

**海富通量化选股混合型证券投资基金  
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：中信证券股份有限公司

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。

基金托管人中信证券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**

<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	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	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
<b>§ 5 托管人报告</b>	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的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	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	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b>	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54

---

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	56
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>57</b>
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## §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	10,219,407.30 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	1,655,354.62 份	8,564,052.68 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> <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。</p>
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	杨军智
	联系电话	021-38650788	010-60834299
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	yjz@citics.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		谢乐斌	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
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	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）	
	海富通量化选股混合 A	海富通量化选股混合 C

本期已实现收益	36,497.75	110,249.72
本期利润	167,498.83	805,643.77
加权平均基金份额本期利润	0.0858	0.0677
本期加权平均净值利润率	8.20%	6.50%
本期基金份额净值增长率	9.10%	8.83%
报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	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	220,301.41	1,093,470.02
期末可供分配基金份额利润	0.1331	0.1277
期末基金资产净值	1,875,656.03	9,657,522.70
期末基金份额净值	1.1331	1.1277
报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
<b>3.1.3 累计期末指标</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	13.31%	12.77%

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
过去一个月	7.12%	0.83%	2.40%	0.50%	4.72%	0.33%
过去三个月	7.32%	1.57%	1.14%	0.98%	6.18%	0.59%
过去六个月	9.10%	1.31%	1.65%	0.89%	7.45%	0.42%
自基金合同生效起至今	13.31%	1.13%	12.74%	1.17%	0.57%	-0.04%

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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.07%	0.83%	2.40%	0.50%	4.67%	0.33%
过去三个月	7.20%	1.57%	1.14%	0.98%	6.06%	0.59%

过去六个月	8.83%	1.31%	1.65%	0.89%	7.18%	0.42%
自基金合同生效起至今	12.77%	1.13%	12.74%	1.17%	0.03%	-0.04%

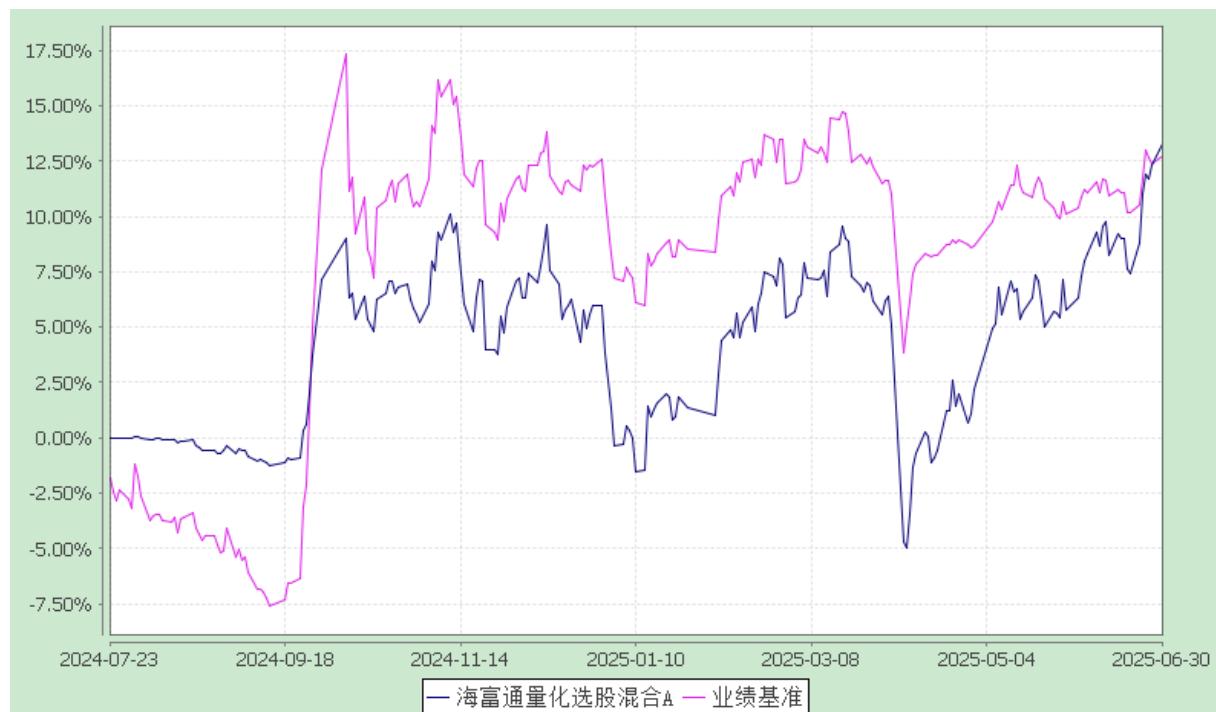
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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历史走势对比图

(2024 年 7 月 23 日至 2025 年 6 月 30 日)

海富通量化选股混合 A



海富通量化选股混合 C



- 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，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

## §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、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		
李自悟	本基金的基金经理；量化投资部副总监。	2024-07-2 3	-	17 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 月起任海富通中证 500 增强基金经理。2023 年 2 月至 2025 年 3 月兼任海富通量化先锋股票基金经理。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。2025 年 3 月起兼任海富通欣益混合基金经理。

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 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年国内经济呈现温和复苏的良好趋势，一二季度 GDP 增长分别为 5.4% 和 5.2%，均位于 5% 以上。生产端，1-6 月规模以上工业增加值增速回升至 6.4%，特别是高技术制造业增长迅猛。在此推动下，工业企业盈利状况得到改善，1-6 月规模以上工业企业利润同比降幅收窄至 1.8%。需求端，出口和国内消费均保持了正增长。出口虽然受到关税博弈的影响，但除 2 月外均保证了较高的增速。社会零售在消费补贴的助力下也逐步走强。政策方面，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，扩张的财政政策有力地支撑了上半年经济的总体修复。

海外方面的演进则主要围绕着关税政策调整、货币政策分化和地缘政治博弈三条主线。一方面，

关税博弈和地缘冲突给市场带来了冲击和波动。另一方面欧美经济数据边际走弱和欧央行的降息操作，打开了市场对于美联储货币政策转向的预期。在此大背景下，美国政府和美联储围绕降息节奏的博弈无疑给市场注入了更多的不确定性。

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%，整体小幅上涨。但以中证 2000 为代表的中小盘指数表现亮眼，中证 2000 年内上涨 15.24%，在宽基指数中位居前列。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。市场整体呈现先抑后扬的节奏，交投保持活跃，市场风险偏好回升明显。

基金投资策略方面，本基金通过量化模型优选个股，通过风险模型限制行业和风格暴露，保持投资组合风格稳定。上半年市场风格变化剧烈，但总体而言小市值和成长风格占优，有利于量化策略的表现。我们秉持获取稳健、可持续超额的理念，积极调整模型，较好地把握住了获取超额的机会。在策略层面，我们积极探索新的数据源，拓展超额来源，在选股模型、行业择时和风格配置等方面持续提升。

#### 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 9.10%，同期业绩比较基准收益率为 1.65%。海富通量化选股混合 C 净值增长率为 8.83%，同期业绩比较基准收益率为 1.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于下半年，我们认为权益市场的热度仍将持续。得益于经济整体的复苏态势，特别是在一系列扩张性政策的推动下，预计国内经济下半年仍将保持不错的增速，全年 GDP 实现 5%以上增速的概率较大。从行业中观层面来看，在当下“反内卷”的风潮下，供需失衡产能逐步出清，市场竞争格局改善，或将帮助企业利润在下半年由负转正。从更长周期来看，随着国内产业升级渐入佳境，我国制造业的产品竞争力和盈利能力将由量变带来质变，这对权益市场的估值和盈利将带来双重贡献。

在经历了前期的市场调整后，市场的悲观预期从去年九月底以来也已经有了明显改善。当下市场流动性充裕，市场热点层出不穷，从年初的 Deepseek、人工智能，到二季度的光模块、创新药等，各种主题都在逐步提升大众对于权益市场的想象力。从资金流向来看，不管是外资还是交易型资金都在积极入场，种种迹象都显示国内权益市场正在逐步复苏。

诚然，展望下半年外部环境还存在一定的不确定性，上半年影响市场的一些因素仍将存在，不管是关税博弈、地缘冲突，还是货币政策的分化。但今年的市场，在一项项历史性突破的刺激下，明显打破了原有的循环路径。信心就是黄金，而眼下我们正在经历着信心的历史性重塑。

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

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

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同规定，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。

本基金报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

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

自 2024 年 10 月 23 日至 2025 年 6 月 30 日，本基金连续超过六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人已根据法规要求向中国证券监督管理委员会上海监管局报告并提出解决方案。

自 2025 年 1 月 15 日起，由基金管理人承担本基金项下相关固定费用。

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，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中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：海富通量化选股混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,508,216.52	2,265,498.37
结算备付金		16,504.88	66,240.03
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	10,382,259.79	18,609,661.86
其中：股票投资		10,382,259.79	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		3,922.72	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	13,725.73	-

<b>资产总计</b>		11,924,629.64	20,941,400.26
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年6月30日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		360,564.06	433,726.68
应付管理人报酬		10,575.63	24,399.46
应付托管费		1,762.60	4,066.59
应付销售服务费		3,637.43	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	6.4.7.6	14,911.19	84,000.00
负债合计		391,450.91	555,238.28
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	10,219,407.30	19,668,504.04
未分配利润	6.4.7.8	1,313,771.43	717,657.94
净资产合计		11,533,178.73	20,386,161.98
负债和净资产总计		11,924,629.64	20,941,400.26

注: 报告截止日 2025 年 6 月 30 日, A 类基金份额净值 1.1331 元, C 类基金份额净值 1.1277 元。  
 基金份额总额 10,219,407.30 份, 其中 A 类基金份额 1,655,354.62 份, C 类基金份额 8,564,052.68 份。

## 6.2 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: 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
<b>一、营业总收入</b>		1,106,481.80
1.利息收入		2,304.66
其中: 存款利息收入	6.4.7.9	2,304.66
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		277,473.38

其中：股票投资收益	6.4.7.10		175,979.08
基金投资收益			-
债券投资收益	6.4.7.11		-
资产支持证券投资收益			-
贵金属投资收益	6.4.7.12		-
衍生工具收益	6.4.7.13		-
股利收益	6.4.7.14		101,494.30
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		826,395.13
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		308.63
<b>减：二、营业总支出</b>			133,339.20
1. 管理人报酬			86,695.19
2. 托管费			14,449.19
3. 销售服务费			31,030.15
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			-
8. 其他费用	6.4.7.17		1,164.67
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>			<b>973,142.60</b>
减：所得税费用			-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>			<b>973,142.60</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>			-
<b>六、综合收益总额</b>			973,142.60

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。

### 6.3 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：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	19,668,504.04	-	717,657.94	20,386,161.9

产				8
二、本期期初净资产	19,668,504.04	-	717,657.94	20,386,161.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,449,096.74	-	596,113.49	-8,852,983.25
(一)、综合收益总额	-	-	973,142.60	973,142.60
(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）	-9,449,096.74	-	-377,029.11	-9,826,125.85
其中：1.基金申购款	3,728,912.97	-	327,826.76	4,056,739.73
2.基金赎回款	-13,178,009.71	-	-704,855.87	-13,882,865.58
(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	10,219,407.30	-	1,313,771.43	11,533,178.73

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。

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 8 月 29 日批准报出。

#### 6.4.2 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。

根据《公开募集证券投资基金管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2025 年 6 月 30 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案，故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

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 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》、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。

#### 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	617,643.68
等于： 本金	617,498.34
加： 应计利息	145.34
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	890,572.84
等于： 本金	890,561.16
加： 应计利息	11.68
合计	1,508,216.52

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。

##### 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	10,037,100.71	-	10,382,259.79	345,159.08
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	10,037,100.71	-	10,382,259.79	345,159.08

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应收利息	-
其他应收款	13,725.73
待摊费用	-
合计	13,725.73

#### 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	0.10
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	14,876.39
其他	34.70
合计	14,911.19

#### 6.4.7.7 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	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,465,012.08	2,465,012.08
本期申购	12,538.04	12,538.04
本期赎回（以“-”号填列）	-822,195.50	-822,195.50
本期末	1,655,354.62	1,655,354.62

海富通量化选股混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,203,491.96	17,203,491.96
本期申购	3,716,374.93	3,716,374.93
本期赎回（以“-”号填列）	-12,355,814.21	-12,355,814.21
本期末	8,564,052.68	8,564,052.68

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
上年度末	283,670.69	-188,603.45	95,067.24
本期期初	283,670.69	-188,603.45	95,067.24
本期利润	36,497.75	131,001.08	167,498.83
本期基金份额交易产生的变动数	-78,670.36	36,405.70	-42,264.66
其中：基金申购款	1,320.91	-824.22	496.69
基金赎回款	-79,991.27	37,229.92	-42,761.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	241,498.08	-21,196.67	220,301.41

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
上年度末	1,936,523.17	-1,313,932.47	622,590.70
本期期初	1,936,523.17	-1,313,932.47	622,590.70
本期利润	110,249.72	695,394.05	805,643.77
本期基金份额交易产生的变动数	-842,664.88	507,900.43	-334,764.45
其中：基金申购款	495,461.49	-168,131.42	327,330.07
基金赎回款	-1,338,126.37	676,031.85	-662,094.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,204,108.01	-110,637.99	1,093,470.02

#### 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	1,581.17
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	458.64
结算备付金利息收入	264.85
其他	-
合计	2,304.66

#### 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	106,825,141.58
减： 卖出股票成本总额	106,490,573.89
减： 交易费用	158,588.61
买卖股票差价收入	175,979.08

#### 6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	101,494.30
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	101,494.30

#### 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	826,395.13
——股票投资	826,395.13
——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	826,395.13
----	------------

#### 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	308.63
合计	308.63

#### 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	1,150.66
信息披露费	-
证券出借违约金	-
证券组合费	14.01
合计	1,164.67

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，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、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
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
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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	152,434,309.37	74.63%
中信证券（山东）	51,827,608.90	25.37%

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。

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	67,278.83	74.64%	-	-
中信证券（山东）	22,855.54	25.36%	-	-

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。

#### 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
当期发生的基金应支付的管理费	86,695.19
其中：应支付销售机构的客户维护费	40,597.74
应支付基金管理人的净管理费	46,097.45

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。

##### 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
当期发生的基金应支付的托管费	14,449.19

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。

#### 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		
	海富通量化选股混合 A	海富通量化选股混合 C	合计
中信证券	-	19,548.69	19,548.69
海富通	-	109.81	109.81
国泰海通证券	-	2,529.93	2,529.93
合计	-	22,188.43	22,188.43

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 ×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。

#### 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。

#### 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

本基金本报告期内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。

##### 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

本基金本报告期内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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内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。

##### 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

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。

#### 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	
	期末余额	当期利息收入
中信证券	1,508,216.52	2,039.81

注：1、本基金的活期存款 617,643.68 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 890,572.84 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。

#### 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。

#### 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）3,200 股，交易金额为人民币 54,496.00 元。于本报告期末，本基金未持有国泰海通证券发行的股票。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。

#### 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

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。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期内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。

#### 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，本基金未持有债券和资产支持证券（2024 年 12 月 31 日：同）。

#### **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 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。

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。

##### 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	1,508,216.52	-	-	-	1,508,216.52
结算备付金	16,504.88	-	-	-	16,504.88
交易性金融资产	-	-	-	10,382,259.79	10,382,259.79

应收股利	-	-	-	3,922.72	3,922.72
其他资产	-	-	-	13,725.73	13,725.73
资产总计	1,524,721.40	-	-	10,399,908.24	11,924,629.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	360,564.06	360,564.06
应付管理人报酬	-	-	-	10,575.63	10,575.63
应付托管费	-	-	-	1,762.60	1,762.60
应付销售服务费	-	-	-	3,637.43	3,637.43
其他负债	-	-	-	14,911.19	14,911.19
负债总计	-	-	-	391,450.91	391,450.91
利率敏感度缺口	1,524,721.40	-	-	10,008,457.33	11,533,178.73
上年度末 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：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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末		
	2025年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	933,988.19	933,988.19
资产合计	-	933,988.19	933,988.19
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	933,988.19	933,988.19
项目	上年度末		
	2024年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
资产合计	-	-	-
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-

资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	-	-
-----------------------	---	---	---

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设 分析	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）		上年度末 2024 年 12 月 31 日
相关风险变量的变动	本期末 2025 年 6 月 30 日		
1. 所有外币相对人民币升值 5%	46,699.41		-
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-46,699.41		-

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，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。

#### 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		上年度末	
	2025 年 6 月 30 日	2024 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日	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	10,382,259.7 9	90.02	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	10,382,259.7 9	90.02	18,609,661.86	91.29

#### 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%	576,497.76	1,040,619.92
	2.业绩比较基准下降 5%	-576,497.76	-1,040,619.92

### 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	10,382,259.79	18,609,661.86

第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	10,382,259.79	18,609,661.86

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券等，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，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2024 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融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。

#### 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	10,382,259.79	87.07
	其中：股票	10,382,259.79	87.07
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	1,524,721.40	12.79
8	其他各项资产	17,648.45	0.15
9	合计	11,924,629.64	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 933,988.19 元，占资产净值比例为 8.10%。

## 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	35,434.00	0.31
B	采矿业	106,807.00	0.93
C	制造业	6,531,484.80	56.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	127,620.00	1.11
E	建筑业	144,507.00	1.25
F	批发和零售业	184,406.00	1.60
G	交通运输、仓储和邮政业	184,505.00	1.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	760,817.80	6.60
J	金融业	260,761.00	2.26
K	房地产业	343,921.00	2.98
L	租赁和商务服务业	146,851.00	1.27
M	科学研究和技术服务业	291,679.00	2.53
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	12,096.00	0.10
Q	卫生和社会工作	12,600.00	0.11

R	文化、体育和娱乐业	215,109.00	1.87
S	综合	89,673.00	0.78
	合计	9,448,271.60	81.92

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
能源	16,159.75	0.14
原材料	58,414.96	0.51
工业	7,332.08	0.06
非日常生活消费品	272,961.23	2.37
日常消费品	34,471.71	0.30
医疗保健	155,195.65	1.35
金融	22,762.27	0.20
信息技术	232,816.28	2.02
通信服务	133,874.26	1.16
合计	933,988.19	8.10

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	00981	中芯国际	1,500	61,146.25	0.53
1	688981	中芯国际	600	52,902.00	0.46
2	00700	腾讯控股	200	91,742.17	0.80
3	01810	小米集团－W	1,600	87,474.24	0.76
4	603259	药明康德	1,200	83,460.00	0.72
5	000063	中兴通讯	2,500	81,225.00	0.70
6	002638	勤上股份	30,100	79,163.00	0.69
7	600104	上汽集团	4,800	77,040.00	0.67
8	002344	海宁皮城	17,100	74,214.00	0.64
9	603808	歌力思	8,800	73,040.00	0.63
10	600757	长江传媒	7,700	71,456.00	0.62
11	603700	宁水集团	5,800	69,484.00	0.60
12	301045	天禄科技	3,000	68,700.00	0.60
13	600983	惠而浦	6,600	68,508.00	0.59
14	000100	TCL 科技	15,800	68,414.00	0.59
15	600241	时代万恒	6,400	68,160.00	0.59
16	601096	宏盛华源	16,400	67,896.00	0.59

17	600941	中国移动	600	67,530.00	0.59
18	000553	安道麦 A	9,300	67,146.00	0.58
19	300556	丝路视觉	3,300	65,571.00	0.57
20	000156	华数传媒	8,000	63,520.00	0.55
21	300425	中建环能	12,100	63,404.00	0.55
22	600675	中华企业	21,100	60,768.00	0.53
23	002761	浙江建投	6,800	60,316.00	0.52
24	09988	阿里巴巴-W	600	60,079.27	0.52
25	600050	中国联通	11,200	59,808.00	0.52
26	603311	金海高科	5,400	59,724.00	0.52
27	605305	中际联合	2,100	58,338.00	0.51
28	300686	智动力	5,800	57,942.00	0.50
29	002893	京能热力	5,400	57,726.00	0.50
30	300140	节能环保	9,300	57,381.00	0.50
31	300732	设研院	7,900	57,038.00	0.49
32	600159	大龙地产	20,600	56,650.00	0.49
33	688041	海光信息	400	56,516.00	0.49
34	002787	华源控股	6,900	56,373.00	0.49
35	600791	京能置业	11,900	56,287.00	0.49
36	600408	安泰集团	27,000	55,620.00	0.48
37	002702	海欣食品	13,300	55,594.00	0.48
38	000725	京东方 A	13,900	55,461.00	0.48
39	600683	京投发展	14,200	54,670.00	0.47
40	600288	大恒科技	5,300	54,484.00	0.47
41	002999	天禾股份	7,800	54,444.00	0.47
42	301359	东南电子	2,640	54,357.60	0.47
43	300274	阳光电源	800	54,216.00	0.47
44	002597	金禾实业	2,300	54,165.00	0.47
45	600866	星湖科技	7,800	53,898.00	0.47
46	600335	国机汽车	8,300	53,535.00	0.46
47	600491	龙元建设	14,200	52,256.00	0.45
48	605180	华生科技	3,500	51,800.00	0.45
49	301446	福事特	2,200	51,788.00	0.45
50	603778	国晟科技	15,400	51,744.00	0.45
51	600620	天宸股份	9,300	50,778.00	0.44
52	300780	德恩精工	3,100	49,879.00	0.43
53	300813	泰林生物	2,300	49,243.00	0.43
54	002484	江海股份	2,400	49,176.00	0.43
55	003008	开普检测	2,300	48,875.00	0.42
56	600067	冠城新材	16,400	48,872.00	0.42
57	09992	泡泡玛特	200	48,625.17	0.42
58	002694	顾地科技	9,900	48,411.00	0.42
59	601996	丰林集团	22,300	48,391.00	0.42
60	603230	内蒙新华	3,700	47,767.00	0.41

61	301353	普莱得	1,860	47,095.20	0.41
62	002587	奥拓电子	7,300	47,085.00	0.41
63	600742	富维股份	4,900	46,599.00	0.40
64	300080	易成新能	11,000	45,980.00	0.40
65	603766	隆鑫通用	3,600	45,936.00	0.40
66	03690	美团-W	400	45,706.93	0.40
67	001373	翔腾新材	1,500	45,060.00	0.39
68	600569	安阳钢铁	22,900	44,884.00	0.39
69	600383	金地集团	11,800	44,722.00	0.39
70	605258	协和电子	1,400	43,610.00	0.38
71	300365	恒华科技	6,600	43,494.00	0.38
72	000333	美的集团	600	43,320.00	0.38
73	300103	达刚控股	6,300	42,903.00	0.37
74	300289	利德曼	8,200	42,640.00	0.37
75	002357	富临运业	4,600	42,550.00	0.37
76	000586	汇源通信	3,800	42,256.00	0.37
77	002445	中南文化	16,500	42,075.00	0.36
78	002972	科安达	3,400	41,786.00	0.36
79	000959	首钢股份	12,200	41,480.00	0.36
80	001324	长青科技	2,100	41,370.00	0.36
81	688008	澜起科技	500	41,000.00	0.36
82	688109	品茗科技	1,300	40,469.00	0.35
83	601127	赛力斯	300	40,296.00	0.35
84	600690	海尔智家	1,600	39,648.00	0.34
85	603306	华懋科技	900	39,150.00	0.34
86	001301	尚太科技	800	39,008.00	0.34
87	300500	启迪设计	3,200	38,880.00	0.34
88	003023	彩虹集团	1,900	38,532.00	0.33
89	601002	晋亿实业	7,700	37,961.00	0.33
90	300160	秀强股份	6,700	37,654.00	0.33
91	688668	鼎通科技	600	37,476.00	0.32
92	600160	巨化股份	1,300	37,284.00	0.32
93	688188	柏楚电子	280	36,864.80	0.32
94	605058	澳弘电子	1,200	36,672.00	0.32
95	600338	西藏珠峰	3,300	36,597.00	0.32
96	300972	万辰集团	200	36,048.00	0.31
97	003016	欣贺股份	4,800	36,000.00	0.31
98	01801	信达生物	500	35,748.44	0.31
99	601999	出版传媒	5,100	35,649.00	0.31
100	002817	黄山胶囊	4,800	35,424.00	0.31
101	600126	杭钢股份	3,900	35,100.00	0.30
102	301329	信音电子	1,800	35,064.00	0.30
103	600218	全柴动力	3,900	34,983.00	0.30
104	002241	歌尔股份	1,500	34,980.00	0.30

105	000050	深天马 A	4,100	34,932.00	0.30
106	601900	南方传媒	2,200	34,408.00	0.30
107	603529	爱玛科技	1,000	34,400.00	0.30
108	603289	泰瑞机器	3,600	34,272.00	0.30
109	600398	海澜之家	4,900	34,104.00	0.30
110	301318	维海德	1,000	33,840.00	0.29
111	600356	恒丰纸业	4,200	33,810.00	0.29
112	605186	健麾信息	1,600	33,504.00	0.29
113	600887	伊利股份	1,200	33,456.00	0.29
114	002084	海鸥住工	9,300	33,015.00	0.29
115	300670	大烨智能	5,000	32,900.00	0.29
116	301020	密封科技	1,500	32,745.00	0.28
117	601728	中国电信	4,200	32,550.00	0.28
118	01530	三生制药	1,500	32,351.43	0.28
119	600482	中国动力	1,400	32,298.00	0.28
120	600489	中金黄金	2,200	32,186.00	0.28
121	600418	江淮汽车	800	32,072.00	0.28
122	300014	亿纬锂能	700	32,067.00	0.28
123	600673	东阳光	2,700	31,401.00	0.27
124	300206	理邦仪器	2,600	31,252.00	0.27
125	600665	天地源	9,300	31,155.00	0.27
126	300088	长信科技	5,200	30,992.00	0.27
127	688085	三友医疗	1,600	30,768.00	0.27
128	002795	永和智控	5,900	30,621.00	0.27
129	09626	哔哩哔哩-W	200	30,586.80	0.27
130	600745	闻泰科技	900	30,177.00	0.26
131	06990	科伦博泰生物-B	100	29,839.00	0.26
132	300442	润泽科技	600	29,718.00	0.26
133	600609	金杯汽车	5,600	29,624.00	0.26
134	02015	理想汽车-W	300	29,273.60	0.25
135	00175	吉利汽车	2,000	29,109.44	0.25
136	688418	震有科技	1,100	29,106.00	0.25
137	00285	比亚迪电子	1,000	29,000.01	0.25
138	601456	国联民生	2,800	28,980.00	0.25
139	601360	三六零	2,800	28,560.00	0.25
140	600298	安琪酵母	800	28,136.00	0.24
141	000021	深科技	1,500	28,110.00	0.24
142	300369	绿盟科技	3,600	27,972.00	0.24
143	600808	马钢股份	8,100	27,945.00	0.24
144	601600	中国铝业	2,600	18,304.00	0.16
144	02600	中国铝业	2,000	9,630.19	0.08
145	603087	甘李药业	500	27,390.00	0.24
146	601777	千里科技	3,200	27,168.00	0.24

147	600873	梅花生物	2,500	26,725.00	0.23
148	600057	厦门象屿	3,800	26,714.00	0.23
149	002030	达安基因	4,400	26,620.00	0.23
150	603936	博敏电子	2,800	26,404.00	0.23
151	301386	未来电器	1,200	26,076.00	0.23
152	003037	三和管桩	3,600	25,848.00	0.22
153	688334	西高院	1,500	25,770.00	0.22
154	09868	小鹏汽车-W	400	25,753.47	0.22
155	600635	大众公用	6,600	25,740.00	0.22
156	603612	索通发展	1,400	25,732.00	0.22
157	300072	海新能科	7,200	25,416.00	0.22
158	300264	佳创视讯	3,900	24,882.00	0.22
159	000927	中国铁物	9,600	24,672.00	0.21
160	300037	新宙邦	700	24,640.00	0.21
161	000635	英力特	2,700	23,949.00	0.21
162	301338	凯格精机	500	23,855.00	0.21
163	002050	三花智控	900	23,742.00	0.21
164	300616	尚品宅配	1,800	23,706.00	0.21
165	002782	可立克	1,800	23,364.00	0.20
166	002330	得利斯	5,100	23,358.00	0.20
167	603486	科沃斯	400	23,292.00	0.20
168	688509	正元地信	5,400	23,166.00	0.20
169	603816	顾家家居	900	22,968.00	0.20
170	002663	普邦股份	12,400	22,940.00	0.20
171	688696	极米科技	200	22,872.00	0.20
172	301503	智迪科技	600	22,830.00	0.20
173	603386	骏亚科技	1,800	22,770.00	0.20
174	000807	云铝股份	1,400	22,372.00	0.19
175	300666	江丰电子	300	22,230.00	0.19
176	688093	世华科技	700	21,735.00	0.19
177	600919	江苏银行	1,800	21,492.00	0.19
178	603499	翔港科技	1,300	21,437.00	0.19
179	00780	同程旅行	1,200	21,427.18	0.19
180	600882	妙可蓝多	700	21,371.00	0.19
181	300939	秋田微	700	21,280.00	0.18
182	002517	恺英网络	1,100	21,241.00	0.18
183	600183	生益科技	700	21,105.00	0.18
184	002648	卫星化学	1,200	20,796.00	0.18
185	002993	奥海科技	500	20,735.00	0.18
186	601881	中国银河	1,200	20,580.00	0.18
187	000921	海信家电	800	20,560.00	0.18
188	688213	思特威	200	20,444.00	0.18
189	300017	网宿科技	1,900	20,368.00	0.18
190	000977	浪潮信息	400	20,352.00	0.18

191	600584	长电科技	600	20,214.00	0.18
192	600312	平高电气	1,300	20,007.00	0.17
193	300990	同飞股份	400	19,960.00	0.17
194	601717	郑煤机	1,200	19,944.00	0.17
195	600031	三一重工	1,100	19,745.00	0.17
196	002011	盾安环境	1,700	19,720.00	0.17
197	002926	华西证券	2,200	19,668.00	0.17
198	601919	中远海控	1,300	19,552.00	0.17
199	601899	紫金矿业	1,000	19,500.00	0.17
200	600989	宝丰能源	1,200	19,368.00	0.17
201	600958	东方证券	2,000	19,360.00	0.17
202	000551	创元科技	1,500	19,275.00	0.17
203	603565	中谷物流	2,000	19,100.00	0.17
204	601928	凤凰传媒	1,700	18,989.00	0.16
205	02382	舜宇光学科技	300	18,973.12	0.16
206	300498	温氏股份	1,100	18,788.00	0.16
207	600012	皖通高速	1,100	18,678.00	0.16
208	01818	招金矿业	1,000	18,603.78	0.16
209	002110	三钢闽光	5,300	18,603.00	0.16
210	000563	陕国投 A	5,200	18,564.00	0.16
211	603993	洛阳钼业	2,200	18,524.00	0.16
212	000338	潍柴动力	1,200	18,456.00	0.16
213	601328	交通银行	2,300	18,400.00	0.16
213	600664	哈药股份	5,000	18,400.00	0.16
214	600219	南山铝业	4,800	18,384.00	0.16
215	688208	道通科技	600	18,360.00	0.16
216	000528	柳工	1,900	18,259.00	0.16
217	300679	电连技术	400	18,152.00	0.16
218	300777	中简科技	500	18,125.00	0.16
219	000651	格力电器	400	17,968.00	0.16
220	000425	徐工机械	2,300	17,871.00	0.15
221	600782	新钢股份	5,000	17,700.00	0.15
222	300627	华测导航	500	17,500.00	0.15
223	300659	中孚信息	1,200	17,448.00	0.15
224	603236	移远通信	200	17,160.00	0.15
225	002636	金安国纪	1,800	17,064.00	0.15
226	002420	毅昌科技	2,700	16,848.00	0.15
227	000776	广发证券	1,000	16,810.00	0.15
228	002802	洪汇新材	1,200	16,788.00	0.15
229	06969	思摩尔国际	1,000	16,633.97	0.14
230	601111	中国国航	2,100	16,569.00	0.14
231	603617	君禾股份	2,300	16,491.00	0.14
232	301291	明阳电气	400	16,460.00	0.14
233	002957	科瑞技术	1,000	16,440.00	0.14

234	000619	海螺新材	2,700	16,308.00	0.14
235	600719	大连热电	2,500	16,200.00	0.14
236	00883	中国海洋石油	1,000	16,159.75	0.14
237	603345	安井食品	200	16,084.00	0.14
238	300270	中威电子	2,000	15,720.00	0.14
239	002865	钧达股份	400	15,600.00	0.14
240	603288	海天味业	400	15,564.00	0.13
241	002670	国盛金控	1,000	15,050.00	0.13
242	002001	新和成	700	14,889.00	0.13
243	600640	国脉文化	1,200	14,544.00	0.13
244	601107	四川成渝	2,400	14,448.00	0.13
245	00939	建设银行	2,000	14,445.29	0.13
246	002230	科大讯飞	300	14,364.00	0.12
247	00268	金蝶国际	1,000	14,080.51	0.12
248	002353	杰瑞股份	400	14,000.00	0.12
249	688095	福昕软件	200	13,582.00	0.12
250	06160	百济神州	100	13,478.62	0.12
251	601519	大智慧	1,300	13,247.00	0.11
252	001266	宏英智能	500	13,225.00	0.11
253	002725	跃岭股份	1,000	13,180.00	0.11
254	603095	越剑智能	800	13,144.00	0.11
255	600815	厦工股份	4,800	13,104.00	0.11
256	300155	安居宝	2,600	13,052.00	0.11
257	002686	亿利达	2,000	13,020.00	0.11
258	002661	克明食品	1,300	13,013.00	0.11
259	603601	再升科技	3,200	12,992.00	0.11
260	09896	名创优品	400	12,986.17	0.11
261	300124	汇川技术	200	12,914.00	0.11
262	000828	东莞控股	1,200	12,828.00	0.11
263	300371	汇中股份	1,100	12,760.00	0.11
264	000570	苏常柴 A	2,200	12,738.00	0.11
265	002888	惠威科技	700	12,698.00	0.11
266	300112	万讯自控	1,400	12,670.00	0.11
267	002333	罗普斯金	2,300	12,650.00	0.11
268	002524	光正眼科	2,800	12,600.00	0.11
269	002876	三利谱	500	12,595.00	0.11
270	002769	普路通	1,300	12,584.00	0.11
271	002939	长城证券	1,500	12,570.00	0.11
272	002209	达意隆	1,000	12,550.00	0.11
273	600728	佳都科技	2,300	12,535.00	0.11
274	300994	久祺股份	800	12,512.00	0.11
275	603926	铁流股份	1,100	12,496.00	0.11
276	000421	南京公用	1,900	12,483.00	0.11
277	01787	山东黄金	500	12,425.32	0.11

278	600703	三安光电	1,000	12,420.00	0.11
279	301282	金禄电子	500	12,395.00	0.11
280	300062	中能电气	2,300	12,374.00	0.11
281	688691	灿芯股份	200	12,372.00	0.11
282	002350	北京科锐	1,800	12,348.00	0.11
283	301388	欣灵电气	500	12,305.00	0.11
284	002877	智能自控	1,400	12,250.00	0.11
285	600909	华安证券	2,100	12,243.00	0.11
286	600517	国网英大	2,400	12,240.00	0.11
287	301321	翰博高新	800	12,232.00	0.11
288	605001	威奥股份	1,700	12,223.00	0.11
289	600819	耀皮玻璃	2,100	12,222.00	0.11
289	002328	新朋股份	2,100	12,222.00	0.11
290	600246	万通发展	2,000	12,220.00	0.11
291	603330	天洋新材	1,800	12,204.00	0.11
292	688033	天宜新材	1,900	12,179.00	0.11
293	001216	华瓷股份	900	12,150.00	0.11
294	002624	完美世界	800	12,136.00	0.11
295	03896	金山云	2,000	12,110.70	0.11
296	002659	凯文教育	2,400	12,096.00	0.10
297	002373	千方科技	1,300	12,090.00	0.10
298	300512	中亚股份	1,400	12,012.00	0.10
299	603339	四方科技	1,000	12,000.00	0.10
299	002121	科陆电子	2,400	12,000.00	0.10
300	002282	博深股份	1,600	11,952.00	0.10
301	09969	诺诚健华	1,000	11,946.55	0.10
302	600076	康欣新材	5,000	11,900.00	0.10
303	002377	国创高新	4,000	11,880.00	0.10
304	688022	瀚川智能	800	11,856.00	0.10
305	600075	新疆天业	2,800	11,844.00	0.10
306	002451	摩恩电气	1,700	11,781.00	0.10
307	02269	药明生物	500	11,695.76	0.10
308	600106	重庆路桥	1,900	11,647.00	0.10
309	600179	安通控股	4,200	11,592.00	0.10
310	01024	快手-W	200	11,545.29	0.10
311	000720	新能泰山	3,300	11,517.00	0.10
312	300496	中科创达	200	11,444.00	0.10
313	600152	维科技术	1,500	11,415.00	0.10
314	301161	唯万密封	500	11,345.00	0.10
315	002396	星网锐捷	500	11,225.00	0.10
316	002723	小崧股份	1,500	11,205.00	0.10
317	000538	云南白药	200	11,158.00	0.10
318	600739	辽宁成大	1,000	11,000.00	0.10
319	603519	立霸股份	900	10,944.00	0.09

320	600685	中船防务	400	10,876.00	0.09
321	002925	盈趣科技	600	10,788.00	0.09
322	00013	和黄医药	500	10,738.21	0.09
323	02367	巨子生物	200	10,523.90	0.09
324	002475	立讯精密	300	10,407.00	0.09
325	600276	恒瑞医药	200	10,380.00	0.09
325	002841	视源股份	300	10,380.00	0.09
326	300241	瑞丰光电	1,800	10,260.00	0.09
327	300074	华平股份	2,100	10,248.00	0.09
328	688289	圣湘生物	500	10,240.00	0.09
329	03800	协鑫科技	11,000	10,031.45	0.09
330	688343	云天励飞	200	9,884.00	0.09
331	603379	三美股份	200	9,624.00	0.08
332	00189	东岳集团	1,000	9,557.24	0.08
333	02273	固生堂	300	9,397.64	0.08
334	600097	开创国际	900	9,396.00	0.08
335	000717	中南股份	3,800	9,272.00	0.08
336	600135	乐凯胶片	1,200	9,264.00	0.08
337	000548	湖南投资	1,700	9,078.00	0.08
338	000783	长江证券	1,300	9,009.00	0.08
338	300279	和晶科技	1,300	9,009.00	0.08
339	300982	苏文电能	500	8,995.00	0.08
340	601106	中国一重	3,200	8,960.00	0.08
341	300489	光智科技	200	8,832.00	0.08
341	601216	君正集团	1,600	8,832.00	0.08
342	000626	远大控股	1,300	8,814.00	0.08
343	601003	柳钢股份	2,500	8,800.00	0.08
344	601658	邮储银行	1,600	8,752.00	0.08
345	600795	国电电力	1,800	8,712.00	0.08
346	600984	建设机械	2,700	8,667.00	0.08
347	603079	圣达生物	500	8,575.00	0.07
348	000042	中洲控股	1,200	8,532.00	0.07
349	600115	中国东航	2,100	8,463.00	0.07
350	03988	中国银行	2,000	8,316.98	0.07
351	301297	富乐德	200	8,266.00	0.07
352	001387	雪祺电气	600	8,244.00	0.07
353	01378	中国宏桥	500	8,198.43	0.07
354	002687	乔治白	1,700	7,888.00	0.07
355	603895	天永智能	300	7,785.00	0.07
356	300846	首都在线	400	7,784.00	0.07
357	002701	奥瑞金	1,300	7,735.00	0.07
358	002245	蔚蓝锂芯	600	7,698.00	0.07
359	002405	四维图新	900	7,686.00	0.07
360	000625	长安汽车	600	7,656.00	0.07

361	603636	南威软件	600	7,584.00	0.07
362	600336	澳柯玛	1,100	7,502.00	0.07
363	000833	粤桂股份	600	7,494.00	0.06
364	603269	海鸥股份	800	7,456.00	0.06
365	300185	通裕重工	2,600	7,436.00	0.06
366	603799	华友钴业	200	7,404.00	0.06
367	600716	凤凰股份	2,000	7,400.00	0.06
368	603656	泰禾智能	400	7,380.00	0.06
369	01055	中国南方航空股份	2,000	7,332.08	0.06
370	002571	德力股份	1,200	7,320.00	0.06
371	09633	农夫山泉	200	7,313.84	0.06
372	603038	华立股份	500	7,310.00	0.06
373	002527	新时达	500	7,295.00	0.06
374	600724	宁波富达	1,600	7,280.00	0.06
375	002649	博彦科技	500	7,265.00	0.06
376	603717	天域生物	1,000	7,250.00	0.06
377	000757	浩物股份	1,600	7,248.00	0.06
378	002611	东方精工	600	7,236.00	0.06
379	000016	深康佳 A	1,400	7,224.00	0.06
380	603516	淳中科技	200	7,180.00	0.06
381	000166	申万宏源	1,400	7,028.00	0.06
382	002403	爱仕达	500	7,010.00	0.06
383	300583	赛托生物	400	6,896.00	0.06
384	300768	迪普科技	400	6,860.00	0.06
385	300144	宋城演艺	800	6,840.00	0.06
385	002042	华孚时尚	1,500	6,840.00	0.06
386	600198	大唐电信	800	6,832.00	0.06
387	000825	太钢不锈	1,900	6,821.00	0.06
388	001308	康冠科技	300	6,786.00	0.06
389	600725	云维股份	2,100	6,783.00	0.06
390	600061	国投资本	900	6,768.00	0.06
391	605162	新中港	900	6,759.00	0.06
392	001696	宗申动力	300	6,735.00	0.06
393	688676	金盘科技	200	6,690.00	0.06
394	001378	德冠新材	300	6,651.00	0.06
395	601116	三江购物	600	6,534.00	0.06
396	603860	中公高科	200	6,224.00	0.05

注：中芯国际和中国铝业同时在 A+H 股上市，合并计算其公允价值参与排序。

## 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	300502	新易盛	287,896.00	1.41
2	688111	金山办公	279,856.00	1.37
3	688041	海光信息	275,711.00	1.35
4	300308	中际旭创	275,550.00	1.35
5	688120	华海清科	258,494.00	1.27
6	600066	宇通客车	255,663.00	1.25
7	000977	浪潮信息	254,749.00	1.25
8	002468	申通快递	253,520.00	1.24
9	688256	寒武纪	250,572.00	1.23
10	688012	中微公司	249,832.42	1.23
11	002273	水晶光电	248,135.00	1.22
12	600050	中国联通	246,309.00	1.21
13	002459	晶澳科技	242,275.00	1.19
14	600418	江淮汽车	228,090.00	1.12
15	002463	沪电股份	219,026.00	1.07
16	601728	中国电信	216,530.00	1.06
17	300151	昌红科技	216,103.00	1.06
18	002926	华西证券	215,939.00	1.06
19	600248	陕建股份	215,713.00	1.06
20	300827	上能电气	215,048.00	1.05

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。

#### 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	600246	万通发展	379,043.00	1.86
2	002594	比亚迪	365,421.00	1.79
3	002273	水晶光电	351,855.00	1.73
4	000776	广发证券	337,514.00	1.66
5	603501	豪威集团	320,068.00	1.57
6	002532	天山铝业	311,781.00	1.53
7	601336	新华保险	308,236.00	1.51
8	300433	蓝思科技	307,573.00	1.51
9	002459	晶澳科技	295,925.00	1.45
10	000807	云铝股份	282,516.00	1.39
11	002463	沪电股份	280,762.00	1.38

12	002001	新和成	279,546.00	1.37
13	600741	华域汽车	276,463.00	1.36
14	000338	潍柴动力	269,483.00	1.32
15	688120	华海清科	267,145.68	1.31
16	300308	中际旭创	265,888.00	1.30
17	000725	京东方 A	260,534.00	1.28
18	601138	工业富联	260,068.00	1.28
19	601939	建设银行	259,598.00	1.27
20	002468	申通快递	259,574.00	1.27

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。

#### 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	97,436,776.69
卖出股票的收入（成交）总额	106,825,141.58

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的。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

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。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

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

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	3,922.72
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	13,725.73
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,648.45

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期内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不存在流通受限情况。

## §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
海富通量化选股混合 A	40	41,383.87	-	-	1,655,354.62	100.00 %
海富通量化选股混合 C	217	39,465.68	3,884,172.32	45.35%	4,679,880.36	54.65%
合计	257	39,764.23	3,884,172.32	38.01%	6,335,234.98	61.99%

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	海富通量化选股混合 A	98,832.23	5.9705%
	海富通量化选股混合 C	1.84	0.0000%
	合计	98,834.07	0.9671%

### 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、基金经理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

## §9 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
本报告期期初基金份额总额	2,465,012.08	17,203,491.96
本报告期基金总申购份额	12,538.04	3,716,374.93
减：本报告期基金总赎回份额	822,195.50	12,355,814.21
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,655,354.62	8,564,052.68

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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，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

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	
中信证券	4	152,434,309.37	74.63%	67,278.83	74.64%	-
中信证券（山 东）	2	51,827,608.90	25.37%	22,855.54	25.36%	-

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。

### 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	-	-	-	-	-	-
中信证券（山 东）	-	-	-	-	-	-

## 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上海万得基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	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	2025-01-14
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旗下部分基金新增海通证券股份有限公司为销售机构的公	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电	2025-03-14

	告	子披露网站	
4	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
5	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)	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
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信建投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	2025-04-11
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售(深圳)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	2025-04-15
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华西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	2025-04-16
9	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
10	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
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国信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	2025-05-06
12	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理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	2025-06-04
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华宝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	2025-06-17

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025/6/13-2025/6/25	-	1,877,757.96	-	1,877,757.96	18.37%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险							

主要包括：

- 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额；
- 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；
- 4、其他可能的风险。

另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 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

### 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