

海富通稳固收益债券型证券投资基金

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
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
§5 托管人报告	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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	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.....	20
7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
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.....	47
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.....	49
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
§8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§9 开放式基金份额变动	54
§10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通稳固收益债券型证券投资基金
基金简称	海富通稳固收益债券
基金主代码	519030
交易代码	519030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月23日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,728,258,232.06 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过合理运用投资组合优化策略，力争实现基金收益随着时间增长的逐步提升。
投资策略	本基金的整体投资策略分为三个层次：第一层次，即资产配置策略，将以优化投资组合保险策略为核心，实现基金投资目标；第二层次，即债券投资策略，将采用自上而下的策略，以久期管理为核心；第三层次，即股票投资策略，包括新股申购策略和积极的精选个股策略。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于中低风险品种。其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	郭明
	联系电话	021-38650788	010-66105799
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588
传真		021-33830166	010-66105798
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 36-37层	北京市西城区复兴门内大街55号
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	北京市西城区复兴门内大街55号

	36-37层	
邮政编码	200120	100140
法定代表人	杨仓兵	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-88,794,845.98
本期利润	-129,028,907.53
加权平均基金份额本期利润	-0.0239
本期加权平均净值利润率	-2.00%
本期基金份额净值增长率	-1.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	133,492,884.36
期末可供分配基金份额利润	0.0282
期末基金资产净值	5,718,801,832.63
期末基金份额净值	1.2095
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	96.23%

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

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

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

3.2 基金净值表现

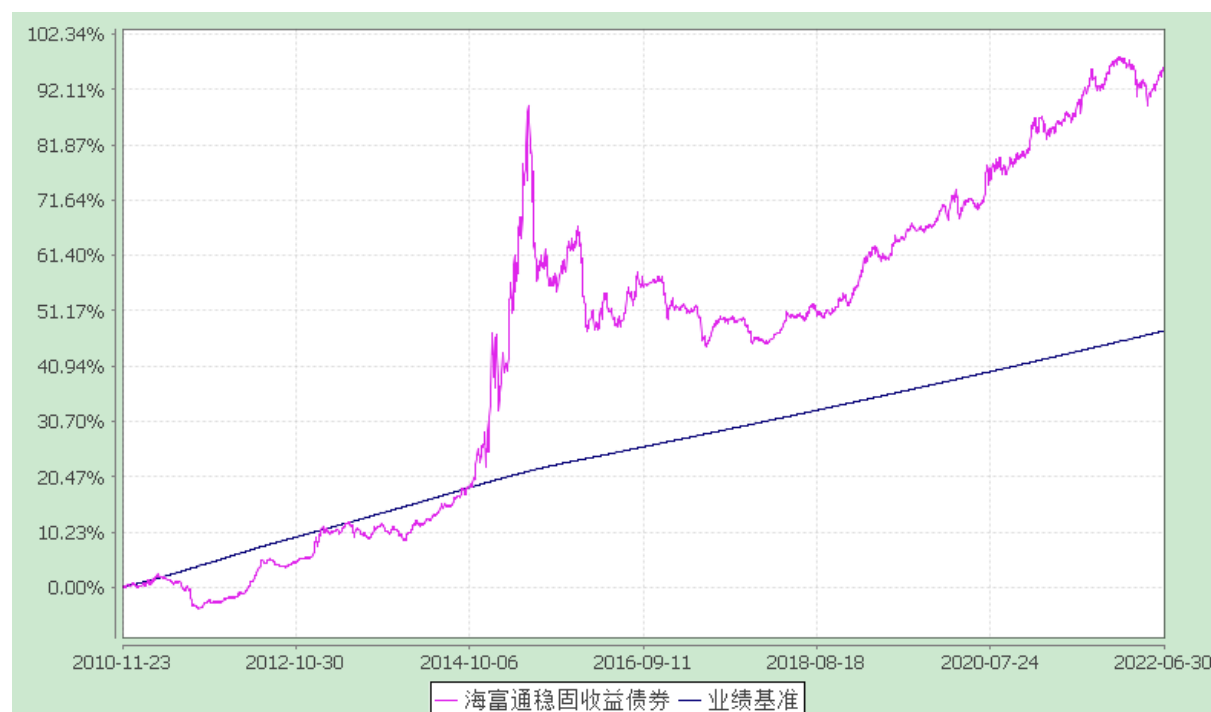
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.41%	0.19%	0.22%	0.01%	1.19%	0.18%
过去三个月	1.58%	0.27%	0.68%	0.01%	0.90%	0.26%
过去六个月	-1.01%	0.28%	1.35%	0.01%	-2.36%	0.27%
过去一年	4.47%	0.27%	2.75%	0.01%	1.72%	0.26%
过去三年	19.84%	0.27%	8.49%	0.01%	11.35%	0.26%
自基金合同生效起至今	96.23%	0.50%	47.44%	0.01%	48.79%	0.49%

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

海富通稳固收益债券型证券投资基金

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
(2010年11月23日至2022年6月30日)



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。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分（二）投资范围、（五）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、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、

海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通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	2020-10-29	-	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

					<p>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。</p>
陈轶平	本基金的基金经理；固定收益投资总监兼债券基金部总监。	2015-12-18	-	13 年	<p>博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011 年 10 月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固定收益投资总监兼债券基金部总监。2013 年 8 月至 2020 年 7 月任海富通货币基金经理。2014 年 8 月至 2019 年 9 月兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014 年 11 月起兼任海富通上证可质押城投债 ETF（现为海富通上证城投债 ETF）基金经理。2015 年 12 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 7 月兼任海富通稳进增利债券（LOF）基金经理。2016 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定开债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2016 年 8 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞丰一年定开债券（现为海富通瑞丰债券）基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 11 月兼任海富通瑞益债券基金经理。</p>

				<p>2016 年 11 月至 2019 年 10 月兼任海富通美元债 (QDII) 基金经理。2017 年 1 月至 2021 年 3 月兼任海富通上证周期产业债 ETF 基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 6 月兼任海富通富源债券基金经理。2017 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 9 月兼任海富通富睿混合 (现海富通沪深 300 指数增强) 基金经理。2017 年 7 月至 2019 年 9 月兼任海富通瑞福一年定开债券 (现为海富通瑞福债券)、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2017 年 7 月至 2018 年 12 月兼任海富通欣悦混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018 年 10 月起兼任海富通上证 10 年期地方政府债 ETF 基金经理。2018 年 11 月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。2019 年 1 月起兼任海富通上清所短融债券基金经理。2019 年 11 月起兼任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 7 月起兼任海富通上证投资级可转债 ETF 基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通利率债债券基金经理。2022 年 3 月起兼任海富通恒益一年定开债券发起式基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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

固定收益方面，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。

本管理人在上半年根据组合规模情况配置信用债，并积极参与利率债波段机会。同时，本管理人上半年根据市场情况降低了可转债资产配置仓位，以在波动较大市场环境下控制组合波动率，同时努力获取权益上涨收益。

权益方面，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。

报告期间，本基金权益仓位较上年末有所上升，行业分布上较为均衡，具体个股根据盈利与估

值的匹配度有所调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-1.01%，同期业绩比较基准收益率为 1.35%，基金净值跑输业绩比较基准 2.36 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

固定收益方面，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。本组合在下半年将继续根据市场情况灵活配置各类债券资产，努力获取稳定收益。

权益方面，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。

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，继续挖掘盈利与估值较匹配的个股，力争跑赢市场。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对海富通稳固收益债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，海富通稳固收益债券型证券投资基金的管理人——海富通基金管理有限公司在海富通稳固收益债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的海富通稳固收益债券型证券投资基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：海富通稳固收益债券型证券投资基金

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	342,005,491.58	246,127,531.87
结算备付金		171,999,458.03	27,313,160.54
存出保证金		600,576.35	111,669.74
交易性金融资产	6.4.7.2	6,874,610,584.62	3,841,739,619.58
其中：股票投资		1,025,726,967.92	559,569,448.03
基金投资		-	-
债券投资		5,848,883,616.70	3,282,170,171.55
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		147,053,219.27	75,467,795.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	40,204,120.03

资产总计		7,536,269,329.85	4,230,963,896.86
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,470,000,000.00	183,000,000.00
应付清算款		326,918,131.15	173,307,947.07
应付赎回款		13,313,952.58	1,953,523.98
应付管理人报酬		3,213,704.25	1,656,039.66
应付托管费		918,201.23	473,154.17
应付销售服务费		1,836,402.43	946,308.39
应付投资顾问费		-	-
应交税费		150,196.85	137,914.13
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,116,908.73	524,405.88
负债合计		1,817,467,497.22	361,999,293.28
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	4,728,258,232.06	3,166,302,227.04
未分配利润	6.4.7.8	990,543,600.57	702,662,376.54
净资产合计		5,718,801,832.63	3,868,964,603.58
负债和净资产总计		7,536,269,329.85	4,230,963,896.86

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2095 元，基金份额总额 4,728,258,232.06 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通稳固收益债券型证券投资基金

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	上年度可比期间 2021年1月1日至 2021年6月30日
一、营业总收入		-73,442,450.30	23,859,284.77
1.利息收入		1,614,119.54	9,514,018.00
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,081,942.18	113,602.37
债券利息收入		-	9,361,060.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		532,177.36	39,355.43
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-35,325,598.19	23,672,946.44
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-112,831,502.25	17,675,990.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	61,352,721.41	4,759,721.73
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	16,153,182.65	1,237,234.14
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	-40,234,061.55	-9,371,391.13
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	503,089.90	43,711.46
减：二、营业总支出		55,586,457.23	6,264,324.66
1. 管理人报酬		22,437,979.21	2,476,285.47
2. 托管费		6,410,851.21	707,510.09
3. 销售服务费		12,821,702.46	1,415,020.25
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		13,749,636.37	1,178,393.70
其中：卖出回购金融资产支出		13,749,636.37	1,178,393.70
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		46,090.17	12,628.69
8. 其他费用	6.4.7.17	120,197.81	474,486.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-129,028,907.53	17,594,960.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-129,028,907.53	17,594,960.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-129,028,907.53	17,594,960.11

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海富通稳固收益债券型证券投资基金

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净	3,166,302,227.04	-	702,662,376.54	3,868,964,603.58

值)				
二、本期期初净资产 (基金净值)	3,166,302,227.04	-	702,662,376.54	3,868,964,603.58
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	1,561,956,005.02	-	287,881,224.03	1,849,837,229.05
(一)、综合收益总额	-	-	-129,028,907.53	-129,028,907.53
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	1,561,956,005.02	-	416,910,131.56	1,978,866,136.58
其中: 1.基金申购款	5,179,551,528.88	-	1,094,353,265.18	6,273,904,794.06
2.基金赎回款	-3,617,595,523.86	-	-677,443,133.62	-4,295,038,657.48
(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)	4,728,258,232.06	-	990,543,600.57	5,718,801,832.63
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	489,358,722.67	-	114,645,432.35	604,004,155.02
二、本期期初净资产 (基金净值)	489,358,722.67	-	114,645,432.35	604,004,155.02
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	79,757,892.42	-	38,613,587.85	118,371,480.27
(一)、综合收益总额	-	-	17,594,960.11	17,594,960.11
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	79,757,892.42	-	21,018,627.74	100,776,520.16

号填列)				
其中：1.基金申购款	290,497,838.55	-	73,679,116.31	364,176,954.86
2.基金赎回款	-210,739,946.13	-	-52,660,488.57	-263,400,434.70
(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)	569,116,615.09	-	153,259,020.20	722,375,635.29

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

海富通稳固收益债券型证券投资基金(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”)证监基金字[2010]983 号文核准募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,695,857,578.55 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 314 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通稳固收益债券型证券投资基金基金合同》于 2010 年 11 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,696,872,897.89 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,015,319.34 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通稳固收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于国内依法发行上市的固定收益类品种，包括公司债券、企业债券、可转换债券、短期融资券、金融债、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购等，同时投资于股票、存托凭证、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金投资于债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，本基金可以参与一级市场新股及存托凭证申购以及在二级市场上投资股票、存托凭证、权证等权益类证券，投资于股票及存托凭证等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%，现金（不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后）。

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》、《海富通稳固收益债券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

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《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>》。

(a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定, 以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《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》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 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(3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

(i) 金融工具的分类影响

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、应收利息和应收申购款，金额分别为人民币 246,127,531.87 元、人民币 27,313,160.54 元、人民币 111,669.74 元、人民币 40,204,120.03 元和人民币 75,467,795.10 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-应收利息和应收申购款，金额分别为人民币 246,139,429.91 元、人民币 27,325,451.54 元、人民币 111,719.94 元、人民币 0.00 元和人民币 75,467,795.10 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，金额为人民币 3,841,739,619.58 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，金额为人民币 3,881,919,500.37 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、应付证券清算款、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，金额分别为人民币 183,000,000.00 元、人民币 173,307,947.07 元、人民币 1,953,523.98 元、人民币 1,656,039.66 元、人民币 473,154.17 元、人民币 946,308.39 元、人民币 492,647.80 元、人民币-148,241.92 元和人民币 180,000.00 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、

应付清算款、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，金额分别为人民币 182,851,758.08 元、人民币 173,307,947.07 元、人民币 1,953,523.98 元、人民币 1,656,039.66 元、人民币 473,154.17 元、人民币 946,308.39 元、人民币 492,647.80 元、人民币 0.00 元和人民币 180,000.00 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和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，本基金按照新金融工具准则，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、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订的《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>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	342,005,491.58
等于：本金	342,002,711.85
加：应计利息	2,779.73
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	342,005,491.58

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,027,035,072.94	-	1,025,726,967.92	-1,308,105.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,439,642,586.81	33,344,908.98	2,482,435,606.26	9,448,110.47
	银行间市场	3,321,734,047.96	39,292,010.44	3,366,448,010.44	5,421,952.04
	合计	5,761,376,634.77	72,636,919.42	5,848,883,616.70	14,870,062.51
	资产支持证券	-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		6,788,411,707.71	72,636,919.42	6,874,610,584.62	13,561,957.49

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	905,168.88
其中：交易所市场	884,763.26
银行间市场	20,405.62
应付利息	-
预提费用	211,739.85
合计	1,116,908.73

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 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	3,166,302,227.04	3,166,302,227.04
本期申购	5,179,551,528.88	5,179,551,528.88
本期赎回（以“-”号填列）	-3,617,595,523.86	-3,617,595,523.86
本期末	4,728,258,232.06	4,728,258,232.06

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	135,953,515.70	566,708,860.84	702,662,376.54
本期利润	-88,794,845.98	-40,234,061.55	-129,028,907.53
本期基金份额交易产生的变动数	86,334,214.64	330,575,916.92	416,910,131.56
其中：基金申购款	219,520,422.48	874,832,842.70	1,094,353,265.18
基金赎回款	-133,186,207.84	-544,256,925.78	-677,443,133.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	133,492,884.36	857,050,716.21	990,543,600.57

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	231,076.77

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	595,086.94
其他	255,778.47
合计	1,081,942.18

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	1,351,725,965.83
减：卖出股票成本总额	1,460,654,030.70
减：交易费用	3,903,437.38
买卖股票差价收入	-112,831,502.25

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 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	81,843,903.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-20,491,182.16
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	61,352,721.41

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 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	8,087,873,136.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,010,853,557.53
减：应计利息总额	97,414,508.11
减：交易费用	96,252.96
买卖债券差价收入	-20,491,182.16

6.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	16,153,182.65
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	16,153,182.65

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-40,234,061.55
——股票投资	-17,843,182.76
——债券投资	-22,390,878.79
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-40,234,061.55

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	502,943.84
基金转换费收入	146.06
合计	503,089.90

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	9,857.96
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	18,000.00
合计	120,197.81

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

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
海通证券	696,320,088.67	21.12%	113,519,483.14	44.45%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	495,298.50	21.83%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	80,745.62	43.77%	39,881.74	44.08%

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

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

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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	22,437,979.21	2,476,285.47
其中：支付销售机构的客户维护费	3,336,987.49	169,651.62

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.70% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,410,851.21	707,510.09

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	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
工商银行	140,097.53
海通证券	589.51
海富通基金	6,952,615.30
合计	7,093,302.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
工商银行	49,395.36
海通证券	423.41
海富通基金	1,171,930.42
合计	1,221,749.19

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给海富通基金管理有限公司，再由海富通基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.4\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	342,005,491.58	231,076.77	1,743,845.38	28,391.72

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2022 年 6 月 30 日，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

于 2022 年 6 月 30 日，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

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,470,000,000.00 元于 2022 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金是一只债券型证券投资基金，属于中低风险品种。本基金投资的金融工具主要为股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人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 37.22%（2021 年 12 月 31 日：42.47%）。

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	40,731,835.62	50,094,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	1,509,176,385.72	421,231,255.30
合计	1,549,908,221.34	471,325,255.30

注：未评级部分为短期融资券、国债、金融债、政策性金融债、政策银行债。

6.4.13.2.2 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	1,584,857,810.72	913,995,044.28
AAA 以下	158,454,351.21	368,811,091.67
未评级	2,555,663,233.43	1,528,038,780.30
合计	4,298,975,395.36	2,810,844,916.25

注：未评级部分为公司债、国债、政策性金融债、政策银行债、中期票据。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处

的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有流动性受限的资产。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，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 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	342,005,491.58	-	-	-	342,005,491.58
结算备付金	171,999,458.03	-	-	-	171,999,458.03
存出保证金	600,576.35	-	-	-	600,576.35
交易性金融资产	1,976,072,453.29	3,334,751,066.74	538,060,096.67	1,025,726,967.92	6,874,610,584.62
应收申购款	20,000,000.00	-	-	127,053,219.27	147,053,219.27
资产总计	2,510,677,979.25	3,334,751,066.74	538,060,096.67	1,152,780,187.19	7,536,269,329.85
负债					
卖出回购金融资产款	1,470,000,000.00	-	-	-	1,470,000,000.00

应付清算款	-	-	-	326,918,131.15	326,918,131.15
应付赎回款	-	-	-	13,313,952.58	13,313,952.58
应付管理人报酬	-	-	-	3,213,704.25	3,213,704.25
应付托管费	-	-	-	918,201.23	918,201.23
应付销售服务费	-	-	-	1,836,402.43	1,836,402.43
应交税费	-	-	-	150,196.85	150,196.85
其他负债	-	-	-	1,116,908.73	1,116,908.73
负债总计	1,470,000,000.00	-	-	347,467,497.22	1,817,467,497.22
利率敏感度缺口	1,040,677,979.25	3,334,751,066.74	538,060,096.67	805,312,689.97	5,718,801,832.63
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	246,127,531.87	-	-	-	246,127,531.87
结算备付金	27,313,160.54	-	-	-	27,313,160.54
存出保证金	111,669.74	-	-	-	111,669.74
交易性金融资产	624,687,077.10	2,227,447,149.27	430,035,945.18	559,569,448.03	3,841,739,619.58
其他资产	-	-	-	40,204,120.03	40,204,120.03
应收申购款	54,500,000.00	-	-	20,967,795.10	75,467,795.10
资产总计	952,739,439.25	2,227,447,149.27	430,035,945.18	620,741,363.16	4,230,963,896.86
负债					
卖出回购金融资产款	183,000,000.00	-	-	-	183,000,000.00
应付清算款	-	-	-	173,307,947.07	173,307,947.07
应付赎回款	-	-	-	1,953,523.98	1,953,523.98
应付管理人报酬	-	-	-	1,656,039.66	1,656,039.66
应付托管费	-	-	-	473,154.17	473,154.17
应付销售服务费	-	-	-	946,308.39	946,308.39
应交税费	-	-	-	137,914.13	137,914.13
其他负债	-	-	-	524,405.88	524,405.88
负债总计	183,000,000.00	-	-	178,999,293.28	361,999,293.28

					8
利率敏感度缺口	769,739,439.25	2,227,447,149.27	430,035,945.18	441,742,069.88	3,868,964,603.58

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	
		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2022年6月30日	2021年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-40,023,462.92	-28,604,621.04
	市场利率下降 25 个基点	40,651,496.94	29,071,942.55

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，本基金通过价值分析，采用自上而下确定投资策略，采取久期管理、类属配置和现金流管理策略等积极投资策略，发现、确认并利用细分市场失衡，实现组合增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，本基金可以参与一级市场新股申购以及在二级市场上投资股票、存托凭证、权证等权益类证券，投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,025,726,967.92	17.94	559,569,448.03	14.46
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	1,025,726,967.92	17.94	559,569,448.03	14.46

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准 (附注 6.4.1) 上升 5%	48,199,274.49	22,007,968.36
	2. 业绩比较基准 (附注 6.4.1) 下降 5%	-48,199,274.49	-22,007,968.36

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。

三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值： 相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,173,818,860.77	941,209,483.98
第二层次	5,700,791,723.85	2,900,530,135.60
第三层次	-	-
合计	6,874,610,584.62	3,841,739,619.58

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、卖出回购金融资产和其他金融负债，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	1,025,726,967.92	13.61
	其中：股票	1,025,726,967.92	13.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,848,883,616.70	77.61
	其中：债券	5,848,883,616.70	77.61
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	514,004,949.61	6.82
8	其他各项资产	147,653,795.62	1.96
9	合计	7,536,269,329.85	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	27,405,761.68	0.48
C	制造业	589,274,843.50	10.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,560,968.00	0.83
E	建筑业	36,858,536.00	0.64
F	批发和零售业	16,067,806.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	17,500,119.36	0.31
H	住宿和餐饮业	5,056,720.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,649,719.48	0.45
J	金融业	178,221,587.90	3.12
K	房地产业	38,328,082.00	0.67
L	租赁和商务服务业	19,295,649.00	0.34

M	科学研究和技术服务业	9,142,042.00	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	7,113,572.00	0.12
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	8,251,561.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	1,025,726,967.92	17.94

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	2,813,200	20,029,984.00	0.35
2	300059	东方财富	781,230	19,843,242.00	0.35
3	300122	智飞生物	169,472	18,813,086.72	0.33
4	600036	招商银行	435,400	18,373,880.00	0.32
5	601688	华泰证券	1,184,800	16,824,160.00	0.29
6	600487	亨通光电	1,135,000	16,502,900.00	0.29
7	601615	明阳智能	475,600	16,075,280.00	0.28
8	601888	中国中免	67,900	15,815,947.00	0.28
9	601668	中国建筑	2,831,300	15,062,516.00	0.26
10	000858	五粮液	73,700	14,882,241.00	0.26
11	000002	万科A	717,800	14,714,900.00	0.26
12	002460	赣锋锂业	97,400	14,483,380.00	0.25
13	600438	通威股份	237,993	14,246,260.98	0.25
14	600887	伊利股份	343,500	13,379,325.00	0.23
15	600383	金地集团	946,900	12,726,336.00	0.22
16	000932	华菱钢铁	2,470,300	12,573,827.00	0.22
17	601166	兴业银行	617,800	12,294,220.00	0.21
18	002080	中材科技	446,800	12,287,000.00	0.21
19	601009	南京银行	1,160,600	12,093,452.00	0.21
20	600519	贵州茅台	5,800	11,861,000.00	0.21
21	600582	天地科技	2,356,700	11,265,026.00	0.20
22	002039	黔源电力	766,640	11,246,608.80	0.20

23	002984	森麒麟	358,600	11,156,046.00	0.20
24	000776	广发证券	596,300	11,150,810.00	0.19
25	002142	宁波银行	310,190	11,107,903.90	0.19
26	603866	桃李面包	665,800	11,018,990.00	0.19
27	300601	康泰生物	226,340	10,226,041.20	0.18
28	600089	特变电工	355,800	9,745,362.00	0.17
29	000333	美的集团	158,439	9,568,131.21	0.17
30	600030	中信证券	437,700	9,480,582.00	0.17
31	002555	三七互娱	425,600	9,035,488.00	0.16
32	000513	丽珠集团	244,100	8,838,861.00	0.15
33	600863	内蒙华电	2,397,500	8,750,875.00	0.15
34	000012	南 玻 A	1,173,400	8,706,628.00	0.15
35	002043	兔 宝 宝	703,500	8,160,600.00	0.14
36	600926	杭州银行	542,500	8,126,650.00	0.14
37	000975	银泰黄金	803,100	7,822,194.00	0.14
38	002216	三全食品	387,051	7,582,329.09	0.13
39	002643	万润股份	357,000	7,447,020.00	0.13
40	601012	隆基绿能	110,320	7,350,621.60	0.13
41	002595	豪迈科技	321,200	7,175,608.00	0.13
42	600985	淮北矿业	490,977	7,148,625.12	0.13
43	000902	新洋丰	410,200	6,928,278.00	0.12
44	601225	陕西煤业	319,500	6,767,010.00	0.12
45	600901	江苏租赁	1,315,800	6,750,054.00	0.12
46	002815	崇达技术	525,875	6,736,458.75	0.12
47	600153	建发股份	513,500	6,711,445.00	0.12
48	600548	深高速	700,134	6,679,278.36	0.12
49	601211	国泰君安	437,600	6,651,520.00	0.12
50	000789	万年青	603,200	6,538,688.00	0.11
51	601669	中国电建	820,900	6,460,483.00	0.11
52	603018	华设集团	672,700	6,424,285.00	0.11
53	300146	汤臣倍健	294,400	6,373,760.00	0.11
54	600522	中天科技	275,700	6,368,670.00	0.11
55	000090	天健集团	920,900	6,345,001.00	0.11
56	300033	同花顺	64,900	6,240,135.00	0.11
57	601567	三星医疗	465,200	6,177,856.00	0.11
58	600886	国投电力	584,600	6,138,300.00	0.11
59	300014	亿纬锂能	62,600	6,103,500.00	0.11
60	601985	中国核电	868,000	5,954,480.00	0.10
61	603707	健友股份	208,130	5,869,266.00	0.10
62	600373	中文传媒	584,000	5,834,160.00	0.10
63	600048	保利发展	326,700	5,704,182.00	0.10
64	600219	南山铝业	1,541,000	5,686,290.00	0.10
65	300358	楚天科技	316,400	5,628,756.00	0.10
66	600570	恒生电子	128,362	5,588,881.48	0.10

67	300737	科顺股份	408,800	5,387,984.00	0.09
68	601231	环旭电子	371,200	5,330,432.00	0.09
69	600496	精工钢构	1,131,800	5,228,916.00	0.09
70	601222	林洋能源	625,100	5,219,585.00	0.09
71	600328	中盐化工	218,800	5,152,740.00	0.09
72	688166	博瑞医药	212,651	5,135,521.65	0.09
73	300502	新易盛	193,800	5,077,560.00	0.09
74	600258	首旅酒店	203,900	5,056,720.00	0.09
75	000930	中粮科技	558,400	5,047,936.00	0.09
76	600729	重庆百货	232,300	5,010,711.00	0.09
77	300476	胜宏科技	267,500	4,911,300.00	0.09
78	000977	浪潮信息	183,900	4,869,672.00	0.09
79	601186	中国铁建	615,800	4,864,820.00	0.09
80	002966	苏州银行	787,380	4,803,018.00	0.08
81	000792	盐湖股份	157,200	4,709,712.00	0.08
82	600350	山东高速	892,300	4,684,575.00	0.08
83	600131	国网信通	343,400	4,618,730.00	0.08
84	603730	岱美股份	352,040	4,615,244.40	0.08
85	600803	新奥股份	246,200	4,576,858.00	0.08
86	000001	平安银行	301,500	4,516,470.00	0.08
87	601899	紫金矿业	483,742	4,513,312.86	0.08
88	600285	羚锐制药	352,700	4,419,331.00	0.08
89	600380	健康元	357,300	4,412,655.00	0.08
90	002034	旺能环境	214,300	4,399,579.00	0.08
91	688550	瑞联新材	63,446	4,351,761.14	0.08
92	000501	武商集团	391,500	4,345,650.00	0.08
93	002414	高德红外	334,040	4,299,094.80	0.08
94	002532	天山铝业	658,200	4,298,046.00	0.08
95	300398	飞凯材料	187,100	4,277,106.00	0.07
96	600461	洪城环境	526,600	4,260,194.00	0.07
97	603228	景旺电子	180,800	4,218,064.00	0.07
98	000959	首钢股份	877,800	4,178,328.00	0.07
99	002048	宁波华翔	257,200	4,120,344.00	0.07
100	603035	常熟汽饰	243,800	4,027,576.00	0.07
101	600426	华鲁恒升	137,700	4,020,840.00	0.07
102	600325	华发股份	530,600	4,016,642.00	0.07
103	605090	九丰能源	196,560	3,984,271.20	0.07
104	002352	顺丰控股	70,600	3,940,186.00	0.07
105	002353	杰瑞股份	96,800	3,901,040.00	0.07
106	002533	金杯电工	541,800	3,841,362.00	0.07
107	300504	天邑股份	216,000	3,836,160.00	0.07
108	002539	云图控股	238,300	3,810,417.00	0.07
109	600528	中铁工业	469,700	3,781,085.00	0.07
110	002801	微光股份	125,500	3,746,175.00	0.07

111	002013	中航机电	302,400	3,734,640.00	0.07
112	600908	无锡银行	661,200	3,722,556.00	0.07
113	601677	明泰铝业	152,500	3,629,500.00	0.06
114	002236	大华股份	217,800	3,576,276.00	0.06
115	603809	豪能股份	267,660	3,519,729.00	0.06
116	002384	东山精密	152,600	3,499,118.00	0.06
117	603300	华铁应急	436,600	3,479,702.00	0.06
118	601456	国联证券	269,700	3,309,219.00	0.06
119	300568	星源材质	112,400	3,264,096.00	0.06
120	600566	济川药业	120,000	3,259,200.00	0.06
121	000708	中信特钢	157,600	3,175,640.00	0.06
122	300481	濮阳惠成	131,600	3,092,600.00	0.05
123	601137	博威合金	173,000	3,062,100.00	0.05
124	002001	新 和 成	134,220	3,061,558.20	0.05
125	002959	小熊电器	48,000	2,991,840.00	0.05
126	600820	隧道股份	478,700	2,929,644.00	0.05
127	300803	指南针	49,400	2,903,732.00	0.05
128	002641	公元股份	591,100	2,849,102.00	0.05
129	688087	英科再生	47,877	2,770,641.99	0.05
130	300685	艾德生物	85,200	2,726,400.00	0.05
131	603060	国检集团	225,540	2,717,757.00	0.05
132	600309	万华化学	27,800	2,696,322.00	0.05
133	002508	老板电器	74,800	2,695,044.00	0.05
134	600483	福能股份	188,300	2,649,381.00	0.05
135	603579	荣泰健康	104,300	2,570,995.00	0.04
136	300790	宇瞳光学	131,200	2,508,544.00	0.04
137	600141	兴发集团	57,000	2,507,430.00	0.04
138	601058	赛轮轮胎	220,300	2,482,781.00	0.04
139	300308	中际旭创	79,100	2,456,055.00	0.04
140	300482	万孚生物	59,200	2,410,032.00	0.04
141	603931	格林达	119,200	2,395,920.00	0.04
142	002562	兄弟科技	365,000	2,365,200.00	0.04
143	300451	创业慧康	327,200	2,355,840.00	0.04
144	002008	大族激光	70,500	2,335,665.00	0.04
145	000726	鲁 泰 A	315,600	2,256,540.00	0.04
146	600195	中牧股份	183,400	2,248,484.00	0.04
147	603180	金牌厨柜	72,040	2,230,358.40	0.04
148	301071	力量钻石	14,300	2,218,359.00	0.04
149	601598	中国外运	566,000	2,196,080.00	0.04
150	603236	DR 移远通	15,860	2,119,847.60	0.04
151	300088	长信科技	273,300	2,027,886.00	0.04
152	300217	东方电热	328,400	2,009,808.00	0.04
153	600456	宝钛股份	32,700	1,942,380.00	0.03
154	603886	元祖股份	106,000	1,867,720.00	0.03

155	300373	扬杰科技	22,000	1,567,500.00	0.03
156	300692	中环环保	210,500	1,530,335.00	0.03
157	002483	润邦股份	234,700	1,516,162.00	0.03
158	688187	时代电气	23,258	1,511,537.42	0.03
159	688300	联瑞新材	19,219	1,492,355.35	0.03
160	002929	润建股份	41,500	1,489,850.00	0.03
161	000683	远兴能源	140,400	1,475,604.00	0.03
162	688211	中科微至	36,121	1,471,208.33	0.03
163	300354	东华测试	44,800	1,440,320.00	0.03
164	300993	玉马遮阳	106,680	1,363,370.40	0.02
165	002063	远光软件	191,400	1,345,542.00	0.02
166	002698	博实股份	110,000	1,301,300.00	0.02
167	688357	建龙微纳	11,546	1,298,232.24	0.02
168	300648	星云股份	31,300	1,270,780.00	0.02
169	000519	中兵红箭	43,000	1,253,450.00	0.02
170	300144	宋城演艺	80,800	1,240,280.00	0.02
171	600702	舍得酒业	6,000	1,223,940.00	0.02
172	603856	东宏股份	91,100	1,218,918.00	0.02
173	300036	超图软件	62,200	1,215,388.00	0.02
174	002985	北摩高科	20,700	1,212,606.00	0.02
175	300268	佳沃食品	40,400	1,201,900.00	0.02
176	603077	和邦生物	281,800	1,200,468.00	0.02
177	601390	中国中铁	194,800	1,196,072.00	0.02
178	603379	三美股份	53,700	1,194,825.00	0.02
179	603324	盛剑环境	29,200	1,193,696.00	0.02
180	603600	永艺股份	129,900	1,189,884.00	0.02
181	603136	天目湖	41,300	1,183,658.00	0.02
182	300251	光线传媒	124,300	1,177,121.00	0.02
183	300980	祥源新材	49,000	1,176,000.00	0.02
184	600639	浦东金桥	85,800	1,166,022.00	0.02
185	002705	新宝股份	52,700	1,158,873.00	0.02
186	000983	山西焦煤	86,230	1,154,619.70	0.02
187	300843	胜蓝股份	49,600	1,132,864.00	0.02
188	002790	瑞尔特	144,600	1,132,218.00	0.02
189	688002	睿创微纳	28,476	1,131,066.72	0.02
190	300233	金城医药	36,900	1,052,757.00	0.02
191	603997	继峰股份	95,700	1,041,216.00	0.02
192	688558	国盛智科	28,998	997,241.22	0.02
193	002009	天奇股份	51,900	960,150.00	0.02
194	688656	浩欧博	23,458	917,911.54	0.02
195	300680	隆盛科技	34,100	883,872.00	0.02
196	601717	郑煤机	28,300	407,803.00	0.01
197	002126	银轮股份	8,999	103,038.55	0.00
198	002925	盈趣科技	1,900	40,888.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	23,946,618.00	0.62
2	601318	中国平安	18,577,450.00	0.48
3	601211	国泰君安	17,985,615.66	0.46
4	601328	交通银行	16,357,047.00	0.42
5	600919	江苏银行	16,135,535.00	0.42
6	601668	中国建筑	15,666,132.00	0.40
7	300122	智飞生物	14,987,413.32	0.39
8	601688	华泰证券	14,877,675.00	0.38
9	000789	万年青	14,172,534.90	0.37
10	000932	华菱钢铁	14,167,973.35	0.37
11	600089	特变电工	13,472,157.84	0.35
12	600887	伊利股份	12,864,056.00	0.33
13	000858	五粮液	12,534,925.00	0.32
14	600325	华发股份	12,329,379.00	0.32
15	600502	安徽建工	12,299,807.00	0.32
16	601888	中国中免	12,197,734.98	0.32
17	601009	南京银行	12,034,125.55	0.31
18	002080	中材科技	11,969,301.46	0.31
19	600487	亨通光电	11,966,968.83	0.31
20	300014	亿纬锂能	11,819,773.00	0.31

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	601328	交通银行	16,927,571.00	0.44
2	601318	中国平安	16,141,590.00	0.42
3	600502	安徽建工	15,658,320.00	0.40
4	601225	陕西煤业	15,156,864.00	0.39
5	600089	特变电工	11,180,575.00	0.29
6	603816	顾家家居	11,120,735.00	0.29
7	601717	郑煤机	10,500,429.00	0.27
8	600036	招商银行	10,334,182.00	0.27

9	300738	奥飞数据	10,003,952.24	0.26
10	600248	陕西建工	9,969,789.00	0.26
11	688201	信安世纪	9,721,202.45	0.25
12	600325	华发股份	9,615,871.63	0.25
13	600123	兰花科创	9,537,416.00	0.25
14	601211	国泰君安	9,228,368.00	0.24
15	002056	横店东磁	9,094,879.02	0.24
16	300569	天能重工	9,060,421.92	0.23
17	600196	复星医药	8,928,528.00	0.23
18	000739	普洛药业	8,772,164.00	0.23
19	600426	华鲁恒升	8,710,741.00	0.23
20	600884	杉杉股份	8,571,129.87	0.22

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,944,654,733.35
卖出股票的收入（成交）总额	1,351,725,965.83

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	1,533,527,294.75	26.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,918,162,002.73	51.03
	其中：政策性金融债	2,186,979,673.42	38.24
4	企业债券	810,412,147.98	14.17
5	企业短期融资券	263,254,006.04	4.60
6	中期票据	175,436,272.35	3.07
7	可转债（可交换债）	148,091,892.85	2.59
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	5,848,883,616.70	102.27

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	220203	22 国开 03	12,000,000	1,203,984,657.53	21.05
2	019664	21 国债 16	10,144,240	1,031,123,642.45	18.03
3	019641	20 国债 11	2,800,000	286,801,161.64	5.02
4	210215	21 国开 15	2,000,000	204,914,904.11	3.58
5	220205	22 国开 05	1,500,000	150,549,246.58	2.63

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的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。

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	600,576.35
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	147,053,219.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	147,653,795.62

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	123107	温氏转债	3,477,951.93	0.06
2	123091	长海转债	3,465,582.88	0.06
3	128046	利尔转债	3,416,024.33	0.06
4	127031	洋丰转债	3,241,964.08	0.06
5	127033	中装转 2	3,239,807.76	0.06
6	127040	国泰转债	3,235,254.04	0.06
7	127017	万青转债	3,233,573.58	0.06
8	128132	交建转债	3,115,750.44	0.05
9	123078	飞凯转债	1,723,290.49	0.03
10	113618	美诺转债	1,698,854.28	0.03
11	110038	济川转债	1,688,089.04	0.03
12	110080	东湖转债	1,660,899.30	0.03
13	113620	傲农转债	1,564,221.07	0.03
14	123086	海兰转债	1,270,026.97	0.02
15	127036	三花转债	1,266,407.33	0.02
16	127043	川恒转债	1,261,435.93	0.02

17	128095	恩捷转债	1,238,456.79	0.02
18	128023	亚太转债	1,219,527.69	0.02
19	110074	精达转债	1,215,956.38	0.02
20	127022	恒逸转债	1,214,943.99	0.02
21	128017	金禾转债	1,214,243.66	0.02
22	128122	兴森转债	1,186,159.94	0.02
23	123106	正丹转债	1,174,677.68	0.02
24	128021	兄弟转债	1,164,049.01	0.02
25	127046	百润转债	1,162,780.48	0.02
26	128081	海亮转债	1,151,987.74	0.02
27	128034	江银转债	1,149,949.68	0.02
28	128131	崇达转 2	1,145,269.71	0.02
29	110070	凌钢转债	1,143,814.19	0.02
30	128141	旺能转债	1,142,138.84	0.02
31	113623	凤 21 转债	1,139,190.00	0.02
32	127038	国微转债	1,131,545.66	0.02
33	127006	敖东转债	1,123,877.19	0.02
34	127044	蒙娜转债	1,123,650.14	0.02
35	128142	新乳转债	1,122,855.12	0.02
36	128048	张行转债	1,122,087.93	0.02
37	123113	仙乐转债	1,121,878.24	0.02
38	123101	拓斯转债	1,118,097.68	0.02
39	127041	弘亚转债	1,117,542.07	0.02
40	110053	苏银转债	1,117,437.98	0.02
41	127005	长证转债	1,114,556.15	0.02
42	128035	大族转债	1,114,533.89	0.02
43	127024	盈峰转债	1,114,352.85	0.02
44	128135	洽洽转债	1,113,635.04	0.02
45	127029	中钢转债	1,113,455.56	0.02
46	123121	帝尔转债	1,109,221.86	0.02
47	127045	牧原转债	1,108,108.59	0.02
48	123025	精测转债	1,108,098.51	0.02
49	123119	康泰转 2	1,107,393.57	0.02
50	113605	大参转债	1,107,031.69	0.02
51	123104	卫宁转债	1,106,738.79	0.02
52	123108	乐普转 2	1,100,805.95	0.02
53	127016	鲁泰转债	1,100,166.57	0.02
54	127012	招路转债	1,100,006.93	0.02
55	127015	希望转债	1,094,445.04	0.02
56	128136	立讯转债	1,094,190.14	0.02
57	128026	众兴转债	1,092,686.95	0.02
58	128125	华阳转债	1,092,131.31	0.02
59	127049	希望转 2	1,090,848.55	0.02
60	127047	帝欧转债	1,090,712.27	0.02

61	110045	海澜转债	1,090,545.35	0.02
62	127018	本钢转债	1,089,816.37	0.02
63	113627	太平转债	1,088,215.87	0.02
64	113584	家悦转债	1,085,772.24	0.02
65	127025	冀东转债	1,084,847.31	0.02
66	110047	山鹰转债	1,083,592.49	0.02
67	127032	苏行转债	1,083,404.51	0.02
68	127020	中金转债	1,082,668.43	0.02
69	128119	龙大转债	1,075,937.01	0.02
70	123096	思创转债	1,074,998.52	0.02
71	113588	润达转债	1,067,236.51	0.02
72	128063	未来转债	1,062,985.99	0.02
73	128105	长集转债	1,044,802.16	0.02
74	127052	西子转债	1,012,633.10	0.02
75	123114	三角转债	967,845.10	0.02
76	128029	太阳转债	796,729.93	0.01
77	123085	万顺转 2	662,571.87	0.01
78	113582	火炬转债	652,843.22	0.01
79	123070	鹏辉转债	632,890.36	0.01
80	113534	鼎胜转债	624,763.18	0.01
81	113504	艾华转债	610,426.11	0.01
82	113626	伯特转债	604,054.56	0.01
83	123056	雪榕转债	601,419.57	0.01
84	123035	利德转债	596,667.34	0.01
85	110081	闻泰转债	590,051.75	0.01
86	123012	万顺转债	588,080.95	0.01
87	113025	明泰转债	585,999.20	0.01
88	113625	江山转债	585,928.38	0.01
89	123044	红相转债	580,021.77	0.01
90	113545	金能转债	577,152.70	0.01
91	113045	环旭转债	575,965.29	0.01
92	110079	杭银转债	575,046.27	0.01
93	110048	福能转债	574,220.72	0.01
94	113599	嘉友转债	573,027.44	0.01
95	123060	苏试转债	572,547.95	0.01
96	110076	华海转债	571,848.83	0.01
97	123048	应急转债	567,998.16	0.01
98	113024	核建转债	567,691.62	0.01
99	113516	苏农转债	567,647.77	0.01
100	113043	财通转债	567,439.22	0.01
101	113052	兴业转债	567,291.39	0.01
102	110083	苏租转债	565,311.43	0.01
103	113578	全筑转债	565,307.45	0.01
104	113602	景 20 转债	563,948.48	0.01

105	113013	国君转债	563,437.79	0.01
106	123064	万孚转债	562,497.45	0.01
107	110073	国投转债	561,749.14	0.01
108	110060	天路转债	560,937.21	0.01
109	113632	鹤 21 转债	560,614.91	0.01
110	113631	皖天转债	560,035.77	0.01
111	110043	无锡转债	558,908.07	0.01
112	110077	洪城转债	558,881.11	0.01
113	113037	紫银转债	558,880.15	0.01
114	113044	大秦转债	558,377.38	0.01
115	113042	上银转债	557,949.78	0.01
116	113011	光大转债	557,193.61	0.01
117	110063	鹰 19 转债	556,523.44	0.01
118	110064	建工转债	556,144.93	0.01
119	113585	寿仙转债	554,981.83	0.01
120	113525	台华转债	553,954.37	0.01
121	110061	川投转债	553,603.46	0.01
122	113051	节能转债	553,494.78	0.01
123	113050	南银转债	553,304.96	0.01
124	123067	斯莱转债	552,624.21	0.01
125	123063	大禹转债	546,262.62	0.01
126	123083	朗新转债	546,262.47	0.01
127	113615	金诚转债	543,013.97	0.01
128	113537	文灿转债	540,753.60	0.01
129	113630	赛伍转债	529,935.41	0.01
130	110059	浦发转债	373,115.66	0.01
131	123050	聚飞转债	251,233.84	0.00
132	113633	科沃转债	14,246.41	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
38,764	121,975.50	4,369,196,246.48	92.41%	359,061,985.58	7.59%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	34,682.66	0.0007%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年11月23日）基金份额总额	2,696,872,897.89
本报告期期初基金份额总额	3,166,302,227.04
本报告期基金总申购份额	5,179,551,528.88
减：本报告期基金总赎回份额	3,617,595,523.86
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	4,728,258,232.06

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	
长江证券	2	1,126,590,660.82	34.18%	819,916.26	36.13%	-
海通证券	1	696,320,088.67	21.12%	495,298.50	21.83%	-
中泰证券	2	452,552,341.39	13.73%	330,955.23	14.58%	-
民生证券	1	410,524,397.81	12.45%	300,217.84	13.23%	-
申万宏源	2	392,538,909.84	11.91%	163,583.47	7.21%	-
德邦证券	2	207,885,332.14	6.31%	152,025.55	6.70%	-
东方证券	1	9,968,968.51	0.30%	7,290.64	0.32%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期新增广发证券 1 个交易单元，兴业证券 2 个交易单元，德邦证券 2 个交易单元，太平洋证券 2 个交易单元，浙商证券 2 个交易单元。

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
长江证券	1,737,122,211.88	31.22%	70,998,500,000.00	61.68%	-	-
海通证券	247,676,601.62	4.45%	-	-	-	-
中泰证券	1,123,498,761.50	20.19%	8,110,000,000.00	7.05%	-	-
民生证券	2,074,169,658.70	37.28%	11,978,000,000.00	10.41%	-	-
申万宏源	235,301,563.81	4.23%	12,128,000,000.00	10.54%	-	-
德邦证券	145,939,587.80	2.62%	10,414,000,000.00	9.05%	-	-
东方证券	-	-	1,470,000,000.00	1.28%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-04
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万联证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-06
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中邮证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-01
4	海富通基金管理有限公司关于调整海富通稳固收益债券型证券投资基金单笔申购、单笔赎回和持有份额最低数量限制的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-12
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增英大证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-05
6	海富通基金管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司销售合作关系的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-30
7	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	2022/3/8-2022/4/25	602,205,592.30	988,630,687.41	1,112,957,861.55	477,878,418.16	10.11%

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的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

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稳固收益债券型证券投资基金的文件
- (二)海富通稳固收益债券型证券投资基金基金合同
- (三)海富通稳固收益债券型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通稳固收益债券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