

**海富通稳固收益债券型证券投资基金**  
**2022 年第 3 季度报告**  
**2022 年 9 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：二〇二二年十月二十六日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	3,761,466,382.77 份
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。

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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	12,714,595.46
2.本期利润	-92,520,961.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0219
4.期末基金资产净值	4,462,318,444.01
5.期末基金份额净值	1.1863

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.92%	0.23%	0.69%	0.01%	-2.61%	0.22%
过去六个月	-0.37%	0.25%	1.37%	0.01%	-1.74%	0.24%
过去一年	-0.11%	0.24%	2.75%	0.01%	-2.86%	0.23%
过去三年	16.03%	0.28%	8.49%	0.01%	7.54%	0.27%
过去五年	28.88%	0.25%	14.54%	0.01%	14.34%	0.24%
自基金合同生效起至今	92.46%	0.50%	48.46%	0.01%	44.00%	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

## 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 9 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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。
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	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

				<p>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。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</p>
--	--	--	--	--

					<p>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 月至 2022 年 08 月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。2022 年 7 月起兼任海富通中证短融 ETF 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 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，A 股市场与全球范围内其他主要股市都经历了一轮显著的调整。以万得全 A 指数来看，当季度跌幅 12.61%。分市场看，沪深 300 指数下跌 15.16%、中证 500 指数下跌 11.47%、科创创业 50 指数下跌 16.01%、创业板综下跌 15.79%、中小综指下跌 12.93%。分行业看，申万一级行业除煤炭以外均告下跌。

三季度影响 A 股市场的主要因素来自于国内和国外两个方向。海外因素方面，最主要的拖累项来自于美联储持续大幅的加息以及地缘冲突的久拖不决。美联储本轮加息操作经历了一个由慢到快的过程且持续性显著超市场预期，尤其是美联储高官对于未来加息的指引令市场倍感压力。本轮美联储的连续加息带来了广泛的“传染”效应，一是美债收益率连续大幅上行，二是美元指数大幅超预期上行。由此，带来全球几乎所有金融资产重新定价。而地缘冲突一方面加剧了投资者对于基础能源和原材料通胀的担忧，另一方面导致欧元疲软，间接助推美元指数的强势表现。

国内因素方面，大致包括了盈利增速下滑和估值中枢下行两方面。7-8 月份市场经历了中报季的业绩大考。A 股市场的中报全市场业绩增速，营业收入同比增速为 8.40%，归母净利润同比增速为 3.30%。不论是营业收入的增速还是归母净利润的增速同比均大幅放缓。在 A 股市场估值和定价的诸因子中，业绩增速不但权重大，而且敏感度很高。这是拖累市场表现的内生性原因，也比较能说明为何国内同期利率水平一再下行，而 A 股的估值不升反降。从交易层面来看，这轮反弹结束的时点也大致同步于中报业绩披露的结束期。

报告期间，本基金权益仓位保持稳定，行业分布较为均衡，具体个股根据盈利与估值的匹配度有所调整。



固定收益方面，三季度国内经济呈现弱修复格局。投资方面，制造业投资仍有支撑，在高技术行业方面表现出色；基建投资在专项债资金与政策性金融工具的支持下维持高位；地产投资遭遇“烂尾断供”的危机模式，投资增速仍在进一步恶化。消费在面临外部冲击下修复路径并不通畅。出口增速拐点初现，但结构上仍有亮点。通胀方面，猪肉价格明显回升，油价高位震荡，在服务业价格压制下 CPI 小幅回升；PPI 受到基数的影响同比回落。货币政策方面，三季度流动性维持宽松，央行调降 MLF 与 OMO 利率 10bp，带动 1 年期与 5 年期 LPR 利率分别调降 5bp 与 15bp。财政政策方面，地方政府专项债发行额度新增 5000 亿，政策性金融工具配套基建贷款加速落地。对应债市而言，流动性宽松与基本面偏弱支撑债市收益率向下，但随后稳增长发力与汇率的贬值压力导致收益率再度上行。全季来看，10 年期国债收益率累计下行 6bp。

信用债方面，受地产贷款风波等影响，利率大幅下行，资金成本持续低位，信用债配置力量增强，信用债收益率和利差明显压缩。地产行业仍在艰难磨底，地产债依然面临一级发行不畅、二级市场价格连锁下跌的困局，尾部风险担忧仍存。城投方面，部分城市发生信用相关负面舆情，再度引发市场对弱区域城投债的关注，政府强烈的支持意愿短期内或可提振市场对核心平台公开债券的信心，但考虑到地方政府协调资源能力有限，中长期对于弱区域的谨慎态度预计仍将维持。

可转债方面，三季度中证转债指数先跟随权益市场上涨，而后一路下探，总体下跌 3.82%。主要受国内疫情反复，经济衰退预期增强，叠加海外局势动荡和美联储加息的影响，权益市场风险偏好持续降低。

本管理人在三季度根据组合规模情况通过中高等级信用债配置底仓，同时积极调整利率债久期，参与波段机会。本管理人三季度根据市场情况，继续保持偏低可转债资产仓位，以在控制波动的前提下获取权益上涨收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-1.92%，同期业绩比较基准收益率为 0.69%，基金净值跑输业绩比较基准 2.61 个百分点。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
----	----	-------	--------------

1	权益投资	819,595,874.25	13.64
	其中：股票	819,595,874.25	13.64
2	固定收益投资	4,998,951,899.23	83.17
	其中：债券	4,998,951,899.23	83.17
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	141,951,724.43	2.36
7	其他资产	49,852,425.78	0.83
8	合计	6,010,351,923.69	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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	7,276,394.00	0.16
B	采矿业	20,704,396.45	0.46
C	制造业	466,170,376.27	10.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,805,444.60	0.65
E	建筑业	35,267,679.00	0.79
F	批发和零售业	26,540,124.00	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	27,861,310.64	0.62
H	住宿和餐饮业	4,175,328.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,744,708.19	0.55
J	金融业	125,352,959.10	2.81
K	房地产业	24,502,386.00	0.55

L	租赁和商务服务业	14,712,416.00	0.33
M	科学研究和技术服务业	4,132,240.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	3,840,256.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,009,600.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	3,500,256.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	819,595,874.25	18.37

### 5.2.2 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。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600919	江苏银行	2,278,700	16,953,528.00	0.38
2	600036	招商银行	462,500	15,563,125.00	0.35
3	600487	亨通光电	823,600	14,989,520.00	0.34
4	600519	贵州茅台	7,800	14,605,500.00	0.33
5	601668	中国建筑	2,730,900	14,064,135.00	0.32
6	300059	东方财富	788,030	13,885,088.60	0.31
7	600153	建发股份	973,600	13,484,360.00	0.30
8	601688	华泰证券	963,400	11,676,408.00	0.26
9	601888	中国中免	57,700	11,439,025.00	0.26
10	002142	宁波银行	355,690	11,222,019.50	0.25

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,135,496,069.57	25.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,614,203,337.70	58.58
	其中：政策性金融债	2,113,195,168.36	47.36
4	企业债券	847,727,992.88	19.00

5	企业短期融资券	151,377,216.98	3.39
6	中期票据	177,158,529.86	3.97
7	可转债（可交换债）	72,988,752.24	1.64
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,998,951,899.23	112.03

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019664	21 国债 16	10,004,240	1,021,490,736.71	22.89
2	220203	22 国开 03	8,300,000	843,778,000.00	18.91
3	220208	22 国开 08	4,300,000	434,637,873.97	9.74
4	210203	21 国开 03	1,200,000	125,480,054.79	2.81
5	210218	21 国开 18	1,000,000	103,383,342.47	2.32

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金暂未参与股指期货交易。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的22华泰G1（185364）的发行人，因存在部分场外期权合约个股挂钩标的超出当期融资融券范围、未对部分期限小于30天的场外期权合约出具书面合规意见书、场外期权业务相关内部制度不健全且内部流程执行不规范、未按要求进行衍生品准入管理等问题，于2022年6月2日被中国证券监督管理委员会责令改正。

对该证券的投资决策程序的说明：证券业整体信用水平高，且该券商为全国大型券商，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。

报告期内本基金投资的22华安G1（185768）的发行人，因不同私募资产管理计划账户间存在违规交易、债券投资风险管控不完善、未针对私募资产管理业务的主要业务人员和相关管理人员建立收入递延支付机制等违规行为，被中国证券监督管理委员会安徽监管局责令改正。

对上述证券的投资决策程序的说明：证券业整体信用水平高，且该券商为地方中型券商，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。

其余八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。

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

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	326,423.52
2	应收证券清算款	29,365,741.50
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	20,160,260.76
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	49,852,425.78

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128141	旺能转债	1,785,888.22	0.04
2	113621	彤程转债	1,680,200.95	0.04
3	123078	飞凯转债	1,552,052.13	0.03
4	111001	山玻转债	1,424,076.02	0.03
5	110075	南航转债	1,096,718.51	0.02
6	123085	万顺转 2	1,086,453.29	0.02
7	123133	佩蒂转债	1,082,978.74	0.02
8	113602	景 20 转债	1,081,320.64	0.02
9	110056	亨通转债	1,065,171.62	0.02
10	110038	济川转债	1,062,799.13	0.02
11	113525	台华转债	1,055,743.73	0.02
12	123035	利德转债	1,053,684.00	0.02
13	123132	回盛转债	1,044,711.17	0.02
14	123091	长海转债	1,044,486.45	0.02
15	113545	金能转债	1,033,442.81	0.02
16	128144	利民转债	1,032,831.00	0.02
17	128132	交建转债	1,025,754.63	0.02
18	127029	中钢转债	1,015,451.82	0.02
19	128046	利尔转债	990,733.42	0.02
20	110059	浦发转债	615,193.05	0.01
21	113042	上银转债	614,284.43	0.01
22	110053	苏银转债	609,456.51	0.01
23	110079	杭银转债	604,337.87	0.01
24	113055	成银转债	603,536.81	0.01

25	110083	苏租转债	602,251.44	0.01
26	127049	希望转 2	582,942.54	0.01
27	127043	川恒转债	579,945.69	0.01
28	127036	三花转债	558,947.50	0.01
29	110074	精达转债	549,217.10	0.01
30	127054	双箭转债	519,642.42	0.01
31	113025	明泰转债	516,567.79	0.01
32	127025	冀东转债	482,866.97	0.01
33	113579	健友转债	441,112.12	0.01
34	128063	未来转债	389,109.91	0.01
35	123060	苏试转债	386,074.47	0.01
36	113534	鼎胜转债	384,872.08	0.01
37	128097	奥佳转债	370,749.23	0.01
38	123067	斯莱转债	369,751.19	0.01
39	113626	伯特转债	367,259.69	0.01
40	128119	龙大转债	365,516.52	0.01
41	127058	科伦转债	364,746.73	0.01
42	123108	乐普转 2	364,509.70	0.01
43	127046	百润转债	362,590.57	0.01
44	123104	卫宁转债	362,467.17	0.01
45	113011	光大转债	361,897.91	0.01
46	113625	江山转债	361,466.50	0.01
47	113037	紫银转债	361,171.86	0.01
48	113634	珀莱转债	360,555.75	0.01
49	113516	苏农转债	360,302.00	0.01
50	110047	山鹰转债	360,201.58	0.01
51	123044	红相转债	359,858.71	0.01
52	127006	敖东转债	359,831.42	0.01
53	113627	太平转债	359,741.36	0.01
54	113056	重银转债	359,679.33	0.01
55	128035	大族转债	359,451.43	0.01

56	128026	众兴转债	359,347.69	0.01
57	123121	帝尔转债	359,170.86	0.01
58	110045	海澜转债	359,161.30	0.01
59	113584	家悦转债	359,131.29	0.01
60	113619	世运转债	358,803.26	0.01
61	128142	新乳转债	358,164.69	0.01
62	110073	国投转债	357,751.54	0.01
63	127018	本钢转债	357,246.41	0.01
64	113044	大秦转债	357,223.27	0.01
65	110063	鹰 19 转债	356,902.00	0.01
66	113623	凤 21 转债	356,859.35	0.01
67	113054	绿动转债	356,828.02	0.01
68	110077	洪城转债	356,415.81	0.01
69	127012	招路转债	356,214.46	0.01
70	127032	苏行转债	355,948.06	0.01
71	127017	万青转债	355,946.83	0.01
72	127016	鲁泰转债	355,754.37	0.01
73	123113	仙乐转债	355,730.05	0.01
74	113638	台 21 转债	355,622.22	0.01
75	113633	科沃转债	355,300.18	0.01
76	127024	盈峰转债	355,232.19	0.01
77	128081	海亮转债	355,133.42	0.01
78	113043	财通转债	355,095.41	0.01
79	110043	无锡转债	355,087.28	0.01
80	113616	韦尔转债	354,971.29	0.01
81	113052	兴业转债	354,950.90	0.01
82	123012	万顺转债	354,896.36	0.01
83	113588	润达转债	354,854.84	0.01
84	127041	弘亚转债	354,824.99	0.01
85	110076	华海转债	354,763.28	0.01
86	113504	艾华转债	354,692.18	0.01



87	113050	南银转债	354,544.82	0.01
88	123064	万孚转债	354,418.41	0.01
89	128125	华阳转债	354,363.63	0.01
90	123101	拓斯转债	354,206.35	0.01
91	127005	长证转债	353,745.99	0.01
92	128135	洽洽转债	353,343.39	0.01
93	127044	蒙娜转债	353,309.67	0.01
94	123056	雪榕转债	353,195.51	0.01
95	113639	华正转债	352,632.86	0.01
96	113631	皖天转债	352,620.69	0.01
97	128131	崇达转 2	352,264.33	0.01
98	113597	佳力转债	352,096.01	0.01
99	127020	中金转债	352,073.20	0.01
100	110082	宏发转债	351,325.47	0.01
101	128034	江银转债	351,230.14	0.01
102	127015	希望转债	351,104.00	0.01
103	128029	太阳转债	350,932.97	0.01
104	113013	国君转债	350,798.78	0.01
105	127047	帝欧转债	350,488.31	0.01
106	123107	温氏转债	350,314.24	0.01
107	113585	寿仙转债	350,180.72	0.01
108	127040	国泰转债	350,083.10	0.01
109	113615	金诚转债	349,543.94	0.01
110	128136	立讯转债	348,566.65	0.01
111	113629	泉峰转债	348,125.48	0.01
112	128048	张行转债	348,081.94	0.01
113	113637	华翔转债	347,660.78	0.01
114	113051	节能转债	347,518.53	0.01
115	127033	中装转 2	347,450.50	0.01
116	128023	亚太转债	346,765.67	0.01
117	110060	天路转债	346,754.47	0.01

118	123063	大禹转债	346,719.56	0.01
119	110070	凌钢转债	346,368.40	0.01
120	113024	核建转债	346,173.35	0.01
121	128095	恩捷转债	345,665.30	0.01
122	123106	正丹转债	345,378.62	0.01
123	113598	法兰转债	345,370.57	0.01
124	127030	盛虹转债	345,038.20	0.01
125	110064	建工转债	344,815.05	0.01
126	110080	东湖转债	344,493.36	0.01
127	110081	闻泰转债	343,856.67	0.01
128	128017	金禾转债	343,215.18	0.01
129	127022	恒逸转债	343,163.34	0.01
130	123048	应急转债	343,128.17	0.01
131	127045	牧原转债	342,624.31	0.01
132	113640	苏利转债	342,360.10	0.01
133	128021	兄弟转债	342,105.27	0.01
134	110085	通 22 转债	341,482.32	0.01
135	113537	文灿转债	340,922.85	0.01
136	110061	川投转债	339,016.34	0.01
137	123083	朗新转债	338,824.37	0.01
138	123114	三角转债	335,682.27	0.01
139	113642	上 22 转债	334,740.32	0.01
140	128105	长集转债	331,797.03	0.01
141	113636	甬金转债	328,340.30	0.01
142	128109	楚江转债	327,602.07	0.01
143	127038	国微转债	308,263.78	0.01

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	4,728,258,232.06
本报告期基金总申购份额	560,437,282.81
减：本报告期基金总赎回份额	1,527,229,132.10
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,761,466,382.77

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 109 只公募基金。截至 2022 年 9 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1380 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”。

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

## 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通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

## 9.2 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。

## 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司  
二〇二二年十月二十六日