州茅台	870,850.00	4.27
13	000596	古井贡酒	870,251.00	4.27
14	603993	洛阳钼业	847,068.00	4.16
15	300573	兴齐眼药	819,311.04	4.02
16	300308	中际旭创	810,076.00	3.97
17	600941	中国移动	808,486.00	3.97
18	600660	福耀玻璃	798,155.00	3.92
19	002262	恩华药业	791,792.00	3.88
20	688578	艾力斯	778,922.07	3.82
21	688111	金山办公	763,792.72	3.75
22	300373	扬杰科技	762,222.00	3.74
23	600050	中国联通	741,692.00	3.64
24	600741	华域汽车	739,417.00	3.63
25	002128	电投能源	718,520.00	3.52
26	601138	工业富联	710,239.00	3.48
27	000899	赣能股份	706,287.00	3.46
28	605499	东鹏饮料	705,450.00	3.46

29	300750	宁德时代	688,267.00	3.38
30	600028	中国石化	682,524.00	3.35
31	000338	潍柴动力	679,810.00	3.33
32	002444	巨星科技	678,364.00	3.33
33	001309	德明利	677,313.00	3.32
34	600710	苏美达	676,374.00	3.32
35	603986	兆易创新	661,331.00	3.24
36	300394	天孚通信	647,865.00	3.18
37	603477	巨星农牧	644,444.00	3.16
38	300783	三只松鼠	642,845.00	3.15
39	601336	新华保险	640,968.00	3.14
40	600160	巨化股份	640,291.00	3.14
41	603501	韦尔股份	633,191.00	3.11
42	600702	舍得酒业	632,340.00	3.10
43	300207	欣旺达	630,059.00	3.09
44	002984	森麒麟	628,359.00	3.08
45	002475	立讯精密	623,147.00	3.06
46	600183	生益科技	623,145.00	3.06
47	002273	水晶光电	619,590.00	3.04
48	688017	绿的谐波	619,243.45	3.04
49	300638	广和通	615,655.00	3.02
50	601500	通用股份	614,978.00	3.02
51	600938	中国海油	610,119.00	2.99
52	000538	云南白药	600,422.40	2.95
53	300476	胜宏科技	588,138.00	2.88
54	601633	长城汽车	587,284.00	2.88
55	001286	陕西能源	572,493.00	2.81
56	603688	石英股份	572,440.00	2.81
57	688612	威迈斯	571,964.74	2.81
58	002130	沃尔核材	567,047.00	2.78
59	688169	石头科技	565,289.00	2.77
60	601318	中国平安	565,228.00	2.77
61	605198	安德利	563,331.00	2.76
62	000333	美的集团	562,411.00	2.76
63	600999	招商证券	555,398.00	2.72
64	000426	兴业银锡	555,395.00	2.72
65	601666	平煤股份	551,180.00	2.70
66	300775	三角防务	543,049.00	2.66
67	601319	中国人保	539,426.00	2.65
68	601601	中国太保	538,438.00	2.64
69	002922	伊戈尔	529,105.00	2.60
70	000807	云铝股份	527,255.05	2.59
71	601677	明泰铝业	525,267.00	2.58
72	002155	湖南黄金	521,188.00	2.56

73	600066	宇通客车	518,617.00	2.54
74	688498	源杰科技	517,977.17	2.54
75	601728	中国电信	513,543.00	2.52
76	601665	齐鲁银行	512,779.00	2.52
77	000818	航锦科技	505,019.00	2.48
78	300979	华利集团	504,677.00	2.48
79	600088	中视传媒	498,356.00	2.44
80	601600	中国铝业	489,099.00	2.40
81	603486	科沃斯	488,031.00	2.39
82	600893	航发动力	485,645.00	2.38
83	300122	智飞生物	485,304.00	2.38
84	002916	深南电路	482,604.00	2.37
85	600958	东方证券	481,140.00	2.36
86	600276	恒瑞医药	480,911.00	2.36
87	601607	上海医药	480,315.00	2.36
88	002003	伟星股份	479,274.00	2.35
89	300502	新易盛	471,671.00	2.31
90	300408	三环集团	470,632.00	2.31
91	600487	亨通光电	469,065.00	2.30
92	000568	泸州老窖	468,679.00	2.30
93	300857	协创数据	468,155.00	2.30
94	601222	林洋能源	468,132.00	2.30
95	600129	太极集团	465,673.00	2.28
96	600096	云天化	465,538.80	2.28
97	603871	嘉友国际	464,119.00	2.28
98	301510	固高科技	461,492.00	2.26
99	300699	光威复材	461,266.00	2.26
100	600219	南山铝业	459,883.00	2.26
101	002368	太极股份	456,371.00	2.24
102	601595	上海电影	453,443.00	2.22
103	002078	太阳纸业	450,989.00	2.21
104	601088	中国神华	448,961.00	2.20
105	300433	蓝思科技	448,868.00	2.20
106	601800	中国交建	443,562.00	2.18
107	301589	诺瓦星云	441,079.00	2.16
108	688766	普冉股份	437,319.30	2.15
109	600585	海螺水泥	433,002.00	2.12
110	000858	五粮液	431,765.00	2.12
111	688188	柏楚电子	429,487.05	2.11
112	600031	三一重工	427,100.00	2.10
113	301004	嘉益股份	424,772.00	2.08
114	601168	西部矿业	418,379.00	2.05
115	600398	海澜之家	417,741.00	2.05
116	600362	江西铜业	416,216.00	2.04

117	601186	中国铁建	414,607.00	2.03
118	600566	济川药业	412,521.00	2.02
119	002422	科伦药业	410,394.00	2.01

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002241	歌尔股份	1,086,088.00	5.33
2	000921	海信家电	1,078,791.00	5.29
3	688608	恒玄科技	1,051,929.38	5.16
4	000596	古井贡酒	992,949.00	4.87
5	000933	神火股份	989,627.00	4.85
6	000651	格力电器	967,566.00	4.75
7	688676	金盘科技	951,824.38	4.67
8	605333	沪光股份	947,096.00	4.65
9	603993	洛阳钼业	927,298.00	4.55
10	000729	燕京啤酒	896,432.00	4.40
11	600519	贵州茅台	893,219.00	4.38
12	601919	中远海控	890,068.00	4.37
13	600660	福耀玻璃	870,910.00	4.27
14	688578	艾力斯	866,370.32	4.25
15	002532	天山铝业	866,271.00	4.25
16	002130	沃尔核材	857,272.00	4.21
17	002001	新和成	850,948.00	4.17
18	300308	中际旭创	827,861.00	4.06
19	600941	中国移动	812,669.00	3.99
20	300573	兴齐眼药	811,735.00	3.98
21	688111	金山办公	811,666.31	3.98
22	300394	天孚通信	793,125.00	3.89
23	001309	德明利	790,441.00	3.88
24	600160	巨化股份	787,613.00	3.86
25	300638	广和通	752,227.00	3.69
26	002262	恩华药业	751,981.00	3.69
27	688017	绿的谐波	751,691.31	3.69
28	605499	东鹏饮料	745,389.20	3.66
29	603986	兆易创新	740,958.00	3.63
30	603477	巨星农牧	732,736.00	3.59
31	300750	宁德时代	731,009.00	3.59
32	300775	三角防务	727,670.00	3.57

33	600710	苏美达	724,266.00	3.55
34	600050	中国联通	722,934.00	3.55
35	000899	赣能股份	713,642.00	3.50
36	600702	舍得酒业	709,831.00	3.48
37	601500	通用股份	706,373.00	3.46
38	600999	招商证券	702,849.00	3.45
39	000426	兴业银锡	698,346.00	3.43
40	688612	威迈斯	697,544.69	3.42
41	600028	中国石化	695,049.00	3.41
42	600183	生益科技	687,634.00	3.37
43	601666	平煤股份	677,061.00	3.32
44	300476	胜宏科技	669,482.00	3.28
45	002444	巨星科技	666,361.00	3.27
46	300857	协创数据	660,635.00	3.24
47	300783	三只松鼠	641,552.00	3.15
48	688169	石头科技	640,216.09	3.14
49	000338	潍柴动力	639,501.00	3.14
50	605198	安德利	638,697.00	3.13
51	600741	华域汽车	636,624.20	3.12
52	300373	扬杰科技	615,811.00	3.02
53	002984	森麒麟	614,958.00	3.02
54	002922	伊戈尔	595,374.00	2.92
55	301510	固高科技	592,314.00	2.91
56	600938	中国海油	589,800.00	2.89
57	001286	陕西能源	588,117.33	2.88
58	002475	立讯精密	587,123.00	2.88
59	000333	美的集团	575,351.00	2.82
60	601138	工业富联	572,615.00	2.81
61	600066	宇通客车	571,897.00	2.81
62	688766	普冉股份	570,095.51	2.80
63	300207	欣旺达	566,260.00	2.78
64	000568	泸州老窖	547,018.00	2.68
65	603688	石英股份	536,250.00	2.63
66	002155	湖南黄金	534,499.00	2.62
67	002128	电投能源	528,563.00	2.59
68	603486	科沃斯	526,694.00	2.58
69	002273	水晶光电	524,498.00	2.57
70	601728	中国电信	523,106.00	2.57
71	603501	韦尔股份	505,828.00	2.48
72	600958	东方证券	505,303.00	2.48
73	600276	恒瑞医药	504,450.00	2.47
74	300979	华利集团	499,857.00	2.45
75	002003	伟星股份	497,663.00	2.44
76	300003	乐普医疗	496,208.00	2.43

77	301004	嘉益股份	495,281.00	2.43
78	601336	新华保险	492,366.00	2.42
79	601595	上海电影	491,187.00	2.41
80	601600	中国铝业	490,004.00	2.40
81	300408	三环集团	483,114.00	2.37
82	601633	长城汽车	481,042.00	2.36
83	301589	诺瓦星云	471,284.00	2.31
84	000538	云南白药	469,768.00	2.30
85	000818	航锦科技	469,597.00	2.30
86	601607	上海医药	469,378.00	2.30
87	300502	新易盛	468,263.00	2.30
88	600088	中视传媒	466,480.00	2.29
89	600893	航发动力	465,146.00	2.28
90	600398	海澜之家	464,047.00	2.28
91	688498	源杰科技	463,331.45	2.27
92	603871	嘉友国际	463,138.00	2.27
93	600219	南山铝业	459,602.00	2.25
94	000922	佳电股份	459,462.00	2.25
95	002916	深南电路	459,130.00	2.25
96	600129	太极集团	457,725.00	2.25
97	600422	昆药集团	452,562.00	2.22
98	688188	柏楚电子	450,094.10	2.21
99	601665	齐鲁银行	448,703.00	2.20
100	300699	光威复材	445,889.00	2.19
101	601319	中国人保	444,093.00	2.18
102	600362	江西铜业	438,481.00	2.15
103	300122	智飞生物	433,345.00	2.13
104	601318	中国平安	431,166.00	2.11
105	600096	云天化	430,436.00	2.11
106	002078	太阳纸业	427,708.00	2.10
107	002368	太极股份	425,131.00	2.09
108	601899	紫金矿业	419,334.00	2.06
109	600298	安琪酵母	419,198.00	2.06
110	603063	禾望电气	418,357.00	2.05
111	600566	济川药业	417,504.00	2.05
112	600487	亨通光电	416,321.00	2.04
113	601898	中煤能源	416,313.00	2.04
114	600690	海尔智家	414,265.00	2.03
115	002384	东山精密	413,786.00	2.03
116	600062	华润双鹤	409,041.00	2.01
117	601677	明泰铝业	407,810.00	2.00

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交量)填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 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	186,677,352.94
卖出股票的收入（成交）总额	174,521,731.70

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的。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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，通过多头或

空头套期保值等策略进行套期保值操作。国债期货相关投资严格遵循法律法规及中国证监会的规定。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，新华人寿保险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北京市分行的处罚。

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。

**8.12.2** 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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末无其他资产。

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期末前十名股票中未存在流通受限情况。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	持有份额	占总份

				额比例		额比例
海富通量化选股混合 A	55	44,818.40	-	-	2,465,012.08	100.00 %
海富通量化选股混合 C	455	37,809.87	477,557.35	2.78%	16,725,934.61	97.22%
合计	510	38,565.69	477,557.35	2.43%	19,190,946.69	97.57%

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)。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通量化选股混合 A	98,832.23	4.0094%
	海富通量化选股混合 C	5,000.23	0.0291%
	合计	103,832.46	0.5279%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海富通量化选股混合 A	0~10
	海富通量化选股混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通量化选股混合 A	0~10
	海富通量化选股混合 C	0
	合计	0~10

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通量化选股混合 A	海富通量化选股混合 C
----	-------------	-------------

基金合同生效日（2024 年 7 月 23 日）基金份额总额	17,320,781.55	215,166,739.37
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	40,455.34	1,984,169.87
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	14,896,224.81	199,947,417.28
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,465,012.08	17,203,491.96

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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：

2024 年 9 月 4 日，海富通基金管理有限公司发布公告，路颖女士自 2024 年 9 月 2 日起担任公司董事长，杨仓兵先生因退休不再担任公司董事长。

2024 年 12 月 11 日，海富通基金管理有限公司发布公告，周小波先生自 2024 年 12 月 9 日起担任公司副总经理。

基金托管人：

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。本年度应支付的审计费用是 24,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续

年限是 1 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 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。

### 11.6.2 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	4	254,150,777.42	70.36%	112,179.40	70.35%	-
中信证券(山 东)	2	107,048,307.22	29.64%	47,285.00	29.65%	-

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式，可免于执行《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》关于交易佣金分仓的规定。

2、基金管理人根据监管规定选择具备证券经纪业务资格的证券公司，并签订证券经纪服务协议。

### 11.7.2 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	-	-	19,998,0 00.00	76.92%	-	-
中信证券(山 东)	-	-	6,000,00 0.00	23.08%	-	-

## 11.8 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	海富通量化选股混合型证券投资基金基金份额发售公告	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	2024-06-17
2	海富通基金管理有限公司关于海富通量化选股混合型证券投资基金新增江海证券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	2024-06-27
3	关于海富通量化选股混合型证券投资基金延长募集期的公告	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	2024-07-04
4	海富通量化选股混合型证券投资基金基金合同生效公告	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	2024-07-24
5	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	2024-09-04
6	海富通量化选股混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	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	2024-09-18
7	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	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	2024-09-30
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金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	2024-10-11
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商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	2024-10-25
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海长量基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网	2024-11-05

	公告	站	
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国泰君安证券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	2024-11-26
12	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	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	2024-12-11

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 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 124 只公募基金。截至 2024 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1722 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”。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通量化选股混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通量化选股混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通量化选股混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通量化选股混合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

### 13.2 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

### 13.3 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  
二〇二五年三月三十一日