

海富通股票混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

§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，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	44
§9 开放式基金份额变动	44
§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息	47
§12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通股票混合型证券投资基金
基金简称	海富通股票混合
基金主代码	519005
交易代码	519005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 7 月 29 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,135,167,105.07 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	精选景气行业和积极主动精选股票投资相结合，分享中国经济高速成长的成果，谋求基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金采用双层次的投资策略：第一层次主要通过通过对股票市场的系统性风险进行分析，确定股票和现金资产的配置比例；第二层次主要是通过对行业景气循环和个股的研究，精选适合本投资组合风险收益特征的股票。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股指数*80%+上证国债指数*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	许俊
	联系电话	021-38650788	010-66596688
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层	北京西城区复兴门内大街1号

	1802-1803室以及19层 1901-1908室	
邮政编码	200120	100818
法定代表人	杨仓兵	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023年1月1日至2023年6月30日）
本期已实现收益	217,558,150.01
本期利润	507,442,047.40
加权平均基金份额本期利润	0.2648
本期加权平均净值利润率	19.41%
本期基金份额净值增长率	19.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	1,062,201,880.59
期末可供分配基金份额利润	0.4975
期末基金资产净值	3,197,368,985.66
期末基金份额净值	1.4975
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	565.37%

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.01%	3.18%	0.70%	0.71%	-0.69%	2.47%
过去三个月	8.55%	3.63%	-4.31%	0.65%	12.86%	2.98%
过去六个月	19.25%	2.86%	-0.45%	0.65%	19.70%	2.21%
过去一年	1.70%	2.72%	-10.98%	0.77%	12.68%	1.95%
过去三年	31.36%	2.52%	-1.61%	0.95%	32.97%	1.57%
自基金合同生效起至今	565.37%	1.97%	311.63%	1.31%	253.74%	0.66%

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

海富通股票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
(2005 年 7 月 29 日至 2023 年 6 月 30 日)



注：1、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。本基金自 2007 年 8 月 22 日至 2007 年 11 月 23 日为持续营销后建仓期。建仓期满至今本基金的各项投资比例已达到基金合同有关投资范围的规定，即股票资产 70%-95%，一年期以内的国家债券和现金的比例不低于 5%。

同时满足第 14 章（七）有关投资组合限制的各项比例要求。

2、为了能更公允地体现基金投资业绩，海富通基金管理有限公司自 2007 年 1 月 1 日起调整海富通股票基金业绩比较基准中股票部分的基准。原比较基准中的上证指数将调整为 MSCI China A 指数，相应的基准权重不变。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 90 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中

基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通欣润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		
吕越超	本基金的基金经理；公募权益投资二部总监。	2016-11-25	-	12 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任长江证券研究所分析师，泰达宏利基金管理有限公司研究员、基金经理。2014 年 11 月至 2016 年 7 月任泰达宏利周期混合基金

					经理，2015 年 6 月至 2016 年 7 月兼任泰达宏利创益混合基金经理。2016 年 11 月起任海富通股票混合基金经理。2019 年 12 月起兼任海富通先进制造股票基金经理。2020 年 3 月起兼任海富通科技创新混合基金经理。2020 年 9 月起兼任海富通成长甄选混合基金经理。
--	--	--	--	--	---

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
吕越超	公募基金	4	6,543,948,957.00	2016/11/25
	私募资产管理计划	1	567,674,141.08	2022/04/27
	其他组合	1	6,532,516,457.32	2018/08/08
	合计	6	13,644,139,555.40	

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。

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

2023 年上半年，国内经济总体呈现复苏态势，其中一季度由于积压需求释放表现尤其明显。3 月后经济运行有所放缓，总需求的修复本身需要一个过程，经济仍在主动去库存阶段，价格端呈现下行态势，但总体来说，上半年宏观经济呈现稳中向好态势，政策定力较足。海外方面，美国一季度发生银行业危机事件，美联储降息的预期时点一度被提前。但美国经济在二季度仍表现较强韧性，通胀读数仍偏高，市场对美国经济衰退的预期不断延后，相应利率终点的预期也后移，影响全球资产价格。产业端，上半年 AI 浪潮席卷全球，全球科技巨头大量增加相关资本开支，一些 AI 应用逐渐涌现，全球主要科技巨头走出牛市行情。

A 股市场整体表现稍弱，风格出现明显切换。春节前，顺周期风格下消费、金融、部分周期品、地产链涨幅靠前，出行链、新能源等资产表现较弱。随着 3 月后国内经济走弱以及 AI 科技浪潮爆发，权益市场出现明显风格切换，以 TMT 为代表的科技成长板块及以低估值、高股息为代表的“中特估”板块表现较好。二季度市场呈现了主题投资活跃的状态。

上半年 A 股主要指数表现方面，上证指数上涨 3.65%，沪深 300 下跌 0.75%，中证 800 上涨 0.02%，中小综指上涨 2.25%，创业板指下跌 5.61%。分行业看，成长板块表现较强，通信、传媒、计算机行业分别上涨 50.7%、42.8%、27.6%；顺周期与消费板块相对落后，房地产和建筑材料行业分别下跌 14.3%、10.5%，商贸零售、美容护理、食品饮料行业分别下跌 23.4%、13.6%、9.1%。

从上半年市场内部结构来看，主线还是在成长，中字头央企行情也表现亮眼。成长主线基本从 2 月份开始演绎，随着 OpenAI 的 AI 软件全球用户数量的快速上升，3-4 月市场沿着应用-大模型-基础算力的产业变化在传媒、计算机、通信等板块寻找投资机会。由于全球科技龙头相关资本开支的快速增加，算力板块表现尤其突出。另外，由于消费疫后复苏条线预期充分，白酒、航空、机场等相关板块上半年表现弱势，而新能源板块跟随自身产业周期，调整幅度也较大。整体而言，市场上半年反映了中国经济内在结构调整的运行节奏，也反映了市场对产业优化升级的期待，产业逻辑仍是主导市场的线索。

在上半年的操作中，本基金积极在新兴产业中寻找投资机会，降低了新能源方向的配置权重，增加了 AIGC 产业方向上的配置权重，总体取得了一定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 19.25%，同期业绩比较基准收益率为-0.45%，基金净值跑赢业绩比较基准 19.70 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着宏观政策基调转向稳增长，国内经济预期企稳，将进入自然复苏阶段，经济复苏的态势将延续。从库存周期看，下半年中美经济周期均将进入被动去库存阶段，今年年底明年年初可能进入主动补库存阶段，内需将逐步企稳回升，外需保持较强韧性。同时，在房地产市场托底、地方债务化解背景下，国内货币政策将保持宽松状态，流动性合理充裕，对 A 股较为偏正面。海外，美联储加息周期也行至尾声，对全球风险资产估值的压制减轻。同时，随着国内外政策态度的明朗，上半年市场风险偏好逐步下行的过程基本结束，下半年风险偏好有望回升。

下半年，继续关注政策驱动、产业驱动的投资主线。结构上，受益于近期宏观政策的调整，顺周期核心资产包括消费、地产链、部分库存偏低的商品及制造业，将有修复性机会。以 AI 为代表的 TMT 板块，更多地需要关注其自身的技术、产品等产业周期发展，关注国内外 AI 应用的进展。中期看，经济结构变化带来的红利较为确定，汽车、半导体等受益于产业趋势及政策导向的行业，或更加容易把握。

下半年，本基金将继续重点关注新兴产业，积极布局 AIGC 产业浪潮下的投资机会，同时坚持自下而上寻找优秀成长股的阿尔法机会，努力争取实现组合持续的超额收益。

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及基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

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

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在海富通股票混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通股票混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	183,366,578.36	137,593,725.05
结算备付金		10,430,424.60	6,937,755.31
存出保证金		1,067,335.88	719,486.33
交易性金融资产	6.4.7.2	2,995,880,923.14	2,134,284,080.01
其中：股票投资		2,995,880,923.14	2,134,284,080.01
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		2,629,706.78	11,920,206.31
应收股利		-	-
应收申购款		31,147,991.91	2,329,638.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		3,224,522,960.67	2,293,784,891.16
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		8,435,953.44	1,933,499.98
应付赎回款		8,589,348.50	12,468,031.08
应付管理人报酬		3,974,862.59	2,865,162.15
应付托管费		662,477.09	477,527.03
应付销售服务费		-	-
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	5,491,333.39	4,004,315.04
负债合计		27,153,975.01	21,748,535.28
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,135,167,105.07	1,809,198,531.65

未分配利润	6.4.7.8	1,062,201,880.59	462,837,824.23
净资产合计		3,197,368,985.66	2,272,036,355.88
负债和净资产总计		3,224,522,960.67	2,293,784,891.16

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4975 元，基金份额总额 2,135,167,105.07 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通股票混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		530,295,525.11	-22,956,021.07
1.利息收入		423,369.92	284,184.20
其中：存款利息收入	6.4.7.9	423,369.92	284,184.20
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		238,139,305.87	-349,734,279.39
其中：股票投资收益	6.4.7.10	229,278,382.27	-354,910,293.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	8,860,923.60	5,176,013.90
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	289,883,897.39	325,628,753.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,848,951.93	865,320.93
减：二、营业总支出		22,853,477.71	18,247,308.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	19,478,242.79	15,535,035.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,246,373.85	2,589,172.52
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.17	128,861.07	123,101.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		507,442,047.40	-41,203,329.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		507,442,047.40	-41,203,329.92
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		507,442,047.40	-41,203,329.92

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海富通股票混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,809,198,531.65	-	462,837,824.23	2,272,036,355.88
二、本期期初净资产（基金净值）	1,809,198,531.65	-	462,837,824.23	2,272,036,355.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	325,968,573.42	-	599,364,056.36	925,332,629.78
（一）、综合收益总额	-	-	507,442,047.40	507,442,047.40
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	325,968,573.42	-	91,922,008.96	417,890,582.38
其中：1.基金申购款	1,468,400,713.50	-	613,136,340.54	2,081,537,054.04
2.基金赎回款	-1,142,432,140.08	-	-521,214,331.58	-1,663,646,471.66
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	-	-

金净值变动（净值减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产（基金净值）	2,135,167,105.07	-	1,062,201,880.59	3,197,368,985.66
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	1,683,150,953.00	-	866,324,822.43	2,549,475,775.43
二、本期期初净资产（基金净值）	1,683,150,953.00	-	866,324,822.43	2,549,475,775.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	9,460,617.39	-	-66,538,801.42	-57,078,184.03
（一）、综合收益总额	-	-	-41,203,329.92	-41,203,329.92
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	9,460,617.39	-	-25,335,471.50	-15,874,854.11
其中：1.基金申购款	760,210,554.99	-	188,271,046.88	948,481,601.87
2.基金赎回款	-750,749,937.60	-	-213,606,518.38	-964,356,455.98
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,692,611,570.39	-	799,786,021.01	2,492,397,591.40

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

海富通股票混合型证券投资基金（原名为海富通股票证券投资基金，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”）证监基金字[2005]85 号《关于同意海富通股票证券投资基金募集申请的批复》核准，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通股票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 419,517,490.36 元。经向中国证监会备案，《海富通股票证券投资基金基金合同》于 2005 年 7 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 419,612,160.22 份基金份额，其中认购资金利息折合 94,669.86 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，海富通股票证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为海富通股票混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通股票混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括为国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金投资组合的基本范围为：股票资产及存托凭证 70%-95%，权证投资 0-3%，一年期以内的政府债券和现金的比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：MSCI China A 指数×80%+上证国债指数×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 2023 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

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的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况、2023 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(d)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(e)本基金城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	183,366,578.36
等于：本金	183,343,933.93
加：应计利息	22,644.43
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	183,366,578.36

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,606,387,045.97	-	2,995,880,923.14	389,493,877.17
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	2,606,387,045.97	-	2,995,880,923.14	389,493,877.17

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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	16,042.07
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,381,071.77
其中：交易所市场	5,381,071.77
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,219.55
合计	5,491,333.39

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,809,198,531.65	1,809,198,531.65
本期申购	1,468,400,713.50	1,468,400,713.50
本期赎回（以“-”号填列）	-1,142,432,140.08	-1,142,432,140.08
本期末	2,135,167,105.07	2,135,167,105.07

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

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,147,088,601.49	-684,250,777.26	462,837,824.23
本期利润	217,558,150.01	289,883,897.39	507,442,047.40
本期基金份额交易产生的变动数	216,434,120.75	-124,512,111.79	91,922,008.96
其中：基金申购款	947,697,724.23	-334,561,383.69	613,136,340.54
基金赎回款	-731,263,603.48	210,049,271.90	-521,214,331.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,581,080,872.25	-518,878,991.66	1,062,201,880.59

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	305,316.87
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	77,620.41
其他	40,432.64
合计	423,369.92

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	7,291,524,975.02
减：卖出股票成本总额	7,042,970,716.87
减：交易费用	19,275,875.88
买卖股票差价收入	229,278,382.27

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,860,923.60
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	8,860,923.60

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	289,883,897.39
——股票投资	289,883,897.39
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	289,883,897.39

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	1,825,085.98

基金转换费收入	23,865.95
合计	1,848,951.93

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	16,041.52
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	18,000.00
合计	128,861.07

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	-	-	643,851,371.22	8.47%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	465,865.90	8.50%	276,273.69	13.17%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用海通证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从海通证券获得研究综合服务。

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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	19,478,242.79	15,535,035.24
其中：支付销售机构的客户维护费	7,304,459.82	6,546,138.67

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 1.50%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 x 1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	3,246,373.85		2,589,172.52	

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 x0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	183,366,578.36	305,316.87	149,498,644.94	217,218.07

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只偏股型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有债券和资产支持证券（2022 年 12 月 31 日：无）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性

金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	183,366,578.36	-	-	-	183,366,578.36
结算备付金	10,430,424.60	-	-	-	10,430,424.60
存出保证金	1,067,335.88	-	-	-	1,067,335.88
交易性金融资产	-	-	-	2,995,880,923.14	2,995,880,923.14
应收清算款	-	-	-	2,629,706.78	2,629,706.78
应收申购款	208.80	-	-	31,147,783.11	31,147,991.91
资产总计	194,864,547.64	-	-	3,029,658,413.03	3,224,522,960.67
负债					
应付清算款	-	-	-	8,435,953.44	8,435,953.44
应付赎回款	-	-	-	8,589,348.50	8,589,348.50
应付管理人报酬	-	-	-	3,974,862.59	3,974,862.59
应付托管费	-	-	-	662,477.09	662,477.09
其他负债	-	-	-	5,491,333.39	5,491,333.39
负债总计	-	-	-	27,153,975.01	27,153,975.01
利率敏感度缺口	194,864,547.64	-	-	3,002,504,438.02	3,197,368,985.66
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	137,593,725.05	-	-	-	137,593,725.05
结算备付金	6,937,755.31	-	-	-	6,937,755.31
存出保证金	719,486.33	-	-	-	719,486.33
交易性金融资产	-	-	-	2,134,284,080.01	2,134,284,080.01
应收清算款	-	-	-	11,920,206.31	11,920,206.31
应收申购款	529.21	-	-	2,329,108.94	2,329,638.15
资产总计	145,251,495.90	-	-	2,148,533,395.26	2,293,784,891.16
负债					
应付清算款	-	-	-	1,933,499.98	1,933,499.98
应付赎回款	-	-	-	12,468,031.08	12,468,031.08
应付管理人报酬	-	-	-	2,865,162.15	2,865,162.15
应付托管费	-	-	-	477,527.03	477,527.03
其他负债	-	-	-	4,004,315.04	4,004,315.04
负债总计	-	-	-	21,748,535.28	21,748,535.28
利率敏感度缺口	145,251,495.90	-	-	2,126,784,859.98	2,272,036,355.88

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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 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(2022 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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外

的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票及存托凭证投资比例为基金总资产的 70%-95%。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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,995,880,923.14	93.70	2,134,284,080.01	93.94
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,995,880,923.14	93.70	2,134,284,080.01	93.94

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	123,409,381.25	104,357,588.94
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-123,409,381.25	-104,357,588.94

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	2,995,880,923.14	2,134,284,080.01
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	2,995,880,923.14	2,134,284,080.01

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可转换债券等，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可转换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，确定相关股票和可转换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 2023 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(2022 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应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,995,880,923.14	92.91
	其中:股票	2,995,880,923.14	92.91
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	193,797,002.96	6.01
8	其他各项资产	34,845,034.57	1.08
9	合计	3,224,522,960.67	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	820,208.00	0.03
C	制造业	1,232,669,566.73	38.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	425,360.90	0.01
F	批发和零售业	176,510.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,427,126,012.75	44.63
J	金融业	8,912,044.00	0.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	93,882,381.00	2.94
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	148,614.00	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	231,720,225.76	7.25
S	综合	-	-
	合计	2,995,880,923.14	93.70

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	300308	中际旭创	1,817,609	268,006,447.05	8.38
2	002605	姚记科技	3,541,706	164,441,409.58	5.14
3	002919	名臣健康	3,475,213	156,732,106.30	4.90
4	002230	科大讯飞	2,199,750	149,495,010.00	4.68
5	300502	新易盛	2,199,345	149,489,479.65	4.68

6	002315	焦点科技	3,605,700	144,228,000.00	4.51
7	688111	金山办公	284,474	134,334,312.28	4.20
8	600732	爱旭股份	4,042,859	124,317,914.25	3.89
9	300394	天孚通信	1,070,600	114,372,198.00	3.58
10	601900	南方传媒	5,477,894	112,351,605.94	3.51
11	300280	紫天科技	1,965,300	93,882,381.00	2.94
12	688668	鼎通科技	951,841	93,090,049.80	2.91
13	300229	拓尔思	3,375,140	87,652,385.80	2.74
14	300494	盛天网络	3,503,340	86,847,798.60	2.72
15	300624	万兴科技	674,820	79,055,163.00	2.47
16	300533	冰川网络	1,570,700	78,472,172.00	2.45
17	688095	福昕软件	585,334	73,974,510.92	2.31
18	300130	新国都	2,593,400	73,471,022.00	2.30
19	688195	腾景科技	1,156,688	61,801,839.84	1.93
20	002174	游族网络	3,113,707	52,310,277.60	1.64
21	300002	神州泰岳	3,712,113	51,969,582.00	1.63
22	002558	巨人网络	2,371,900	42,528,167.00	1.33
23	601138	工业富联	1,623,500	40,912,200.00	1.28
24	301052	果麦文化	797,210	39,318,397.20	1.23
25	300559	佳发教育	2,381,614	39,296,631.00	1.23
26	603000	人民网	1,129,200	32,972,640.00	1.03
27	002517	恺英网络	1,971,000	31,023,540.00	0.97
28	603019	中科曙光	514,200	26,172,780.00	0.82
29	002292	奥飞娱乐	2,540,100	25,350,198.00	0.79
30	301185	鸥玛软件	765,600	25,280,112.00	0.79
31	603918	金桥信息	865,380	23,771,988.60	0.74
32	603533	掌阅科技	843,800	23,390,136.00	0.73
33	300548	博创科技	541,500	18,654,675.00	0.58
34	300654	世纪天鸿	1,357,900	17,815,648.00	0.56
35	002343	慈文传媒	2,162,600	16,392,508.00	0.51
36	300459	汤姆猫	2,329,950	15,121,375.50	0.47
37	601949	中国出版	1,119,859	13,214,336.20	0.41
38	301191	菲菱科思	122,970	12,717,557.40	0.40
39	300570	太辰光	231,600	12,670,836.00	0.40
40	002624	完美世界	740,000	12,498,600.00	0.39
41	000063	中兴通讯	266,200	12,122,748.00	0.38
42	002555	三七互娱	320,200	11,168,576.00	0.35
43	601595	上海电影	320,817	9,066,288.42	0.28
44	601858	中国科传	258,700	8,692,320.00	0.27
45	300033	同花顺	49,200	8,623,776.00	0.27
46	600633	浙数文化	519,000	8,412,990.00	0.26
47	688292	浩瀚深度	292,299	8,388,981.30	0.26
48	300291	百纳千成	1,174,600	8,269,184.00	0.26
49	300043	星辉娱乐	2,157,800	8,048,594.00	0.25

50	688159	有方科技	203,222	8,043,526.76	0.25
51	688256	寒武纪	42,610	8,010,680.00	0.25
52	002602	世纪华通	863,400	6,553,206.00	0.20
53	003031	中瓷电子	46,700	6,216,704.00	0.19
54	000917	电广传媒	850,100	6,214,231.00	0.19
55	601599	浙文影业	1,565,400	5,885,904.00	0.18
56	002459	晶澳科技	111,752	4,660,058.40	0.15
57	002351	漫步者	222,600	4,603,368.00	0.14
58	600105	永鼎股份	434,000	3,233,300.00	0.10
59	300226	上海钢联	90,100	2,919,240.00	0.09
60	300830	金现代	305,900	2,906,050.00	0.09
61	300031	宝通科技	112,200	2,773,584.00	0.09
62	603322	超讯通信	90,900	2,661,552.00	0.08
63	301231	荣信文化	63,500	2,136,140.00	0.07
64	002599	盛通股份	233,000	2,108,650.00	0.07
65	000938	紫光股份	62,400	1,987,440.00	0.06
66	603118	共进股份	141,480	1,880,269.20	0.06
67	603444	吉比特	3,800	1,866,218.00	0.06
68	600977	中国电影	129,600	1,820,880.00	0.06
69	000892	欢瑞世纪	341,100	1,487,196.00	0.05
70	603258	电魂网络	34,200	1,453,842.00	0.05
71	300212	易华录	42,800	1,422,244.00	0.04
72	603888	新华网	42,100	1,381,722.00	0.04
73	688228	开普云	18,027	925,866.72	0.03
74	688080	映翰通	12,840	627,876.00	0.02
75	002609	捷顺科技	46,400	541,024.00	0.02
76	601928	凤凰传媒	42,700	486,780.00	0.02
77	600986	浙文互联	73,600	471,040.00	0.01
78	300766	每日互动	26,800	449,168.00	0.01
79	002876	三利谱	13,000	431,210.00	0.01
80	002487	大金重工	13,900	428,676.00	0.01
81	300525	博思软件	25,320	388,408.80	0.01
82	301391	卡莱特	3,000	351,510.00	0.01
83	688369	致远互联	6,206	343,191.80	0.01
84	003021	兆威机电	3,600	315,828.00	0.01
85	600602	云赛智联	20,000	301,200.00	0.01
86	301155	海力风电	3,900	300,612.00	0.01
87	601088	中国神华	9,300	285,975.00	0.01
88	002436	兴森科技	18,200	282,100.00	0.01
89	301165	锐捷网络	4,500	277,740.00	0.01
90	600028	中国石化	43,100	274,116.00	0.01
91	601225	陕西煤业	14,300	260,117.00	0.01
92	601318	中国平安	5,400	250,560.00	0.01
93	000681	视觉中国	13,100	240,909.00	0.01

94	688088	虹软科技	5,583	238,673.25	0.01
95	600425	青松建化	52,300	231,166.00	0.01
96	688588	凌志软件	14,520	225,786.00	0.01
97	300168	万达信息	19,800	224,334.00	0.01
98	002837	英维克	7,410	221,855.40	0.01
99	300133	华策影视	30,500	216,245.00	0.01
100	601390	中国中铁	28,100	212,998.00	0.01
101	600373	中文传媒	15,900	211,788.00	0.01
102	000498	山东路桥	29,800	191,316.00	0.01
103	002415	海康威视	5,700	188,727.00	0.01
104	603108	润达医疗	9,500	176,510.00	0.01
105	601360	三六零	13,700	171,798.00	0.01
106	300693	盛弘股份	4,191	154,731.72	0.00
107	003032	传智教育	10,200	148,614.00	0.00
108	000810	创维数字	5,700	92,169.00	0.00
109	002291	遥望科技	4,600	60,260.00	0.00
110	002850	科达利	400	52,900.00	0.00
111	002709	天赐材料	1,200	49,428.00	0.00
112	002531	天顺风能	3,100	47,213.00	0.00
113	688041	海光信息	616	42,054.32	0.00
114	601186	中国铁建	2,100	20,685.00	0.00
115	601288	农业银行	5,600	19,768.00	0.00
116	601998	中信银行	3,000	17,940.00	0.00
117	300474	景嘉微	136	12,238.64	0.00
118	000032	深桑达 A	11	361.90	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300229	拓尔思	281,890,459.92	12.41
2	688111	金山办公	223,416,098.89	9.83
3	300308	中际旭创	200,085,048.63	8.81
4	002315	焦点科技	149,980,718.70	6.60
5	300502	新易盛	145,965,011.57	6.42
6	000032	深桑达 A	142,178,631.14	6.26
7	002230	科大讯飞	140,897,287.01	6.20
8	600732	爱旭股份	138,238,335.01	6.08
9	002919	名臣健康	130,234,028.20	5.73
10	300459	汤姆猫	124,328,355.41	5.47

11	002605	姚记科技	123,084,987.01	5.42
12	601900	南方传媒	120,488,049.67	5.30
13	688256	寒武纪	118,706,365.32	5.22
14	300533	冰川网络	116,548,348.00	5.13
15	603019	中科曙光	115,753,869.81	5.09
16	601360	三六零	109,843,338.12	4.83
17	300418	昆仑万维	105,377,926.63	4.64
18	300058	蓝色光标	102,586,609.15	4.52
19	300274	阳光电源	100,641,293.85	4.43
20	300130	新国都	96,469,142.17	4.25
21	601728	中国电信	94,519,512.00	4.16
22	300394	天孚通信	94,419,744.05	4.16
23	601858	中国科传	93,164,663.30	4.10
24	300280	紫天科技	90,615,873.28	3.99
25	300624	万兴科技	87,435,122.41	3.85
26	688668	鼎通科技	85,622,828.92	3.77
27	002368	太极股份	79,548,162.68	3.50
28	002174	游族网络	78,480,769.25	3.45
29	600050	中国联通	76,631,589.88	3.37
30	300033	同花顺	76,451,300.70	3.36
31	600415	小商品城	75,209,122.57	3.31
32	603486	科沃斯	73,383,418.17	3.23
33	300548	博创科技	72,588,024.71	3.19
34	301052	果麦文化	72,261,556.68	3.18
35	300442	润泽科技	70,777,262.02	3.12
36	600536	中国软件	66,543,209.60	2.93
37	300494	盛天网络	65,870,243.83	2.90
38	688095	福昕软件	64,862,625.76	2.85
39	605168	三人行	64,549,831.13	2.84
40	002517	恺英网络	63,063,236.27	2.78
41	300559	佳发教育	59,604,256.08	2.62
42	000977	浪潮信息	59,143,673.06	2.60
43	300474	景嘉微	58,822,408.36	2.59
44	688195	腾景科技	58,304,798.52	2.57
45	300299	富春股份	56,597,894.85	2.49
46	688032	禾迈股份	55,273,987.92	2.43
47	002459	晶澳科技	55,214,404.14	2.43
48	002292	奥飞娱乐	54,631,722.62	2.40
49	300364	中文在线	53,887,846.72	2.37
50	601595	上海电影	52,255,456.43	2.30
51	601949	中国出版	52,030,523.40	2.29
52	600559	老白干酒	51,717,483.62	2.28
53	300570	太辰光	51,623,311.25	2.27
54	002558	巨人网络	48,744,901.99	2.15

55	300002	神州泰岳	48,289,022.17	2.13
56	002343	慈文传媒	46,335,030.20	2.04
57	300291	百纳千成	46,122,925.00	2.03
58	688041	海光信息	45,828,238.62	2.02
59	300634	彩讯股份	45,453,461.64	2.00

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688063	派能科技	226,167,832.62	9.95
2	300418	昆仑万维	210,800,590.57	9.28
3	300229	拓尔思	210,330,311.54	9.26
4	300438	鹏辉能源	188,549,069.09	8.30
5	605117	德业股份	166,848,895.31	7.34
6	000032	深桑达 A	164,741,955.12	7.25
7	688256	寒武纪	160,352,472.23	7.06
8	300058	蓝色光标	156,186,702.08	6.87
9	688348	昱能科技	152,374,084.78	6.71
10	300274	阳光电源	149,397,239.77	6.58
11	601360	三六零	145,306,766.40	6.40
12	688032	禾迈股份	134,402,630.28	5.92
13	300693	盛弘股份	122,355,369.51	5.39
14	601728	中国电信	102,810,647.28	4.53
15	601858	中国科传	97,478,202.80	4.29
16	002897	意华股份	96,480,766.44	4.25
17	300459	汤姆猫	93,091,979.78	4.10
18	603019	中科曙光	90,749,128.81	3.99
19	603486	科沃斯	89,621,249.17	3.94
20	002335	科华数据	89,590,178.51	3.94
21	688111	金山办公	88,278,851.08	3.89
22	002368	太极股份	85,967,402.56	3.78
23	605168	三人行	72,228,093.64	3.18
24	300442	润泽科技	70,622,548.44	3.11
25	600050	中国联通	70,115,727.00	3.09
26	300624	万兴科技	70,075,605.23	3.08
27	603179	新泉股份	68,206,919.98	3.00
28	600415	小商品城	66,321,714.65	2.92
29	002126	银轮股份	66,276,021.94	2.92
30	300769	德方纳米	65,796,068.28	2.90

31	300033	同花顺	63,696,630.65	2.80
32	300474	景嘉微	63,563,544.57	2.80
33	002517	恺英网络	63,318,372.43	2.79
34	600536	中国软件	61,454,339.82	2.70
35	300533	冰川网络	58,585,958.28	2.58
36	002709	天赐材料	57,912,299.77	2.55
37	000977	浪潮信息	52,585,705.91	2.31
38	300570	太辰光	51,127,181.20	2.25
39	603596	伯特利	50,535,707.24	2.22
40	600559	老白干酒	50,281,909.21	2.21
41	002459	晶澳科技	49,969,936.44	2.20
42	688041	海光信息	47,851,059.16	2.11
43	601689	拓普集团	47,089,347.32	2.07
44	300548	博创科技	46,839,148.00	2.06
45	300364	中文在线	45,706,872.34	2.01
46	600732	爱旭股份	45,662,708.25	2.01

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	7,614,683,662.61
卖出股票的收入（成交）总额	7,291,524,975.02

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

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的爱旭股份（600732），因公司未能就发放年终奖做出合理预期并审慎做出决策，存货跌价损失测算中可变现净值的确定方法不合理，对限电影响造成损失的性质认定不准确，导致 2022 年 1 月 29 日业绩预告信息披露不准确，公司在 2022 年 4 月 22 日披露的业绩预告更正公告中对补充计提存货跌价损失的原因披露不准确、不完整，设立子公司的相关决议公司未履行董事会审议程序，且未及时进行信息披露。于 2022 年 12 月 9 日被中国证券监督管理委员会上海监管局出具警示函。

对该证券的投资决策程序的说明：上海爱旭新能源股份有限公司前身为上海港机股份有限公司，主要从事大型港口设备、工程船舶和大型金属结构及其部件、配件的设计、建造和销售。经过收购重组后，上市公司主营业务由房地产开发与经营转型进入太阳能光伏行业。近年来公司电池片盈利稳步修复，推动业绩加速增长，同时推动新型电池技术量产升级，竞争力有望进一步提升。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,067,335.88

2	应收清算款	2,629,706.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	31,147,991.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,845,034.57

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

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
129,843	16,444.22	564,610,346.65	26.44%	1,570,556,758.42	73.56%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,798,397.39	0.0842%
------------------	--------------	---------

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005 年 7 月 29 日）基金份额总额	419,612,160.22
本报告期期初基金份额总额	1,809,198,531.65
本报告期基金总申购份额	1,468,400,713.50
减：本报告期基金总赎回份额	1,142,432,140.08
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,135,167,105.07

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

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	5,274,372,904.49	35.38%	3,804,420.48	35.19%	-
天风证券	2	3,458,876,796.80	23.20%	2,527,996.54	23.38%	-
国金证券	1	2,066,393,902.63	13.86%	1,490,495.91	13.79%	-
兴业证券	2	855,745,781.69	5.74%	621,967.47	5.75%	-
光大证券	1	790,939,344.68	5.31%	570,506.03	5.28%	-
安信证券	1	686,121,352.17	4.60%	501,755.37	4.64%	-
中金财富	1	506,736,850.73	3.40%	370,576.82	3.43%	-
中信建投	1	343,605,799.51	2.31%	251,277.74	2.32%	-
国泰君安	1	262,696,792.26	1.76%	192,110.61	1.78%	-
东方证券	2	252,576,565.01	1.69%	182,185.22	1.69%	-
国信证券	2	139,636,696.28	0.94%	102,107.54	0.94%	-
东北证券	1	130,353,747.31	0.87%	95,326.62	0.88%	-
长江证券	2	98,552,914.97	0.66%	71,740.85	0.66%	-
东吴证券	2	36,565,766.00	0.25%	26,374.64	0.24%	-
民生证券	2	3,033,423.10	0.02%	2,188.10	0.02%	-
中信浙江	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
高盛高华	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内交易单元未发生变更。

2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行主观性评议，形成证券公司交易单元租用意见。

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会核准。

<2> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信浙江	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
高盛高华	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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终止部分代销机构办理旗下基金相关销售业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-06
2	海富通基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-22
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增新华信通基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
5	海富通基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理旗下基金相关销售业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增济安财富（北京）基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-18
7	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加兴业银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-19

§11 影响投资者决策的其他重要信息**11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况**

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 109 只公募基金。截至 2023 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1649 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通基金管理有限公司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。

2020 年 3 月，由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金牛进取奖”，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖项。2020 年 7 月，由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金基金·股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获“IAMAC 推介·2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。

§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股票混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通股票混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通股票混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通股票混合型证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇二三年八月三十一日