

# 海富通欣利混合型证券投资基金

## 2022 年中期报告

### 2022 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：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十一日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | 5  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7  |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 9  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....              | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 11 |
| 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.....             | 12 |
| 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.....                 | 15 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....       | 15 |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....                  | 15 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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真实、准确和完整发表意见.....       | 15 |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | 16 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 16 |
| 6.2 利润表.....                                 | 17 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表.....                        | 18 |
| 6.4 报表附注.....                                | 19 |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                       | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 41 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 41 |
| 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.....       | 42 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 46 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 48 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....      | 48 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 49 |
| 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.....   | 49 |
| 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.....      | 49 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                     | 49 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 49 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                           | 49 |
| <b>§8 基金份额持有人信息</b> .....                    | 51 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                   | 51 |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 51        |
| 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 ..... | 52        |
| <b>§9 开放式基金份额变动</b> .....               | <b>52</b> |
| <b>§10 重大事件揭示</b> .....                 | <b>52</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 52        |
| 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 .....  | 52        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 52        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 52        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 52        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....     | 53        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 53        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 53        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....         | <b>54</b> |
| <b>§12 备查文件目录</b> .....                 | <b>56</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                       | 56        |
| 12.2 存放地点 .....                         | 56        |
| 12.3 查阅方式 .....                         | 56        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金名称            | 海富通欣利混合型证券投资基金   |                 |
| 基金简称            | 海富通欣利混合          |                 |
| 基金主代码           | 011554           |                 |
| 交易代码            | 011554           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型、开放式          |                 |
| 基金合同生效日         | 2021 年 9 月 14 日  |                 |
| 基金管理人           | 海富通基金管理有限公司      |                 |
| 基金托管人           | 华夏银行股份有限公司       |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 141,821,173.32 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 海富通欣利混合 A        | 海富通欣利混合 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 011554           | 011555          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 76,156,973.38 份  | 65,664,199.94 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金通过积极主动的资产配置与严谨的风险管理，在严格控制风险的前提下，积极把握证券市场的投资机会，追求资产的保值增值。   |
| 投资策略   | <p>本基金通过对宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究，同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素，兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动，结合投资时钟理论，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例。并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，或借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应，以规避或分散市场风险。</p> <p>在大类资产配置的框架下，本基金投资策略还包括股票投资策略、债券投资组合策略、资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略、流通受限证券投资策略、股票期权投资策略、存托凭证投资策略等。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×20%+中证综合债指数收益率×75%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

|    |       |       |
|----|-------|-------|
| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|----|-------|-------|

|             |      |                                      |                             |
|-------------|------|--------------------------------------|-----------------------------|
| 名称          |      | 海富通基金管理有限公司                          | 华夏银行股份有限公司                  |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 岳冲                                   | 郑鹏                          |
|             | 联系电话 | 021-38650788                         | (010) 85238667              |
|             | 电子邮箱 | chongyue@hftfund.com                 | zhengpeng@hxb.com.cn        |
| 客户服务电话      |      | 40088-40099                          | 95577                       |
| 传真          |      | 021-33830166                         | 01085238680                 |
| 注册地址        |      | 上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦<br>36-37层 | 北京市东城区建国门内大街22<br>号(100005) |
| 办公地址        |      | 上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦<br>36-37层 | 北京市东城区建国门内大街22<br>号(100005) |
| 邮政编码        |      | 200120                               | 100005                      |
| 法定代表人       |      | 杨仓兵                                  | 李民吉                         |

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称          | 办公地址                             |
|--------|-------------|----------------------------------|
| 注册登记机构 | 海富通基金管理有限公司 | 上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层 |

## §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(2022年1月1日至2022年6月30日) |            |
|---------------|---------------------------|------------|
|               | 海富通欣利混合 A                 | 海富通欣利混合 C  |
| 本期已实现收益       | 448,074.35                | 329,220.50 |
| 本期利润          | 393,652.12                | 863,447.90 |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0037                    | 0.0115     |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.37%                     | 1.14%      |

|               |                       |               |
|---------------|-----------------------|---------------|
| 本期基金份额净值增长率   | 1.55%                 | 1.45%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |               |
|               | 海富通欣利混合 A             | 海富通欣利混合 C     |
| 期末可供分配利润      | 1,297,278.78          | 1,014,695.62  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0170                | 0.0155        |
| 期末基金资产净值      | 78,924,651.43         | 67,944,473.49 |
| 期末基金份额净值      | 1.0363                | 1.0347        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |               |
|               | 海富通欣利混合 A             | 海富通欣利混合 C     |
| 基金份额累计净值增长率   | 3.63%                 | 3.47%         |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通欣利混合 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月      | 2.65%    | 0.34%       | 2.03%      | 0.28%         | 0.62% | 0.06% |
| 过去三个月      | 3.02%    | 0.47%       | 2.38%      | 0.35%         | 0.64% | 0.12% |
| 过去六个月      | 1.55%    | 0.46%       | -0.40%     | 0.37%         | 1.95% | 0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.63%    | 0.37%       | -0.14%     | 0.32%         | 3.77% | 0.05% |

海富通欣利混合 C

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月      | 2.65%    | 0.34%       | 2.03%      | 0.28%         | 0.62% | 0.06% |
| 过去三个月      | 2.98%    | 0.47%       | 2.38%      | 0.35%         | 0.60% | 0.12% |
| 过去六个月      | 1.45%    | 0.46%       | -0.40%     | 0.37%         | 1.85% | 0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.47%    | 0.37%       | -0.14%     | 0.32%         | 3.61% | 0.05% |

#### 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

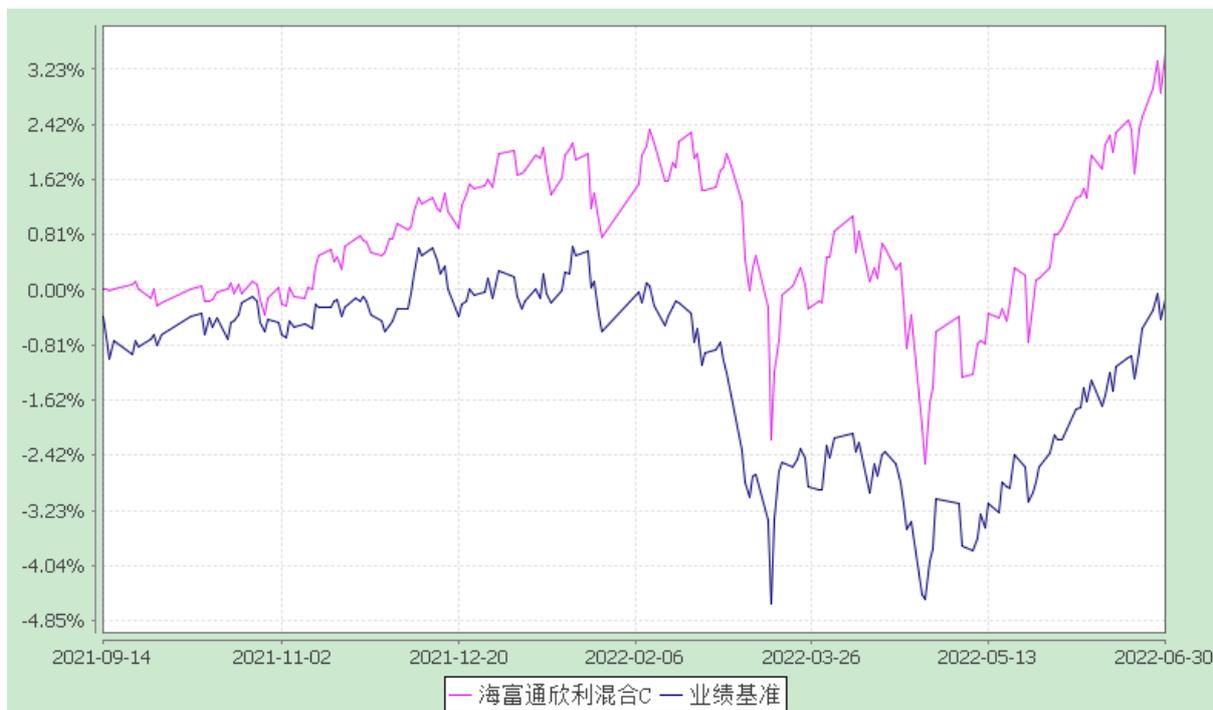
较

海富通欣利混合型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2021 年 9 月 14 日至 2022 年 6 月 30 日)

海富通欣利混合 A



海富通欣利混合 C



注：1、本基金合同于 2021 年 9 月 14 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 94 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥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、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、海富通惠鑫混合型证券投资基金、海富通欣润混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|----------|-----------------|------|--------|---|
|    |          | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 江勇 | 本基金的基金经理 | 2021-09-14      | -    | 11 年   | 经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师，资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017 年 6 月加入海富通基金管理有限 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | 公司。2018 年 7 月起任海富通上证非周期 ETF 联接基金经理。2018 年 7 月至 2022 年 5 月任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF、海富通中证 100 指数(LOF)基金经理。2018 年 7 月至 2020 年 3 月任海富通中证内地低碳指数（现海富通中证 500 增强）基金经理。2020 年 8 月起兼任海富通中证长三角领先 ETF 基金经理。2020 年 8 月至 2022 年 5 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 联接基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通稳固收益债券的基金经理。2021 年 2 月起兼任海富通欣睿混合基金经理。2021 年 6 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 和海富通策略收益债券基金经理。2021 年 9 月起兼任海富通欣利混合基金经理。 |
|--|--|--|--|---|

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的样本，对其进行了 95%置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组

合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年，中美经济与政策周期继续错位。中国面临经济下行压力，叠加疫情的冲击，导致二季度经济出现快速下探，宏观政策迅速转向宽松，推出稳增长一揽子措施，随着疫情受控、政策发力，中国经济在 5、6 月份快速修复。海外方面，在不断的货币宽松刺激下，美国通胀水平持续抬升，俄乌冲突又进一步加剧了本就高企的通胀，同时 4 月受中国疫情冲击全球供应链受到较大影响，种种因素导致大宗商品价格暴涨，美国、欧洲通胀水平持续上升。美联储加息路径不断上修，带来美债收益率的大幅上升，全球资本市场在美联储收紧、俄乌冲突、中国疫情等冲击下出现剧烈波动。

A 股市场整体走势如同 V 字型态势，风格出现明显变化。1 月-4 月底前，逆周期、稳增长、通胀交易的相关资产表现较好，成长、消费风格的资产快速下行。随着 4 月底政治局会议明确稳增长，以及上海疫情初步得到控制、充裕的流动性发挥作用，权益市场出现大幅反弹。市场风格向成长板块明显偏移。上半年 A 股主要指数方面，上证指数下跌 6.63%，沪深 300 下跌 9.22%，中证 800 下跌 9.97%，中小综指下跌 10.77%，创业板指下跌 15.41%。分行业看，周期行业表现相对较好，煤炭上涨 31.38%，交通运输、综合、美容护理和房地产分别下跌 0.71%、1.46%、1.81% 和 2.31%；成长明显落后，电子、计算机、传媒、国防军工和环保分别下跌 24.46%、23.64%、22.25%、20.05% 和 16.42%。

从上半年市场内部的结构看，逆周期的建筑地产和通胀交易的煤炭等大宗商品交相呼应成为市场两条主线。周期主线在一季度演绎得淋漓尽致，尤其在俄乌冲突加剧全球通胀走势的背景下，与此匹配的是相关行业上半年的业绩表现。上游价格的大幅上行部分侵蚀了中下游行业的利润。成长行业内部，高景气的新能源汽车、光伏、风电等反弹幅度明显高于景气度偏弱的半导体、计算机等。消费领域的疫后复苏主线演绎非常充分，包括白酒以及航空、酒店、免税等。市场 1-4 月亏钱效应明显，5、6 月份赚钱效应明显，但前后风格差异明显。整个市场反映出宏观大变局下的产业升级高景气带来的红利，优势产业成为市场配置热点。

债券方面，上半年受到疫情影响，经济增速由 4.8% 下滑至 0.4%。投资方面，制造业投资高增，在设备制造业等高科技行业方面表现出色；基建投资在专项债资金支持的情况下维持高位；地产投

资受到前端拿地与新开工大幅回落的影响仍然较为低迷。消费在国内疫情反复的情况下总体低迷。出口增速较 2021 年的高点出现回落，但短期仍保持一定韧性。通胀方面，猪肉价格回升，油价高位震荡，CPI 小幅回升；PPI 受到基数的影响同比回落。货币政策方面，流动性维持宽松，但受制于美国加息影响，MLF 与 OMO 利率仅在年初调降 10bp，2 季度 5 年期限 LPR 单边下调 15bp。此外央行上缴利润，财政部加速留抵退税均补充了流动性。财政政策方面新增专项债在上半年基本完成全年发行额度。对应债市而言，市场博弈的焦点由 1 季度的宽货币与宽信用，转向 2 季度的短期资金面宽松与中期经济反弹，收益率表现总体区间窄幅震荡。曲线形态上，流动性充裕，资金利率明显偏离政策利率导致短端跟随资金面下行，收益率曲线持续陡峭化。上半年整体来看，10 年期国债收益率较 2021 年末累计上行 4.5bp。信用方面，收益率跟随利率债波动，短端下行幅度较大，中长端低等级下行、中高等级小幅震荡。从节奏来看，1 月受降息落地等因素影响，信用债收益率整体下行；2 月海外利率上行、金融数据和地产政策边际放松，推升宽信用预期，债市走弱；3 月基金赎回压力进一步带动利率调整；4 月-5 月国内疫情反弹，叠加货币政策宽松预期，信用债收益率大幅下行；6 月疫情得到控制，信用债再度承压。当前信用债收益率仍处于历史 15%分位数以下的低位；信用利差呈现明显的期限分化，利差曲线较为陡峭。可转债方面，上半年中证转债指数下跌 4.07%。在经历了 1 季度正股与溢价下跌后，2 季度随着国内疫情好转，经济逐渐改善的影响，市场信心大幅修复。

报告期间，本基金权益仓位相对保持稳定，在控制回撤的基础上，积极寻找合适的股票以赚取绝对收益，行业分布上较为均衡；同时，本基金积极参与新股申购以增强投资收益。债券方面配置以绝对收益角度出发，主要配置中短久期、高评级的信用债及存单，转债方面以配置低价转债为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通欣利混合 A 净值增长率为 1.55%，同期业绩比较基准收益率为-0.40%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.95 个百分点。海富通欣利混合 C 净值增长率为 1.45%，同期业绩比较基准收益率为-0.40%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.85 个百分点。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济复苏态势或依然延续，但幅度可能偏弱。内需、外需均有隐忧，流动性将继续维持在相对宽松的状态。出口与制造业将逐步面临外需下行的压力，地产压力仍需更多的政策智慧解决，消费的恢复继续分化，基建将是确定性最高的支撑领域。货币政策将保持相对宽松的状态，但受制于通胀上行、内外均衡等可能难以更加宽松，但剩余流动性对 A 股依然偏正面。

下半年，回归业绩确定性，从上游到下游，从短久期到长久期。上游原材料价格压力下半年将

逐步明显，中下游盈利或将改善。产业趋势变化将是权益市场的主要驱动力。经济结构变化带来的红利较为确定，电动车、光伏、风电、储能、半导体等受益于产业趋势政策导向的行业投资机会，或更加容易把握。

债券方面，展望下半年，经济处于复苏阶段。国务院决定通过发行金融债券 3000 亿补充重大项目资本金，基建将继续发力。房地产投资方面，在政策放松后呈现弱反弹趋势，预计下半年环比有所改善。制造业投资考虑到企业利润整体趋于下行，预计下半年制造业投资或小幅回落。消费受疫情影响最为严重，预计消费或延续缓慢复苏的态势。通胀方面，当前生猪存栏量稍有下滑，猪肉价格触底回升，CPI 同比或持续回升，下半年有高于 3% 的风险；PPI 在高基数、海外需求回落的情况下同比回落趋势仍然相对确定。货币政策方面，美联储加息周期下对国内货币政策形成制约。上半年央行上缴利润、财政留抵退税基本结束，下半年基础货币投放或减少，降准或弥补部分资金缺口，资金面或逐渐回归中性。财政方面关注是否推出特别国债、提高赤字率、提前发行专项债额度等增量政策。下半年债券市场处于政策发力、经济恢复期，同时通胀压力逐渐显现，收益率总体或处于承压上行的阶段。信用方面，在城投监管政策未变的情况下，预计信用债供给仍有限。短期来看，宽松资金面维持，信用利差缺乏走扩空间；中期资金面逐渐回归中性，但考虑到利率调整的空间整体有限，机构结构性资产荒局面难以完全扭转，信用利差走扩也将带来逢高配置的机会。板块方面，考虑以城投、国企和类金融底仓配置策略，辅以中短久期强省“弱平台”适度挖掘、部分国有地产择券以及部分优质企业永续债增强回报。资本债仍可延续逢高配置思路，关注 TLAC 等新品种。可转债方面，市场整体趋势依然向上，转债较高的溢价率或仍能维持，但优势板块或有所切换。

未来，本基金将继续在控制风险的基础上，积极寻找市场的结构性机会，力争跑赢市场。本基金也将利用动态的仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。固定收益部分，仍以持有高等级信用债为主，同时将视市场状况配置一定比例的具备绝对收益的转债，以增厚组合收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人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，基金收益分配后份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

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

本基金本报告期无需要说明的情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，海富通欣利混合型证券投资基金未进行利润分配。

#### 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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2022 年中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：海富通欣利混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产           | 附注号        | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |            |                                |                                  |
| 银行存款          | 6.4.7.1    | 416,494.00                     | 195,804.28                       |
| 结算备付金         |            | 397,184.56                     | 851,547.19                       |
| 存出保证金         |            | 34,753.95                      | 54,228.31                        |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 142,691,737.79                 | 207,372,300.78                   |
| 其中：股票投资       |            | 54,257,986.13                  | 64,514,949.28                    |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 88,433,751.66                  | 142,857,351.50                   |
| 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    | 3,400,162.85                   | -                                |
| 应收清算款         |            | 635,708.72                     | 182,033.75                       |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 2,560.00                       | -                                |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                              | 1,744,956.40                     |
| 资产总计          |            | 147,578,601.87                 | 210,400,870.71                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2021 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                                |                                  |
| 短期借款          |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债       |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                              | 4,800,000.00                     |
| 应付清算款         |            | 443,919.04                     | -                                |
| 应付赎回款         |            | 2,045.25                       | 128.78                           |
| 应付管理人报酬       |            | 74,078.10                      | 109,445.38                       |
| 应付托管费         |            | 12,346.34                      | 18,240.91                        |
| 应付销售服务费       |            | 11,867.90                      | 15,680.52                        |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | 8,011.89                       | 6,681.53                         |

|             |         |                |                |
|-------------|---------|----------------|----------------|
| 应付利润        |         | -              | -              |
| 递延所得税负债     |         | -              | -              |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 157,208.43     | 142,291.01     |
| 负债合计        |         | 709,476.95     | 5,092,468.13   |
| <b>净资产：</b> |         |                |                |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 141,821,173.32 | 201,235,719.05 |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 5,047,951.60   | 4,072,683.53   |
| 净资产合计       |         | 146,869,124.92 | 205,308,402.58 |
| 负债和净资产总计    |         | 147,578,601.87 | 210,400,870.71 |

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0363 元，C 类基金份额净值 1.0347 元。

基金份额总额 141,821,173.32 份，其中 A 类基金份额 76,156,973.38 份，C 类基金份额 65,664,199.94 份。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通欣利混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期                              |
|-----------------------|----------|---------------------------------|
|                       |          | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| <b>一、营业总收入</b>        |          | 2,124,813.62                    |
| 1.利息收入                |          | 23,103.76                       |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.9  | 13,069.72                       |
| 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            |          | 10,034.04                       |
| 证券出借利息收入              |          | -                               |
| 其他利息收入                |          | -                               |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 1,596,269.82                    |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.10 | -1,418,780.42                   |
| 基金投资收益                |          | -                               |
| 债券投资收益                | 6.4.7.11 | 2,053,366.55                    |
| 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 | 961,683.69                      |
| 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 | 479,805.17                      |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -                               |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.16 | 25,634.87                       |

|                            |          |                     |
|----------------------------|----------|---------------------|
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | 867,713.60          |
| 1. 管理人报酬                   |          | 546,113.25          |
| 2. 托管费                     |          | 91,018.86           |
| 3. 销售服务费                   |          | 74,922.61           |
| 4. 投资顾问费                   |          | -                   |
| 5. 利息支出                    |          | 44,782.49           |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 44,782.49           |
| 6. 信用减值损失                  |          | -                   |
| 7. 税金及附加                   |          | 4,616.24            |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.17 | 106,260.15          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>1,257,100.02</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>1,257,100.02</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | -                   |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | <b>1,257,100.02</b> |

注：基金合同成立于 2021 年 09 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海富通欣利混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |                |              |                |
|------------------------|---------------------------------------|----------------|--------------|----------------|
|                        | 实收基金                                  | 其他综合<br>收益（若有） | 未分配利润        | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产（基金净值）        | 201,235,719.05                        | -              | 4,072,683.53 | 205,308,402.58 |
| 二、本期期初净资产（基金净值）        | 201,235,719.05                        | -              | 4,072,683.53 | 205,308,402.58 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）   | -59,414,545.73                        | -              | 975,268.07   | -58,439,277.66 |
| （一）、综合收益总额             | -                                     | -              | 1,257,100.02 | 1,257,100.02   |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -59,414,545.73                        | -              | -281,831.95  | -59,696,377.68 |

|  |                |   |              |                |
|--|----------------|---|--------------|----------------|
| (净值减少以“-”号填列)                            |                |   |              |                |
| 其中：1.基金申购款                               | 35,483,724.67  | - | -125,699.72  | 35,358,024.95  |
| 2.基金赎回款                                  | -94,898,270.40 | - | -156,132.23  | -95,054,402.63 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -              | - | -            | -              |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 141,821,173.32 | - | 5,047,951.60 | 146,869,124.92 |

注：基金合同成立于 2021 年 09 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

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

海富通欣利混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]229 号《关于准予海富通欣利混合型证券投资基金注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通欣利混合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，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 221,610,845.56 元，其中海富通欣利混合 A 为人民币 120,391,548.49 元，海富通欣利混合 C 为人民币 101,219,297.07 元。经向中国证监会备案，《海富通欣利混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 9 月 14 日正式生效，基金合同生效日的海富通欣利混合 A 基金份额总额为 120,410,992.42 份，其中认购资金利息折合 19,443.93 份基金份额，海富通欣利混合 C 基金份额总额为 101,223,867.70 份，其中认购资金利息折合 4,570.63 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，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

根据《海富通欣利混合型证券投资基金基金合同》及《海富通欣利混合型证券投资基金基金招募说明书》的有关规定，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《海富通欣利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券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）、货币市场工具、同业存单、股指期货、股票期权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。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产及存托凭证的比例占基金资产的比例为 0%-50%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0%-50%，投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终，扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×20%+中证综合债指数收益率×75%+恒生指数收益率（经汇率调整）×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 2022 年 8 月 30 日批准报出。

#### 6.4.2 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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《海富通欣利混合型证券投资基金基金合同》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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年度的经营成果和基金净值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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外, 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

#### (a) 金融工具

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式, 将金融工具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。本基金考虑自身业务模式, 以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日, 本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求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。金融资产减值计量方式的变更对于本基金的影响不重大。

根据新金融工具准则的相关规定, 本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额, 2021 年度的比较财务报表未重列。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款, 金额分别为 195,804.28 元、851,547.19 元、54,228.31 元、1,744,956.40 元和 182,033.75 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款, 金额分别为 195,869.47 元、851,968.71 元、54,255.15 元、0.00 元和 182,033.75 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 207,372,300.78 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资

产为交易性金融资产，金额为 209,116,743.63 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债，金额分别为 4,800,000.00 元、128.78 元、109,445.38 元、18,240.91 元、15,680.52 元、60,146.02 元、-1,855.03 元和 84,000.02 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债，金额分别为 4,798,144.97 元、128.78 元、109,445.38 元、18,240.91 元、15,680.52 元、60,146.02 元、0.00 元和 84,000.02 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开

发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(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。

(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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

| 项目              | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------|
| 活期存款            | 416,494.00             |
| 等于: 本金          | 416,336.00             |
| 加: 应计利息         | 158.00                 |
| 定期存款            | -                      |
| 等于: 本金          | -                      |
| 加: 应计利息         | -                      |
| 其中: 存款期限 1 个月以内 | -                      |

|             |            |
|-------------|------------|
| 存款期限 1-3 个月 | -          |
| 存款期限 3 个月以上 | -          |
| 其他存款        | -          |
| 等于：本金       | -          |
| 加：应计利息      | -          |
| 合计          | 416,494.00 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |        | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |              |                |              |
|---------------|--------|------------------------|--------------|----------------|--------------|
|               |        | 成本                     | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动       |
| 股票            |        | 51,765,636.36          | -            | 54,257,986.13  | 2,492,349.77 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |        | -                      | -            | -              | -            |
| 债券            | 交易所市场  | 86,645,468.17          | 1,865,521.96 | 88,433,751.66  | -77,238.47   |
|               | 银行间市场  | -                      | -            | -              | -            |
|               | 合计     | 86,645,468.17          | 1,865,521.96 | 88,433,751.66  | -77,238.47   |
|               | 资产支持证券 | -                      | -            | -              | -            |
| 基金            |        | -                      | -            | -              | -            |
| 其他            |        | -                      | -            | -              | -            |
| 合计            |        | 138,411,104.53         | 1,865,521.96 | 142,691,737.79 | 2,415,111.30 |

#### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 3,400,162.85           | -         |

|       |              |   |
|-------|--------------|---|
| 银行间市场 | -            | - |
| 合计    | 3,400,162.85 | - |

#### 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从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年6月30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      | 67,948.28         |
| 其中：交易所市场    | 67,773.28         |
| 银行间市场       | 175.00            |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 89,260.15         |
| 合计          | 157,208.43        |

#### 6.4.7.7 实收基金

海富通欣利混合 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 120,959,859.29             | 120,959,859.29 |
| 本期申购          | 18,183,901.53              | 18,183,901.53  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -62,986,787.44             | -62,986,787.44 |
| 本期末           | 76,156,973.38              | 76,156,973.38  |

海富通欣利混合 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 80,275,859.76              | 80,275,859.76  |
| 本期申购          | 17,299,823.14              | 17,299,823.14  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -31,911,482.96             | -31,911,482.96 |
| 本期末           | 65,664,199.94              | 65,664,199.94  |

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

海富通欣利混合 A

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分        | 未分配利润合计      |
|----------------|--------------|--------------|--------------|
| 上年度末           | 1,360,192.72 | 1,115,602.62 | 2,475,795.34 |
| 本期利润           | 448,074.35   | -54,422.23   | 393,652.12   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -510,988.29  | 409,218.88   | -101,769.41  |
| 其中：基金申购款       | 259,912.68   | -341,960.67  | -82,047.99   |
| 基金赎回款          | -770,900.97  | 751,179.55   | -19,721.42   |
| 本期已分配利润        | -            | -            | -            |
| 本期末            | 1,297,278.78 | 1,470,399.27 | 2,767,678.05 |

海富通欣利混合 C

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分        | 未分配利润合计      |
|----------------|--------------|--------------|--------------|
| 上年度末           | 856,837.09   | 740,051.10   | 1,596,888.19 |
| 本期利润           | 329,220.50   | 534,227.40   | 863,447.90   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -171,361.97  | -8,700.57    | -180,062.54  |
| 其中：基金申购款       | 166,976.59   | -210,628.32  | -43,651.73   |
| 基金赎回款          | -338,338.56  | 201,927.75   | -136,410.81  |
| 本期已分配利润        | -            | -            | -            |
| 本期末            | 1,014,695.62 | 1,265,577.93 | 2,280,273.55 |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----|----------------------------|
|    | 活期存款利息收入                   |

|           |           |
|-----------|-----------|
| 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 | 4,287.43  |
| 其他        | 2,096.01  |
| 合计        | 13,069.72 |

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 87,989,015.51              |
| 减：卖出股票成本总额 | 89,178,609.48              |
| 减：交易费用     | 229,186.45                 |
| 买卖股票差价收入   | -1,418,780.42              |

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 1,763,906.27               |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 289,460.28                 |
| 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                           | 2,053,366.55               |

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 79,729,437.02              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 78,100,078.14              |
| 减：应计利息总额               | 1,339,110.35               |
| 减：交易费用                 | 788.25                     |
| 买卖债券差价收入               | 289,460.28                 |

**6.4.7.12 贵金属投资收益**

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.13 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 961,683.69                 |
| 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            | 961,683.69                 |

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产                  | 479,805.17                 |
| ——股票投资                     | 665,746.73                 |
| ——债券投资                     | -185,941.56                |
| ——资产支持证券投资                 | -                          |
| ——基金投资                     | -                          |
| ——贵金属投资                    | -                          |
| ——其他                       | -                          |
| 2.衍生工具                     | -                          |
| ——权证投资                     | -                          |
| 3.其他                       | -                          |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的<br>预估增值税 | -                          |
| 合计                         | 479,805.17                 |

**6.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 25,634.87                  |
| 合计      | 25,634.87                  |

**6.4.7.17 其他费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 审计费用      | 29,752.78                  |
| 信息披露费     | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金   | -                          |
| 其他费用      | 500.00                     |
| 债券托管账户维护费 | 16,500.00                  |
| 合计        | 106,260.15                 |

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过股票交易，基金合同成立于 2021 年 09 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易，基金合同成立于 2021 年 09 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内没有应支付关联方的佣金，基金合同成立于 2021 年 09 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 546,113.25                 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 73,603.66                  |

注：1、支付基金管理人海富通基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

2、基金合同成立于 2021 年 09 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 91,018.86                  |

注：1、支付基金托管人华夏银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

2、基金合同成立于 2021 年 09 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |           |           |
|----------------|----------------------------|-----------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费           |           |           |
|                | 海富通欣利混合 A                  | 海富通欣利混合 C | 合计        |
| 华夏银行           | -                          | 51,386.64 | 51,386.64 |

|       |   |           |           |
|-------|---|-----------|-----------|
| 海通证券  | - | 0.06      | 0.06      |
| 海富通基金 | - | 23,433.28 | 23,433.28 |
| 合计    | - | 74,819.98 | 74,819.98 |

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：海富通欣利混合 C 类基金日基金销售服务费=前一日 C 类份额对应的基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2021 年 09 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易，基金合同成立于 2021 年 09 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

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

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

本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务，基金合同成立于 2021 年 09 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

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

本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务，基金合同成立于 2021 年 09 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金，基金合同成立于 2021 年 09 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

##### 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                   |
|-------|----------------------|
|       | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|       |                      |

|      | 期末余额       | 当期利息收入   |
|------|------------|----------|
| 华夏银行 | 416,494.00 | 6,686.28 |

注：基金合同成立于 2021 年 09 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |        |      |      |                |           |
|---------------------------------------|--------|------|------|----------------|-----------|
| 关联方名称                                 | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入      |           |
|                                       |        |      |      | 数量（单位：<br>股/张） | 总金额       |
| 海通证券                                  | 688234 | 天岳先进 | 网下发行 | 1,111          | 91,979.69 |
| 海通证券                                  | 688259 | 创耀科技 | 网下发行 | 691            | 46,020.60 |

注：基金合同成立于 2021 年 09 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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

本基金本报告期无其他需要说明的关联交易事项，基金合同成立于 2021 年 09 月 14 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |        |        |       |        |          |            |              |    |
|----------------------|------|------------|--------|--------|-------|--------|----------|------------|--------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 受限期    | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额     | 期末估值总额       | 备注 |
| 600938               | 中国海油 | 2022-04-14 | 6 个月以上 | 新股锁定   | 10.80 | 15.86  | 84,004   | 907,243.20 | 1,332,303.44 | -  |
| 688150               | 莱特光电 | 2022-03-10 | 6 个月以上 | 新股锁定   | 22.05 | 19.60  | 3,335    | 73,536.75  | 65,366.00    | -  |
| 688170               | 德龙激光 | 2022-04-22 | 6 个月以上 | 新股锁定   | 30.18 | 47.04  | 823      | 24,838.14  | 38,713.92    | -  |

注：根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上

市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

#### 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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，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。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2022 年 6 月 30 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 54.95%（2021 年 12 月 31 日：64.04%）。

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。

##### 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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 6,919,344.85      | 11,371,916.50       |
| 合计     | 6,919,344.85      | 11,371,916.50       |

注：未评级部分为国债。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | -                 | 29,213,000.00       |
| 合计     | -                 | 29,213,000.00       |

##### 6.4.13.2.3 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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 77,992,361.97     | 101,285,530.00      |
| AAA 以下 | 2,714,491.52      | 986,905.00          |
| 未评级    | 807,553.32        | -                   |
| 合计     | 81,514,406.81     | 102,272,435.00      |

注：未评级部分为国债。

### 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上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.98%。

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。于本报告期末,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大,此外还持有银行存款、结算备付金和存出保证金等利率敏感性资产,因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

| 本期末<br>2022年6月30日 | 1年以内       | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计         |
|-------------------|------------|------|------|-----|------------|
| 资产                |            |      |      |     |            |
| 银行存款              | 416,494.00 | -    | -    | -   | 416,494.00 |
| 结算备付金             | 397,184.56 | -    | -    | -   | 397,184.56 |
| 存出保证金             | 34,753.95  | -    | -    | -   | 34,753.95  |

|                                      |               |               |              |               |                |
|--------------------------------------|---------------|---------------|--------------|---------------|----------------|
| 交易性金融资产                              | 34,593,900.05 | 53,201,143.67 | 638,707.94   | 54,257,986.13 | 142,691,737.79 |
| 买入返售金融资产                             | 3,400,162.85  | -             | -            | -             | 3,400,162.85   |
| 应收清算款                                | -             | -             | -            | 635,708.72    | 635,708.72     |
| 应收申购款                                | -             | -             | -            | 2,560.00      | 2,560.00       |
| 资产总计                                 | 38,842,495.41 | 53,201,143.67 | 638,707.94   | 54,896,254.85 | 147,578,601.87 |
| 负债                                   |               |               |              |               |                |
| 应付清算款                                | -             | -             | -            | 443,919.04    | 443,919.04     |
| 应付赎回款                                | -             | -             | -            | 2,045.25      | 2,045.25       |
| 应付管理人报酬                              | -             | -             | -            | 74,078.10     | 74,078.10      |
| 应付托管费                                | -             | -             | -            | 12,346.34     | 12,346.34      |
| 应付销售服务费                              | -             | -             | -            | 11,867.90     | 11,867.90      |
| 应交税费                                 | -             | -             | -            | 8,011.89      | 8,011.89       |
| 其他负债                                 | -             | -             | -            | 157,208.43    | 157,208.43     |
| 负债总计                                 | -             | -             | -            | 709,476.95    | 709,476.95     |
| 利率敏感度缺口                              | 38,842,495.41 | 53,201,143.67 | 638,707.94   | 54,186,777.90 | 146,869,124.92 |
| <b>上年度末<br/>2021 年 12 月 31<br/>日</b> | <b>1 年以内</b>  | <b>1-5 年</b>  | <b>5 年以上</b> | <b>不计息</b>    | <b>合计</b>      |
| 资产                                   |               |               |              |               |                |
| 银行存款                                 | 195,804.28    | -             | -            | -             | 195,804.28     |
| 结算备付金                                | 851,547.19    | -             | -            | -             | 851,547.19     |
| 存出保证金                                | 54,228.31     | -             | -            | -             | 54,228.31      |
| 交易性金融资产                              | 70,773,916.50 | 71,809,975.00 | 273,460.00   | 64,514,949.28 | 207,372,300.78 |
| 应收清算款                                | -             | -             | -            | 182,033.75    | 182,033.75     |
| 其他资产                                 | -             | -             | -            | 1,744,956.40  | 1,744,956.40   |
| 资产总计                                 | 71,875,496.28 | 71,809,975.00 | 273,460.00   | 66,441,939.43 | 210,400,870.71 |
| 负债                                   |               |               |              |               |                |
| 卖出回购金融资产款                            | 4,800,000.00  | -             | -            | -             | 4,800,000.00   |
| 应付赎回款                                | -             | -             | -            | 128.78        | 128.78         |
| 应付管理人报酬                              | -             | -             | -            | 109,445.38    | 109,445.38     |

|         |               |               |            |               |                |
|---------|---------------|---------------|------------|---------------|----------------|
| 应付托管费   | -             | -             | -          | 18,240.91     | 18,240.91      |
| 应付销售服务费 | -             | -             | -          | 15,680.52     | 15,680.52      |
| 应交税费    | -             | -             | -          | 6,681.53      | 6,681.53       |
| 其他负债    | -             | -             | -          | 142,291.01    | 142,291.01     |
| 负债总计    | 4,800,000.00  | -             | -          | 292,468.13    | 5,092,468.13   |
| 利率敏感度缺口 | 67,075,496.28 | 71,809,975.00 | 273,460.00 | 66,149,471.30 | 205,308,402.58 |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他变量保持不变 |                                 |                          |
|----|------------------|---------------------------------|--------------------------|
| 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |
|    |                  | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日          | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|    | 市场利率上升 25 个基点    | -335,348.83                     | -683,752.68              |
|    | 市场利率下降 25 个基点    | 338,822.31                      | 693,043.17               |

#### 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和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产及存托凭证的比例占

基金资产的比例为 0%-50%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0%-50%，投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |                      | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |                      |
|---------------|------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 54,257,986.1<br>3      | 36.94                | 64,514,949.28            | 31.42                |
| 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            | 54,257,986.1<br>3      | 36.94                | 64,514,949.28            | 31.42                |

#### 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<br>影响金额(单位：人民币元) |                          |
|                          |                                | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日          | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|                          | 1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%       | 2,399,253.83                    | 1,824,956.44             |
| 2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5% | -2,399,253.83                  | -1,824,956.44                   |                          |

#### 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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 71,447,788.86          | 65,647,110.98            |
| 第二层次          | 69,807,565.57          | 141,725,189.80           |
| 第三层次          | 1,436,383.36           | -                        |
| 合计            | 142,691,737.79         | 207,372,300.78           |

##### 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，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、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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(2021 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买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

##### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 54,257,986.13  | 36.77         |
|    | 其中：股票             | 54,257,986.13  | 36.77         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 88,433,751.66  | 59.92         |
|    | 其中：债券             | 88,433,751.66  | 59.92         |
|    | 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          | 3,400,162.85   | 2.30          |
|    | 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      | 813,678.56     | 0.55          |
| 8  | 其他各项资产            | 673,022.67     | 0.46          |
| 9  | 合计                | 147,578,601.87 | 100.00        |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | 2,754,958.44  | 1.88          |
| C  | 制造业              | 27,395,228.49 | 18.65         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,993,962.20  | 2.04          |
| E  | 建筑业              | 2,204,443.00  | 1.50          |
| F  | 批发和零售业           | 804,103.00    | 0.55          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,643,516.00  | 1.80          |
| H  | 住宿和餐饮业           | 181,040.00    | 0.12          |

|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,923,875.00  | 1.31  |
| J | 金融业             | 8,574,808.00  | 5.84  |
| K | 房地产业            | 2,485,856.00  | 1.69  |
| L | 租赁和商务服务业        | 397,652.00    | 0.27  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 730,135.00    | 0.50  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 253,185.00    | 0.17  |
| 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       | 915,224.00    | 0.62  |
| S | 综合              | -             | -     |
|   | 合计              | 54,257,986.13 | 36.94 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 600919 | 江苏银行 | 212,400 | 1,512,288.00 | 1.03         |
| 2  | 600938 | 中国海油 | 84,004  | 1,332,303.44 | 0.91         |
| 3  | 600926 | 杭州银行 | 83,400  | 1,249,332.00 | 0.85         |
| 4  | 601668 | 中国建筑 | 229,500 | 1,220,940.00 | 0.83         |
| 5  | 603866 | 桃李面包 | 72,500  | 1,199,875.00 | 0.82         |
| 6  | 600350 | 山东高速 | 216,300 | 1,135,575.00 | 0.77         |
| 7  | 601688 | 华泰证券 | 77,600  | 1,101,920.00 | 0.75         |
| 8  | 601567 | 三星医疗 | 80,400  | 1,067,712.00 | 0.73         |
| 9  | 600487 | 亨通光电 | 65,400  | 950,916.00   | 0.65         |
| 10 | 600582 | 天地科技 | 190,100 | 908,678.00   | 0.62         |
| 11 | 600548 | 深高速  | 90,600  | 864,324.00   | 0.59         |
| 12 | 600383 | 金地集团 | 62,500  | 840,000.00   | 0.57         |
| 13 | 600048 | 保利发展 | 48,100  | 839,826.00   | 0.57         |
| 14 | 600373 | 中文传媒 | 81,300  | 812,187.00   | 0.55         |
| 15 | 300122 | 智飞生物 | 7,200   | 799,272.00   | 0.54         |
| 16 | 601009 | 南京银行 | 75,800  | 789,836.00   | 0.54         |
| 17 | 002555 | 三七互娱 | 33,300  | 706,959.00   | 0.48         |

|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 18 | 600219 | 南山铝业 | 189,400 | 698,886.00 | 0.48 |
| 19 | 600089 | 特变电工 | 25,300  | 692,967.00 | 0.47 |
| 20 | 600496 | 精工钢构 | 145,000 | 669,900.00 | 0.46 |
| 21 | 603018 | 华设集团 | 68,000  | 649,400.00 | 0.44 |
| 22 | 600461 | 洪城环境 | 79,900  | 646,391.00 | 0.44 |
| 23 | 600438 | 通威股份 | 10,600  | 634,516.00 | 0.43 |
| 24 | 601211 | 国泰君安 | 41,500  | 630,800.00 | 0.43 |
| 25 | 600131 | 国网信通 | 46,000  | 618,700.00 | 0.42 |
| 26 | 601222 | 林洋能源 | 74,000  | 617,900.00 | 0.42 |
| 27 | 600901 | 江苏租赁 | 120,000 | 615,600.00 | 0.42 |
| 28 | 600380 | 健康元  | 49,100  | 606,385.00 | 0.41 |
| 29 | 300601 | 康泰生物 | 12,900  | 582,822.00 | 0.40 |
| 30 | 603886 | 元祖股份 | 31,900  | 562,078.00 | 0.38 |
| 31 | 603035 | 常熟汽饰 | 33,600  | 555,072.00 | 0.38 |
| 32 | 600908 | 无锡银行 | 98,300  | 553,429.00 | 0.38 |
| 33 | 601615 | 明阳智能 | 16,200  | 547,560.00 | 0.37 |
| 34 | 600863 | 内蒙华电 | 148,600 | 542,390.00 | 0.37 |
| 35 | 002966 | 苏州银行 | 88,860  | 542,046.00 | 0.37 |
| 36 | 603707 | 健友股份 | 19,100  | 538,620.00 | 0.37 |
| 37 | 600483 | 福能股份 | 38,100  | 536,067.00 | 0.36 |
| 38 | 300502 | 新易盛  | 19,000  | 497,800.00 | 0.34 |
| 39 | 600985 | 淮北矿业 | 33,800  | 492,128.00 | 0.34 |
| 40 | 600153 | 建发股份 | 37,400  | 488,818.00 | 0.33 |
| 41 | 000002 | 万科A  | 23,600  | 483,800.00 | 0.33 |
| 42 | 300737 | 科顺股份 | 36,700  | 483,706.00 | 0.33 |
| 43 | 601225 | 陕西煤业 | 22,200  | 470,196.00 | 0.32 |
| 44 | 600285 | 羚锐制药 | 36,700  | 459,851.00 | 0.31 |
| 45 | 600803 | 新奥股份 | 23,700  | 440,583.00 | 0.30 |
| 46 | 601137 | 博威合金 | 24,600  | 435,420.00 | 0.30 |
| 47 | 000977 | 浪潮信息 | 16,100  | 426,328.00 | 0.29 |
| 48 | 600036 | 招商银行 | 9,900   | 417,780.00 | 0.28 |
| 49 | 000333 | 美的集团 | 6,900   | 416,691.00 | 0.28 |
| 50 | 000012 | 南玻A  | 55,500  | 411,810.00 | 0.28 |
| 51 | 600519 | 贵州茅台 | 200     | 409,000.00 | 0.28 |
| 52 | 603809 | 豪能股份 | 30,370  | 399,365.50 | 0.27 |
| 53 | 603730 | 岱美股份 | 29,510  | 386,876.10 | 0.26 |
| 54 | 002013 | 中航机电 | 31,300  | 386,555.00 | 0.26 |
| 55 | 002539 | 云图控股 | 23,400  | 374,166.00 | 0.25 |
| 56 | 601899 | 紫金矿业 | 39,500  | 368,535.00 | 0.25 |
| 57 | 600012 | 皖通高速 | 46,600  | 348,102.00 | 0.24 |
| 58 | 300481 | 濮阳惠成 | 14,700  | 345,450.00 | 0.24 |
| 59 | 002533 | 金杯电工 | 44,800  | 317,632.00 | 0.22 |
| 60 | 600456 | 宝钛股份 | 5,300   | 314,820.00 | 0.21 |
| 61 | 688550 | 瑞联新材 | 4,489   | 307,900.51 | 0.21 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 62  | 600566 | 济川药业 | 11,300 | 306,908.00 | 0.21 |
| 63  | 601231 | 环旭电子 | 21,200 | 304,432.00 | 0.21 |
| 64  | 002039 | 黔源电力 | 20,720 | 303,962.40 | 0.21 |
| 65  | 601888 | 中国中免 | 1,300  | 302,809.00 | 0.21 |
| 66  | 002815 | 崇达技术 | 22,800 | 292,068.00 | 0.20 |
| 67  | 300398 | 飞凯材料 | 12,500 | 285,750.00 | 0.19 |
| 68  | 002080 | 中材科技 | 10,100 | 277,750.00 | 0.19 |
| 69  | 600528 | 中铁工业 | 34,400 | 276,920.00 | 0.19 |
| 70  | 600887 | 伊利股份 | 7,100  | 276,545.00 | 0.19 |
| 71  | 002698 | 博实股份 | 22,700 | 268,541.00 | 0.18 |
| 72  | 000090 | 天健集团 | 38,800 | 267,332.00 | 0.18 |
| 73  | 601166 | 兴业银行 | 13,400 | 266,660.00 | 0.18 |
| 74  | 002641 | 公元股份 | 54,500 | 262,690.00 | 0.18 |
| 75  | 002508 | 老板电器 | 7,100  | 255,813.00 | 0.17 |
| 76  | 600570 | 恒生电子 | 5,800  | 252,532.00 | 0.17 |
| 77  | 601186 | 中国铁建 | 31,100 | 245,690.00 | 0.17 |
| 78  | 300504 | 天邑股份 | 13,600 | 241,536.00 | 0.16 |
| 79  | 002984 | 森麒麟  | 7,400  | 230,214.00 | 0.16 |
| 80  | 600325 | 华发股份 | 30,000 | 227,100.00 | 0.15 |
| 81  | 603579 | 荣泰健康 | 9,200  | 226,780.00 | 0.15 |
| 82  | 600729 | 重庆百货 | 10,500 | 226,485.00 | 0.15 |
| 83  | 601598 | 中国外运 | 58,300 | 226,204.00 | 0.15 |
| 84  | 601985 | 中国核电 | 32,800 | 225,008.00 | 0.15 |
| 85  | 601669 | 中国电建 | 28,500 | 224,295.00 | 0.15 |
| 86  | 688166 | 博瑞医药 | 9,078  | 219,233.70 | 0.15 |
| 87  | 002043 | 兔宝宝  | 18,200 | 211,120.00 | 0.14 |
| 88  | 300033 | 同花顺  | 2,100  | 201,915.00 | 0.14 |
| 89  | 600426 | 华鲁恒升 | 6,900  | 201,480.00 | 0.14 |
| 90  | 002384 | 东山精密 | 8,700  | 199,491.00 | 0.14 |
| 91  | 000001 | 平安银行 | 13,300 | 199,234.00 | 0.14 |
| 92  | 300476 | 胜宏科技 | 10,800 | 198,288.00 | 0.14 |
| 93  | 000792 | 盐湖股份 | 6,600  | 197,736.00 | 0.13 |
| 94  | 600886 | 国投电力 | 18,800 | 197,400.00 | 0.13 |
| 95  | 002801 | 微光股份 | 6,600  | 197,010.00 | 0.13 |
| 96  | 600820 | 隧道股份 | 32,100 | 196,452.00 | 0.13 |
| 97  | 600030 | 中信证券 | 9,000  | 194,940.00 | 0.13 |
| 98  | 600141 | 兴发集团 | 4,200  | 184,758.00 | 0.13 |
| 99  | 600258 | 首旅酒店 | 7,300  | 181,040.00 | 0.12 |
| 100 | 601677 | 明泰铝业 | 7,200  | 171,360.00 | 0.12 |
| 101 | 688656 | 浩欧博  | 4,349  | 170,176.37 | 0.12 |
| 102 | 603228 | 景旺电子 | 7,200  | 167,976.00 | 0.11 |
| 103 | 600328 | 中盐化工 | 6,800  | 160,140.00 | 0.11 |
| 104 | 600195 | 中牧股份 | 13,000 | 159,380.00 | 0.11 |
| 105 | 002562 | 兄弟科技 | 24,200 | 156,816.00 | 0.11 |

|     |        |       |        |            |      |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 106 | 300692 | 中环环保  | 21,000 | 152,670.00 | 0.10 |
| 107 | 603856 | 东宏股份  | 11,400 | 152,532.00 | 0.10 |
| 108 | 603180 | 金牌厨柜  | 4,900  | 151,704.00 | 0.10 |
| 109 | 688357 | 建龙微纳  | 1,313  | 147,633.72 | 0.10 |
| 110 | 688300 | 联瑞新材  | 1,863  | 144,661.95 | 0.10 |
| 111 | 688087 | 英科再生  | 2,224  | 128,702.88 | 0.09 |
| 112 | 603931 | 格林达   | 6,400  | 128,640.00 | 0.09 |
| 113 | 002929 | 润建股份  | 3,500  | 125,650.00 | 0.09 |
| 114 | 002001 | 新 和 成 | 5,500  | 125,455.00 | 0.09 |
| 115 | 002048 | 宁波华翔  | 7,800  | 124,956.00 | 0.09 |
| 116 | 601456 | 国联证券  | 10,000 | 122,700.00 | 0.08 |
| 117 | 300451 | 创业慧康  | 14,900 | 107,280.00 | 0.07 |
| 118 | 000726 | 鲁 泰 A | 14,500 | 103,675.00 | 0.07 |
| 119 | 002643 | 万润股份  | 4,900  | 102,214.00 | 0.07 |
| 120 | 605090 | 九丰能源  | 5,040  | 102,160.80 | 0.07 |
| 121 | 000902 | 新洋丰   | 5,800  | 97,962.00  | 0.07 |
| 122 | 600639 | 浦东金桥  | 7,000  | 95,130.00  | 0.06 |
| 123 | 603300 | 华铁应急  | 11,900 | 94,843.00  | 0.06 |
| 124 | 000932 | 华菱钢铁  | 18,600 | 94,674.00  | 0.06 |
| 125 | 300803 | 指南针   | 1,600  | 94,048.00  | 0.06 |
| 126 | 000501 | 武商集团  | 8,000  | 88,800.00  | 0.06 |
| 127 | 000776 | 广发证券  | 4,400  | 82,280.00  | 0.06 |
| 128 | 603060 | 国检集团  | 6,700  | 80,735.00  | 0.05 |
| 129 | 300144 | 宋城演艺  | 4,800  | 73,680.00  | 0.05 |
| 130 | 000975 | 银泰黄金  | 7,500  | 73,050.00  | 0.05 |
| 131 | 002034 | 旺能环境  | 3,500  | 71,855.00  | 0.05 |
| 132 | 002959 | 小熊电器  | 1,100  | 68,563.00  | 0.05 |
| 133 | 688150 | 莱特光电  | 3,335  | 65,366.00  | 0.04 |
| 134 | 300790 | 宇瞳光学  | 3,400  | 65,008.00  | 0.04 |
| 135 | 300308 | 中际旭创  | 2,000  | 62,100.00  | 0.04 |
| 136 | 301071 | 力量钻石  | 400    | 62,052.00  | 0.04 |
| 137 | 300482 | 万孚生物  | 1,500  | 61,065.00  | 0.04 |
| 138 | 300217 | 东方电热  | 9,700  | 59,364.00  | 0.04 |
| 139 | 600004 | 白云机场  | 3,900  | 58,149.00  | 0.04 |
| 140 | 300685 | 艾德生物  | 1,800  | 57,600.00  | 0.04 |
| 141 | 002790 | 瑞尔特   | 7,200  | 56,376.00  | 0.04 |
| 142 | 300568 | 星源材质  | 1,900  | 55,176.00  | 0.04 |
| 143 | 688227 | 品高股份  | 2,550  | 54,621.00  | 0.04 |
| 144 | 688187 | 时代电气  | 828    | 53,811.72  | 0.04 |
| 145 | 300993 | 玉马遮阳  | 4,100  | 52,398.00  | 0.04 |
| 146 | 601390 | 中国中铁  | 8,100  | 49,734.00  | 0.03 |
| 147 | 688211 | 中科微至  | 1,201  | 48,916.73  | 0.03 |
| 148 | 000683 | 远兴能源  | 4,600  | 48,346.00  | 0.03 |
| 149 | 300980 | 祥源新材  | 2,000  | 48,000.00  | 0.03 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 150 | 688002 | 睿创微纳 | 1,186 | 47,107.92 | 0.03 |
| 151 | 002009 | 天奇股份 | 2,500 | 46,250.00 | 0.03 |
| 152 | 300843 | 胜蓝股份 | 2,000 | 45,680.00 | 0.03 |
| 153 | 603997 | 继峰股份 | 3,900 | 42,432.00 | 0.03 |
| 154 | 002925 | 盈趣科技 | 1,900 | 40,888.00 | 0.03 |
| 155 | 300088 | 长信科技 | 5,400 | 40,068.00 | 0.03 |
| 156 | 688170 | 德龙激光 | 823   | 38,713.92 | 0.03 |
| 157 | 300268 | 佳沃食品 | 1,300 | 38,675.00 | 0.03 |
| 158 | 300354 | 东华测试 | 1,200 | 38,580.00 | 0.03 |
| 159 | 601717 | 郑煤机  | 2,600 | 37,466.00 | 0.03 |
| 160 | 000930 | 中粮科技 | 4,100 | 37,064.00 | 0.03 |
| 161 | 002483 | 润邦股份 | 5,700 | 36,822.00 | 0.03 |
| 162 | 601089 | 福元医药 | 1,749 | 36,816.45 | 0.03 |
| 163 | 603236 | 移远通信 | 260   | 34,751.60 | 0.02 |
| 164 | 002414 | 高德红外 | 2,300 | 29,601.00 | 0.02 |
| 165 | 300251 | 光线传媒 | 3,100 | 29,357.00 | 0.02 |
| 166 | 603600 | 永艺股份 | 3,200 | 29,312.00 | 0.02 |
| 167 | 300036 | 超图软件 | 1,500 | 29,310.00 | 0.02 |
| 168 | 601058 | 赛轮轮胎 | 2,600 | 29,302.00 | 0.02 |
| 169 | 002985 | 北摩高科 | 500   | 29,290.00 | 0.02 |
| 170 | 000519 | 中兵红箭 | 1,000 | 29,150.00 | 0.02 |
| 171 | 603379 | 三美股份 | 1,300 | 28,925.00 | 0.02 |
| 172 | 002063 | 远光软件 | 4,100 | 28,823.00 | 0.02 |
| 173 | 603136 | 天目湖  | 1,000 | 28,660.00 | 0.02 |
| 174 | 002705 | 新宝股份 | 1,300 | 28,587.00 | 0.02 |
| 175 | 300373 | 扬杰科技 | 400   | 28,500.00 | 0.02 |
| 176 | 300680 | 隆盛科技 | 1,000 | 25,920.00 | 0.02 |
| 177 | 300233 | 金城医药 | 900   | 25,677.00 | 0.02 |
| 178 | 688558 | 国盛智科 | 578   | 19,877.42 | 0.01 |
| 179 | 603077 | 和邦生物 | 4,600 | 19,596.00 | 0.01 |
| 180 | 300146 | 汤臣倍健 | 900   | 19,485.00 | 0.01 |
| 181 | 000983 | 山西焦煤 | 1,400 | 18,746.00 | 0.01 |
| 182 | 002352 | 顺丰控股 | 200   | 11,162.00 | 0.01 |
| 183 | 603324 | 盛剑环境 | 200   | 8,176.00  | 0.01 |
| 184 | 300648 | 星云股份 | 200   | 8,120.00  | 0.01 |

## 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  | 600938 | 中国海油 | 1,296,054.00 | 0.63 |
| 2  | 600350 | 山东高速 | 1,147,484.90 | 0.56 |
| 3  | 603866 | 桃李面包 | 1,040,610.58 | 0.51 |
| 4  | 600919 | 江苏银行 | 948,119.00   | 0.46 |
| 5  | 600248 | 陕西建工 | 937,668.00   | 0.46 |
| 6  | 601717 | 郑煤机  | 921,815.00   | 0.45 |
| 7  | 601567 | 三星医疗 | 893,780.00   | 0.44 |
| 8  | 600373 | 中文传媒 | 883,128.00   | 0.43 |
| 9  | 600582 | 天地科技 | 834,014.00   | 0.41 |
| 10 | 600383 | 金地集团 | 820,065.00   | 0.40 |
| 11 | 600801 | 华新水泥 | 771,352.00   | 0.38 |
| 12 | 002539 | 云图控股 | 758,756.00   | 0.37 |
| 13 | 002555 | 三七互娱 | 747,546.00   | 0.36 |
| 14 | 300122 | 智飞生物 | 719,123.00   | 0.35 |
| 15 | 603856 | 东宏股份 | 713,719.50   | 0.35 |
| 16 | 600089 | 特变电工 | 710,440.00   | 0.35 |
| 17 | 601818 | 光大银行 | 696,213.00   | 0.34 |
| 18 | 601339 | 百隆东方 | 682,983.00   | 0.33 |
| 19 | 601966 | 玲珑轮胎 | 666,068.00   | 0.32 |
| 20 | 600496 | 精工钢构 | 648,092.00   | 0.32 |

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  | 601939 | 建设银行 | 2,861,396.00 | 1.39            |
| 2  | 601607 | 上海医药 | 2,548,566.00 | 1.24            |
| 3  | 601328 | 交通银行 | 2,194,865.00 | 1.07            |
| 4  | 601006 | 大秦铁路 | 2,026,796.00 | 0.99            |
| 5  | 600639 | 浦东金桥 | 1,823,454.00 | 0.89            |
| 6  | 600028 | 中国石化 | 1,556,876.00 | 0.76            |
| 7  | 601838 | 成都银行 | 1,162,003.00 | 0.57            |
| 8  | 600967 | 内蒙一机 | 1,140,936.00 | 0.56            |
| 9  | 601717 | 郑煤机  | 1,082,188.00 | 0.53            |
| 10 | 600089 | 特变电工 | 1,059,570.00 | 0.52            |
| 11 | 601225 | 陕西煤业 | 1,055,087.00 | 0.51            |
| 12 | 600248 | 陕西建工 | 1,010,736.00 | 0.49            |
| 13 | 601928 | 凤凰传媒 | 921,606.00   | 0.45            |
| 14 | 600674 | 川投能源 | 911,943.00   | 0.44            |
| 15 | 600900 | 长江电力 | 909,888.00   | 0.44            |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 16 | 600987 | 航民股份 | 852,901.00 | 0.42 |
| 17 | 601668 | 中国建筑 | 803,749.00 | 0.39 |
| 18 | 600901 | 江苏租赁 | 799,699.00 | 0.39 |
| 19 | 601009 | 南京银行 | 791,699.00 | 0.39 |
| 20 | 600036 | 招商银行 | 747,262.00 | 0.36 |

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|               |               |
|---------------|---------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 78,255,899.60 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 87,989,015.51 |

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      | 7,726,898.17  | 5.26         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 10,372,458.08 | 7.06         |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | 51,708,209.32 | 35.21        |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 18,626,186.09 | 12.68        |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 88,433,751.66 | 60.21        |

#### 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  | 163799 | 20 国元 G1 | 100,000 | 10,401,231.23 | 7.08         |
| 2  | 143723 | G18 风电 1 | 100,000 | 10,388,213.70 | 7.07         |
| 3  | 127557 | 17 广铁 01 | 100,000 | 10,373,827.95 | 7.06         |
| 4  | 136557 | 16 国寿投   | 100,000 | 10,372,458.08 | 7.06         |
| 5  | 136692 | 16 鲁能 02 | 100,000 | 10,293,071.23 | 7.01         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的浦发转债（110095）的发行人，因监管发现的问题屡查屡犯、配合现场检查不力、内部控制制度修订不及时、信息系统管控有效性不足、未向监管部门真实反映业务数据、净值型理财产品估值方法使用不准确、未严格执行理财投资合作机构名单制管理等违规行为，于 2021 年 7 月 13 日被中国银行保险监督管理委员会处罚罚款 6920 万元。

对该证券的投资决策程序的说明:银行业整体信用水平高,且该银行为全国大型银行,综合实力强,信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程,该证券被纳入本基金的实际投资组合。其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称    | 金额         |
|----|-------|------------|
| 1  | 存出保证金 | 34,753.95  |
| 2  | 应收清算款 | 635,708.72 |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 2,560.00   |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 673,022.67 |

### 7.12.4 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  | 110059 | 浦发转债     | 6,853,880.28 | 4.67         |
| 2  | 132015 | 18 中油 EB | 6,241,308.72 | 4.25         |
| 3  | 113042 | 上银转债     | 1,260,903.45 | 0.86         |
| 4  | 110045 | 海澜转债     | 1,200,800.68 | 0.82         |
| 5  | 110073 | 国投转债     | 855,998.68   | 0.58         |
| 6  | 113044 | 大秦转债     | 518,025.89   | 0.35         |
| 7  | 123113 | 仙乐转债     | 347,903.36   | 0.24         |
| 8  | 127024 | 盈峰转债     | 215,583.84   | 0.15         |
| 9  | 110083 | 苏租转债     | 181,577.55   | 0.12         |
| 10 | 113584 | 家悦转债     | 157,510.48   | 0.11         |
| 11 | 110080 | 东湖转债     | 118,297.67   | 0.08         |
| 12 | 128131 | 崇达转 2    | 115,450.58   | 0.08         |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 13 | 113627 | 太平转债 | 109,920.79 | 0.07 |
| 14 | 127047 | 帝欧转债 | 106,203.73 | 0.07 |
| 15 | 128108 | 蓝帆转债 | 101,814.52 | 0.07 |

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的<br>公允价值 | 占基金资产净<br>值比例(%) | 流通受限情<br>况说明 |
|----|--------|------|-----------------|------------------|--------------|
| 1  | 600938 | 中国海油 | 1,332,303.44    | 0.91             | 新股流通受限       |

## §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<br>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<br>额比例 | 持有份额       | 占总份<br>额比例 |
| 海富通欣利混合<br>A | 247      | 308,327.83       | 75,571,445.62  | 99.23%     | 585,527.76 | 0.77%      |
| 海富通欣利混合<br>C | 65       | 1,010,218.4<br>6 | 65,456,868.58  | 99.68%     | 207,331.36 | 0.32%      |
| 合计           | 312      | 454,555.04       | 141,028,314.20 | 99.44%     | 792,859.12 | 0.56%      |

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 | 海富通欣利混合 A | 510,687.94 | 0.6706%  |
|                  | 海富通欣利混合 C | 0.00       | 0.0000%  |
|                  | 合计        | 510,687.94 | 0.3601%  |

**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<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 海富通欣利混合 A | 10~50             |
|                                    | 海富通欣利混合 C | 0                 |
|                                    | 合计        | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 海富通欣利混合 A | 0~10              |
|                                    | 海富通欣利混合 C | 0                 |
|                                    | 合计        | 0~10              |

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

| 项目                             | 海富通欣利混合 A      | 海富通欣利混合 C      |
|--------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2021 年 9 月 14 日）基金份额总额 | 120,410,992.42 | 101,223,867.70 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 120,959,859.29 | 80,275,859.76  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 18,183,901.53  | 17,299,823.14  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 62,986,787.44  | 31,911,482.96  |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 76,156,973.38  | 65,664,199.94  |

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

**§10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

报告期内本基金投资策略未发生改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

报告期内，本基金的管理人、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。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 中信建投 | 2      | 163,116,851.80 | 100.00%      | 118,993.66 | 100.00%    | -  |

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评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行主观性评议，形成证券公司交易单元租用意见。

**(2)交易单元的选择程序**

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

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

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

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易          |              | 回购交易           |              | 权证交易 |              |
|------|---------------|--------------|----------------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信建投 | 50,856,987.57 | 100.00%      | 497,800,000.00 | 100.00%      | -    | -            |

**10.8 其他重大事件**

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

|    |   |                            | 期          |
|----|---|----------------------------|------------|
| 1  | 海富通基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告             | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-04 |
| 2  | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                     | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-07 |
| 3  | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                     | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-07 |
| 4  | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-20 |
| 5  | 海富通基金管理有限公司关于海富通欣利混合型证券投资基金新增海通证券股份有限公司为销售机构的公告       | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-24 |
| 6  | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为销售机构的公告               | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-29 |
| 7  | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司为销售机构的公告               | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-13 |
| 8  | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行招赢通为销售平台的公告                  | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-21 |
| 9  | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-22 |
| 10 | 海富通基金管理有限公司关于调整公募基金产品适当性风险等级划分方法的公告                   | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-06-16 |

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |               |      |               | 报告期末持有基金情况    |        |
|--|----------------|------------------------|---------------|------|---------------|---------------|--------|
|  | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额          | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构   | 1              | 2022/1/1-2022/5/29     | 50,008,000.00 | -    | 27,921,819.00 | 22,086,181.00 | 15.57% |
| 产品特有风险                                       |                |                        |               |      |               |               |        |
| 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：

- 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；
- 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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 109 只公募基金。截至 2022 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1473 亿元人民币。

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

2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金再度被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·成长基金管理公司奖。

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

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021

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

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

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36—37 层本基金管理人办公地址。

### 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

二〇二二年八月三十一日