

海富通量化先锋股票型证券投资基金
2023 年年度报告
2023 年 12 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年三月二十九日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
§6 审计报告	19
6.1 审计意见	19
6.2 形成审计意见的基础	20
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	20
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	20
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71

8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	71
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	71
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	72
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	72
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	72
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12	投资组合报告附注	72
§9	基金份额持有人信息	73
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	74
§10	开放式基金份额变动	74
§11	重大事件揭示	75
11.1	基金份额持有人大会决议	75
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	75
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
11.4	基金投资策略的改变	75
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	75
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	75
11.6.1	管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	75
11.6.2	托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	75
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8	其他重大事件	77
12	影响投资者决策的其他重要信息	79
§13	备查文件目录	81
13.1	备查文件目录	81
13.2	存放地点	81
13.3	查阅方式	81

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通量化先锋股票型证券投资基金	
基金简称	海富通量化先锋股票	
基金主代码	005188	
交易代码	005188	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2018 年 2 月 8 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	88,823,257.78 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C
下属分级基金的交易代码	005189	005188
报告期末下属分级基金的份 额总额	13,219,244.51 份	75,604,013.27 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在严格控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金，在进行资产配置决策时，依据量化择时模型，对宏观经济、政策预期、市场情绪、投资者行为等指标进行监控，精确把握市场方向，在本基金的投资比例范围内对组合中股票、债券等资产的仓位进行调整。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	许俊
	联系电话	021-38650788	010-66596688
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京西城区复兴门内大街1 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京西城区复兴门内大街1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		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	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号 前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年	
	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C
本期已实现收益	104,484.62	-5,054,866.59	-63,417,070.35	-30,608,442.46	58,641,255.91	34,498,337.58
本期利润	1,355,134.65	-4,369,556.70	-67,590,520.61	-24,230,242.68	41,886,526.45	23,137,374.15
加权平均基金份额本期利润	0.0840	-0.2508	-0.7746	-0.5947	0.3846	0.3687
本期加权平均净值利润率	6.24%	-19.49%	-51.23%	-39.04%	20.26%	19.25%
本期基金份额净值增长率	-6.56%	-6.94%	-25.25%	-25.58%	22.35%	21.87%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C
期末可	-724,821.2	-4,695,527	3,975,998.2	201,661.04	113,815,796	47,311,175.4

可供分配利润	8	.31	1		.52	5
期末可供分配基金份额利润	-0.0548	-0.0621	0.0966	0.0941	0.7527	0.7605
期末基金资产净值	16,181,778.26	92,186,820.48	53,909,262.15	2,808,744.74	265,016,168.80	109,519,148.42
期末基金份额净值	1.2241	1.2193	1.3101	1.3102	1.7527	1.7605
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C
基金份额累计净值增长率	44.07%	43.41%	54.19%	54.10%	106.29%	107.06%

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

1. 海富通量化先锋股票 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	-5.85%	0.81%	-3.53%	0.69%	-2.32%	0.12%
过去六个 月	-10.18%	0.80%	-7.33%	0.68%	-2.85%	0.12%
过去一年	-6.56%	0.74%	-5.19%	0.66%	-1.37%	0.08%
过去三年	-14.55%	1.20%	-9.35%	0.86%	-5.20%	0.34%
过去五年	78.46%	1.26%	30.21%	1.03%	48.25%	0.23%
自基金合 同生效起 至今	44.07%	1.23%	2.58%	1.06%	41.49%	0.17%

2. 海富通量化先锋股票 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	-5.94%	0.81%	-3.53%	0.69%	-2.41%	0.12%
过去六个 月	-10.37%	0.80%	-7.33%	0.68%	-3.04%	0.12%
过去一年	-6.94%	0.74%	-5.19%	0.66%	-1.75%	0.08%
过去三年	-15.59%	1.20%	-9.35%	0.86%	-6.24%	0.34%
过去五年	74.91%	1.26%	30.21%	1.03%	44.70%	0.23%
自基金合 同生效起 至今	43.41%	1.24%	2.58%	1.06%	40.83%	0.18%

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

海富通量化先锋股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1. 海富通量化先锋股票 A

(2018 年 2 月 8 日至 2023 年 12 月 31 日)



2. 海富通量化先锋股票 C

(2018 年 2 月 8 日至 2023 年 12 月 31 日)

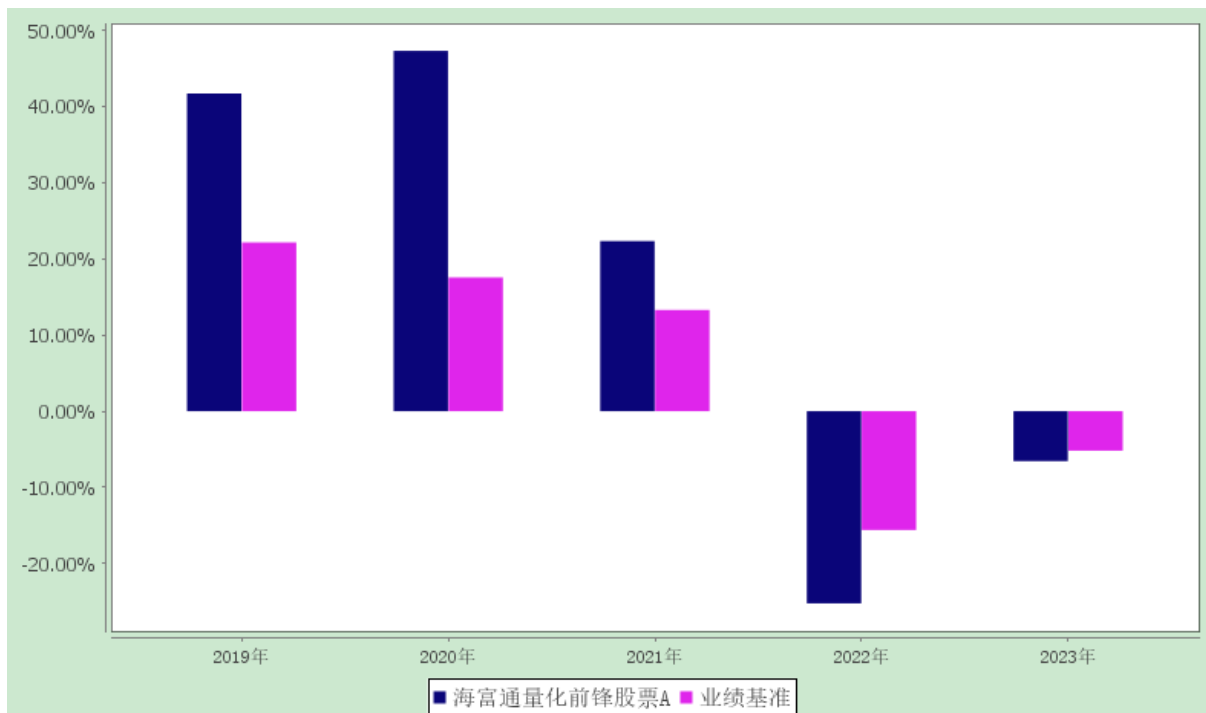


注：本基金合同于 2018 年 2 月 8 日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

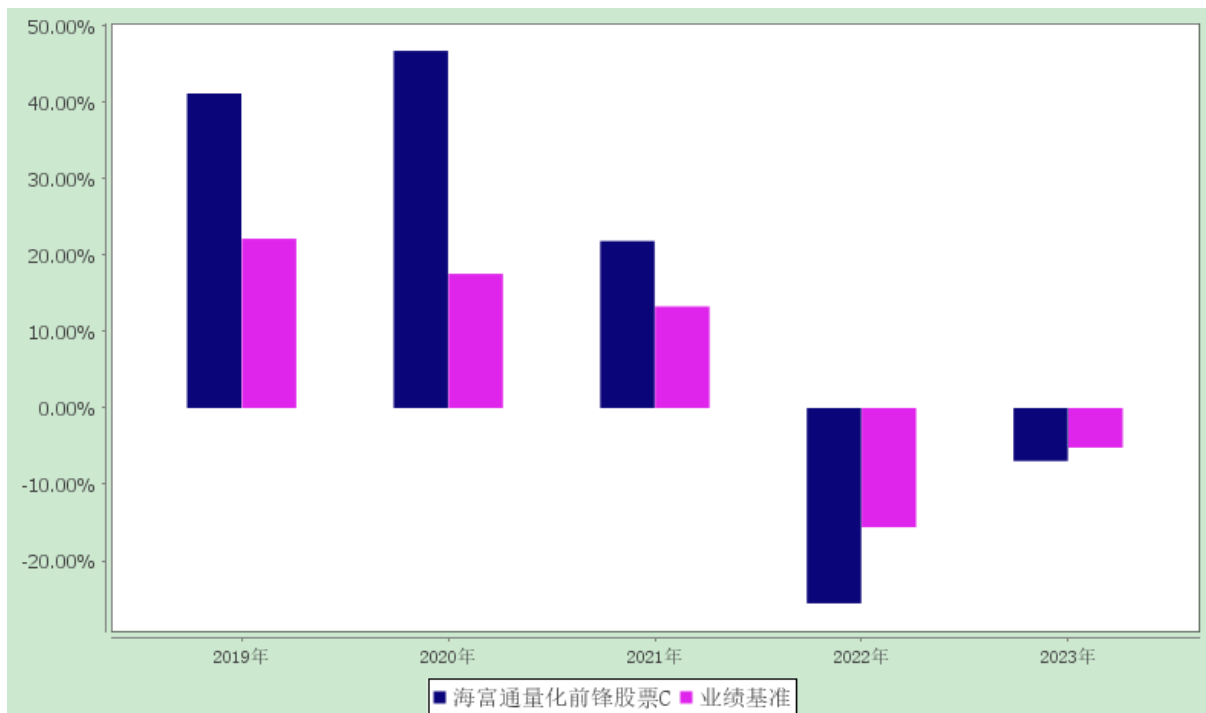
3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通量化先锋股票型证券投资基金
过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1. 海富通量化先锋股票 A



2. 海富通量化先锋股票 C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、海富通量化先锋股票 A:

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	3.140	56,764,578.33	88,665.76	56,853,244.09	-
合计	3.140	56,764,578.33	88,665.76	56,853,244.09	-

2、海富通量化先锋股票 C:

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	3.140	15,521,800.31	10,491,888.74	26,013,689.05	-
合计	3.140	15,521,800.31	10,491,888.74	26,013,689.05	-

§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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 88 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、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、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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李自悟	本基金的基金经理	2023-02-15	-	15 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2008 年 4 月至 2010 年 1 月任 MNJ Capital Management 交易员，2010 年 7 月至 2011 年 6 月任 BlackRock 研究员，2011 年 7 月至 2016 年 3 月任国家外汇管理局中央外汇业务中心基金经理，2016 年 3 月至 2019 年 8 月任上海均直资产管理有限公司基金经理，2019 年 9 月至 2022 年 8 月任野村东方国际证券量化投资主管。2022 年 8 月加入海富通基金管理有限公司。2023 年 2 月起任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。2023 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合基金经理。
朱斌全	本基金的基金经理	2022-12-13	-	16 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018 年 11 月至 2022 年 8 月任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月至 2022 年 12 月兼任海富通富祥混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通沪深 300

					增强（原海富通富睿混合）、海富通量化多因子混合及海富通欣益混合的基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通欣享混合的基金经理。2020 年 10 月至 2022 年 8 月兼任海富通新内需混合基金经理。2022 年 8 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2022 年 12 月起兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 指数增强基金经理。
林立禾	本基金的基金经理助理	2022-12-06	2023-11-23	5 年	美国密歇根大学定量金融与风险管理硕士。历任中欧基金管理有限公司风险管理部量化风控岗。2020 年 8 月加入海富通基金管理有限公司，历任量化研究员、量化投资部基金经理助理。2023 年 11 月起任海富通欣益混合、海富通富利三个月持有、海富通沪深 300 增强的基金经理。

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年，国内经济逐步复苏，全年实现 GDP 增速 5.2%。同时物价较为平稳，全年 CPI 上涨 0.2%。经济复苏方向较为确定，但复苏的速度略低于市场预期。特别是以房地产为代表的传统行业，对实体经济有一定的拖累作用。海外资金受制于较高的美债利率，全年先流入后流出，特别是在四季度对市场影响较大。

从 A 股市场看，全年主要指数均以下跌为主，上证指数为-3.70%，沪深 300 为-11.38%，中证 800 为-10.37%，创业板指为-19.41%。行业板块方面，根据中信一级行业分类，通信、传媒、煤炭、家电、石油石化排名前五，涨幅分别为 24.78%、19.84%、13.39%、9.13%、9.03%；消费者服务、房地产、电力设备及新能源、建材、基础化工排名后五，分别下跌 41.18%、24.80%、24.65%、20.47%、17.50%。

基金投资策略方面，本基金以量化多因子选股体系为框架，以人工智能深度学习模型为核心，对多维度历史数据进行深度解析，总结归纳市场运行规律，并将相关成果系统性的应用于投资实践。同时，结合基于机器学习的市场基金持仓结构跟踪模型，力争在战胜业绩比较基准的同时，在同类型基金中获得超额收益。在运作方面，本基金严格限制行业和个股偏离，并通过风险模型保持投资组合的风格暴露在合理范围之内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通量化先锋股票 A 净值增长率为-6.56%，同期业绩比较基准收益率为-5.19%，基金净值跑输业绩比较基准 1.37 个百分点。海富通量化先锋股票 C 净值增

长率为-6.94%，同期业绩比较基准收益率为-5.19%，基金净值跑输业绩比较基准 1.75 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

2023 年量化策略整体表现较为突出，一方面得益于偏震荡的市场环境，适合反转类的量化策略。另一方面市场风格偏向小市值，特别是微盘股等市场关注度较低的板块表现较好，和量化倾向于小市值的投资风格较为吻合。但需要注意当风格走向极致时，往往也意味着资金的扎堆和策略的拥挤。市场的反身性可能也预示着趋势拐点的临近。

展望 2024 年，持续了近 3 年的小盘风格是否延续可能是对量化策略影响最大的因素之一。如何在市场风格反转时控制好风险，是量化策略永远的挑战。同时，在风格变化后，量化策略如何迭代，能否适应新的市场环境，会成为在 2024 年的胜负手。但同时需要指出的是，量化策略的回撤事实上也并不罕见，国内或是国外市场都存在。好的组合管理在超额收益回撤后也往往能较快的修复业绩。面对业绩的波动，保持一颗冷静的平常心，可能是每个量化基金经理所面对的最大的挑战。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过业务审核、合规检查、系统监控、重点抽查、专项稽核等一系列方式开展工作，强化基金运作和公司运营的合规性，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、加强合规管理，持续完善公司的规章制度，健全内控体系，落实内控责任。

报告期内，坚持以法律法规和公司制度为依据，对公司和基金运作的各项业务开展提供全面的合规咨询、审核、监测与检查，确保基金运作的合法合规性。根据法律法规、监管政策的变化，结合业务发展及公司管理需要，新增和修订了多项内部制度和流程，并持续倡导合规文化建设，提升了公司内部控制环境建设。

二、客观开展内外部内控评估，进一步完善内控措施。

根据法规、监管要求并结合风险导向和全覆盖原则，公司继续通过日常业务的定期合规检查、不定期自查等方式，重点关注规章制度的执行情况、第一道防线风险控制的有效性和投资运作与产品合同约定的一致性。同时，对各部门的业务有重点的开展了多项专项检查和内部审计。另外，根据法规和公司管理需要，公司聘请会计师事务所等外部专业机构对公司开展了内部控制评价等方面的审计。针对上述内外部评估检查中发现的问题，公司相关业务部门均认真进行整改。通过及时跟踪落实各项问题的整改情况，严格控制了各部门的主要风险，加强并完善了公司的内部控制状况。

三、有效推进反洗钱与反恐怖融资工作。

报告期内，结合反洗钱法规及公司业务特点完善了反洗钱制度及流程，组织多场反

洗钱专项培训和宣传活动；基于风险为本的工作思路，继续开展客户信息数据治理工作，稳步推进代销机构分类管理工作，全面升级反洗钱系统，持续优化监测模型，强化对大额交易和可疑交易方面的监控，并按时向中国反洗钱监测分析中心报送相关数据。报告期内，公司根据监管要求完成了 2022 年度洗钱固有风险评估工作，有效管控公司洗钱固有风险敞口。另外，公司加大反洗钱课题研习工作力度，组织反洗钱专兼职人员深入开展相关课题研究，提升反洗钱工作质效。

四、强化法规学习，组织开展内外部培训，提升员工的合规及风险意识。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，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 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。

本基金报告期内未进行过利润分配，但符合基金合同规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2023 年 3 月 23 日至 2023 年 6 月 19 日，连续五十九个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形；自 2023 年 7 月 7 日至 2023 年 8 月 4 日，连续二十一个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在海富通量化先锋股票型证券投资基金（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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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 审计报告

普华永道中天审字(2024)第 20575 号

海富通量化先锋股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

（一）我们审计的内容

我们审计了海富通量化前锋股票型证券投资基金(以下简称“海富通量化前锋股票基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了海富通量化前锋股票基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于海富通量化前锋股票基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

海富通量化前锋股票基金的基金管理人海富通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估海富通量化前锋股票基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算海富通量化前锋股票基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督海富通量化前锋股票基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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

决策，则通常认为错报是重大的。

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

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

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

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

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对海富通量化先锋股票基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致海富通量化先锋股票基金不能持续经营。

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

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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

朱宏宇 胡莲莲

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2024 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通量化先锋股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	7,555,904.08	5,414,052.11
结算备付金		9,292,197.48	1,737,968.23
存出保证金		854,167.08	417,665.63
交易性金融资产	7.4.7.2	89,940,626.97	49,992,671.65
其中：股票投资		87,612,919.34	49,987,797.07
基金投资		-	-
债券投资		2,327,707.63	4,874.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,036,243.16	1,176.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		112,679,138.77	57,563,533.71
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,696,024.81	-
应付赎回款		884.14	2,586.81
应付管理人报酬		68,412.05	102,499.75
应付托管费		11,402.01	17,083.30
应付销售服务费		17,310.24	5,581.03
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1,391.34
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	516,506.78	716,384.59
负债合计		4,310,540.03	845,526.82

净资产：			
实收基金	7.4.7.7	88,823,257.78	43,292,041.16
未分配利润	7.4.7.8	19,545,340.96	13,425,965.73
净资产合计		108,368,598.74	56,718,006.89
负债和净资产总计		112,679,138.77	57,563,533.71

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.2241 元，C 类基金份额净值 1.2193 元。基金份额总额 88,823,257.78 份，其中 A 类基金份额 13,219,244.51 份，C 类基金份额 75,604,013.27 份。

7.2 利润表

会计主体：海富通量化先锋股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-2,115,847.81	-87,923,245.66
1.利息收入		42,757.73	148,437.35
其中：存款利息收入	7.4.7.9	42,052.64	145,919.45
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		705.09	2,517.90
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,300,754.36	-90,451,766.16
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-4,575,514.48	-92,820,884.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	17,295.82	123,577.18
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-64,851.56	351,616.66
股利收益	7.4.7.14	322,315.86	1,893,924.75
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	1,935,959.92	2,204,749.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	206,188.90	175,333.63
减：二、营业总支出		898,574.24	3,897,517.63

1. 管理人报酬		598,545.15	2,964,578.21
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		99,757.49	494,096.36
3. 销售服务费		88,699.71	254,071.78
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		608.95	1,278.62
8. 其他费用	7.4.7.17	110,962.94	183,492.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,014,422.05	-91,820,763.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,014,422.05	-91,820,763.29
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,014,422.05	-91,820,763.29

7.3 净资产变动表

会计主体：海富通量化先锋股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	43,292,041.16	-	13,425,965.73	56,718,006.89
二、本期期初净资产	43,292,041.16	-	13,425,965.73	56,718,006.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	45,531,216.62	-	6,119,375.23	51,650,591.85
（一）、综合收益总额	-	-	-3,014,422.05	-3,014,422.05
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减	45,531,216.62	-	9,133,797.28	54,665,013.90

少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	147,187,814.90	-	43,478,933.37	190,666,748.27
2. 基金赎回款	-101,656,598.28	-	-34,345,136.09	-136,001,734.37
(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	88,823,257.78	-	19,545,340.96	108,368,598.74
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	213,408,345.25	-	161,126,971.97	374,535,317.22
二、本期期初净资产	213,408,345.25	-	161,126,971.97	374,535,317.22
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-170,116,304.09	-	-147,701,006.24	-317,817,310.33
(一)、综合收益总额	-	-	-91,820,763.29	-91,820,763.29
(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)	-170,116,304.09	-	-55,880,242.95	-225,996,547.04
其中：1. 基金申购款	22,343,138.60	-	13,998,975.84	36,342,114.44
2. 基金赎回款	-192,459,442.69	-	-69,879,218.79	-262,338,661.48
(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	43,292,041.16	-	13,425,965.73	56,718,006.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：胡光涛，会计机构负责人：胡正万

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海富通量化先锋股票型证券投资基金(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[2017]第 1210 号《关于准予海富通量化先锋股票型证券投资基金注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通量化先锋股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 330,949,630.14 元，已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0107 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通量化先锋股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 331,099,125.24 份，其中认购资金利息折合 149,495.10 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《海富通量化先锋股票型证券投资基金基金合同》和《海富通量化先锋股票型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通量化先锋股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、地方政府债、中小企业私募债及其他经中国证监会允许投资的债券）、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）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比

例范围为 80-95%。在每个交易日日终，扣除股指期货合约须缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。股指期货投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×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 2024 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通量化先锋股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1)金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其

变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2)金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3)衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那

么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易

费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基

金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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：

(1)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。

(2)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。

(3)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。

(4)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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	7,555,904.08	5,414,052.11
等于：本金	7,555,154.32	5,413,457.32
加：应计利息	749.76	594.79
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	7,555,904.08	5,414,052.11

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	87,038,205.62	-	87,612,919.34	574,713.72	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,299,904.00	26,101.71	2,327,707.63	1,701.92
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,299,904.00	26,101.71	2,327,707.63	1,701.92
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	89,338,109.62	26,101.71	89,940,626.97	576,415.64	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	

股票		51,242,631.87	-	49,987,797.07	-1,254,834.80
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	4,300.00	4.06	4,874.58	570.52
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,300.00	4.06	4,874.58	570.52
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		51,246,931.87	4.06	49,992,671.65	-1,254,264.28

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	6,642,400.00	-	-	-
——股指期货	6,642,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,642,400.00	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,805,840.00	-	-	-
——股指期货	2,805,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,805,840.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2401	IC2401	3.00	3,262,080.00	-1,880.00
IM2402	IM2402	3.00	3,518,880.00	140,440.00
合计	-	-	-	138,560.00
减：可抵销期货 暂收款	-	-	-	138,560.00
净额	-	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末其他资产无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	411,506.78	421,384.59
其中：交易所市场	411,506.78	421,384.59
银行间市场	-	-
应付利息	-	-

预提费用	105,000.00	295,000.00
合计	516,506.78	716,384.59

7.4.7.7 实收基金

海富通量化先锋股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	41,148,221.69	41,148,221.69
本期申购	7,001,355.66	7,001,355.66
本期赎回（以“-”号填列）	-34,930,332.84	-34,930,332.84
本期末	13,219,244.51	13,219,244.51

海富通量化先锋股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,143,819.47	2,143,819.47
本期申购	140,186,459.24	140,186,459.24
本期赎回（以“-”号填列）	-66,726,265.44	-66,726,265.44
本期末	75,604,013.27	75,604,013.27

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

海富通量化先锋股票 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	3,975,998.21	8,785,042.25	12,761,040.46
本期期初	3,975,998.21	8,785,042.25	12,761,040.46
本期利润	104,484.62	1,250,650.03	1,355,134.65
本期基金份额交易产生	-4,805,304.11	-6,348,337.25	-11,153,641.36

的变动数			
其中：基金申购款	615,673.23	1,909,042.72	2,524,715.95
基金赎回款	-5,420,977.34	-8,257,379.97	-13,678,357.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-724,821.28	3,687,355.03	2,962,533.75

海富通量化先锋股票 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	201,661.04	463,264.23	664,925.27
本期期初	201,661.04	463,264.23	664,925.27
本期利润	-5,054,866.59	685,309.89	-4,369,556.70
本期基金份额交易产生的变动数	157,678.24	20,129,760.40	20,287,438.64
其中：基金申购款	3,102,222.73	37,851,994.69	40,954,217.42
基金赎回款	-2,944,544.49	-17,722,234.29	-20,666,778.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,695,527.31	21,278,334.52	16,582,807.21

7.4.7.9 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12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
活期存款利息收入	12,734.56	51,394.09
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	20,712.64	89,057.09
其他	8,605.44	5,468.27
合计	42,052.64	145,919.45

7.4.7.10 股票投资收益

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 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	746,626,592.57	1,485,592,906.24
减：卖出股票成本总额	749,526,571.97	1,574,883,233.31
减：交易费用	1,675,535.08	3,530,557.68
买卖股票差价收入	-4,575,514.48	-92,820,884.75

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	22,881.68	49,992.52
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-5,585.86	73,584.66
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	17,295.82	123,577.18

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	4,471,759.61	6,599,479.68
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	4,408,950.00	6,367,400.00
减：应计利息总额	68,395.29	158,476.16
减：交易费用	0.18	18.86
买卖债券差价收入	-5,585.86	73,584.66

7.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

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12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股指期货投资收益（税前）	-58,272.00	363,160.00
股指期货差价收入应缴纳增值税额	-5,053.40	-10,577.47
减：交易费用	1,526.16	965.87
合计	-64,851.56	351,616.66

7.4.7.14 股利收益

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12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	322,315.86	1,893,924.75
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	322,315.86	1,893,924.75

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	1,830,679.92	2,171,469.52
——股票投资	1,829,548.52	2,171,560.26
——债券投资	1,131.40	-90.74
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	105,280.00	33,280.00
——权证投资	-	-
——股指期货	105,280.00	33,280.00

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	1,935,959.92	2,204,749.52

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
基金赎回费收入	206,188.90	175,333.63
合计	206,188.90	175,333.63

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
审计费用	45,000.00	55,000.00
信息披露费	60,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	5,962.94	8,492.66
合计	110,962.94	183,492.66

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、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
法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东
上海富诚海富通资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	-	-	562,368,108.14	20.46%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期	占当期佣	期末应付佣金余	占期末应付

	佣金	金总量的比例	额	佣金总额的比例
海通证券	409,274.03	22.76%	226,300.33	53.70%

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. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	598,545.15	2,964,578.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	124,066.05	107,452.42
应支付基金管理人的净管理费	474,479.10	2,857,125.79

注：海富通量化先锋股票型证券投资基金的管理费率由 1.50% 下调至 1.20%，自 2023 年 8 月 26 日起执行新的管理费率。

2023 年 8 月 26 日之前，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 × 1.50% / 当年天数。

2023 年 8 月 26 日(含)之后，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 × 1.20% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	99,757.49	494,096.36

注：海富通量化先锋股票型证券投资基金的托管费率由 0.25% 下调至 0.20%，自 2023

年 8 月 26 日起执行新的托管费率。

2023 年 8 月 26 日之前,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。

2023 年 8 月 26 日(含)之后,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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通量化先锋股票A	海富通量化先锋股票C	合计
中国银行	-	406.45	406.45
海通证券	-	485.10	485.10
海富通	-	44,805.76	44,805.76
合计	-	45,697.31	45,697.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通量化先锋股票A	海富通量化先锋股票C	合计
中国银行	-	574.42	574.42
海通证券	-	147.37	147.37
海富通	-	236,942.91	236,942.91
合计	-	237,664.70	237,664.70

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 0.40%,基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 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 x0.40%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期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。

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

本基金本报告期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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	7,555,904.08	12,734.56	5,414,052.11

7.4.10.7 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 2023年1月1日至2023年12月31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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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

				股/张)	
海通证券	688234	天岳先进	网下发行	2,559	211,859.61
海通证券	688259	创耀科技	网下发行	1,595	106,227.00
海通证券	301228	实朴检测	网下发行	3,721	74,717.68

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只股票型的证券投资基金，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，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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 12 月 31 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.00%（2022 年 12 月 31 日：0.01%）。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日

AAA	-	-
AAA 以下	687.36	4,874.58
未评级	2,327,020.27	-
合计	2,327,707.63	4,874.58

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债。

7.4.13.3 流动性风险

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均能及时变现。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金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、债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	7,555,904.08	-	-	-	7,555,904.08
结算备付金	9,292,197.48	-	-	-	9,292,197.48
存出保证金	40,451.88	-	-	813,715.20	854,167.08
交易性金融资产	2,327,020.27	687.36	-	87,612,919.34	89,940,626.97
应收申购款	5,000,009.99	-	-	36,233.17	5,036,243.16
资产总计	24,215,583.70	687.36	-	88,462,867.71	112,679,138.77
负债					
应付清算款	-	-	-	3,696,024.81	3,696,024.81
应付赎回款	-	-	-	884.14	884.14
应付管理人报酬	-	-	-	68,412.05	68,412.05
应付托管费	-	-	-	11,402.01	11,402.01
应付销售服务费	-	-	-	17,310.24	17,310.24
其他负债	-	-	-	516,506.78	516,506.78
负债总计	-	-	-	4,310,540.03	4,310,540.03
利率敏感度缺口	24,215,583.70	687.36	-	84,152,327.68	108,368,598.74
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,414,052.11	-	-	-	5,414,052.11
结算备付金	1,737,968.23	-	-	-	1,737,968.23
存出保证金	39,512.03	-	-	378,153.60	417,665.63
交易性金融资产	-	2,592.19	2,282.39	49,987,797.07	49,992,671.65
应收申购款	-	-	-	1,176.09	1,176.09
资产总计	7,191,532.37	2,592.19	2,282.39	50,367,126.76	57,563,533.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,586.81	2,586.81
应付管理人报酬	-	-	-	102,499.75	102,499.75
应付托管费	-	-	-	17,083.30	17,083.30
应付销售服务费	-	-	-	5,581.03	5,581.03
应交税费	-	-	-	1,391.34	1,391.34

其他负债	-	-	-	716,384.59	716,384.59
负债总计	-	-	-	845,526.82	845,526.82
利率敏感度缺口	7,191,532.37	2,592.19	2,282.39	49,521,599.94	56,718,006.89

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-2,769.91	-55.29
市场利率下降 25 个基点	2,780.09	56.10	

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市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。本基金投资组合中股票及存托凭证投资 80%-95%、权证投资 0%-3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	87,612,919.34	80.85	49,987,797.07	88.13
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	87,612,919.34	80.85	49,987,797.07	88.13

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	3,996,839.60	2,208,622.02
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-3,996,839.60	-2,208,622.02

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末	上年度末

	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
第一层次	87,613,606.70	49,943,618.30
第二层次	2,327,020.27	890.43
第三层次	-	48,162.92
合计	89,940,626.97	49,992,671.65

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	48,162.92	48,162.92
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	53,510.33	53,510.33
当期利得或损失总额	-	5,347.41	5,347.41
其中：计入损益的利得或损失	-	5,347.41	5,347.41
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	454,252.50	454,252.50
转出第三层次	-	369,327.57	369,327.57
当期利得或损失总额	-	-36,762.01	-36,762.01
其中：计入损益的利得或损失	-	-36,762.01	-36,762.01
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	48,162.92	48,162.92
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-5,989.98	-5,989.98

注：于2023年12月31日，本基金未持有第三层次的交易性金融资产（2022年12月31日：持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资）。于2023年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资（2022年度：同）。计入损益的利得或损失计入利润表中的投资收益及公允价值变动损益项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	48,162.92	亚式期权模型	预期年化波动率	29.09%~97.55%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年12月31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）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	87,612,919.34	77.75
	其中：股票	87,612,919.34	77.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,327,707.63	2.07
	其中：债券	2,327,707.63	2.07
	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	16,848,101.56	14.95
8	其他各项资产	5,890,410.24	5.23
9	合计	112,679,138.77	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净 值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,521,117.00	2.33
C	制造业	51,728,932.34	47.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应 业	3,566,940.00	3.29
E	建筑业	881,048.00	0.81

F	批发和零售业	2,992,180.00	2.76
G	交通运输、仓储和邮政业	3,898,193.00	3.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,966,530.00	8.27
J	金融业	8,436,497.00	7.79
K	房地产业	838,209.00	0.77
L	租赁和商务服务业	487,265.00	0.45
M	科学研究和技术服务业	953,882.00	0.88
N	水利、环境和公共设施管理业	458,914.00	0.42
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	1,215,206.00	1.12
S	综合	668,006.00	0.62
	合计	87,612,919.34	80.85

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600637	东方明珠	127,000	955,040.00	0.88
2	601901	方正证券	116,900	942,214.00	0.87
3	300364	中文在线	36,600	941,718.00	0.87
4	600126	杭钢股份	169,400	902,902.00	0.83
5	002252	上海莱士	112,400	899,200.00	0.83
6	601136	首创证券	50,600	858,176.00	0.79
7	600959	江苏有线	259,000	813,260.00	0.75
8	002128	电投能源	56,500	806,255.00	0.74
9	600986	浙文互联	146,500	799,890.00	0.74
10	601018	宁波港	224,500	799,220.00	0.74
11	000039	中集集团	104,200	797,130.00	0.74
12	600737	中粮糖业	84,900	699,576.00	0.65
13	600900	长江电力	29,100	679,194.00	0.63

14	600839	四川长虹	128,000	677,120.00	0.62
15	000009	中国宝安	56,900	668,006.00	0.62
16	603659	璞泰来	30,500	638,365.00	0.59
17	601398	工商银行	128,800	615,664.00	0.57
18	002475	立讯精密	17,700	609,765.00	0.56
19	601939	建设银行	93,100	606,081.00	0.56
20	601328	交通银行	104,800	601,552.00	0.56
21	001213	中铁特货	141,100	592,620.00	0.55
22	601985	中国核电	78,300	587,250.00	0.54
23	603283	赛腾股份	8,000	580,480.00	0.54
24	000408	藏格矿业	22,200	562,548.00	0.52
25	601995	中金公司	14,700	559,335.00	0.52
26	001965	招商公路	56,700	553,959.00	0.51
27	002001	新 和 成	32,300	547,808.00	0.51
28	300551	古鳌科技	31,400	546,360.00	0.50
29	002533	金杯电工	61,600	497,728.00	0.46
30	600674	川投能源	32,900	497,448.00	0.46
31	001872	招商港口	29,600	472,416.00	0.44
32	601298	青岛港	73,000	451,140.00	0.42
33	300750	宁德时代	2,700	440,802.00	0.41
34	601288	农业银行	120,900	440,076.00	0.41
35	000829	天音控股	43,500	414,990.00	0.38
36	000063	中兴通讯	15,400	407,792.00	0.38
37	000572	海马汽车	81,400	399,674.00	0.37
38	600873	梅花生物	40,800	389,640.00	0.36
39	600383	金地集团	88,400	385,424.00	0.36
40	600016	民生银行	100,000	374,000.00	0.35
41	601158	重庆水务	65,200	369,684.00	0.34
42	600350	山东高速	52,000	360,880.00	0.33
43	300102	乾照光电	48,400	355,740.00	0.33
44	603132	金徽股份	25,900	354,312.00	0.33
45	301123	奕东电子	15,100	354,246.00	0.33
46	002212	天融信	36,200	354,036.00	0.33
47	002035	华帝股份	56,800	352,728.00	0.33
48	603636	南威软件	27,400	351,268.00	0.32
49	601138	工业富联	23,200	350,784.00	0.32
50	002171	楚江新材	46,700	349,316.00	0.32
51	002540	亚太科技	52,800	349,008.00	0.32
52	601608	中信重工	90,400	348,944.00	0.32
53	002662	京威股份	99,000	347,490.00	0.32
54	600789	鲁抗医药	48,600	347,004.00	0.32
55	002498	汉缆股份	86,600	346,400.00	0.32
56	002091	江苏国泰	44,200	346,086.00	0.32
57	000036	华联控股	88,900	345,821.00	0.32

58	600519	贵州茅台	200	345,200.00	0.32
59	000012	南玻A	61,900	344,783.00	0.32
60	600740	山西焦化	68,100	343,224.00	0.32
61	600710	苏美达	48,300	342,447.00	0.32
62	600623	华谊集团	53,100	341,964.00	0.32
63	000883	湖北能源	80,600	340,938.00	0.31
64	600941	中国移动	3,400	338,232.00	0.31
65	603708	家家悦	25,600	334,592.00	0.31
66	002241	歌尔股份	14,500	304,645.00	0.28
67	000997	新大陆	15,400	301,994.00	0.28
68	600398	海澜之家	40,300	299,026.00	0.28
69	601728	中国电信	55,000	297,550.00	0.27
70	600298	安琪酵母	8,400	295,512.00	0.27
71	000333	美的集团	5,400	295,002.00	0.27
72	300136	信维通信	12,400	292,640.00	0.27
73	002938	鹏鼎控股	13,100	292,392.00	0.27
74	688080	映翰通	7,200	292,176.00	0.27
75	600845	宝信软件	5,900	287,920.00	0.27
76	300894	火星人	17,700	287,448.00	0.27
77	300433	蓝思科技	21,700	286,440.00	0.26
78	688181	八亿时空	10,600	286,200.00	0.26
79	603109	神驰机电	17,400	285,708.00	0.26
80	600774	汉商集团	28,800	283,968.00	0.26
81	300501	海顺新材	19,600	282,828.00	0.26
82	300033	同花顺	1,800	282,366.00	0.26
83	601225	陕西煤业	13,500	282,015.00	0.26
84	300782	卓胜微	2,000	282,000.00	0.26
85	601077	渝农商行	69,000	281,520.00	0.26
86	000338	潍柴动力	20,600	281,190.00	0.26
87	300122	智飞生物	4,600	281,106.00	0.26
88	600276	恒瑞医药	6,200	280,426.00	0.26
89	600660	福耀玻璃	7,500	280,425.00	0.26
90	300496	中科创达	3,500	280,210.00	0.26
91	002223	鱼跃医疗	8,100	280,098.00	0.26
92	600863	内蒙华电	71,500	278,850.00	0.26
93	002730	电光科技	29,400	278,712.00	0.26
94	601766	中国中车	52,900	278,254.00	0.26
95	601633	长城汽车	11,000	277,420.00	0.26
96	601336	新华保险	8,900	277,057.00	0.26
97	300999	金龙鱼	8,300	277,054.00	0.26
98	000661	长春高新	1,900	277,020.00	0.26
99	603259	药明康德	3,800	276,488.00	0.26
100	601888	中国中免	3,300	276,177.00	0.25
101	000625	长安汽车	16,400	276,012.00	0.25

102	601881	中国银河	22,900	275,945.00	0.25
103	002459	晶澳科技	13,300	275,576.00	0.25
104	601800	中国交建	36,100	274,360.00	0.25
105	688499	利元亨	7,197	274,061.76	0.25
106	000977	浪潮信息	8,200	272,240.00	0.25
107	002129	TCL 中环	17,175	268,617.00	0.25
108	300769	德方纳米	4,400	268,532.00	0.25
109	600588	用友网络	15,000	266,850.00	0.25
110	300922	天秦装备	15,300	261,171.00	0.24
111	000910	大亚圣象	32,500	260,000.00	0.24
112	600025	华能水电	30,000	258,900.00	0.24
113	002415	海康威视	7,400	256,928.00	0.24
114	300319	麦捷科技	25,700	247,748.00	0.23
115	601899	紫金矿业	19,600	244,216.00	0.23
116	603185	弘元绿能	7,300	242,944.00	0.22
117	300149	睿智医药	31,700	242,505.00	0.22
118	601179	中国西电	48,100	237,133.00	0.22
119	300896	爱美客	800	235,464.00	0.22
120	603501	韦尔股份	2,200	234,762.00	0.22
121	002600	领益智造	34,100	230,516.00	0.21
122	601319	中国人保	46,000	222,640.00	0.21
123	688010	福光股份	9,200	221,352.00	0.20
124	688111	金山办公	700	221,340.00	0.20
125	601919	中远海控	23,100	221,298.00	0.20
126	600015	华夏银行	39,300	220,866.00	0.20
127	603799	华友钴业	6,700	220,631.00	0.20
128	002821	凯莱英	1,900	220,590.00	0.20
129	002384	东山精密	11,900	216,342.00	0.20
130	601688	华泰证券	15,300	213,435.00	0.20
131	601818	光大银行	72,900	211,410.00	0.20
132	002027	分众传媒	33,400	211,088.00	0.19
133	601607	上海医药	12,600	210,798.00	0.19
134	688680	海优新材	3,200	210,080.00	0.19
135	600085	同仁堂	3,900	209,430.00	0.19
136	300219	鸿利智汇	24,800	208,816.00	0.19
137	002130	沃尔核材	27,400	206,870.00	0.19
138	688981	中芯国际	3,900	206,778.00	0.19
139	002352	顺丰控股	5,100	206,040.00	0.19
140	300296	利亚德	34,100	204,600.00	0.19
141	601211	国泰君安	13,700	203,856.00	0.19
142	300866	安克创新	2,300	203,780.00	0.19
143	688188	柏楚电子	800	202,488.00	0.19
144	688128	中国电研	9,800	201,096.00	0.19
145	688255	凯尔达	8,200	200,490.00	0.19

146	600584	长电科技	6,700	200,062.00	0.18
147	301235	华康医疗	7,800	199,914.00	0.18
148	300120	经纬辉开	27,500	199,650.00	0.18
149	603917	合力科技	11,200	198,912.00	0.18
150	600066	宇通客车	15,000	198,750.00	0.18
151	002236	大华股份	10,700	197,415.00	0.18
152	601600	中国铝业	35,000	197,400.00	0.18
153	000568	泸州老窖	1,100	197,362.00	0.18
154	000423	东阿阿胶	4,000	197,280.00	0.18
155	601699	潞安环能	9,000	197,190.00	0.18
156	600894	广日股份	26,800	196,980.00	0.18
157	300001	特锐德	9,800	196,980.00	0.18
158	002731	萃华珠宝	17,800	196,868.00	0.18
159	300839	博汇股份	19,200	196,416.00	0.18
160	300355	蒙草生态	52,300	196,125.00	0.18
161	600050	中国联通	44,700	195,786.00	0.18
162	002493	荣盛石化	18,900	195,615.00	0.18
163	000932	华菱钢铁	37,800	194,670.00	0.18
164	600600	青岛啤酒	2,600	194,350.00	0.18
165	688363	华熙生物	2,900	194,097.00	0.18
166	600019	宝钢股份	32,700	193,911.00	0.18
167	601186	中国铁建	25,400	193,294.00	0.18
168	000707	双环科技	24,100	192,800.00	0.18
169	601628	中国人寿	6,800	192,780.00	0.18
170	601390	中国中铁	33,900	192,552.00	0.18
171	601100	恒立液压	3,500	191,380.00	0.18
172	301302	华如科技	7,600	190,836.00	0.18
173	002083	孚日股份	37,800	190,512.00	0.18
174	688045	必易微	4,400	188,452.00	0.17
175	000963	华东医药	4,500	186,570.00	0.17
176	301197	工大科雅	9,900	186,021.00	0.17
177	000938	紫光股份	9,600	185,760.00	0.17
178	603589	口子窖	4,100	185,730.00	0.17
179	603136	天目湖	10,100	185,537.00	0.17
180	688078	龙软科技	4,600	185,472.00	0.17
181	603369	今世缘	3,800	185,250.00	0.17
182	603076	乐惠国际	6,900	184,920.00	0.17
183	688521	芯原股份	3,700	184,852.00	0.17
184	688168	安博通	5,100	184,416.00	0.17
185	601231	环旭电子	12,200	184,342.00	0.17
186	688012	中微公司	1,200	184,320.00	0.17
187	688056	莱伯泰科	5,500	184,305.00	0.17
188	688479	友车科技	7,900	184,228.00	0.17
189	000100	TCL 科技	42,800	184,040.00	0.17

190	603328	依顿电子	22,500	183,375.00	0.17
191	301187	欧圣电气	9,200	183,172.00	0.17
192	002649	博彦科技	14,900	182,823.00	0.17
193	301138	华研精机	6,300	182,700.00	0.17
194	000663	永安林业	22,500	181,800.00	0.17
195	603019	中科曙光	4,600	181,654.00	0.17
196	002283	天润工业	31,000	181,350.00	0.17
197	003029	吉大正元	9,200	181,332.00	0.17
198	300414	中光防雷	18,800	181,044.00	0.17
199	600176	中国巨石	18,400	180,872.00	0.17
200	301258	富士莱	5,600	180,768.00	0.17
201	001207	联科科技	10,600	180,730.00	0.17
202	600741	华域汽车	11,100	180,708.00	0.17
203	603197	保隆科技	3,200	180,480.00	0.17
204	688613	奥精医疗	8,100	180,306.00	0.17
205	688126	沪硅产业	10,400	180,128.00	0.17
206	000612	焦作万方	31,300	179,975.00	0.17
207	000725	京东方 A	46,100	179,790.00	0.17
208	300408	三环集团	6,100	179,645.00	0.17
209	300534	陇神戎发	18,200	179,634.00	0.17
210	603993	洛阳钼业	34,500	179,400.00	0.17
211	600529	山东药玻	7,000	179,200.00	0.17
212	002461	珠江啤酒	22,500	177,750.00	0.16
213	300439	美康生物	15,300	177,633.00	0.16
214	688303	大全能源	6,000	177,420.00	0.16
215	600351	亚宝药业	25,700	177,330.00	0.16
216	600885	宏发股份	6,400	176,896.00	0.16
217	601998	中信银行	33,400	176,686.00	0.16
218	002165	红宝丽	41,700	176,391.00	0.16
219	688667	菱电电控	2,104	172,612.16	0.16
220	688002	睿创微纳	3,900	172,458.00	0.16
221	600469	风神股份	27,600	170,292.00	0.16
222	600522	中天科技	13,500	168,615.00	0.16
223	002462	嘉事堂	11,800	167,678.00	0.15
224	603737	三棵树	3,520	167,587.20	0.15
225	600031	三一重工	12,100	166,617.00	0.15
226	000933	神火股份	9,900	166,320.00	0.15
227	300454	深信服	2,300	166,267.00	0.15
228	600702	舍得酒业	1,700	164,390.00	0.15
229	300166	东方国信	17,400	163,560.00	0.15
230	600037	歌华有线	21,000	162,330.00	0.15
231	002410	广联达	9,400	161,116.00	0.15
232	300882	万胜智能	6,600	160,776.00	0.15
233	688510	航亚科技	8,731	153,840.22	0.14

234	688580	伟思医疗	2,400	153,432.00	0.14
235	600150	中国船舶	5,200	153,088.00	0.14
236	601163	三角轮胎	10,600	152,746.00	0.14
237	300285	国瓷材料	6,600	152,592.00	0.14
238	600480	凌云股份	16,700	152,137.00	0.14
239	002651	利君股份	21,700	150,164.00	0.14
240	300014	亿纬锂能	3,500	147,700.00	0.14
241	600979	广安爱众	42,600	147,396.00	0.14
242	300645	正元智慧	8,100	147,339.00	0.14
243	300760	迈瑞医疗	500	145,300.00	0.13
244	600436	片仔癀	600	145,194.00	0.13
245	300558	贝达药业	2,800	144,340.00	0.13
246	601799	星宇股份	1,100	144,221.00	0.13
247	688307	中润光学	4,600	143,060.00	0.13
248	000589	贵州轮胎	23,300	142,596.00	0.13
249	301231	荣信文化	5,600	142,520.00	0.13
250	605066	天正电气	15,500	142,290.00	0.13
251	000425	徐工机械	26,000	141,960.00	0.13
252	300683	海特生物	3,900	140,829.00	0.13
253	002138	顺络电子	5,200	140,452.00	0.13
254	002788	鹭燕医药	15,600	140,244.00	0.13
255	601816	京沪高铁	28,500	140,220.00	0.13
256	600332	白云山	4,900	140,140.00	0.13
257	300373	扬杰科技	3,800	139,460.00	0.13
258	000617	中油资本	25,800	139,320.00	0.13
259	688009	中国通号	31,800	139,284.00	0.13
260	600382	广东明珠	30,800	139,216.00	0.13
261	000893	亚钾国际	5,300	139,072.00	0.13
262	002412	汉森制药	20,500	138,990.00	0.13
263	000823	超声电子	14,500	138,765.00	0.13
264	601668	中国建筑	28,800	138,528.00	0.13
265	600901	江苏金租	28,500	137,940.00	0.13
266	688082	盛美上海	1,300	135,733.00	0.13
267	688117	圣诺生物	4,800	135,360.00	0.12
268	300009	安科生物	13,100	133,882.00	0.12
269	605208	永茂泰	14,000	133,000.00	0.12
270	600699	均胜电子	7,400	132,904.00	0.12
271	688508	芯朋微	2,700	132,867.00	0.12
272	002304	洋河股份	1,200	131,880.00	0.12
273	603000	人民网	4,700	131,506.00	0.12
274	300843	胜蓝股份	5,700	130,986.00	0.12
275	600977	中国电影	10,700	130,968.00	0.12
276	600893	航发动力	3,500	130,830.00	0.12
277	601601	中国太保	5,500	130,790.00	0.12

278	301096	百诚医药	2,000	130,200.00	0.12
279	605009	豪悦护理	3,400	129,778.00	0.12
280	600210	紫江企业	27,400	128,780.00	0.12
281	601958	金钼股份	13,600	128,520.00	0.12
282	601658	邮储银行	29,500	128,325.00	0.12
283	002367	康力电梯	17,000	127,840.00	0.12
284	301126	达嘉维康	9,800	127,694.00	0.12
285	600438	通威股份	5,100	127,653.00	0.12
286	600160	巨化股份	7,700	126,973.00	0.12
287	603985	恒润股份	5,100	126,735.00	0.12
288	600795	国电电力	30,300	126,048.00	0.12
289	000921	海信家电	6,100	124,440.00	0.11
290	001289	龙源电力	6,200	122,822.00	0.11
291	002032	苏泊尔	2,300	121,923.00	0.11
292	000159	国际实业	18,600	120,714.00	0.11
293	603333	尚纬股份	21,100	120,481.00	0.11
294	002624	完美世界	10,100	119,584.00	0.11
295	002271	东方雨虹	6,200	119,040.00	0.11
296	603282	亚光股份	4,600	118,864.00	0.11
297	001212	中旗新材	4,900	116,424.00	0.11
298	688569	铁科轨道	4,200	115,962.00	0.11
299	300957	贝泰妮	1,700	115,889.00	0.11
300	003025	思进智能	8,400	113,484.00	0.10
301	300308	中际旭创	1,000	112,910.00	0.10
302	603102	百合股份	2,900	112,462.00	0.10
303	002287	奇正藏药	5,000	112,450.00	0.10
304	000960	锡业股份	7,800	111,696.00	0.10
305	002080	中材科技	7,000	111,440.00	0.10
306	002230	科大讯飞	2,400	111,312.00	0.10
307	600489	中金黄金	11,100	110,556.00	0.10
308	000050	深天马 A	10,300	109,695.00	0.10
309	600266	城建发展	22,100	106,964.00	0.10
310	600362	江西铜业	5,900	105,374.00	0.10
311	002949	华阳国际	7,500	104,775.00	0.10
312	300228	富瑞特装	14,600	103,660.00	0.10
313	300358	楚天科技	9,600	102,720.00	0.09
314	603527	众源新材	9,500	102,695.00	0.09
315	301361	众智科技	4,300	102,512.00	0.09
316	603288	海天味业	2,700	102,465.00	0.09
317	688503	聚和材料	1,900	101,840.00	0.09
318	000783	长江证券	18,900	101,682.00	0.09
319	000822	山东海化	14,700	100,548.00	0.09
320	002139	拓邦股份	10,300	100,528.00	0.09
321	000786	北新建材	4,300	100,448.00	0.09

322	601021	春秋航空	2,000	100,400.00	0.09
323	600546	山煤国际	5,700	99,807.00	0.09
324	600867	通化东宝	9,200	99,636.00	0.09
325	300440	运达科技	13,200	98,340.00	0.09
326	002353	杰瑞股份	3,400	95,574.00	0.09
327	603611	诺力股份	4,900	92,757.00	0.09
328	300515	三德科技	8,000	92,320.00	0.09
329	002768	国恩股份	4,300	92,106.00	0.08
330	688017	绿的谐波	600	92,100.00	0.08
331	300575	中旗股份	12,000	91,680.00	0.08
332	600271	航天信息	8,400	89,376.00	0.08
333	301082	久盛电气	4,900	88,935.00	0.08
334	300227	光韵达	11,100	87,024.00	0.08
335	300337	银邦股份	10,700	86,563.00	0.08
336	688371	菲沃泰	4,900	86,289.00	0.08
337	003816	中国广核	27,600	85,836.00	0.08
338	600380	健康元	6,900	85,767.00	0.08
339	600989	宝丰能源	5,800	85,666.00	0.08
340	688182	灿勤科技	4,800	85,344.00	0.08
341	002709	天赐材料	3,400	85,272.00	0.08
342	688489	三未信安	1,800	84,636.00	0.08
343	601318	中国平安	2,100	84,630.00	0.08
344	600760	中航沈飞	2,000	84,360.00	0.08
345	300119	瑞普生物	5,100	83,589.00	0.08
346	603517	绝味食品	3,100	83,266.00	0.08
347	301162	国能日新	1,600	83,008.00	0.08
348	601166	兴业银行	5,100	82,671.00	0.08
349	688065	凯赛生物	1,500	82,470.00	0.08
350	601618	中国中冶	26,900	82,314.00	0.08
351	603260	合盛硅业	1,600	81,600.00	0.08
352	002003	伟星股份	7,500	81,375.00	0.08
353	000533	顺钠股份	17,300	81,137.00	0.07
354	601689	拓普集团	1,100	80,850.00	0.07
355	600301	华锡有色	6,400	80,512.00	0.07
356	688420	美腾科技	3,100	80,104.00	0.07
357	600132	重庆啤酒	1,200	79,740.00	0.07
358	600495	晋西车轴	18,600	79,608.00	0.07
359	300550	和仁科技	5,300	79,447.00	0.07
360	300553	集智股份	2,200	78,760.00	0.07
361	603486	科沃斯	1,900	78,736.00	0.07
362	603681	永冠新材	5,200	78,520.00	0.07
363	603339	四方科技	6,600	78,474.00	0.07
364	688686	奥普特	700	78,400.00	0.07
365	002358	森源电气	18,000	78,300.00	0.07

366	688419	耐科装备	2,200	78,210.00	0.07
367	300800	力合科技	5,700	77,919.00	0.07
368	002277	友阿股份	19,200	77,376.00	0.07
369	002887	绿茵生态	8,900	77,252.00	0.07
370	600262	北方股份	4,000	77,000.00	0.07
371	002641	公元股份	15,300	76,959.00	0.07
372	688273	麦澜德	2,300	76,613.00	0.07
373	002006	精工科技	5,000	76,400.00	0.07
374	688008	澜起科技	1,300	76,388.00	0.07
375	002469	三维化学	12,600	76,356.00	0.07
376	603179	新泉股份	1,500	76,065.00	0.07
377	688728	格科微	3,700	75,739.00	0.07
378	601168	西部矿业	5,300	75,631.00	0.07
379	688368	晶丰明源	700	75,558.00	0.07
380	002422	科伦药业	2,600	75,530.00	0.07
381	000166	申万宏源	17,000	75,480.00	0.07
382	600566	济川药业	2,400	75,432.00	0.07
383	603319	湘油泵	4,300	75,422.00	0.07
384	002582	好想你	9,800	75,166.00	0.07
385	000895	双汇发展	2,800	74,788.00	0.07
386	600418	江淮汽车	4,600	74,290.00	0.07
387	600161	天坛生物	2,400	74,256.00	0.07
388	002050	三花智控	2,500	73,500.00	0.07
389	002213	大为股份	5,200	73,164.00	0.07
390	300875	捷强装备	2,500	72,975.00	0.07
391	600236	桂冠电力	13,100	72,574.00	0.07
392	002019	亿帆医药	4,900	72,422.00	0.07
393	601898	中煤能源	7,400	71,706.00	0.07
394	600188	兖矿能源	3,600	71,316.00	0.07
395	002658	雪迪龙	8,600	69,058.00	0.06

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	002415	海康威视	3,167,083.09	5.58
2	000338	潍柴动力	2,995,278.00	5.28
3	600519	贵州茅台	2,904,991.00	5.12

4	300750	宁德时代	2,828,971.00	4.99
5	601888	中国中免	2,800,695.00	4.94
6	601766	中国中车	2,736,280.00	4.82
7	601138	工业富联	2,721,680.00	4.80
8	002475	立讯精密	2,529,538.00	4.46
9	000063	中兴通讯	2,509,428.00	4.42
10	002129	TCL 中环	2,477,518.50	4.37
11	600660	福耀玻璃	2,446,732.00	4.31
12	000333	美的集团	2,422,667.50	4.27
13	000858	五 粮 液	2,311,318.00	4.08
14	002304	洋河股份	2,178,867.00	3.84
15	000100	TCL 科技	2,177,708.00	3.84
16	600104	上汽集团	2,153,866.00	3.80
17	000725	京东方 A	2,111,569.00	3.72
18	300433	蓝思科技	2,111,345.00	3.72
19	601728	中国电信	2,109,925.00	3.72
20	300999	金龙鱼	2,109,049.00	3.72
21	601899	紫金矿业	2,068,609.00	3.65
22	300308	中际旭创	2,000,841.00	3.53
23	600025	华能水电	1,952,028.00	3.44
24	003816	中国广核	1,946,745.00	3.43
25	601328	交通银行	1,934,684.00	3.41
26	002938	鹏鼎控股	1,933,487.00	3.41
27	000538	云南白药	1,921,394.34	3.39
28	601688	华泰证券	1,907,142.00	3.36
29	002027	分众传媒	1,899,490.00	3.35
30	300014	亿纬锂能	1,891,771.00	3.34
31	601628	中国人寿	1,879,911.00	3.31
32	600941	中国移动	1,846,468.00	3.26
33	688126	沪硅产业	1,844,484.02	3.25
34	002252	上海莱士	1,839,045.00	3.24
35	600188	兖矿能源	1,836,651.09	3.24
36	688111	金山办公	1,804,286.28	3.18
37	600050	中国联通	1,798,904.00	3.17
38	002812	恩捷股份	1,797,762.00	3.17
39	601225	陕西煤业	1,785,682.00	3.15
40	600346	恒力石化	1,782,804.00	3.14
41	000651	格力电器	1,773,592.00	3.13
42	600887	伊利股份	1,771,362.00	3.12
43	600309	万华化学	1,769,206.00	3.12
44	601668	中国建筑	1,748,475.00	3.08
45	600600	青岛啤酒	1,718,097.00	3.03
46	300146	汤臣倍健	1,696,058.00	2.99
47	601398	工商银行	1,675,659.00	2.95

48	600690	海尔智家	1,621,839.00	2.86
49	601012	隆基绿能	1,621,457.00	2.86
50	000938	紫光股份	1,617,578.00	2.85
51	002459	晶澳科技	1,609,795.24	2.84
52	600885	宏发股份	1,606,906.00	2.83
53	600258	首旅酒店	1,583,535.00	2.79
54	601816	京沪高铁	1,579,911.00	2.79
55	688128	中国电研	1,560,434.10	2.75
56	601100	恒立液压	1,549,935.07	2.73
57	688521	芯原股份	1,540,022.91	2.72
58	002001	新 和 成	1,530,836.00	2.70
59	600276	恒瑞医药	1,524,169.00	2.69
60	600031	三一重工	1,523,629.00	2.69
61	600637	东方明珠	1,512,093.00	2.67
62	603659	璞泰来	1,501,180.00	2.65
63	603259	药明康德	1,486,902.00	2.62
64	300498	温氏股份	1,477,118.00	2.60
65	600900	长江电力	1,469,196.00	2.59
66	002568	百润股份	1,469,182.00	2.59
67	601601	中国太保	1,454,529.00	2.56
68	002352	顺丰控股	1,439,583.00	2.54
69	601658	邮储银行	1,437,296.00	2.53
70	601901	方正证券	1,434,423.82	2.53
71	002078	太阳纸业	1,433,581.29	2.53
72	600438	通威股份	1,428,699.00	2.52
73	600741	华域汽车	1,428,267.00	2.52
74	601006	大秦铁路	1,424,298.00	2.51
75	600126	杭钢股份	1,422,717.00	2.51
76	002714	牧原股份	1,402,403.60	2.47
77	601018	宁波港	1,400,294.00	2.47
78	002223	鱼跃医疗	1,390,212.00	2.45
79	300274	阳光电源	1,386,385.00	2.44
80	600584	长电科技	1,365,644.00	2.41
81	601336	新华保险	1,361,533.00	2.40
82	601088	中国神华	1,357,800.00	2.39
83	601360	三六零	1,355,962.00	2.39
84	600016	民生银行	1,345,508.00	2.37
85	603288	海天味业	1,335,508.90	2.35
86	000568	泸州老窖	1,322,662.00	2.33
87	002179	中航光电	1,309,096.00	2.31
88	300769	德方纳米	1,305,145.80	2.30
89	601319	中国人保	1,302,090.00	2.30
90	002493	荣盛石化	1,293,925.00	2.28
91	002651	利君股份	1,291,006.00	2.28

92	688063	派能科技	1,272,180.54	2.24
93	002385	大北农	1,271,377.00	2.24
94	601818	光大银行	1,268,289.00	2.24
95	601186	中国铁建	1,255,681.00	2.21
96	600845	宝信软件	1,254,121.00	2.21
97	600489	中金黄金	1,243,263.00	2.19
98	002533	金杯电工	1,237,108.00	2.18
99	601800	中国交建	1,234,061.00	2.18
100	688981	中芯国际	1,226,161.88	2.16
101	000039	中集集团	1,224,722.00	2.16
102	601857	中国石油	1,223,923.00	2.16
103	000895	双汇发展	1,222,856.00	2.16
104	603993	洛阳钼业	1,202,875.00	2.12
105	601607	上海医药	1,194,999.00	2.11
106	600329	达仁堂	1,190,201.00	2.10
107	603605	珀莱雅	1,185,426.00	2.09
108	002683	广东宏大	1,181,683.00	2.08
109	688012	中微公司	1,178,433.67	2.08
110	688396	华润微	1,176,507.36	2.07
111	601600	中国铝业	1,165,276.00	2.05
112	601689	拓普集团	1,164,470.00	2.05
113	688009	中国通号	1,160,981.53	2.05
114	600036	招商银行	1,153,643.00	2.03
115	688303	大全能源	1,146,575.15	2.02
116	601985	中国核电	1,146,228.00	2.02
117	300124	汇川技术	1,144,641.00	2.02
118	300408	三环集团	1,143,172.00	2.02

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。

8.4.2 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	600519	贵州茅台	3,009,734.00	5.31
2	002415	海康威视	2,936,344.12	5.18
3	000338	潍柴动力	2,742,408.00	4.84
4	601138	工业富联	2,506,545.00	4.42
5	601766	中国中车	2,454,959.00	4.33
6	601888	中国中免	2,418,687.60	4.26
7	300750	宁德时代	2,414,789.00	4.26
8	600188	兖矿能源	2,245,357.50	3.96

9	300274	阳光电源	2,237,168.00	3.94
10	000858	五 粮 液	2,210,346.00	3.90
11	600660	福耀玻璃	2,182,800.82	3.85
12	600104	上汽集团	2,178,515.00	3.84
13	601688	华泰证券	2,178,279.00	3.84
14	002129	TCL 中环	2,151,223.25	3.79
15	000333	美的集团	2,120,368.00	3.74
16	000651	格力电器	2,088,119.00	3.68
17	002812	恩捷股份	2,075,912.96	3.66
18	002304	洋河股份	2,055,931.00	3.62
19	002475	立讯精密	2,035,292.00	3.59
20	000100	TCL 科技	2,028,476.70	3.58
21	601668	中国建筑	2,021,855.00	3.56
22	600309	万华化学	1,991,178.00	3.51
23	300308	中际旭创	1,952,562.00	3.44
24	000725	京东方 A	1,935,389.00	3.41
25	000063	中兴通讯	1,925,251.00	3.39
26	300433	蓝思科技	1,870,752.00	3.30
27	601899	紫金矿业	1,867,616.00	3.29
28	003816	中国广核	1,861,774.00	3.28
29	000538	云南白药	1,853,233.00	3.27
30	601728	中国电信	1,820,428.00	3.21
31	601006	大秦铁路	1,805,662.00	3.18
32	600346	恒力石化	1,777,712.00	3.13
33	300999	金龙鱼	1,771,691.00	3.12
34	002179	中航光电	1,726,475.60	3.04
35	600887	伊利股份	1,715,905.00	3.03
36	601628	中国人寿	1,706,678.00	3.01
37	600025	华能水电	1,699,821.00	3.00
38	601012	隆基绿能	1,672,016.00	2.95
39	002027	分众传媒	1,670,241.00	2.94
40	002938	鹏鼎控股	1,667,469.00	2.94
41	300146	汤臣倍健	1,654,917.00	2.92
42	688126	沪硅产业	1,626,335.83	2.87
43	600258	首旅酒店	1,623,881.00	2.86
44	300014	亿纬锂能	1,615,151.00	2.85
45	600276	恒瑞医药	1,608,814.00	2.84
46	600690	海尔智家	1,593,586.00	2.81
47	600885	宏发股份	1,592,131.80	2.81
48	002049	紫光国微	1,561,282.00	2.75
49	002956	西麦食品	1,558,545.85	2.75
50	600600	青岛啤酒	1,557,230.00	2.75
51	600941	中国移动	1,544,507.00	2.72
52	601225	陕西煤业	1,543,695.00	2.72

53	600050	中国联通	1,518,860.00	2.68
54	002651	利君股份	1,517,693.00	2.68
55	002311	海大集团	1,505,842.00	2.65
56	002078	太阳纸业	1,457,570.00	2.57
57	300498	温氏股份	1,455,296.00	2.57
58	600741	华域汽车	1,441,624.00	2.54
59	300124	汇川技术	1,437,008.00	2.53
60	002568	百润股份	1,423,540.00	2.51
61	688111	金山办公	1,421,840.76	2.51
62	601816	京沪高铁	1,420,511.00	2.50
63	601088	中国神华	1,392,532.00	2.46
64	002299	圣农发展	1,380,295.00	2.43
65	600406	国电南瑞	1,362,285.00	2.40
66	000568	泸州老窖	1,359,048.00	2.40
67	002714	牧原股份	1,358,227.00	2.39
68	601100	恒立液压	1,358,118.00	2.39
69	688128	中国电研	1,344,809.09	2.37
70	601601	中国太保	1,344,691.00	2.37
71	601328	交通银行	1,341,386.00	2.37
72	600031	三一重工	1,330,826.00	2.35
73	688521	芯原股份	1,326,788.96	2.34
74	600438	通威股份	1,322,030.00	2.33
75	000938	紫光股份	1,309,151.00	2.31
76	002385	大北农	1,295,833.00	2.28
77	601658	邮储银行	1,286,171.00	2.27
78	601360	三六零	1,284,209.00	2.26
79	002459	晶澳科技	1,265,927.60	2.23
80	603605	珀莱雅	1,264,369.00	2.23
81	601857	中国石油	1,258,917.00	2.22
82	603259	药明康德	1,205,961.98	2.13
83	688063	派能科技	1,203,481.08	2.12
84	002352	顺丰控股	1,196,060.00	2.11
85	688599	天合光能	1,195,325.85	2.11
86	601689	拓普集团	1,176,553.00	2.07
87	600329	达仁堂	1,170,124.00	2.06
88	603288	海天味业	1,165,593.00	2.06
89	600584	长电科技	1,163,331.00	2.05
90	603118	共进股份	1,155,096.00	2.04
91	688396	华润微	1,152,096.05	2.03
92	002683	广东宏大	1,139,610.05	2.01
93	002223	鱼跃医疗	1,135,225.00	2.00

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	785,322,145.72
卖出股票的收入（成交）总额	746,626,592.57

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,327,020.27	2.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	687.36	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,327,707.63	2.15

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019678	22 国债 13	23,000	2,327,020.27	2.15
2	128135	洽洽转债	6	687.36	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	854,167.08
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	5,036,243.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,890,410.24

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128135	洽洽转债	687.36	0.00

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通量化先锋股票 A	258	51,237.38	5,508,706.00	41.67%	7,710,538.51	58.33%
海富通量化先锋股票 C	351	215,396.05	72,506,453.37	95.90%	3,097,559.90	4.10%
合计	609	145,851.00	78,015,159.37	87.83%	10,808,098.41	12.17%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C 级比例分母为各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通量化先锋股票 A	399,465.98	3.0219%
	海富通量化先锋股票 C	20,421.82	0.0270%
	合计	419,887.80	0.4727%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海富通量化先锋股票 A	0
	海富通量化先锋股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通量化先锋股票 A	10~50
	海富通量化先锋股票 C	0
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C
基金合同生效日（2018 年 2 月 8 日）基金份额总额	218,570,279.56	112,528,845.68
本报告期期初基金份额总额	41,148,221.69	2,143,819.47
本报告期基金总申购份额	7,001,355.66	140,186,459.24
减：本报告期基金总赎回份额	34,930,332.84	66,726,265.44
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,219,244.51	75,604,013.27

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2023 年 12 月 13 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第七届董事会第二十一一次临时会议审议通过，何树方先生不再担任公司副总经理职务。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所提供审计服务。本年度应支付的审计费用是 45,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 6 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成	佣金	占当期佣金总	

			交总额 的比例		量的比 例	
国盛证券	2	295,981,169.86	19.32%	216,831.07	21.59%	-
银河证券	1	200,080,639.93	13.06%	105,998.37	10.55%	-
国金证券	1	184,148,884.35	12.02%	99,940.50	9.95%	-
中信证券	4	149,776,895.88	9.78%	108,934.71	10.85%	-
国泰君安	2	111,343,290.70	7.27%	81,327.25	8.10%	-
西南证券	2	106,578,571.11	6.96%	77,938.83	7.76%	-
上海证券	1	97,932,868.52	6.39%	72,294.68	7.20%	-
天风证券	2	84,195,874.41	5.50%	62,802.02	6.25%	-
华创证券	1	82,289,546.07	5.37%	34,668.98	3.45%	-
太平洋证券	2	54,563,727.03	3.56%	40,624.50	4.04%	-
申万宏源	2	48,183,060.07	3.15%	20,780.81	2.07%	-
招商证券	2	47,340,901.70	3.09%	35,311.32	3.52%	-
长江证券	1	33,961,562.31	2.22%	21,100.56	2.10%	-
渤海证券	1	15,680,017.87	1.02%	11,538.74	1.15%	-
野村东方国际证券	1	12,417,495.94	0.81%	8,956.59	0.89%	-
华西证券	1	5,020,389.95	0.33%	3,671.77	0.37%	-
开源证券	2	2,366,328.00	0.15%	1,706.87	0.17%	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商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、研究水平和综合服务支持三个部分进行评议，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，经投资部部门内部讨论，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会审议。

<2> 核准。在完成对证券公司的评估和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成	成交金 额	占当期回 购成交总	成交金额	占当期权 证成交总

		交总额的 比例		额的比例		额的比例
国盛证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	4,299,204.00	44.75%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	4,951,000.00	53.00%	-	-
西南证券	-	-	4,391,000.00	47.00%	-	-
上海证券	4,803,070.00	49.99%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	4,440.38	0.05%	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	501,208.00	5.22%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-08
2	海富通量化先锋股票型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-16
3	海富通基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证	2023-02-22

		监会基金电子披露网站	
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海长量基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-02
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通期货股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-03
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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-13
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海大智慧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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-08
8	海富通基金管理有限公司关于海富通量化先锋股票型证券投资基金新增上海陆享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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-14
9	海富通基金管理有限公司关于海富通量化先锋股票型证券投资基金新增销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-14
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-07-10
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增麦高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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-01
12	海富通基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-26
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增玄元保险代理有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-11-14
14	海富通基金管理有限公司关于调整基金经理助理的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-11-24

		网站	
15	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-12-13

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	2023/8/4-2023/1/19	-	27,834,761.10	10,768,566.36	17,066,194.74	19.21%
	2	2023/12/27-2023/12/27	-	16,805,310.48	-	16,805,310.48	18.92%
	3	2023/6/20-2023/6/26,2023/6/30-2023/7/6	-	35,335,521.04	29,471,401.08	5,864,119.96	6.60%
	4	2023/8/3-2023/8/6	-	7,240,081.09	7,240,081.09	-	-
	5	2023/6/19-2023/7/19	-	8,828,073.27	8,828,073.27	-	-
	6	2023/1/1-2023/3/29	26,036,191.92	-	26,036,191.92	-	-
个人	1	2023/3/23-2023/6/19,2023/6/27-2023/6/29,2023/7/7-2023/8/3	4,999,225.00	-	-	4,999,225.00	5.63%
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>							

2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额；

3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于 5000 万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；

4、其他可能的风险。

另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 113 只公募基金。截至 2023 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1510 亿元人民币。

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

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联“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”。2023 年 8 月，海富通荣获《上海证券报》颁发的“上证·中国基金投教创新案例奖”。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇二四年三月二十九日