

# 海富通均衡甄选混合型证券投资基金

**2026 年中期报告**

**2026 年 6 月 30 日**

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 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 2026 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合规守信情况的说明              | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 13 |
| 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             | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 14 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15 |
| 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       | 15 |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 16 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 16 |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | 16 |
| 6.1 资产负债表                               | 16 |
| 6.2 利润表                                 | 17 |
| 6.3 净资产变动表                              | 18 |
| 6.4 报表附注                                | 20 |
| <b>§7 投资组合报告</b>                        | 42 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 42 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 43 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 43 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 46 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 48 |
| 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      | 48 |
| 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   | 48 |
| 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   | 48 |
| 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      | 48 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 48 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 48 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 49 |
| <b>§8 基金份额持有人信息</b>                     | 50 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 50 |

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| 8.2 盈利投资者数量占比 .....                     | 50        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 50        |
| 8.4 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 ..... | 50        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                | <b>51</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                  | <b>51</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 51        |
| 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 .....  | 51        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 51        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 51        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 52        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....      | 52        |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 .....  | 52        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 53        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>55</b> |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                  | <b>56</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                       | 56        |
| 12.2 存放地点 .....                         | 56        |
| 12.3 查阅方式 .....                         | 56        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称            | 海富通均衡甄选混合型证券投资基金   |                    |
| 基金简称            | 海富通均衡甄选混合          |                    |
| 基金主代码           | 010790             |                    |
| 交易代码            | 010790             |                    |
| 基金运作方式          | 契约型、开放式            |                    |
| 基金合同生效日         | 2021 年 1 月 26 日    |                    |
| 基金管理人           | 海富通基金管理有限公司        |                    |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司       |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 1,625,535,493.50 份 |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 海富通均衡甄选混合 A        | 海富通均衡甄选混合 C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 010790             | 010791             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 485,035,480.03 份   | 1,140,500,013.47 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险的前提下，均衡甄选优质行业及上市公司进行投资，力求超额收益与长期资本增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 投资策略   | <p>本基金通过对国内外宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究，紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素，兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动，动态把握不同资产类别的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，进行基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的合理配置。在严格控制投资风险的基础上，力求超额收益与长期资本增值。</p> <p>本基金所界定的均衡甄选投资，通过甄选具有真实业绩支撑、成长性相对确定并匹配合理估值的个股进行投资；构建组合时，将注重从风格（成长、价值）、行业上进行相对均衡的分散，并适当结合港股通投资实现跨市场风险分散，从而控制个股风险。</p> <p>另外，本基金的投资策略还包括债券投资组合策略、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。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率×75%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）×5%+中证综合债券指数收益率×20%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 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。本基金将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                                                    | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 岳冲                                                             | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 021-38650788                                                   | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | chongyue@hftfund.com                                           | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 40088-40099                                                    | 95588               |
| 传真          |      | 021-33830166                                                   | 010-66105798        |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区<br>陆家嘴环路479号18层<br>1802-1803室以及19层<br>1901-1908室 | 北京市西城区复兴门内大街55<br>号 |
| 办公地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区<br>陆家嘴环路479号18层<br>1802-1803室以及19层<br>1901-1908室 | 北京市西城区复兴门内大街55<br>号 |
| 邮政编码        |      | 200120                                                         | 100140              |
| 法定代表人       |      | 谢乐斌                                                            | 廖林                  |

2.4 信息披露方式

|                   |                                                             |
|-------------------|-------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 《中国证券报》                                                     |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | <a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a> |
| 基金中期报告置备地点        | 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<br>479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层<br>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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日） |             |
|---------------|--------------------------------------|-------------|
|               | 海富通均衡甄选混合 A                          | 海富通均衡甄选混合 C |

|               |                       |                  |
|---------------|-----------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | 57,558,730.69         | 219,760,680.88   |
| 本期利润          | 184,303,086.23        | 574,997,601.98   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.5825                | 0.4676           |
| 本期加权平均净值利润率   | 39.41%                | 32.99%           |
| 本期基金份额净值增长率   | 39.60%                | 39.02%           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |                  |
|               | 海富通均衡甄选混合 A           | 海富通均衡甄选混合 C      |
| 期末可供分配利润      | 136,967,154.42        | 259,918,649.51   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.2824                | 0.2279           |
| 期末基金资产净值      | 893,120,308.81        | 2,010,831,068.66 |
| 期末基金份额净值      | 1.8414                | 1.7631           |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |                  |
|               | 海富通均衡甄选混合 A           | 海富通均衡甄选混合 C      |
| 基金份额累计净值增长率   | 84.14%                | 76.31%           |

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

海富通均衡甄选混合 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      | 40.96%   | 2.27%       | 9.96%      | 1.04%         | 31.00% | 1.23% |
| 过去六个月      | 39.60%   | 1.96%       | 8.02%      | 0.97%         | 31.58% | 0.99% |
| 过去一年       | 111.24%  | 1.80%       | 24.11%     | 0.86%         | 87.13% | 0.94% |
| 过去三年       | 98.64%   | 1.53%       | 30.61%     | 0.93%         | 68.03% | 0.60% |
| 过去五年       | 70.42%   | 1.42%       | 8.02%      | 0.91%         | 62.40% | 0.51% |
| 自基金合同生效起至今 | 84.14%   | 1.40%       | 4.12%      | 0.91%         | 80.02% | 0.49% |

海富通均衡甄选混合 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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

|            |         |       |        |       |        |       |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月      | 40.68%  | 2.27% | 9.96%  | 1.04% | 30.72% | 1.23% |
| 过去六个月      | 39.02%  | 1.96% | 8.02%  | 0.97% | 31.00% | 0.99% |
| 过去一年       | 109.54% | 1.80% | 24.11% | 0.86% | 85.43% | 0.94% |
| 过去三年       | 93.92%  | 1.53% | 30.61% | 0.93% | 63.31% | 0.60% |
| 过去五年       | 63.74%  | 1.42% | 8.02%  | 0.91% | 55.72% | 0.51% |
| 自基金合同生效起至今 | 76.31%  | 1.40% | 4.12%  | 0.91% | 72.19% | 0.49% |

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

海富通均衡甄选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  
(2021 年 1 月 26 日至 2026 年 6 月 30 日)

海富通均衡甄选混合 A



海富通均衡甄选混合 C





注：本基金合同于 2021 年 1 月 26 日生效。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投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，于 2003 年 4 月 1 日发起设立。目前，公司的股东为国泰海通证券股份有限公司、法国巴黎资产管理 BE 控股公司，注册资本为 3 亿元人民币。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下运作的公募基金共有 100 只，分别是：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 A100 指数证券投资基金(LOF)、海富通中小盘混合型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、

海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通瑞兴 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、海富通添合收益债券型证券投资基金、海富通聚益优选三个月持有期债券型基金中基金（FOF）、海富通瑞颐 30 天滚动持有债券型证券投资基金、海富通瑞泽 90 天持有期债券型发起式证券投资基金、海富通沪港深医疗创新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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 吴昊 | 本基金的基金经理 | 2024-07-25      | -    | 16 年   | 博士。持有基金从业人员资格证书。历任国联证券股份有限公司计算机行业分析师,天治基金管理有限公司研究员、基金经理,德邦基金管理有限公司基金经理、权益投资二部副总经理,2023 年 11 月加入海富通基金管理有限公司,现任公募权益投资部基金经理。2015 年 2 月至 2017 年 7 月任天治财富增长证券投资基金基金经理。2017 年 12 月至 2018 年 12 月任德邦多元回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月至 2022 年 3 月任德邦稳盈增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月至 2022 年 3 月任德邦安鑫混合型证券投资基金、德邦惠利混合型证券投资基金基金经理。2020 年 5 月至 2023 年 10 月任德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月至 2023 年 10 月任德邦科技创新一年定期开放混合型证券投资基 |

|     |                   |            |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|-----|-------------------|------------|---|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                   |            |   |      | 金基金经理。2021 年 12 月至 2023 年 10 月任德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 7 月起任海富通均衡甄选混合基金经理。2024 年 9 月起兼任海富通电子信息传媒产业股票基金经理。2024 年 9 月至 2025 年 7 月兼任海富通数字经济混合基金经理。2024 年 11 月起兼任海富通成长甄选混合基金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 周雪军 | 本基金的基金经理；首席权益投资官。 | 2021-01-26 | - | 18 年 | 硕士，持有基金从业人员资格证书。历任北京金融街控股股份有限公司职员、天治基金管理有限公司研究员，2012 年 6 月至 2015 年 2 月任天治财富增长混合基金经理，2014 年 1 月至 2015 年 2 月兼任天治趋势精选混合基金经理。2015 年 2 月加入海富通基金管理有限公司，历任公募权益投资部总经理、公募权益投资部总监、总经理助理，现任首席权益投资官。2015 年 6 月起任海富通收益增长混合基金经理。2016 年 4 月起兼任海富通改革驱动混合基金经理。2018 年 11 月至 2019 年 11 月兼任海富通中小盘混合基金经理。2018 年 12 月至 2022 年 8 月兼任海富通沪港深混合基金经理。2021 年 1 月起兼任海富通均衡甄选混合基金经理。2021 年 2 月至 2025 年 7 月兼任海富通惠睿精选混合基金经理。2021 年 10 月至 2024 年 2 月兼任海富通惠增一年定开基金经理。2022 年 8 月至 2024 年 8 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2025 年 3 月起兼任海富通远见回报混合基金经理。 |

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值(元) | 任职时间 |
|----|------|---------|---------|------|
|----|------|---------|---------|------|

|     |          |    |                   |            |
|-----|----------|----|-------------------|------------|
| 周雪军 | 公募基金     | 4  | 10,497,750,050.20 | 2015/06/09 |
|     | 私募资产管理计划 | 1  | 2,606,901,762.87  | 2024/01/22 |
|     | 其他组合     | 36 | 67,733,560,602.25 | 2020/11/27 |
|     | 合计       | 41 | 80,838,212,415.32 |            |

注：表内任职日期为基金经理加入公司以来首次开始管理各类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

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

上半年，国内经济总体平稳，结构上向新向优发展。从总量看，上半年国内 GDP 为 69.6 万亿元，实际 GDP 增速为 4.7%，符合全年增长目标。节奏上，2026 年一季度经济实现开门红，尽管二季度增速有所回落，但是经济稳定运行的基本面并没有变化。结构上，高端制造业和出口为经济增

长的亮点。今年上半年以高端制造、数智经济、现代服务为代表的新动能对上半年经济增长的贡献率超过四成，经济向新向优的特点鲜明。今年上半年我国出口金额同比增长 17.60%，远高于去年同期的 5.85%。产业政策方面，国内因地制宜发展新质生产力，科技实力和经济实力持续增强。

从 A 股市场运行来看，上半年上证指数涨幅为 3.16%，沪深 300 为 7.55%，中证 500 为 20.97%，创业板指为 35.58%，科创 50 为 64.25%。行业板块方面，根据申万一级行业分类，表现靠前的板块是电子、通信、建筑材料、机械设备，表现靠后的板块是商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料。从行情节奏看，在年初美联储宽松预期和美国财政脉冲背景下，市场交易流动性宽松和经济复苏受益品种。但是，2 月底美伊战争爆发，油价高位震荡运行，美联储宽松预期消退，加息预期升温，此外战争影响了各国年内经济增长预期，此前的交易逻辑逆转。与此同时，美国科技巨头上修 2026 年资本开支，AI 投资拉动全球经济，AI 产业链成为市场的主线行情。整体而言，上半年 A 股以科技成长风格为主，AI 相关行业涨幅居前，市场结构较为分化。

在上半年的操作中，本基金大致把握住了市场的节奏变化，坚持以科技成长和周期制造为核心主线。在科技成长板块，紧密跟踪 AI 产业趋势，适度加大配置力度；在海外算力、国内算力、半导体设备、AI 相关材料等方向积极挖掘紧缺环节和新技术变化领域，强化优质个股精选。在周期制造板块，根据美以伊冲突的变化和进展，在新、老能源行业与经济顺周期相关的有色、机械行业之间进行平衡配置，对冲原油供给冲击带来的市场波动风险。总体上，本产品上半年的业绩实现了较好增长。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通均衡甄选混合 A 净值增长率为 39.60%，同期业绩比较基准收益率为 8.02%。海富通均衡甄选混合 C 净值增长率为 39.02%，同期业绩比较基准收益率为 8.02%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从全球经济看，AI 投资拉动经济的趋势仍延续，但地缘风险仍可能扰动市场。美国对 AI 投资延续高增长，进而拉动了中国、韩国、日本等国家的出口增速。同时，也要注意今年地缘政治风险较多，海外金融市场可能面临更多波动风险，未来需要密切跟踪。

从国内市场看，市场有望震荡上行。基本面上，国内经济向新向优，AI 产业链保持高景气，宏观经济步入补库周期。流动性上，国内宏观流动性保持宽松，海外宏观流动性短期趋紧但未来有望缓解；监管层引导中长线资金入市，整体风险偏好保持稳定。展望未来，我们对 A 股充满信心，将继续跟踪国内政策和经济的变化，以把握市场节奏和投资机会。

对于下半年的操作，本基金继续维持相对乐观的态度。一方面，继续关注和挖掘国内外 AI 相关

产业链的技术进步、产业景气、竞争格局等变化，在海外算力、国内算力、半导体设备、AI 产业链材料、AI 终端应用等多个细分方向积极挖掘格局向好、业绩持续兑现、估值相对合理的优质标的；另一方面，对海外经济及流动性、国内经济及结构变化持续跟踪，在出口制造业、资源及周期品、新消费、低估值高股息等方向精选个股、波段操作，以期获取相对稳健的绝对收益，平衡组合波动。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。

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

本基金本报告期无需要说明的情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——海富通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通均衡甄选混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                        |                          |
| 货币资金     | 6.4.7.1 | 163,199,717.05         | 146,091,416.66           |
| 结算备付金    |         | 2,987,812.92           | 2,753,233.34             |
| 存出保证金    |         | 534,101.14             | 442,475.24               |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 2,553,701,428.19       | 1,940,925,718.43         |
| 其中：股票投资  |         | 2,553,701,428.19       | 1,940,925,718.43         |
| 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     |         | -                      | -                        |
| 应收申购款    |         | 317,882,266.36         | 24,175,780.48            |
| 递延所得税资产  |         | -                      | -                        |
| 其他资产     | 6.4.7.5 | -                      | -                        |
| 资产总计     |         | 3,038,305,325.66       | 2,114,388,624.15         |



| 负债和净资产      | 附注号     | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <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       |         | 72,906,165.57          | 18,694,508.98            |
| 应付赎回款       |         | 56,144,127.90          | 26,136,096.26            |
| 应付管理人报酬     |         | 2,422,797.65           | 2,061,194.60             |
| 应付托管费       |         | 403,799.59             | 343,532.43               |
| 应付销售服务费     |         | 1,256,449.82           | 519,466.21               |
| 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 | 1,220,607.66           | 1,193,135.62             |
| 负债合计        |         | 134,353,948.19         | 48,947,934.10            |
| <b>净资产：</b> |         |                        |                          |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 1,625,535,493.50       | 1,590,036,659.63         |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 1,278,415,883.97       | 475,404,030.42           |
| 净资产合计       |         | 2,903,951,377.47       | 2,065,440,690.05         |
| 负债和净资产总计    |         | 3,038,305,325.66       | 2,114,388,624.15         |

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.8414 元，C 类基金份额净值 1.7631 元。

基金份额总额 1,625,535,493.50 份，其中 A 类基金份额 485,035,480.03 份，C 类基金份额 1,140,500,013.47 份。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通均衡甄选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目             | 附注号     | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至<br>2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b> |         | 781,546,469.25                           | 48,536,697.14                                 |
| 1.利息收入         |         | 356,807.71                               | 243,256.65                                    |
| 其中：存款利息收入      | 6.4.7.9 | 356,807.71                               | 243,256.65                                    |
| 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）           |            | 299,073,668.20        | -76,245,823.22       |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.10   | 286,821,631.28        | -95,897,230.80       |
| 基金投资收益                     |            | -                     | -                    |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.11   | -                     | 827.97               |
| 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   | 12,252,036.92         | 19,650,579.61        |
| 其他投资收益                     |            | -                     | -                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.15   | 481,981,276.64        | 124,522,587.09       |
| 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   | 134,716.70            | 16,676.62            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | <b>22,245,781.04</b>  | <b>13,779,888.34</b> |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 13,120,520.60         | 10,616,742.03        |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 2,186,753.42          | 1,769,456.95         |
| 3. 销售服务费                   |            | 6,842,811.58          | 1,299,317.99         |
| 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                   |            | -                     | 0.35                 |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.17   | 95,695.44             | 94,371.02            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>759,300,688.21</b> | <b>34,756,808.80</b> |
| 减：所得税费用                    |            | -                     | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>759,300,688.21</b> | <b>34,756,808.80</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | <b>-</b>              | <b>-</b>             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | <b>759,300,688.21</b> | <b>34,756,808.80</b> |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：海富通均衡甄选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 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 | 1, 590, 036, 659. 63                  | -          | 475, 404, 030. 42 | 2, 065, 440, 690. 05 |

|                                          |                                            |            |                  |                   |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|------------|------------------|-------------------|
| 二、本期期初净资产                                | 1,590,036,659.63                           | -          | 475,404,030.42   | 2,065,440,690.05  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 35,498,833.87                              | -          | 803,011,853.55   | 838,510,687.42    |
| （一）、综合收益总额                               | -                                          | -          | 759,300,688.21   | 759,300,688.21    |
| （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）      | 35,498,833.87                              | -          | 43,711,165.34    | 79,209,999.21     |
| 其中：1.基金申购款                               | 1,434,249,992.81                           | -          | 589,820,933.83   | 2,024,070,926.64  |
| 2.基金赎回款                                  | -1,398,751,158.94                          | -          | -546,109,768.49  | -1,944,860,927.43 |
| （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                                | 1,625,535,493.50                           | -          | 1,278,415,883.97 | 2,903,951,377.47  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |            |                  |                   |
|                                          | 实收基金                                       | 其他综合收益（若有） | 未分配利润            | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                                | 2,104,662,131.74                           | -          | -324,620,208.57  | 1,780,041,923.17  |
| 二、本期期初净资产                                | 2,104,662,131.74                           | -          | -324,620,208.57  | 1,780,041,923.17  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 14,567,195.19                              | -          | 39,708,504.36    | 54,275,699.55     |
| （一）、综合收益总额                               | -                                          | -          | 34,756,808.80    | 34,756,808.80     |
| （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）      | 14,567,195.19                              | -          | 4,951,695.56     | 19,518,890.75     |
| 其中：1.基金申购款                               | 382,850,373.09                             | -          | -62,396,527.37   | 320,453,845.72    |
| 2.基金赎回                                   | -368,283,177.90                            | -          | 67,348,222.93    | -300,934,954.     |

|                                          |                  |   |                 |                  |
|------------------------------------------|------------------|---|-----------------|------------------|
| 款                                        |                  |   |                 | 97               |
| (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                                | 2,119,229,326.93 | - | -284,911,704.21 | 1,834,317,622.72 |

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

海富通均衡甄选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(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020] 2939 号《关于准予海富通均衡甄选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《海富通均衡甄选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，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 3,977,850,083.55 元。经向中国证监会备案，《海富通均衡甄选混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 1 月 26 日正式生效，基金合同生效日的海富通均衡甄选混合 A 类基金份额总额为 3,240,186,425.74 份，其中认购资金利息折合 1,252,030.52 份基金份额，海富通均衡甄选混合 C 类基金份额总额为 739,059,684.77 份，其中认购资金利息折合 143,996.44 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《海富通均衡甄选混合型证券投资基金基金合同》和《海富通均衡甄选混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用及销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用，而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、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《海富通均衡甄选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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、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、股指期货、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产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合约、国债期货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×75%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）×5%+中证综合债券指数收益率×20%。

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 2026 年 8 月 28 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》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）发布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 6.4.2 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要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、2026 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

#### 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[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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，截至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对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。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

c)对本基金从上市公司、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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本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。对本基金通过沪港通、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)本基金卖出股票按 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。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e)对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------|
| 活期存款  | 163,199,717.05         |
| 等于：本金 | 163,185,730.05         |

|                |                |
|----------------|----------------|
| 加：应计利息         | 13,987.00      |
| 定期存款           | -              |
| 等于：本金          | -              |
| 加：应计利息         | -              |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -              |
| 存款期限 1-3 个月    | -              |
| 存款期限 3 个月以上    | -              |
| 其他存款           | -              |
| 等于：本金          | -              |
| 加：应计利息         | -              |
| 合计             | 163,199,717.05 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |      |                  |                |
|---------------|-------|------------------------|------|------------------|----------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息 | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 1,603,550,779.16       | -    | 2,553,701,428.19 | 950,150,649.03 |
| 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            |       | 1,603,550,779.16       | -    | 2,553,701,428.19 | 950,150,649.03 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额



本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 915.30                 |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 1,132,911.91           |
| 其中：交易所市场    | 1,132,911.91           |
| 银行间市场       | -                      |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 86,780.45              |
| 合计          | 1,220,607.66           |

6.4.7.7 实收基金

海富通均衡甄选混合 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |                 |
|---------------|----------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额            |
| 上年度末          | 961,212,241.23             | 961,212,241.23  |
| 本期申购          | 311,105,681.17             | 311,105,681.17  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -787,282,442.37            | -787,282,442.37 |
| 本期末           | 485,035,480.03             | 485,035,480.03  |

海富通均衡甄选混合 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|               | 2026年1月1日至2026年6月30日 |                  |
|---------------|----------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）              | 账面金额             |
| 上年度末          | 628,824,418.40       | 628,824,418.40   |
| 本期申购          | 1,123,144,311.64     | 1,123,144,311.64 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -611,468,716.57      | -611,468,716.57  |
| 本期末           | 1,140,500,013.47     | 1,140,500,013.47 |

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

海富通均衡甄选混合 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           | 87,522,715.28  | 219,233,583.70  | 306,756,298.98  |
| 本期期初           | 87,522,715.28  | 219,233,583.70  | 306,756,298.98  |
| 本期利润           | 57,558,730.69  | 126,744,355.54  | 184,303,086.23  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -8,114,291.55  | -74,860,264.88  | -82,974,556.43  |
| 其中：基金申购款       | 72,347,853.22  | 131,830,328.08  | 204,178,181.30  |
| 基金赎回款          | -80,462,144.77 | -206,690,592.96 | -287,152,737.73 |
| 本期已分配利润        | -              | -               | -               |
| 本期末            | 136,967,154.42 | 271,117,674.36  | 408,084,828.78  |

海富通均衡甄选混合 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           | 31,439,087.90  | 137,208,643.54  | 168,647,731.44  |
| 本期期初           | 31,439,087.90  | 137,208,643.54  | 168,647,731.44  |
| 本期利润           | 219,760,680.88 | 355,236,921.10  | 574,997,601.98  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 8,718,880.73   | 117,966,841.04  | 126,685,721.77  |
| 其中：基金申购款       | 88,037,320.01  | 297,605,432.52  | 385,642,752.53  |
| 基金赎回款          | -79,318,439.28 | -179,638,591.48 | -258,957,030.76 |
| 本期已分配利润        | -              | -               | -               |
| 本期末            | 259,918,649.51 | 610,412,405.68  | 870,331,055.19  |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

|           |            |
|-----------|------------|
| 活期存款利息收入  | 261,904.82 |
| 定期存款利息收入  | -          |
| 其他存款利息收入  | -          |
| 结算备付金利息收入 | 5,683.42   |
| 其他        | 89,219.47  |
| 合计        | 356,807.71 |

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 2,619,218,763.12                      |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,328,521,362.24                      |
| 减：交易费用     | 3,875,769.60                          |
| 买卖股票差价收入   | 286,821,631.28                        |

#### 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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 12,252,036.92              |
| 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            | 12,252,036.92              |

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------|----------------------------|
|------|----------------------------|

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 1.交易性金融资产                  | 481,981,276.64 |
| ——股票投资                     | 481,981,276.64 |
| ——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<br>预估增值税 | -              |
| 合计                         | 481,981,276.64 |

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 134,706.84                 |
| 基金转换费收入 | 9.86                       |
| 合计      | 134,716.70                 |

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 27,273.08                  |
| 信息披露费   | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 银行划款手续费 | 8,389.56                   |
| 证券组合费   | 525.43                     |
| 合计      | 95,695.44                  |

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系           |
|------------------------|-------------------|
| 海富通基金管理有限公司(“海富通”)     | 基金管理人、登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”) | 基金托管人、基金销售机构      |
| 国泰海通证券股份有限公司(“国泰海通证券”) | 基金管理人的股东、基金销售机构   |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。关联方国泰海通证券股份有限公司（简称“国泰海通证券”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原关联方海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

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                   |              | 上年度可比期间              |              |
|--------|----------------------|--------------|----------------------|--------------|
|        | 2026年1月1日至2026年6月30日 |              | 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 | 成交金额                 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 国泰海通证券 | 180,482,157.69       | 3.56%        | 20,594,288.89        | 0.32%        |

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期                              |            |           |              |
|--------|---------------------------------|------------|-----------|--------------|
|        | 2026 年 1 月 1 日至 2026 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 |
| 国泰海通证券 | 78,671.86                       | 3.55%      | 78,671.86 | 6.94%        |
| 关联方名称  | 上年度可比期间                         |            |           |              |

|        | 2025年1月1日至2025年6月30日 |                |          |                  |
|--------|----------------------|----------------|----------|------------------|
|        | 当期<br>佣金             | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 国泰海通证券 | 8,978.07             | 0.32%          | -        | -                |

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。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》。

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<br>2026年1月1日至2026年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2025年1月1日至2025年6<br>月30日 |
|------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 13,120,520.60                  | 10,616,742.03                       |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 1,726,507.59                   | 1,717,334.12                        |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 11,394,013.01                  | 8,899,407.91                        |

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 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 x1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2025年1月1日至2025年6<br>月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,186,753.42                   | 1,769,456.95                        |

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日      |              |              |
|----------------|---------------------------------|--------------|--------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |              |              |
|                | 海富通均衡甄选混合 A                     | 海富通均衡甄选混合 C  | 合计           |
| 中国工商银行         | -                               | 105,108.98   | 105,108.98   |
| 海富通            | -                               | 5,324,926.29 | 5,324,926.29 |
| 国泰海通证券         | -                               | 19,630.57    | 19,630.57    |
| 合计             | -                               | 5,449,665.84 | 5,449,665.84 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>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                |              |              |
|                | 海富通均衡甄选混合 A                     | 海富通均衡甄选混合 C  | 合计           |
| 中国工商银行         | -                               | 106,634.79   | 106,634.79   |
| 海通证券           | -                               | 7,641.81     | 7,641.81     |
| 海富通            | -                               | 416,365.53   | 416,365.53   |
| 国泰海通证券         | -                               | 10,146.66    | 10,146.66    |
| 合计             | -                               | 540,788.79   | 540,788.79   |

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.80%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.80%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 x0.80%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期                   |            | 上年度可比期间              |            |
|--------|----------------------|------------|----------------------|------------|
|        | 2026年1月1日至2026年6月30日 |            | 2025年1月1日至2025年6月30日 |            |
|        | 期末余额                 | 当期利息收入     | 期末余额                 | 当期利息收入     |
| 中国工商银行 | 163,199,717.05       | 261,904.82 | 118,199,063.37       | 205,376.75 |

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日      |        |      |      |            |            |
|--------------------------------------------|--------|------|------|------------|------------|
| 关联方名称                                      | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入  |            |
|                                            |        |      |      | 数量（单位：股/张） | 总金额        |
| 国泰海通证券                                     | 688781 | 视涯科技 | 网下申购 | 9,746      | 221,039.28 |
| 国泰海通证券                                     | 301666 | 大普微  | 网下申购 | 3,048      | 140,451.84 |
| 国泰海通证券                                     | 301599 | 理奇智能 | 网下申购 | 4,325      | 60,160.75  |
| 国泰海通证券                                     | 301696 | 三瑞智能 | 网下申购 | 2,157      | 53,234.76  |
| 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |        |      |      |            |            |
| 关联方名称                                      | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入  |            |
|                                            |        |      |      | 数量（单位：股/张） | 总金额        |
| -                                          | -      | -    | -    | -          | -          |

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况



本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |       |            |          |          |       |        |          |            |            |    |
|----------------------|-------|------------|----------|----------|-------|--------|----------|------------|------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称  | 成功认购日      | 受限期      | 流通受限类型   | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
| 001237               | 惠康科技  | 2026-05-15 | 6 个月     | 新股锁定     | 53.26 | 58.74  | 285      | 15,179.10  | 16,740.90  | -  |
| 001248               | 华润新能源 | 2026-06-24 | 6 个月     | 新股未上市并锁定 | 10.11 | 10.11  | 58,873   | 595,206.03 | 595,206.03 | -  |
| 001248               | 华润新能源 | 2026-06-24 | 1 个月内（含） | 新股未上市    | 10.11 | 10.11  | 25,231   | 255,085.41 | 255,085.41 | -  |
| 001312               | 福恩股份  | 2026-04-14 | 6 个月     | 新股锁定     | 18.38 | 16.78  | 134      | 2,462.92   | 2,248.52   | -  |
| 001365               | 天海电子  | 2026-05-11 | 6 个月     | 新股锁定     | 27.19 | 31.31  | 719      | 19,549.61  | 22,511.89  | -  |
| 001399               | 惠科股份  | 2026-06-16 | 6 个月     | 新股锁定     | 10.12 | 27.73  | 6,488    | 65,658.56  | 179,912.24 | -  |
| 301513               | 尚水智能  | 2026-04-10 | 6 个月     | 新股锁定     | 26.66 | 50.96  | 138      | 3,679.08   | 7,032.48   | -  |
| 301531               | 春光集团  | 2026-04-28 | 6 个月     | 新股锁定     | 13.30 | 51.56  | 290      | 3,857.00   | 14,952.40  | -  |
| 301599               | 理奇智能  | 2026-04-22 | 6 个月     | 新股锁定     | 13.91 | 32.47  | 433      | 6,023.03   | 14,059.51  | -  |
| 301666               | 大普微   | 2026-04-08 | 6 个月     | 新股锁定     | 46.08 | 463.33 | 1,220    | 56,217.60  | 565,262.60 | -  |
| 301669               | 高特电子  | 2026-06-02 | 6 个月     | 新股锁定     | 7.08  | 28.40  | 546      | 3,865.68   | 15,506.40  | -  |
| 301683               | 慧谷新材  | 2026-03-24 | 6 个月     | 新股锁定     | 78.38 | 121.77 | 96       | 7,524.48   | 11,689.92  | -  |
| 301696               | 三瑞智能  | 2026-03-31 | 6 个月     | 新股锁定     | 24.68 | 86.80  | 216      | 5,330.88   | 18,748.80  | -  |
| 603293               | 埃泰克   | 2026-04-09 | 6 个月     | 新股锁定     | 33.49 | 33.93  | 72       | 2,411.28   | 2,442.96   | -  |
| 603435               | 嘉德利   | 2026-05-15 | 6 个月     | 新股锁定     | 15.76 | 46.71  | 104      | 1,639.04   | 4,857.84   | -  |

|        |      |            |      |      |       |        |       |            |            |   |
|--------|------|------------|------|------|-------|--------|-------|------------|------------|---|
| 603459 | 红板科技 | 2026-03-31 | 6 个月 | 新股锁定 | 17.70 | 84.32  | 330   | 5,841.00   | 27,825.60  | - |
| 688781 | 视涯科技 | 2026-03-18 | 9 个月 | 新股锁定 | 22.68 | 42.16  | 6,335 | 143,677.80 | 267,083.60 | - |
| 688797 | 臻宝科技 | 2026-06-16 | 6 个月 | 新股锁定 | 44.56 | 468.67 | 207   | 9,223.92   | 97,014.69  | - |
| 688811 | 有研新材 | 2026-04-01 | 6 个月 | 新股锁定 | 6.41  | 24.13  | 834   | 5,345.94   | 20,124.42  | - |
| 688820 | 盛合晶微 | 2026-04-13 | 6 个月 | 新股锁定 | 19.68 | 141.49 | 2,391 | 47,054.88  | 338,302.59 | - |

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期       | 复牌开盘单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|--------------|---------------|---------------|----|
| 688072 | 拓荆科技 | 2026-06-29 | 重大事项 | 879.53 | 2026-07-13 | 890.99 | 50,404       | 21,298,186.62 | 44,331,830.12 | -  |

#### 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的建设，在董事会下设立审计委员会，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委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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<br>2026 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                   | 163,199,717.05 | -     | -     | -                | 163,199,717.05   |
| 结算备付金                  | 2,987,812.92   | -     | -     | -                | 2,987,812.92     |
| 存出保证金                  | 534,101.14     | -     | -     | -                | 534,101.14       |
| 交易性金融资产                | -              | -     | -     | 2,553,701,428.19 | 2,553,701,428.19 |
| 应收申购款                  | 14,200,000.00  | -     | -     | 303,682,266.36   | 317,882,266.36   |
| 资产总计                   | 180,921,631.11 | -     | -     | 2,857,383,694.55 | 3,038,305,325.66 |
| 负债                     |                |       |       |                  |                  |
| 应付清算款                  | -              | -     | -     | 72,906,165.57    | 72,906,165.57    |
| 应付赎回款                  | -              | -     | -     | 56,144,127.90    | 56,144,127.90    |
| 应付管理人报酬                | -              | -     | -     | 2,422,797.65     | 2,422,797.65     |
| 应付托管费                  | -              | -     | -     | 403,799.59       | 403,799.59       |
| 应付销售服务费                | -              | -     | -     | 1,256,449.82     | 1,256,449.82     |
| 其他负债                   | -              | -     | -     | 1,220,607.66     | 1,220,607.66     |
| 负债总计                   | -              | -     | -     | 134,353,948.19   | 134,353,948.19   |
| 利率敏感度缺口                | 180,921,631.11 | -     | -     | 2,723,029,746.36 | 2,903,951,377.47 |
| 上年度末<br>2025 年 12 月 31 | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息              | 合计               |

|         |                |   |   |                  |                  |
|---------|----------------|---|---|------------------|------------------|
| 日       |                |   |   |                  |                  |
| 资产      |                |   |   |                  |                  |
| 货币资金    | 146,091,416.66 | - | - | -                | 146,091,416.66   |
| 结算备付金   | 2,753,233.34   | - | - | -                | 2,753,233.34     |
| 存出保证金   | 442,475.24     | - | - | -                | 442,475.24       |
| 交易性金融资产 | -              | - | - | 1,940,925,718.43 | 1,940,925,718.43 |
| 应收申购款   | 22,078,698.38  | - | - | 2,097,082.10     | 24,175,780.48    |
| 资产总计    | 171,365,823.62 | - | - | 1,943,022,800.53 | 2,114,388,624.15 |
| 负债      |                |   |   |                  |                  |
| 应付清算款   | -              | - | - | 18,694,508.98    | 18,694,508.98    |
| 应付赎回款   | -              | - | - | 26,136,096.26    | 26,136,096.26    |
| 应付管理人报酬 | -              | - | - | 2,061,194.60     | 2,061,194.60     |
| 应付托管费   | -              | - | - | 343,532.43       | 343,532.43       |
| 应付销售服务费 | -              | - | - | 519,466.21       | 519,466.21       |
| 其他负债    | -              | - | - | 1,193,135.62     | 1,193,135.62     |
| 负债总计    | -              | - | - | 48,947,934.10    | 48,947,934.10    |
| 利率敏感度缺口 | 171,365,823.62 | - | - | 1,894,074,866.43 | 2,065,440,690.05 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2025 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(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

|    |     |
|----|-----|
| 项目 | 本期末 |
|----|-----|

|               | 2026 年 6 月 30 日     |               |               |
|---------------|---------------------|---------------|---------------|
|               | 美元<br>折合人民币         | 港币<br>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 | -                   | -             | -             |
| 项目            | 上年度末<br>2025年12月31日 |               |               |
|               | 美元<br>折合人民币         | 港币<br>折合人民币   | 合计            |
| 以外币计价的资产      |                     |               |               |
| 交易性金融资产       | -                   | 16,061,961.26 | 16,061,961.26 |
| 资产合计          | -                   | 16,061,961.26 | 16,061,961.26 |
| 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 | -                   | 16,061,961.26 | 16,061,961.26 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

|    |                  |                |
|----|------------------|----------------|
| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 |                |
| 分析 | 相关风险变量的变动        | 对资产负债表日基金资产净值的 |

|  |                   | 影响金额（单位：人民币元）   |                  |
|--|-------------------|-----------------|------------------|
|  |                   | 本期末             | 上年度末             |
|  |                   | 2026 年 6 月 30 日 | 2025 年 12 月 31 日 |
|  | 1. 所有外币相对人民币升值 5% | -               | 803,098.06       |
|  | 2. 所有外币相对人民币贬值 5% | -               | -803,098.06      |

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。

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

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             |                      |
|---------------|------------------|----------------------|------------------|----------------------|
|               | 2026 年 6 月 30 日  |                      | 2025 年 12 月 31 日 |                      |
|               | 公允价值             | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) | 公允价值             | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 2,553,701,428.19 | 87.94                | 1,940,925,718.43 | 93.97                |
| 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 | 2,553,701,428.19 | 87.94 | 1,940,925,718.43 | 93.97 |

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<br>2026 年 6 月 30 日      | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|    | 1.业绩比较基准上升 5%                  | 233,215,455.65              | 144,237,828.08           |
|    | 2.业绩比较基准下降 5%                  | -233,215,455.65             | -144,237,828.08          |

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 2,506,892,989.27       | 1,940,925,718.43         |
| 第二层次          | 45,182,121.56          | -                        |
| 第三层次          | 1,626,317.36           | -                        |
| 合计            | 2,553,701,428.19       | 1,940,925,718.43         |

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 2026 年 6 月 30 日,本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2025 年 12 月 31 日:无)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债,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              | 2,553,701,428.19 | 84.05        |
|    | 其中:股票             | 2,553,701,428.19 | 84.05        |
| 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 | 166,187,529.97   | 5.47   |
| 8 | 其他各项资产       | 318,416,367.50   | 10.48  |
| 9 | 合计           | 3,038,305,325.66 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -                | -            |
| B  | 采矿业              | 243,402,053.34   | 8.38         |
| C  | 制造业              | 2,150,444,846.22 | 74.05        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 850,291.44       | 0.03         |
| E  | 建筑业              | -                | -            |
| F  | 批发和零售业           | 39,654,621.00    | 1.37         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 6,700,050.00     | 0.23         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 30,120,801.45    | 1.04         |
| J  | 金融业              | 70,529,884.74    | 2.43         |
| K  | 房地产业             | 11,998,880.00    | 0.41         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -                | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -                | -            |
| 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               | -                | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -                | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -                | -            |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 2,553,701,428.19 | 87.94        |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 300502 | 新易盛  | 431,260   | 261,774,820.00 | 9.01         |
| 2  | 300308 | 中际旭创 | 188,500   | 239,395,000.00 | 8.24         |
| 3  | 002463 | 沪电股份 | 1,123,100 | 171,609,680.00 | 5.91         |
| 4  | 002384 | 东山精密 | 416,500   | 109,268,775.00 | 3.76         |
| 5  | 601899 | 紫金矿业 | 3,392,531 | 85,288,229.34  | 2.94         |
| 6  | 300750 | 宁德时代 | 198,600   | 78,051,786.00  | 2.69         |
| 7  | 603986 | 兆易创新 | 84,000    | 68,460,000.00  | 2.36         |
| 8  | 600711 | 盛屯矿业 | 5,050,200 | 55,400,694.00  | 1.91         |
| 9  | 600183 | 生益科技 | 285,400   | 49,488,360.00  | 1.70         |
| 10 | 688361 | 中科飞测 | 110,268   | 47,415,240.00  | 1.63         |
| 11 | 688072 | 拓荆科技 | 50,404    | 44,331,830.12  | 1.53         |
| 12 | 600176 | 中国巨石 | 584,800   | 42,620,224.00  | 1.47         |
| 13 | 688630 | 芯碁微装 | 69,738    | 38,313,359.82  | 1.32         |
| 14 | 688183 | 生益电子 | 272,110   | 36,027,364.00  | 1.24         |
| 15 | 002371 | 北方华创 | 40,000    | 35,382,400.00  | 1.22         |
| 16 | 000811 | 冰轮环境 | 598,300   | 33,636,426.00  | 1.16         |
| 17 | 002080 | 中材科技 | 373,000   | 33,570,000.00  | 1.16         |
| 18 | 688147 | 微导纳米 | 203,489   | 32,940,799.32  | 1.13         |
| 19 | 688012 | 中微公司 | 68,224    | 31,962,944.00  | 1.10         |
| 20 | 300661 | 圣邦股份 | 194,100   | 27,849,468.00  | 0.96         |
| 21 | 002916 | 深南电路 | 59,900    | 27,428,210.00  | 0.94         |
| 22 | 000975 | 山金国际 | 1,498,124 | 25,468,108.00  | 0.88         |
| 23 | 300548 | 长芯博创 | 91,300    | 25,381,400.00  | 0.87         |
| 24 | 600489 | 中金黄金 | 1,335,600 | 24,107,580.00  | 0.83         |
| 25 | 300475 | 香农芯创 | 80,200    | 24,060,000.00  | 0.83         |
| 26 | 600549 | 厦门钨业 | 281,100   | 23,949,720.00  | 0.82         |
| 27 | 300570 | 太辰光  | 96,700    | 23,856,857.00  | 0.82         |
| 28 | 000338 | 潍柴动力 | 856,300   | 23,334,175.00  | 0.80         |
| 29 | 688808 | 联讯仪器 | 10,031    | 23,295,292.23  | 0.80         |
| 30 | 688668 | 鼎通科技 | 61,868    | 23,095,324.40  | 0.80         |
| 31 | 300259 | 新天科技 | 3,461,100 | 22,947,093.00  | 0.79         |
| 32 | 003031 | 中瓷电子 | 126,200   | 22,753,860.00  | 0.78         |
| 33 | 002738 | 中矿资源 | 383,900   | 22,646,261.00  | 0.78         |
| 34 | 603061 | 金海通  | 44,800    | 22,499,456.00  | 0.77         |
| 35 | 301217 | 铜冠铜箔 | 121,600   | 20,072,512.00  | 0.69         |
| 36 | 000776 | 广发证券 | 850,300   | 19,897,020.00  | 0.69         |
| 37 | 002842 | 翔鹭钨业 | 403,000   | 19,424,600.00  | 0.67         |
| 38 | 301526 | 国际复材 | 411,000   | 19,181,370.00  | 0.66         |
| 39 | 600595 | 中孚实业 | 3,386,100 | 19,029,882.00  | 0.66         |
| 40 | 601688 | 华泰证券 | 881,100   | 18,168,282.00  | 0.63         |
| 41 | 603083 | 剑桥科技 | 70,900    | 18,070,283.00  | 0.62         |

|    |        |        |           |               |      |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 42 | 000534 | 万泽股份   | 639,400   | 17,493,984.00 | 0.60 |
| 43 | 002601 | 龙佰集团   | 1,058,700 | 17,447,376.00 | 0.60 |
| 44 | 605111 | 新洁能    | 171,600   | 17,012,424.00 | 0.59 |
| 45 | 688313 | 仕佳光子   | 90,000    | 16,618,500.00 | 0.57 |
| 46 | 688809 | 强一股份   | 26,662    | 16,610,426.00 | 0.57 |
| 47 | 600482 | 中国动力   | 495,600   | 16,255,680.00 | 0.56 |
| 48 | 600105 | 永鼎股份   | 236,700   | 15,972,516.00 | 0.55 |
| 49 | 600397 | 江钨装备   | 572,700   | 15,594,621.00 | 0.54 |
| 50 | 000807 | 云铝股份   | 700,800   | 15,515,712.00 | 0.53 |
| 51 | 688456 | 有研粉材   | 106,677   | 14,892,109.20 | 0.51 |
| 52 | 688256 | 寒武纪    | 9,009     | 14,374,309.95 | 0.49 |
| 53 | 000425 | 徐工机械   | 1,667,800 | 13,492,502.00 | 0.46 |
| 54 | 688347 | 华虹宏力   | 39,643    | 13,331,940.90 | 0.46 |
| 55 | 002283 | 天润工业   | 1,377,200 | 13,289,980.00 | 0.46 |
| 56 | 000921 | 海信家电   | 478,628   | 13,076,116.96 | 0.45 |
| 57 | 000510 | 新金路    | 515,500   | 12,805,020.00 | 0.44 |
| 58 | 601336 | 新华保险   | 212,105   | 12,654,184.30 | 0.44 |
| 59 | 002244 | 滨江集团   | 1,578,800 | 11,998,880.00 | 0.41 |
| 60 | 688409 | 富创精密   | 39,070    | 11,965,187.50 | 0.41 |
| 61 | 002222 | 福晶科技   | 127,100   | 11,728,788.00 | 0.40 |
| 62 | 000100 | TCL 科技 | 2,013,500 | 11,718,570.00 | 0.40 |
| 63 | 601600 | 中国铝业   | 1,374,453 | 11,298,003.66 | 0.39 |
| 64 | 301196 | 唯科科技   | 90,000    | 11,287,800.00 | 0.39 |
| 65 | 601377 | 兴业证券   | 1,823,111 | 11,011,590.44 | 0.38 |
| 66 | 600546 | 山煤国际   | 1,000,000 | 10,930,000.00 | 0.38 |
| 67 | 002345 | 潮宏基    | 1,169,500 | 10,724,315.00 | 0.37 |
| 68 | 601898 | 中煤能源   | 849,200   | 10,343,256.00 | 0.36 |
| 69 | 601168 | 西部矿业   | 364,200   | 9,884,388.00  | 0.34 |
| 70 | 301165 | 锐捷网络   | 115,800   | 9,316,110.00  | 0.32 |
| 71 | 603979 | 金诚信    | 156,500   | 9,238,195.00  | 0.32 |
| 72 | 688041 | 海光信息   | 24,000    | 8,887,200.00  | 0.31 |
| 73 | 301338 | 凯格精机   | 53,000    | 8,633,170.00  | 0.30 |
| 74 | 000688 | 国城矿业   | 250,900   | 8,588,307.00  | 0.30 |
| 75 | 002602 | 世纪华通   | 600,000   | 8,460,000.00  | 0.29 |
| 76 | 688766 | 普冉股份   | 11,000    | 8,432,600.00  | 0.29 |
| 77 | 600875 | 东方电气   | 263,000   | 7,566,510.00  | 0.26 |
| 78 | 601319 | 中国人保   | 1,114,700 | 7,535,372.00  | 0.26 |
| 79 | 688677 | 海泰新光   | 74,242    | 7,508,093.46  | 0.26 |
| 80 | 688141 | 杰华特    | 47,469    | 7,286,491.50  | 0.25 |
| 81 | 300604 | 长川科技   | 20,200    | 6,896,684.00  | 0.24 |
| 82 | 688300 | 联瑞新材   | 27,927    | 6,825,358.80  | 0.24 |
| 83 | 600233 | 圆通速递   | 425,400   | 6,700,050.00  | 0.23 |
| 84 | 000831 | 中国稀土   | 120,200   | 6,669,898.00  | 0.23 |
| 85 | 688127 | 蓝特光学   | 65,610    | 6,403,536.00  | 0.22 |

|     |        |       |         |              |      |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 86  | 688392 | 骄成超声  | 25,731  | 5,845,568.58 | 0.20 |
| 87  | 300408 | 三环集团  | 34,900  | 5,824,810.00 | 0.20 |
| 88  | 002281 | 光迅科技  | 22,500  | 5,781,150.00 | 0.20 |
| 89  | 000933 | 神火股份  | 265,300 | 5,624,360.00 | 0.19 |
| 90  | 300763 | 锦浪科技  | 55,900  | 5,050,565.00 | 0.17 |
| 91  | 603129 | 春风动力  | 19,700  | 5,039,260.00 | 0.17 |
| 92  | 688146 | 中船特气  | 13,009  | 4,553,019.91 | 0.16 |
| 93  | 600150 | 中国船舶  | 124,000 | 4,189,960.00 | 0.14 |
| 94  | 601609 | 金田股份  | 387,300 | 4,182,840.00 | 0.14 |
| 95  | 600988 | 赤峰黄金  | 157,800 | 4,153,296.00 | 0.14 |
| 96  | 688020 | 方邦股份  | 15,970  | 3,986,112.00 | 0.14 |
| 97  | 601601 | 中国太保  | 44,300  | 1,263,436.00 | 0.04 |
| 98  | 001248 | 华润新能源 | 84,104  | 850,291.44   | 0.03 |
| 99  | 301666 | 大普微   | 1,220   | 565,262.60   | 0.02 |
| 100 | 688820 | 盛合晶微  | 2,391   | 338,302.59   | 0.01 |
| 101 | 688781 | 视涯科技  | 6,335   | 267,083.60   | 0.01 |
| 102 | 001399 | 惠科股份  | 6,488   | 179,912.24   | 0.01 |
| 103 | 688797 | 臻宝科技  | 207     | 97,014.69    | 0.00 |
| 104 | 603459 | 红板科技  | 330     | 27,825.60    | 0.00 |
| 105 | 001365 | 天海电子  | 719     | 22,511.89    | 0.00 |
| 106 | 688811 | 有研复材  | 834     | 20,124.42    | 0.00 |
| 107 | 301696 | 三瑞智能  | 216     | 18,748.80    | 0.00 |
| 108 | 001237 | 惠康科技  | 285     | 16,740.90    | 0.00 |
| 109 | 301669 | 高特电子  | 546     | 15,506.40    | 0.00 |
| 110 | 301531 | 春光集团  | 290     | 14,952.40    | 0.00 |
| 111 | 301599 | 理奇智能  | 433     | 14,059.51    | 0.00 |
| 112 | 301683 | 慧谷新材  | 96      | 11,689.92    | 0.00 |
| 113 | 301513 | 尚水智能  | 138     | 7,032.48     | 0.00 |
| 114 | 603435 | 嘉德利   | 104     | 4,857.84     | 0.00 |
| 115 | 603293 | 埃泰克   | 72      | 2,442.96     | 0.00 |
| 116 | 001312 | 福恩股份  | 134     | 2,248.52     | 0.00 |

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------------|
| 1  | 603799 | 华友钴业 | 38,035,760.18 | 1.84               |
| 2  | 002738 | 中矿资源 | 36,045,755.80 | 1.75               |
| 3  | 002080 | 中材科技 | 34,799,390.00 | 1.68               |
| 4  | 603986 | 兆易创新 | 34,500,372.35 | 1.67               |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 5  | 688256 | 寒武纪  | 33,603,592.09 | 1.63 |
| 6  | 603259 | 药明康德 | 32,999,273.67 | 1.60 |
| 7  | 688183 | 生益电子 | 31,738,040.35 | 1.54 |
| 8  | 688630 | 芯碁微装 | 30,475,257.87 | 1.48 |
| 9  | 300570 | 太辰光  | 28,535,243.00 | 1.38 |
| 10 | 688072 | 拓荆科技 | 27,813,675.89 | 1.35 |
| 11 | 600346 | 恒力石化 | 27,790,278.05 | 1.35 |
| 12 | 300750 | 宁德时代 | 26,285,135.00 | 1.27 |
| 13 | 600546 | 山煤国际 | 26,149,929.00 | 1.27 |
| 14 | 002916 | 深南电路 | 25,090,539.00 | 1.21 |
| 15 | 300661 | 圣邦股份 | 24,971,563.36 | 1.21 |
| 16 | 300475 | 香农芯创 | 24,468,120.00 | 1.18 |
| 17 | 000811 | 冰轮环境 | 24,324,614.50 | 1.18 |
| 18 | 002384 | 东山精密 | 24,313,037.00 | 1.18 |
| 19 | 300476 | 胜宏科技 | 24,174,187.14 | 1.17 |
| 20 | 300548 | 长芯博创 | 23,236,926.00 | 1.13 |

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------------|
| 1  | 300502 | 新易盛  | 91,120,108.60 | 4.41               |
| 2  | 601138 | 工业富联 | 73,419,350.83 | 3.55               |
| 3  | 300308 | 中际旭创 | 58,792,069.00 | 2.85               |
| 4  | 600673 | 东阳光  | 52,666,426.16 | 2.55               |
| 5  | 002463 | 沪电股份 | 48,396,641.47 | 2.34               |
| 6  | 300014 | 亿纬锂能 | 46,353,031.88 | 2.24               |
| 7  | 300394 | 天孚通信 | 43,727,232.16 | 2.12               |
| 8  | 300475 | 香农芯创 | 39,181,919.44 | 1.90               |
| 9  | 600988 | 赤峰黄金 | 39,062,638.00 | 1.89               |
| 10 | 603799 | 华友钴业 | 37,417,070.02 | 1.81               |
| 11 | 300476 | 胜宏科技 | 35,158,211.93 | 1.70               |
| 12 | 600153 | 建发股份 | 35,029,953.36 | 1.70               |
| 13 | 603993 | 洛阳钼业 | 34,951,345.00 | 1.69               |
| 14 | 000893 | 亚钾国际 | 34,899,132.00 | 1.69               |
| 15 | 001979 | 招商蛇口 | 31,912,600.69 | 1.55               |
| 16 | 603259 | 药明康德 | 31,490,533.00 | 1.52               |
| 17 | 603298 | 杭叉集团 | 30,383,953.00 | 1.47               |
| 18 | 601318 | 中国平安 | 28,892,132.28 | 1.40               |
| 19 | 002602 | 世纪华通 | 27,532,100.00 | 1.33               |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 20 | 601009 | 南京银行 | 26,193,311.00 | 1.27 |
|----|--------|------|---------------|------|

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 2,459,315,795.36 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 2,619,218,763.12 |

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将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。

#### 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，将根据风险管理原则，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，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资将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

本报告期内本基金未投资国债期货。

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约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 | 534,101.14     |
| 2  | 应收清算款 | -              |
| 3  | 应收股利  | -              |
| 4  | 应收利息  | -              |
| 5  | 应收申购款 | 317,882,266.36 |
| 6  | 其他应收款 | -              |
| 7  | 待摊费用  | -              |
| 8  | 其他    | -              |
| 9  | 合计    | 318,416,367.50 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别        | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构            |        |                |        |
|-------------|----------|-----------|------------------|--------|----------------|--------|
|             |          |           | 机构投资者            |        | 个人投资者          |        |
|             |          |           | 持有份额             | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 海富通均衡甄选混合 A | 5,935    | 81,724.60 | 290,021,605.13   | 59.79% | 195,013,874.90 | 40.21% |
| 海富通均衡甄选混合 C | 26,978   | 42,275.19 | 1,034,939,639.78 | 90.74% | 105,560,373.69 | 9.26%  |
| 合计          | 32,913   | 49,388.86 | 1,324,961,244.91 | 81.51% | 300,574,248.59 | 18.49% |

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 盈利投资者数量占比

| 项目        | 过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日) |
|-----------|---------------------------------------|
| 盈利投资者数量占比 | 99.14%                                |

8.3 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 | 海富通均衡甄选混合 A | 7,887,482.53 | 1.6262%  |
|                  | 海富通均衡甄选混合 C | 151,114.56   | 0.0132%  |
|                  | 合计          | 8,038,597.09 | 0.4945%  |

8.4 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 | 海富通均衡甄选混合 A | >100              |
|                        | 海富通均衡甄选混合 C | 0                 |

|                 |             |      |
|-----------------|-------------|------|
| 持有本开放式基金        | 合计          | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 海富通均衡甄选混合 A | >100 |
|                 | 海富通均衡甄选混合 C | 0    |
|                 | 合计          | >100 |

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 海富通均衡甄选混合 A      | 海富通均衡甄选混合 C      |
|--------------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2021 年 1 月 26 日）基金份额总额 | 3,240,186,425.74 | 739,059,684.77   |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 961,212,241.23   | 628,824,418.40   |
| 本报告期基金总申购份额                    | 311,105,681.17   | 1,123,144,311.64 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 787,282,442.37   | 611,468,716.57   |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 485,035,480.03   | 1,140,500,013.47 |

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：

2026 年 4 月 30 日，海富通基金管理有限公司发布公告，魏峻先生不再担任公司副总经理。

2026 年 5 月 23 日，海富通基金管理有限公司发布公告，总经理任志强先生自 2026 年 5 月 22 日起兼任公司首席信息官，陶网雄先生不再担任公司首席信息官。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况****10.6.1 管理人受调查或处罚等情况**

报告期内，本基金管理人无受调查或处罚情况。

**10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况**

报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

**10.6.3 托管人受调查或处罚等情况**

报告期内，本基金托管人无重大受调查或处罚等情况。

**10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况**

报告期内，本基金托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

**10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况****10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易             |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|--------|--------|------------------|--------------|------------|------------|----|
|        |        | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 国海证券   | 2      | 2,272,678,848.40 | 44.77%       | 990,662.89 | 44.73%     | -  |
| 国联民生证券 | 2      | 952,765,155.42   | 18.77%       | 415,311.93 | 18.75%     | -  |
| 东吴证券   | 2      | 715,695,071.93   | 14.10%       | 311,973.66 | 14.09%     | -  |
| 兴业证券   | 2      | 280,084,556.12   | 5.52%        | 122,090.36 | 5.51%      | -  |
| 中金公司   | 2      | 198,979,047.81   | 3.92%        | 86,731.90  | 3.92%      | -  |
| 申万宏源   | 2      | 192,635,423.86   | 3.80%        | 83,971.05  | 3.79%      | -  |
| 国泰海通证券 | 3      | 180,482,157.69   | 3.56%        | 78,671.86  | 3.55%      | -  |
| 浙商证券   | 2      | 159,036,339.49   | 3.13%        | 69,326.02  | 3.13%      | -  |
| 华泰证券   | 1      | 88,307,214.65    | 1.74%        | 38,494.42  | 1.74%      | -  |
| 长江证券   | 2      | 35,338,153.43    | 0.70%        | 17,668.94  | 0.80%      | -  |
| 东北证券   | 1      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 广发证券   | 2      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 方正证券   | 1      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 东方证券   | 2      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 中信证券   | 2      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 中泰证券   | 2      | -                | -            | -          | -          | -  |

注：1、本基金本报告期退租中信证券 1 个交易单元。

2、交易单元的选择标准：

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

3、交易单元的选择程序：

（1）由牵头部门依据上述交易单元选择标准及公司内控制度要求，对候选券商开展尽职调查，综合评估其财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力。

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

（3）基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易 |              | 回购交易 |              | 权证交易 |              |
|--------|------|--------------|------|--------------|------|--------------|
|        | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国海证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国联民生证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 东吴证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 兴业证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中金公司   | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 申万宏源   | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国泰海通证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 浙商证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 华泰证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 长江证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 东北证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 广发证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 方正证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 东方证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中泰证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日 |
|----|------|--------|-------|
|----|------|--------|-------|

|    |                                                         |                             | 期          |
|----|---------------------------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 1  | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华创证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告     | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-01-27 |
| 2  | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                       | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-03-19 |
| 3  | 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(2025 年度)             | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-03-31 |
| 4  | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                       | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-04-01 |
| 5  | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                       | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-04-09 |
| 6  | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                       | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-04-23 |
| 7  | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增广东顺德农村商业银行股份有限公司为销售机构的公告           | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-04-28 |
| 8  | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-04-28 |
| 9  | 海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                                | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-04-30 |
| 10 | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增南京银行股份有限公司为销售机构的公告                 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-05-08 |
| 11 | 海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                                | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-05-23 |
| 12 | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所上市股票及相关风险提示的公告             | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-06-13 |
| 13 | 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                      | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-06-30 |

§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              | 2026/1/1-2026/6/30     | 344,908,938.41 | 392,948,088.17 | 350,554,828.20 | 387,302,198.38 | 23.83% |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 2              | 2026/1/1-2026/6/30     | 409,908,938.41 | 355,761,794.28 | 409,908,938.41 | 355,761,794.28 | 21.89% |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                |                        |                |                |                |                |        |
| <p>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：</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>4、其他可能的风险。</p> <p>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。</p> |                |                        |                |                |                |                |        |

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 137 只公募基金。截至 2026 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 3108 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。2008 年 3 月，海富通获批从事特定客户资产管理业务。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，中国保险监督管理委员会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人。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。

## §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均衡甄选混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通均衡甄选混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通均衡甄选混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通均衡甄选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它文件

### 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

二〇二六年八月三十一日