

# 海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）

## 2024 年第 2 季度报告

### 2024 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年七月十九日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	海富通中证 100 指数（LOF）
场内简称	海富通 100LOF
基金主代码	162307
交易代码	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
报告期末基金份额总额	47,061,022.05 份
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 100 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。	
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	
下属分级基金的基金简称	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C
下属分级基金的场内简称	海富通 100LOF	-
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	47,030,284.09 份	30,737.96 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C
	1.本期已实现收益	1,051,730.49
2.本期利润	-511,934.70	-317.42
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0108	-0.0103
4.期末基金资产净值	53,385,607.26	34,854.08

5.期末基金份额净值	1.1351	1.1339
------------	--------	--------

注：(1) 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。

(2) 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。

(3) 海富通中证100指数证券投资基金(LOF)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 本报告期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、海富通中证 100 指数 A：

阶段	净值增长率①	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	-0.99%	0.71%	-1.79%	0.74%	0.80%	-0.03%
过去六个月	1.67%	0.83%	1.41%	0.87%	0.26%	-0.04%
过去一年	-8.85%	0.84%	-9.70%	0.86%	0.85%	-0.02%
过去三年	-30.23%	1.02%	-34.76%	1.04%	4.53%	-0.02%
过去五年	9.30%	1.09%	-18.11%	1.11%	27.41%	-0.02%
自基金合同生效起至今	51.32%	1.31%	5.02%	1.31%	46.30%	0.00%

#### 2、海富通中证 100 指数 C：

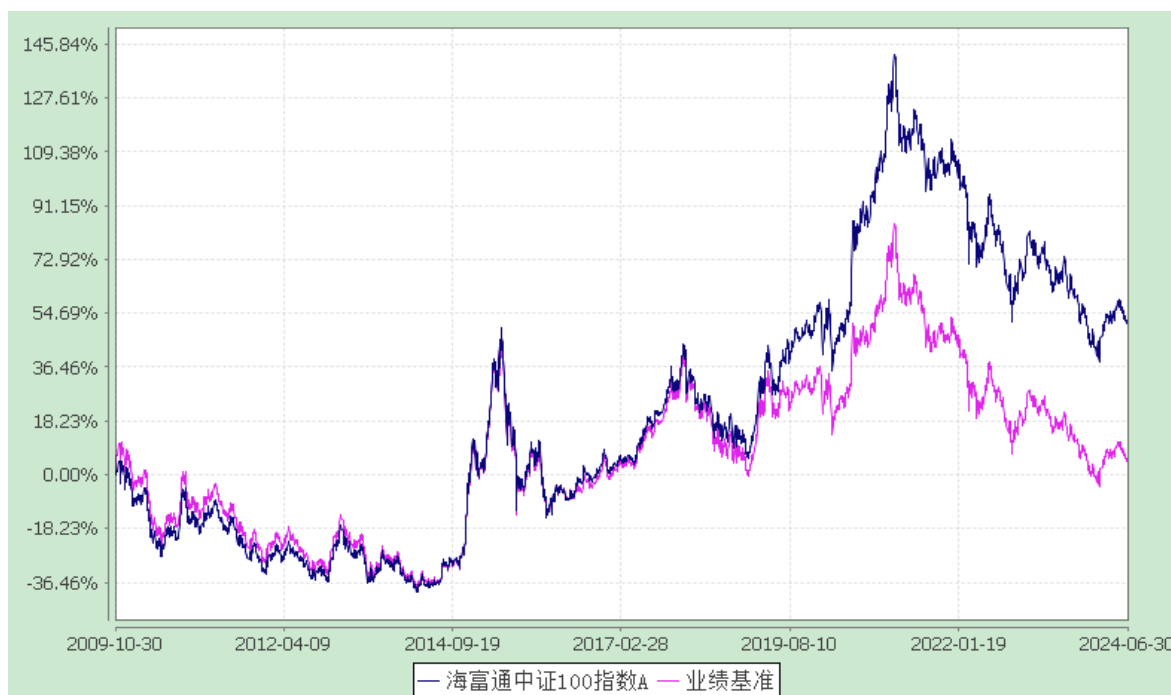
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.00%	0.71%	-1.79%	0.74%	0.79%	-0.03%
过去六个	1.58%	0.83%	1.41%	0.87%	0.17%	-0.04%

月						
过去一年	-8.97%	0.84%	-9.70%	0.86%	0.73%	-0.02%
过去三年	-30.22%	1.02%	-34.76%	1.04%	4.54%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-25.84%	1.04%	-33.24%	1.07%	7.40%	-0.03%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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 100 指数证券投资基金（LOF）  
 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  
 (2009 年 10 月 30 日至 2024 年 6 月 30 日)

#### 1. 海富通中证 100 指数 A:



#### 2. 海富通中证 100 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	-	7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、量化投资部基金经理助理。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的基金经理。2020年7月至2022年12月兼任海富通量化先锋股票、海富通中证500增强基金经理。2023年8月起任海富

					通中证 100 指数（LOF）、海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。2024 年 4 月起兼任海富通中证汽车零部件主题 ETF 基金经理。2024 年 6 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 发起联接基金经理。
--	--	--	--	--	--

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 公平交易专项说明

##### 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。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度 A 股市场高位震荡后下跌。沪深 300 指数下跌了 2.14%、中证 500 指数下跌 6.50%、科创 50 指数下跌 6.64%、创业板综指下跌 8.50%、中小综指下跌 6.45%。分行业看，中信一级行业表现靠前的板块是银行、电力及公用事业、交通运输、煤炭、电子，跌幅较大的板块是消费者服务、传媒、商贸零售、计算机、轻工制造。当前全市场风险偏好降低，类债策略依然是市场的主流预期，高股息率国企密集的行业更受到市场偏爱。

海外因素方面，美国最新通胀低于预期，但是中期通胀韧性仍存。从相关数据来看，自 3 月以来美国零售消费环比逐步走弱，居民消费开始显露疲态。虽然最新非农就业数据超预期，但是结构略有恶化，最新失业率也持续攀升，平均时薪增速震荡下行，但仍高于美联储合意的 3.5%。6 月 CPI 同比增长 3.0%，较上月继续放缓，且低于市场预期，显示美国通胀进一步降温。6 月美联储议息会议较 5 月略偏鸽派。考虑到租金通胀、油价波动、贸易摩擦等因素，美国中期通胀压力依然不小，美联储降息次数或少于两次。

国内因素方面，虽然 4-5 月经济数据边际走弱，但是高质量发展依旧是主线。最新高频数据显示，多数房地产相关指标跌幅仍较大，在地产疲弱背景下国内经济预计仍以修复为主。从有关部门的发言来看，二季度整体经济继续稳中向好，全年有望实现 5% 左右的增长目标。在此背景下，预计总量刺激政策加码的可能性或降低，短期来看国内政策重心或将集中在供给侧而非需求端。

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 100 指数 A 净值增长率为-0.99%，同期业绩比较基准收益率为-1.79%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.80 个百分点。海富通中证 100 指数 C 净值增长率为-1.00%，同期业绩比较基准收益率为-1.79%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.79 个百分点。



#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	50,424,950.98	94.08
	其中：股票	50,424,950.98	94.08
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,168,215.87	5.91
7	其他各项资产	4,499.42	0.01
8	合计	53,597,666.27	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 积极投资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	-	-
B	采矿业	783,408.00	1.47
C	制造业	560,227.00	1.05

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	256,044.00	0.48
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	102,060.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,701,739.00	3.19

### 5.2.2 指数投资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	589,472.00	1.10
B	采矿业	3,780,643.28	7.08
C	制造业	28,725,804.47	53.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,186,770.16	4.09
E	建筑业	917,386.44	1.72
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,648,134.69	3.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,848,042.66	5.33
J	金融业	6,033,874.83	11.30

K	房地产业	584,802.00	1.09
L	租赁和商务服务业	647,645.97	1.21
M	科学研究和技术服务业	488,620.92	0.91
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	272,014.56	0.51
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	48,723,211.98	91.21

### 5.2.3 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。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	2,848	4,179,126.72	7.82
2	300750	宁德时代	14,360	2,585,230.80	4.84
3	600036	招商银行	62,413	2,133,900.47	3.99
4	601318	中国平安	48,656	2,012,412.16	3.77
5	000333	美的集团	24,807	1,600,051.50	3.00
6	600900	长江电力	50,548	1,461,848.16	2.74
7	601899	紫金矿业	81,452	1,431,111.64	2.68
8	002594	比亚迪	4,576	1,145,144.00	2.14
9	601398	工商银行	176,676	1,007,053.20	1.89
10	002475	立讯精密	25,208	990,926.48	1.85

#### 5.3.2 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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601225	陕西煤业	30,400	783,408.00	1.47

2	002648	卫星化学	9,800	176,204.00	0.33
3	002601	龙佰集团	8,300	154,131.00	0.29
4	002709	天赐材料	7,000	122,920.00	0.23
5	600588	用友网络	11,000	110,000.00	0.21

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.9.2 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。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,975.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,523.74
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,499.42

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 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。

#### 5.11.5.2 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通中证100指数 A	海富通中证100指数 C
本报告期期初基金份额总额	47,804,814.27	30,114.41
报告期期间基金总申购份额	516,676.30	3,759.84
减：报告期期间基金总赎回份额	1,291,206.48	3,136.29
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	47,030,284.09	30,737.96

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 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 123 只公募基金。截至 2024 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1613 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公

告确认海富通为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

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

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

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。2023 年 8 月，海富通荣获《上海证券报》颁发的“上证·中国基金投教创新案例奖”。

## §9 备查文件目录

### 9.1 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 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同
- (三)海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）招募说明书
- (四)海富通中证 100 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

## 9.2 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

## 9.3 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

二〇二四年七月十九日