海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§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 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15
6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 37
7.1 期末基金资产组合情况 37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 37
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 38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 42
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 43
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 43
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 43
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 43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 43
7.12 投资组合报告附注 43
§8 基金份额持有人信息 44

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 45
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 45
§9 开放式基金份额变动 45
§10 重大事件揭示 45
10.1基金份额持有人大会决议 46
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 46
10.3涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 46
10.4基金投资策略的改变 46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 46
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 46
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 46
10.8 其他重大事件 48
11 影响投资者决策的其他重要信息 49
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 49
§12 备查文件目录 49
12.1 备查文件目录 49
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	海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）	
基金简称	海富通中证 A100 指数（LOF）	
场内简称	海富通 A100LOF	
基金主代码	162307	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 10 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	
报告期末基金份额总额	35,714,627.01 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2010 年 1 月 8 日	
下属分级基金的基金简称	海富通中证 A100 指数 A	海富通中证 A100 指数 C
下属分级基金场内简称	海富通 A100LOF	-
下属分级基金的交易代码	162307	010224
报告期末下属分级基金的份额总额	35,256,010.29 份	458,616.72 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资方式，通过有效的投资程序约束和数量化风险管理手段，控制基金投资组合相对于业绩比较基准的偏离度，实现对业绩比较基准的有效跟踪。本基金管理人将力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差小于 4%。
投资策略	本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证 A100 指数*95%+活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。

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	姓名	岳冲	许俊
	联系电话	021-38650788	010-66596688

负责人	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	北京市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	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		谢乐斌	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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）**	
	海富通中证 A100 指数 A	海富通中证 A100 指数 C
本期已实现收益	1,975,874.72	24,428.05
本期利润	4,793,131.01	59,617.35
加权平均基金份额本期利润	0.1292	0.1288
本期加权平均净值利润率	8.19%	8.18%

本期基金份额净值增长率	8.37%	8.31%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	海富通中证 A100 指数 A	海富通中证 A100 指数 C
期末可供分配利润	23,264,188.88	300,325.72
期末可供分配基金份额利润	0.6599	0.6549
期末基金资产净值	58,520,199.17	758,942.44
期末基金份额净值	1.6599	1.6549
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	海富通中证 A100 指数 A	海富通中证 A100 指数 C
基金份额累计净值增长率	121.27%	8.23%

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。

4、本基金于 2020 年 11 月 09 日发布公告，自 2020 年 11 月 10 日起增加一种新的收费模式份额-C 类基金份额。该类别仅开通场外申购赎回业务，收取销售服务费，不收取申购费。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通中证 A100 指数 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	12.13%	1.27%	11.76%	1.30%	0.37%	-0.03%
过去六个月	8.37%	1.14%	8.08%	1.16%	0.29%	-0.02%
过去一年	29.88%	1.03%	28.86%	1.05%	1.02%	-0.02%
过去三年	33.29%	1.07%	30.50%	1.09%	2.79%	-0.02%
过去五年	2.02%	1.08%	-5.75%	1.10%	7.77%	-0.02%
过去七年	59.84%	1.11%	18.40%	1.13%	41.44%	-0.02%
过去十年	133.91%	1.10%	61.95%	1.11%	71.96%	-0.01%
自基金合同生效起至今	121.27%	1.29%	51.66%	1.30%	69.61%	-0.01%

海富通中证 A100 指数 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	12.10%	1.27%	11.76%	1.30%	0.34%	-0.03%
过去六个月	8.31%	1.14%	8.08%	1.16%	0.23%	-0.02%
过去一年	29.76%	1.03%	28.86%	1.05%	0.90%	-0.02%
过去三年	32.86%	1.07%	30.50%	1.09%	2.36%	-0.02%
过去五年	1.84%	1.08%	-5.75%	1.10%	7.59%	-0.02%

自基金合同生效起至今	8.23%	1.09%	-3.52%	1.11%	11.75%	-0.02%

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

海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）

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

（2009 年 10 月 30 日至 2026 年 6 月 30 日）

海富通中证 A100 指数 A



海富通中证 A100 指数 C



注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期满至今，本基金投资组合均达到本基金合同第十五条（二）、（七）规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下运作的公募基金共有 100 只，分别是：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证

券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化前锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通盈丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资基金、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、海富通中证 2000 增强策略

交易型开放式指数证券投资基金、海富通红利优选混合型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通量化选股混合型证券投资基金、海富通上证基准做市公司债交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、海富通远见回报混合型证券投资基金、海富通配置优选三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、海富通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、海富通致远量化选股股票型发起式证券投资基金、海富通添合收益债券型证券投资基金、海富通聚益优选三个月持有期债券型基金中基金（FOF）、海富通瑞颐 30 天滚动持有债券型证券投资基金、海富通瑞泽 90 天持有期债券型发起式证券投资基金、海富通沪港深医疗创新混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
纪君凯	本基金的基金经理	2023-08-04	2026-03-02	9 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任天风证券上海自营分公司衍生品部投资研究、期权交易职位。2017 年 7 月加入海富通基金管理有限公司，历任投资经理、基金经理助理。2020 年 6 月至 2023 年 7 月任海富通上证非周期 ETF、海富通上证周期 ETF 基金经理。2020 年 7 月至 2022 年 12 月兼任海富通量化前锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。2023 年 8 月至 2026 年 3 月兼任海富通中证 A100 指数（LOF）、海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。2024 年 4 月至 2025 年 7 月兼任海富通中证汽车零部件主题 ETF 基金经理。2024 年 6 月至 2026 年 3 月兼任海富通中证港股通科技 ETF 发起联接基金经理。2025 年 1 月至 2026 年 3 月兼任海富通中证 A500ETF 基金经理。
王宁宁	本基金的基金经理	2026-02-09	-	9 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。曾任平安道远投资管理（上海）有限公司企划财务部企划财务，平安基金管理有限公司 ETF 指数投资部指数研究员、ETF 基金经理

					助理，大成基金管理有限公司指数与期货投资部 ETF 基金经理助理。2024 年 5 月加入海富通基金管理有限公司，历任指数研究员、基金经理助理。2026 年 2 月起任海富通中证 A100 指数（LOF）、海富通中证港股通科技 ETF 发起联接基金经理。2026 年 3 月起兼任海富通中证 A500ETF、海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

经济方面，上半年经济总体平稳，结构上向新向优发展。从总量看，上半年国内 GDP 为 69.6 万亿元，实际 GDP 增速为 4.7%，符合全年增长目标。节奏上，2026 年一季度经济实现开门红，尽管二季度增速有所回落，但是经济稳定运行的基本面并没有变化。结构上，高端制造业和出口为经济增长的亮点。今年上半年以高端制造、数智经济、现代服务为代表的新动能对上半年经济增长的贡献率超过四成，经济向新向优的特点鲜明。今年上半年我国出口金额同比增长 17.60%，远高于去年同期的 5.85%。产业政策方面，国内因地制宜发展新质生产力，科技实力和经济实力持续增强。

从 A 股市场运行来看，上半年上证指数涨幅为 3.16%，沪深 300 为 7.55%，中证 500 为 20.97%，创业板指为 35.58%，科创 50 为 64.25%， A100 指数涨幅为 8.47%。行业板块方面，根据申万一级行业分类，表现靠前的板块是电子、通信、建筑材料、机械设备，表现靠后的板块是商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料。从行情节奏看，在年初美联储宽松预期和美国财政脉冲背景下，市场交易流动性宽松和经济复苏受益品种。但是，2 月底美伊战争爆发，油价持续高位震荡运行，美联储宽松预期消退，加息预期升温，此外战争影响了各国年内经济增长预期，此前的交易逻辑逆转。与此同时，美国科技巨头上修 2026 年资本开支，AI 投资拉动全球经济，AI 产业链成为市场的主线行情。整体而言，上半年 A 股以科技成长风格为主，AI 相关行业涨幅居前，市场结构较为分化。

作为指数基金，在操作上我们严格遵守基金合同，应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度，降低跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通中证 A100 指数 A 净值增长率为 8.37%，同期业绩比较基准收益率为 8.08%。海富通中证 A100 指数 C 净值增长率为 8.31%，同期业绩比较基准收益率为 8.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

从国内市场看，市场有望震荡上行。从基本面看，国内经济向新向优，AI 产业链保持高景气度，宏观经济步入补库周期。从流动性看，国内宏观流动性保持宽松，海外宏观流动性短期趋紧但未来有望缓解，此外监管层引导中长线资金入市，整体流动性环境保持稳态。

作为指数基金，我们将继续秉承指数化投资策略，紧密跟踪指数，降低跟踪误差。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益分配每年至多 6 次，每次基金收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%。

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”）在对海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）（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）、投资组合报告等财务数据真实、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：海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资　产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	610,482.05	4,215,058.22
结算备付金		-	3,383.21
存出保证金		6,490.37	2,463.52
交易性金融资产	6.4.7.2	58,861,158.03	57,148,002.87
其中：股票投资		55,829,681.04	57,148,002.87
基金投资		-	-
债券投资		3,031,476.99	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		4,585.28	5,017.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		59,482,715.73	61,373,925.39
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 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		-	-
应付赎回款		110,182.35	37,819.88
应付管理人报酬		33,452.28	36,345.35
应付托管费		5,734.70	6,230.62
应付销售服务费		60.66	63.91
应付投资顾问费		-	-
应交税费		110.88	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	54,033.25	106,911.66
负债合计		203,574.12	187,371.42
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	35,714,627.01	39,947,150.06
未分配利润	6.4.7.8	23,564,514.60	21,239,403.91
净资产合计		59,279,141.61	61,186,553.97
负债和净资产总计		59,482,715.73	61,373,925.39

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.6599 元，C 类基金份额净值 1.6549 元。基金份额总额 35,714,627.01 份，其中 A 类基金份额 35,256,010.29 份，C 类基金份额 458,616.72 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	**附注号**	**本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日**	**上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日**
一、营业总收入		5,156,733.13	806,934.74
1.利息收入		3,983.57	6,292.91
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,983.57	6,292.91

债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,298,383.37	-103,520.03
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,729,936.36	-776,455.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	13,519.63	-
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	554,927.38	672,935.96
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	2,852,445.59	902,567.80
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,920.60	1,594.06
减：二、营业总支出		303,984.77	302,884.80
1．管理人报酬		205,583.35	197,020.77
2．托管费		35,242.91	33,775.01
3．销售服务费		361.63	63.77
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		48.61	-
8．其他费用	6.4.7.17	62,748.27	72,025.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**4,852,748.36**	**504,049.94**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**4,852,748.36**	**504,049.94**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,852,748.36	504,049.94

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	39,947,150.06	-	21,239,403.91	61,186,553.97
二、本期期初净资产	39,947,150.06	-	21,239,403.91	61,186,553.97
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,232,523.05	-	2,325,110.69	-1,907,412.36
（一）、综合收益总额	-	-	4,852,748.36	4,852,748.36
（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）	-4,232,523.05	-	-2,527,637.67	-6,760,160.72
其中：1.基金申购款	961,347.10	-	544,269.06	1,505,616.16
2.基金赎回款	-5,193,870.15	-	-3,071,906.73	-8,265,776.88
（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	35,714,627.01	-	23,564,514.60	59,279,141.61

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	46,129,814.41	-	12,305,549.64	58,435,364.05
二、本期期初净资产	46,129,814.41	-	12,305,549.64	58,435,364.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,828,238.78	-	9,061.24	-1,819,177.54
（一）、综合收益总额	-	-	504,049.94	504,049.94
（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	-1,828,238.78	-	-494,988.70	-2,323,227.48

填列）				
其中：1.基金申购款	880,196.21	-	219,585.93	1,099,782.14
2.基金赎回款	-2,708,434.99	-	-714,574.63	-3,423,009.62
（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	44,301,575.63	-	12,314,610.88	56,616,186.51

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

海富通中证 A100 指数证券投资基金(LOF)(原海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF))(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[2009]879 号《关于核准海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》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《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。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 2,086,432,233.85 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 226 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2009 年 10 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,087,148,875.30 份基金份额，其中认购资金利息折合 716,641.45 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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2009]第 205 号文审核同意，本基金 107,647,812.00 份基金份额于 2010 年 1 月 8 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)招募说明书》并报中国证监会备案，自 2020 年 11 月 10 日起，本基金根据申购费用、赎回费用及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。在投资者申购时收取前端申购

费用，不收取销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取前端申购费用，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。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据本基金管理人海富通基金管理有限公司 2024 年 10 月 25 日《关于海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）变更基金名称并修改相关法律文件的公告》，经与基金托管人协商一致并履行规定程序，自 2024 年 10 月 28 日起，将海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）的基金名称变更为海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）并修改相关法律文件，更新标的指数名称和业绩比较基准指数名称。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金《基金合同》的有关规定, 本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及备选成份股、新股（首次公开发行股票或增发）、存托凭证、固定收益产品、权证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。其中股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 90%-95%，投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的 80%。现金、固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 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。本基金的基金管理人力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差小于 4%。本基金业绩比较基准为：中证 A100 指数×95％＋活期存款利率（税后）×5％。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2026 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部 (以下简称“财政部”) 颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a)本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入,截至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

d)本基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e)对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	610,482.05
等于：本金	610,449.47
加：应计利息	32.58
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	610,482.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		40,761,352.02	-	55,829,681.04	15,068,329.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,002,897.00	29,376.99	3,031,476.99	-797.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,002,897.00	29,376.99	3,031,476.99	-797.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		43,764,249.02	29,376.99	58,861,158.03	15,067,532.02

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	57.70
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,907.28
其中：交易所市场	1,907.28
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用	52,068.27
合计	54,033.25

6.4.7.7 实收基金

海富通中证 A100 指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,457,355.50	39,457,355.50
本期申购	940,355.83	940,355.83
本期赎回（以“-”号填列）	-5,141,701.04	-5,141,701.04
本期末	35,256,010.29	35,256,010.29

海富通中证 A100 指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	489,794.56	489,794.56
本期申购	20,991.27	20,991.27
本期赎回（以“-”号填列）	-52,169.11	-52,169.11
本期末	458,616.72	458,616.72

注：截至 2026 年 6 月 30 日止，本基金 A 类份额于深交所上市的基金份额为 1,443,554.00 份 (2025 年 12 月 31 日：1,457,025.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 33,812,456.29 份 (2025 年 12 月 31 日：38,000,330.50 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

6.4.7.8 未分配利润

海富通中证 A100 指数 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	32,060,002.77	-11,079,143.90	20,980,858.87
本期期初	32,060,002.77	-11,079,143.90	20,980,858.87

本期利润	1,975,874.72	2,817,256.29	4,793,131.01
本期基金份额交易产生的变动数	-3,496,555.57	986,754.57	-2,509,801.00
其中：基金申购款	785,613.98	-253,389.85	532,224.13
基金赎回款	-4,282,169.55	1,240,144.42	-3,042,025.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,539,321.92	-7,275,133.04	23,264,188.88

海富通中证 A100 指数 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	396,182.33	-137,637.29	258,545.04
本期期初	396,182.33	-137,637.29	258,545.04
本期利润	24,428.05	35,189.30	59,617.35
本期基金份额交易产生的变动数	-25,447.88	7,611.21	-17,836.67
其中：基金申购款	17,448.75	-5,403.82	12,044.93
基金赎回款	-42,896.63	13,015.03	-29,881.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	395,162.50	-94,836.78	300,325.72

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,959.35
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	12.83
其他	11.39
合计	3,983.57

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	9,960,965.73
减：卖出股票成本总额	8,222,544.54
减：交易费用	8,484.83
买卖股票差价收入	1,729,936.36

6.4.7.11 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期

	2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	13,519.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	13,519.63

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	554,927.38
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	554,927.38

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	2,852,445.59
——股票投资	2,853,242.59
——债券投资	-797.00
——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	2,852,445.59

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	1,920.60
合计	1,920.60

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	12,396.69
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,680.00
债券托管账户维护费	9,000.00
合计	62,748.27

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、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股	成交金额	占当期股

		票成交总额的比例		票成交总额的比例
国泰海通证券	14,011,945.85	100.00%	-	-

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	2,605.06	100.00%	1,907.28	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	-	-	-	-

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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	205,583.35	197,020.77
其中：应支付销售机构的客户维护费	91,337.33	82,384.77
应支付基金管理人的净管理费	114,246.02	114,636.00

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 0.70%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 x0.70%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	35,242.91	33,775.01

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.12%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 x0.12%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通中证 A100 指数 A	海富通中证 A100 指数 C	合计
海富通	-	0.94	0.94
合计	-	0.94	0.94
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通中证A100指数A	海富通中证A100指数C	合计
海富通	-	0.41	0.41
合计	-	0.41	0.41

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 0.10%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.10%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 x0.10%/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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	610,482.05	3,959.35	3,947,891.90	6,282.06

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（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

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

本基金是采用指数化操作的股票型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。本基金投资的金融工具主要为股票投资。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委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计委员会所制定的各项风险管理政策。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	3,031,476.99	-
合计	3,031,476.99	-

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、无第三方评级机构评级的债券。

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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	610,482.05	-	-	-	610,482.05
存出保证金	6,490.37	-	-	-	6,490.37
交易性金融资产	3,031,476.99	-	-	55,829,681.04	58,861,158.03
应收申购款	-	-	-	4,585.28	4,585.28
资产总计	3,648,449.41	-	-	55,834,266.32	59,482,715.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	110,182.35	110,182.35
应付管理人报酬	-	-	-	33,452.28	33,452.28
应付托管费	-	-	-	5,734.70	5,734.70
应付销售服务费	-	-	-	60.66	60.66
应交税费	-	-	-	110.88	110.88
其他负债	-	-	-	54,033.25	54,033.25
负债总计	-	-	-	203,574.12	203,574.12
利率敏感度缺口	3,648,449.41	-	-	55,630,692.20	59,279,141.61

上年度末 2025 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	4,215,058.22	-	-	-	4,215,058.22
结算备付金	3,383.21	-	-	-	3,383.21
存出保证金	2,463.52	-	-	-	2,463.52
交易性金融资产	-	-	-	57,148,002.87	57,148,002.87
应收申购款	198.81	-	-	4,818.76	5,017.57
资产总计	4,221,103.76	-	-	57,152,821.63	61,373,925.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	37,819.88	37,819.88
应付管理人报酬	-	-	-	36,345.35	36,345.35
应付托管费	-	-	-	6,230.62	6,230.62
应付销售服务费	-	-	-	63.91	63.91
其他负债	-	-	-	106,911.66	106,911.66
负债总计	-	-	-	187,371.42	187,371.42
利率敏感度缺口	4,221,103.76	-	-	56,965,450.21	61,186,553.97

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-2,190.30	-
	市场利率下降 25 个基点	2,197.27	-

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的股票，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。

本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金以降低基金的跟踪误差为目的，在考虑流动性风险的前提下，构建债券投资组合。确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整股票资产、债券资产和货币市场工具的比例，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 90%-95%，投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的 80%。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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	55,829,681.04	94.18	57,148,002.87	93.40
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	55,829,681.04	94.18	57,148,002.87	93.40

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	3,425,720.81	3,289,823.11

	2.业绩比较基准下降 5%	-3,425,720.81	-3,289,823.11

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	55,829,681.04	56,640,923.75
第二层次	3,031,476.99	507,079.12
第三层次	-	-
合计	58,861,158.03	57,148,002.87

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不会将相关股票和债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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	55,829,681.04	93.86
	其中：股票	55,829,681.04	93.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,031,476.99	5.10
	其中：债券	3,031,476.99	5.10
	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	610,482.05	1.03
8	其他各项资产	11,075.65	0.02
9	合计	59,482,715.73	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

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	319,108.80	0.54
B	采矿业	3,174,862.12	5.36
C	制造业	40,039,397.23	67.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,312,786.56	2.21
E	建筑业	575,349.16	0.97
F	批发和零售业	81,548.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	1,152,843.26	1.94

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,830,282.40	4.77
J	金融业	4,721,516.26	7.96
K	房地产业	303,588.00	0.51
L	租赁和商务服务业	172,892.49	0.29
M	科学研究和技术服务业	1,016,997.68	1.72
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	128,509.08	0.22
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	55,829,681.04	94.18

7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

7.3.1 期末指数投资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	3,720	4,724,400.00	7.97
2	300750	宁德时代	8,660	3,403,466.60	5.74
3	300502	新易盛	4,600	2,792,200.00	4.71
4	600519	贵州茅台	2,048	2,427,883.52	4.10
5	603986	兆易创新	2,200	1,793,000.00	3.02
6	601318	中国平安	35,056	1,673,573.44	2.82
7	688256	寒武纪	992	1,582,785.60	2.67
8	600036	招商银行	40,713	1,445,311.50	2.44
9	601899	紫金矿业	54,252	1,363,895.28	2.30
10	002371	北方华创	1,390	1,229,538.40	2.07

11	000333	美的集团	16,007	1,209,008.71	2.04
12	688012	中微公司	2,565	1,201,702.50	2.03
13	002475	立讯精密	16,808	1,183,283.20	2.00
14	688008	澜起科技	3,781	1,171,731.90	1.98
15	688041	海光信息	3,000	1,110,900.00	1.87
16	600900	长江电力	40,248	1,065,364.56	1.80
17	688981	中芯国际	6,550	1,040,271.00	1.75
18	000725	京东方 A	119,700	1,038,996.00	1.75
19	603259	药明康德	8,168	1,016,997.68	1.72
20	300059	东方财富	41,700	849,846.00	1.43
21	600276	恒瑞医药	14,708	765,404.32	1.29
22	300274	阳光电源	4,780	760,115.60	1.28
23	601398	工商银行	106,476	752,785.32	1.27
24	002594	比亚迪	8,928	711,561.60	1.20
25	300476	胜宏科技	2,000	692,860.00	1.17
26	002463	沪电股份	4,400	672,320.00	1.13
27	000651	格力电器	14,880	558,000.00	0.94
28	603019	中科曙光	4,800	514,704.00	0.87
29	603993	洛阳钼业	28,700	503,685.00	0.85
30	600150	中国船舶	14,841	501,477.39	0.85
31	000338	潍柴动力	17,700	482,325.00	0.81
32	601816	京沪高铁	97,700	442,581.00	0.75
33	600309	万华化学	6,200	424,142.00	0.72
34	300124	汇川技术	6,300	417,879.00	0.70
35	002415	海康威视	12,197	417,137.40	0.70
36	600111	北方稀土	8,400	403,620.00	0.68
37	000100	TCL 科技	69,230	402,918.60	0.68
38	000063	中兴通讯	10,700	387,233.00	0.65
39	600089	特变电工	16,770	377,325.00	0.64
40	601857	中国石油	43,106	374,160.08	0.63
41	601088	中国神华	9,144	356,981.76	0.60
42	002028	思源电气	2,000	346,000.00	0.58
43	600031	三一重工	19,700	340,416.00	0.57
44	300014	亿纬锂能	5,000	325,150.00	0.55
45	000792	盐湖股份	10,600	320,014.00	0.54
46	002714	牧原股份	9,120	319,108.80	0.54
47	600406	国电南瑞	13,331	304,613.35	0.51
48	601668	中国建筑	68,724	298,262.16	0.50
49	601919	中远海控	20,900	277,134.00	0.47
50	300760	迈瑞医疗	2,000	271,660.00	0.46
51	601728	中国电信	51,600	267,804.00	0.45
52	600660	福耀玻璃	5,300	267,332.00	0.45
53	601012	隆基绿能	20,124	264,026.88	0.45
54	603501	豪威集团	2,780	263,683.00	0.44

55	601225	陕西煤业	12,900	262,515.00	0.44
56	002230	科大讯飞	6,400	261,376.00	0.44
57	600941	中国移动	3,000	258,390.00	0.44
58	600690	海尔智家	12,528	255,696.48	0.43
59	002352	顺丰控股	8,001	250,111.26	0.42
60	601985	中国核电	27,400	247,422.00	0.42
61	002460	赣锋锂业	3,780	247,212.00	0.42
62	603799	华友钴业	5,100	246,126.00	0.42
63	600160	巨化股份	4,500	238,545.00	0.40
64	000425	徐工机械	27,300	220,857.00	0.37
65	601600	中国铝业	26,400	217,008.00	0.37
66	601766	中国中车	40,531	210,761.20	0.36
67	002466	天齐锂业	3,400	208,488.00	0.35
68	002179	中航光电	4,200	194,040.00	0.33
69	601100	恒立液压	1,800	193,608.00	0.33
70	601006	大秦铁路	39,700	183,017.00	0.31
71	600489	中金黄金	9,700	175,085.00	0.30
72	601888	中国中免	3,219	172,892.49	0.29
73	002625	光启技术	5,700	172,824.00	0.29
74	600893	航发动力	4,400	168,696.00	0.28
75	600010	包钢股份	75,300	167,919.00	0.28
76	601127	赛力斯	2,700	165,375.00	0.28
77	688271	联影医疗	1,600	161,968.00	0.27
78	600019	宝钢股份	28,951	157,203.93	0.27
79	600760	中航沈飞	3,800	156,180.00	0.26
80	688111	金山办公	729	155,313.45	0.26
81	000807	云铝股份	6,900	152,766.00	0.26
82	600989	宝丰能源	7,300	148,409.00	0.25
83	601727	上海电气	21,000	147,000.00	0.25
84	002001	新和成	5,100	144,942.00	0.24
85	002422	科伦药业	3,700	142,524.00	0.24
86	601390	中国中铁	34,100	142,197.00	0.24
87	000538	云南白药	3,000	142,110.00	0.24
88	600547	山东黄金	6,000	138,540.00	0.23
89	600585	海螺水泥	8,000	135,600.00	0.23
90	601669	中国电建	28,700	134,890.00	0.23
91	300015	爱尔眼科	15,558	128,509.08	0.22
92	600426	华鲁恒升	4,900	117,208.00	0.20
93	600895	张江高科	3,100	115,475.00	0.19
94	600048	保利发展	23,900	110,657.00	0.19
95	600436	片仔癀	1,000	109,280.00	0.18
96	600438	通威股份	9,000	108,990.00	0.18
97	600196	复星医药	4,200	94,374.00	0.16
98	000963	华东医药	2,900	81,548.00	0.14

99	001979	招商蛇口	12,000	77,160.00	0.13
100	000002	万科 A	100	296.00	0.00

7.3.2 期末积极投资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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	2,366,522.80	3.87
2	601225	陕西煤业	340,484.00	0.56
3	600660	福耀玻璃	277,236.00	0.45
4	601100	恒立液压	212,041.00	0.35
5	000807	云铝股份	192,292.00	0.31
6	601727	上海电气	153,759.00	0.25
7	600895	张江高科	107,080.00	0.18
8	600196	复星医药	93,746.00	0.15
9	000963	华东医药	84,258.00	0.14
10	688012	中微公司	62,395.32	0.10
11	300014	亿纬锂能	40,488.00	0.07
12	601088	中国神华	37,328.00	0.06
13	600760	中航沈飞	34,616.00	0.06
14	601857	中国石油	33,462.00	0.05
15	002625	光启技术	15,272.00	0.02

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。

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	300750	宁德时代	578,139.00	0.94
2	600519	贵州茅台	540,727.56	0.88
3	300308	中际旭创	436,820.00	0.71
4	601318	中国平安	351,727.00	0.57
5	601899	紫金矿业	302,516.00	0.49
6	600028	中国石化	277,109.31	0.45
7	600050	中国联通	266,146.40	0.43
8	600036	招商银行	263,527.00	0.43

9	688256	寒武纪	244,922.00	0.40
10	000333	美的集团	231,843.00	0.38
11	002241	歌尔股份	225,389.00	0.37
12	002027	分众传媒	212,775.18	0.35
13	000938	紫光股份	198,809.00	0.32
14	601088	中国神华	193,931.00	0.32
15	600900	长江电力	182,180.00	0.30
16	002371	北方华创	181,312.00	0.30
17	002475	立讯精密	168,613.00	0.28
18	688041	海光信息	166,972.00	0.27
19	002648	卫星化学	154,176.00	0.25
20	603986	兆易创新	144,122.00	0.24

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

买入股票成本（成交）总额	4,050,980.12
卖出股票收入（成交）总额	9,960,965.73

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

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	3,031,476.99	5.11
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	3,031,476.99	5.11

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

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	019792	25 国债 19	30,000	3,031,476.99	5.11

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,490.37
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,585.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,075.65

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

海富通中证 A100 指数 A	2,369	14,882.23	1,030,385.11	2.92%	34,225,625.18	97.08%
海富通中证 A100 指数 C	34	13,488.73	-	-	458,616.72	100.00%
合计	2,403	14,862.52	1,030,385.11	2.89%	34,684,241.90	97.11%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通中证 A100 指数 A	99,128.35	0.2812%
	海富通中证 A100 指数 C	65.66	0.0143%
	合计	99,194.01	0.2777%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海富通中证 A100 指数 A	0~10
	海富通中证 A100 指数 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通中证 A100 指数 A	0
	海富通中证 A100 指数 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通中证 A100 指数 A	海富通中证 A100 指数 C
基金合同生效日（2009 年 10 月 30 日）基金份额总额	2,087,148,875.30	-
本报告期期初基金份额总额	39,457,355.50	489,794.56
本报告期基金总申购份额	940,355.83	20,991.27
减：本报告期基金总赎回份额	5,141,701.04	52,169.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	35,256,010.29	458,616.72

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

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

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

基金托管人：

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及本基金基金管理人基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人无受调查或处罚情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通证券	2	14,011,945.85	100.00%	2,605.06	100.00%	-

开源证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金新增华泰证券 2 个交易单元。

2、交易单元的选择标准：

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

3、交易单元的选择程序：

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

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

（3）基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰海通证券	3,002,897.00	100.00%	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

国盛证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

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	海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）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	2026-02-11
2	海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）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	2026-03-03
3	海富通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)	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	2026-03-31
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东莞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	2026-04-20
5	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	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	2026-04-30
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳前海微众银行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	2026-05-19
7	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	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	2026-05-23
8	海富通基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2026-06-10

	销售业务的公告	电子披露网站	
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所上市股票及相关风险提示的公告	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	2026-06-13

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 137 只公募基金。截至 2026 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 3108 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人。2008 年 3 月，海富通获批从事特定客户资产管理业务。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保险监督管理委员会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）的文件
(二)海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）基金合同
(三)海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）招募说明书
(四)海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）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
二〇二六年八月三十一日