

海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金
2022 年年度报告
2022 年 12 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年三月三十一日

§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。本年度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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 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。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	6
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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
4.9 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.....	20
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	20
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.....	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	20
§6 审计报告	21
6.1 审计意见.....	21
6.2 形成审计意见的基础.....	21
6.3 其他信息.....	21
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任.....	22
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任.....	22
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	27
§8 投资组合报告	61
8.1 期末基金资产组合情况.....	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	62
8.3 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.....	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	71

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
8.6 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	73
8.7 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	73
8.8 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	73
8.9 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	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12 投资组合报告附注	74
§9 基金份额持有人信息	76
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
9.3 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	76
§10 开放式基金份额变动	77
§11 重大事件揭示	77
11.1 基金份额持有人大会决议	77
11.2 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	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
11.4 基金投资策略的改变	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	78
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	78
11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	78
11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
11.8 其他重大事件	80
12 影响投资者决策的其他重要信息	82
§13 备查文件目录	84
13.1 备查文件目录	85
13.2 存放地点	85
13.3 查阅方式	85

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	海富通欣享混合	
基金主代码	519228	
交易代码	519228	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 10 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	484,773,234.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C
下属分级基金的交易代码	519229	519228
报告期末下属分级基金的份 额总额	264,307,305.66 份	220,465,928.52 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金坚持灵活的资产配置,在严格控制下跌风险的基础上,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	本基金的资产配置策略以基金的投资目标为中心,首先按照投资时钟理论,根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段,作出权益类资产的初步配置,并根据投资时钟判断大致的行业配置;其次结合证券市场趋势指标,判断证券市场指数的大致风险收益比,从而做出权益类资产的具体仓位选择。债券投资采取“自上而下”的策略,深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以价值发现为基础,在市场创新和变化中寻找投资机会,采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略和套利等积极投资管理方式,确定和构造

	合理的债券组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	陆志俊
	联系电话	021-38650788	95559
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559
传真		021-33830166	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	中国（上海）长宁区仙霞路 18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		杨仓兵	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金年度报告备置地点	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
----	----	------

会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号 东方广场毕马威大楼 8 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2022 年		2021 年		2020 年	
	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C
本期已实现收益	1,419,076.54	1,107,537.29	39,730,293.55	28,231,411.46	38,637,049.91	15,013,889.26
本期利润	-16,278,233.25	-10,686,552.10	35,841,889.35	21,639,998.26	58,334,093.68	22,412,515.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0379	-0.0684	0.0815	0.0851	0.1749	0.1879
本期加权平均净值利润率	-3.28%	-5.29%	6.46%	6.05%	15.14%	14.53%
本期基金份额净值增长率	-3.36%	-3.44%	6.70%	6.59%	15.21%	15.09%

3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C
期末可供分配利润	9,075,097.01	15,858,442.06	74,132,798.12	67,943,466.31	61,861,728.07	50,767,810.25
期末可供分配基金份额利润	0.0343	0.0719	0.1169	0.2552	0.1537	0.2831
期末基金资产净值	278,132,031.52	240,151,745.72	751,524,011.26	353,804,103.45	496,460,895.66	245,650,548.93
期末基金份额净值	1.0523	1.0893	1.1849	1.3290	1.2334	1.3698
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C
基金份额累计净值增长率	46.83%	49.55%	51.93%	54.89%	42.39%	45.31%

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

1. 海富通欣享混合 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
过去三个月	-0.84%	0.22%	1.03%	0.64%	-1.87%	-0.42%
过去六个月	-2.85%	0.23%	-6.01%	0.55%	3.16%	-0.32%
过去一年	-3.36%	0.26%	-9.30%	0.63%	5.94%	-0.37%
过去三年	18.80%	0.27%	4.65%	0.64%	14.15%	-0.37%
过去五年	37.39%	0.26%	13.82%	0.64%	23.57%	-0.38%
自基金合同生效起至今	46.83%	0.25%	23.09%	0.61%	23.74%	-0.36%

2. 海富通欣享混合 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
过去三个月	-0.85%	0.22%	1.03%	0.64%	-1.88%	-0.42%
过去六个月	-2.89%	0.23%	-6.01%	0.55%	3.12%	-0.32%
过去一年	-3.44%	0.26%	-9.30%	0.63%	5.86%	-0.37%
过去三年	18.45%	0.27%	4.65%	0.64%	13.80%	-0.37%
过去五年	39.79%	0.26%	13.82%	0.64%	25.97%	-0.38%
自基金合同生效起至今	49.55%	0.25%	23.09%	0.61%	26.46%	-0.36%

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

海富通欣享灵活配置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的历史走势对比图

1. 海富通欣享混合 A

(2017 年 3 月 10 日至 2022 年 12 月 31 日)



2. 海富通欣享混合 C

(2017 年 3 月 10 日至 2022 年 12 月 31 日)



注：本基金合同于 2017 年 3 月 10 日生效。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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金

过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1. 海富通欣享混合 A



2. 海富通欣享混合 C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、海富通欣享混合 A:

单位：人民币元

年度	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发放 总额	年度利润分配 合计	备注
2022 年	0.924	12,080,410.30	12,249,355.80	24,329,766.10	-
2021 年	1.300	57,048,978.35	14,832,988.59	71,881,966.94	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	2.224	69,129,388.65	27,082,344.39	96,211,733.04	-

2、海富通欣享混合 C:

单位：人民币元

年度	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发放 总额	年度利润分配 合计	备注
2022 年	1.930	33,851,318.93	7,503,126.90	41,354,445.83	-
2021 年	1.300	3,445,267.27	29,032,012.96	32,477,280.23	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	3.230	37,296,586.20	36,535,139.86	73,831,726.06	-

§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 12 月 31 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

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		
朱斌全	本基金的基金经理	2020-10-29	-	15 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018 年 11 月至 2022 年 8 月任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月至 2022 年 12 月兼任海富通富祥混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通沪深 300 增强（原海富通富睿混合）、海富通量化多因子混合及海富通欣益混合的基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通欣享混合的基金经理。2020 年 10 月至 2022 年 8 月兼任海富通新内需混合基金经理。2022 年 8 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2022 年 12 月起兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。
谈云飞	本基金的基金经理	2017-03-10	-	17 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 4 月至 2014 年 6 月就职于华宝兴

				<p>业基金管理有限公司，曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理，2014年6月加入海富通基金管理有限公司。2014年7月至2015年10月任海富通现金管理货币基金经理。2014年9月至2020年9月任海富通季季增利理财债券基金经理。2015年1月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015年4月至2020年1月兼任海富通新内需混合基金经理。2016年2月起兼任海富通货币基金经理。2016年4月至2017年6月兼任海富通纯债债券、海富通双福债券（原海富通双福分级债券）、海富通双利债券基金经理。2016年4月至2020年1月兼任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016年9月起兼任海富通聚利债券基金经理。2016年9月至2020年1月兼任海富通欣荣混合基金经理。2016年9月至2019年10月兼任海富通欣益混合基金经理。2017年2月至2021年10月兼任海富通强化回报混合基金经理。2017年3月起兼任海富通欣享混合基金经理。2017年3月至2018年1月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017年7月至2020年9月任海富通季季通利理财债券基金经理。2019年9月起兼任海富通中短债债券基金经理。2021年2月起兼任海富通惠睿精选混合基金经理。2022年</p>
--	--	--	--	--

					3 月起兼任海富通惠鑫混合、海富通欣润混合基金经理。2022 年 5 月起兼任海富通恒益一年定开债券发起式基金经理。
--	--	--	--	--	--

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了一级市场和二级市场的所有投资交易管理活动以及公司内部的证券分配，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 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，回顾 2022 年，债券收益率总体先下后上，基本维持在 2.6%-2.9% 的区间窄幅震荡。具体来看，年初政策利率调降，但由于经济工作会议的积极表态和开门红的经济数据，收益率在降息回落后出现一波上行。随后 3 月上海疫情爆发，叠加资金面超预期长时间宽松，收益率逐步下行，期间 7 月超预期降息带动收益率触及 2.58% 的年内低点。11 月以来防疫政策、地产政策的调整，经济走弱的预期被迅速扭转，叠加银行理财产品出现破净赎回引发负反馈的现象，债券收益率快速调整至年内 2.9% 的高点。年末国内感染人数迎来高峰，经济下行压力再度加大，债券收益率小幅下行。全年来看 10 年期国债到期收益率累计上行 6bp。

信用债方面，1-10 月信用债整体表现强势，一是资金面宽松+利率窄幅波动，信用债票息优势凸显，二是强配置需求+弱新增供给+低风险偏好，使得结构性资产荒延续。进入 11 月后，债市剧烈调整，一方面疫情防控、房地产政策调整动摇了债市根基，短端资金面持续收敛，造成本身较为拥挤的市场发生踩踏；另一方面，资管新规后，理财从市场稳定器变成放大器，赎回压力容易引发“净值下跌-遭遇赎回-被动抛售-净值下跌-继续赎回”的反馈效应。临近年末，信用债逐渐止跌，尤其是中高等级、中短久期率先在市场波动中修复，考虑到理财仍有陆续赎回和定开型产品到期，需要持续关注反馈机制的演绎。

报告期内，本基金全年保持中等期限、中高等级信用债的配置，参与了利率债的交易，债券部分收益较为稳定。本基金在三季度面对债券收益率的低点，缩短组合久期，提高了流动性高的利率债和商金债仓位，在 4 季度的债券调整中受到的净值冲击相对较小。同时，在 4 季度的调整中，本基金债券部分顺势提高了中高等级、中短久期信用债的仓位，并适度提高了组合杠杆及静态收益率，为来年票息收益打好基础。

权益方面，回顾本报告期的投资操作，本基金按照量化方法构建了以沪深 300 为基准的股票组合，同时也加入了一些中证 1000 增强的选股策略，并控制组合的偏离度和估值水平，在波动较大的市场环境下，尽量控制组合的下行风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通欣享混合 A 净值增长率为-3.36%，同期业绩比较基准收益率为-9.30%，基金净值跑赢业绩比较基准 5.94 个百分点。海富通欣享混合 C 净值增长率为-3.44%，同期业绩比较基准收益率为-9.30%，基金净值跑赢业绩比较基准 5.86 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 2023 年，利率债方面，经济向上的大方向相对确定，债市很难逆势而为，债券收益率中枢或较 2022 年抬升。但在外需走弱和地产修复偏慢的背景

下，经济向上的弹性相对有限，利率中枢抬升的幅度不会太大。预计 10 年国债收益率的震荡区间在 2.7%-3.2% 左右。从波动率来说，经济修复将带动信贷需求回升，流动性回归合理充裕以后，资金利率波动加大。同时，防控放松下经济的修复不会一蹴而就，市场可能会在强预期和弱现实中反复切换，也会增加利率的波动性。

信用债方面，理财盈利模式和机构行为的转变，对信用债影响深远，尤其是中低等级信用债面临利差系统性重估风险，利差中枢可能出现系统性上行。短端信用债需求好于中长端，预计将在赎回扰动缓解时率先修复，关注高等级、短久期信用债跌出来的机会。板块方面，城投区域分化格局已形成，不宜过度下沉；房地产供给端政策加码，信贷、债券、股权三个融资渠道“三箭齐发”，不过政策出台-落地-见效需要时间；持续看好煤炭债高景气下的配置价值，钢铁、建筑材料、下游消费及服务业等需关注地产修复进展与疫情扰动情况；二级资本债与永续债已经超调过 2022 年 3 月赎回风波的高点，配置价值逐渐显现，同时关注巴塞尔协议三落地后的影响。

2023 年，本基金债券部分仍将以中等期限、中高等级信用债为主，阶段性参与利率债的交易机会，力求在控制风险的基础上获得更高的配置收益。

权益方面，中国经济在 2022 年经历了一段时间的低迷，但随着国内需求的逐步恢复，2023 年经济增长有望逐步回升。同时，政府也将继续采取相应财政和货币政策以支持经济增长，消费需求也将逐渐回升。预计未来几年，中国消费市场将保持稳健增长，数字化和智能化的趋势进一步加速，新一代人工智能有望提升全要素生产率。综上，随着政策支持和各个产业的逐步恢复，中国经济和股市有望实现高质量发展。2023 年，本基金将使用量化方法配置行业及个股，均衡配置，控制组合的整体估值水平和流动性，力争实现稳定的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2022 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过业务审核、合规检查、系统监控、重点抽查、专项稽核等一系列方式开展工作，强化基金运作和公司运营的合规性，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、加强合规管理，持续完善公司的规章制度，健全内控体系，落实内控责任。

报告期内，坚持以法律法规和公司制度为依据，对公司和基金运作的各项业务开展提供全面的合规咨询、审核、监测与检查，确保基金运作的合法合规性。根据法律法规、监管政策的变化及公司管理需要，新增和修订了多项内部制度和流程，并持续倡导合规文化建设，提升了公司内部控制环境建设。

二、客观开展内外部内控评估，进一步完善内控措施。

根据法规、监管要求并结合风险导向和全覆盖原则，公司进一步加强了日常业务的定期合规检查，重点关注规章制度的执行情况、第一道防线风险控制的有效性。同时，

对各部门的业务有重点的开展了多项专项检查和内部审计。另外，根据法规要求，公司聘请律师事务所、会计师事务所等外部专业机构分别对公司开展了合规有效性评估和内部控制评价审计。针对上述内外部评估检查中发现的问题，公司相关业务部门均认真进行整改。通过及时跟踪落实各项问题的整改情况，严格控制了各部门的主要风险，加强并完善了公司的内部控制状况。

三、有效推进反洗钱与反恐怖融资工作。

报告期内，结合反洗钱法规及公司业务特点完善了反洗钱制度及流程，组织多场反洗钱专项培训、考试和宣传活动；基于风险为本的工作思路，继续开展客户信息核查清理工作，稳步推进代销机构分类管理工作，全面升级反洗钱系统，持续优化监测模型，强化对大额交易和可疑交易方面的监控，并按时向中国反洗钱监测分析中心报送相关数据。报告期内，公司根据监管要求完成了 2021 年度洗钱固有风险自评工作、机构洗钱和恐怖融资风险自评工作。

四、强化法规学习，组织开展内外部培训，提升员工的合规及风险意识。

本报告期内，为提高公司全员的合规意识，加大了合规培训力度，强化主动合规意识培育。公司进一步加强组织各类合规培训频率，及时对法规、监管精神和公司要求进行宣导，并通过制作合规法务月刊、举办合规知识竞赛等多样化的合规宣传培训方式进一步提高法律法规宣导工作的及时性，丰富合规宣导工作的形式，激发全体员工学习合规内控政策的积极性，营造合规文化浓厚氛围。通过培训，增强了全体员工的合规意识和风险防范意识，提升了员工的主动识别和控制业务风险的积极性和能力。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金财产安全、合规、诚信运作。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金的基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%；基金收益分配后基金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。

本基金报告期内进行过一次利润分配，以截止 2022 年 12 月 15 日本基金的可供分配利润为基准。本次分红于 2022 年 12 月 23 日完成权益登记，海富通欣享混合 A 单位分红金额为 0.0924 元，海富通欣享混合 C 单位分红金额为 0.1930 元。合计利润分配金额为 65,684,211.93 元。符合基金合同规定。

4.9 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，基金托管人在海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，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

本报告期内，海富通基金管理有限公司在海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

毕马威华振审字第 2300343 号

海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了后附的海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

该基金管理人海富通基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2022 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情

况可能导致该基金不能持续经营。

(5)评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙) 中国注册会计师
 王国蓓 倪益
 北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
 2023 年 3 月 29 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日: 2022 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	1,042,677.78	4,237,888.79
结算备付金		4,642,181.12	12,624,737.28
存出保证金		85,842.24	83,541.54
交易性金融资产	7.4.7.2	536,922,797.49	1,122,698,839.69
其中: 股票投资		84,437,458.83	246,400,005.77
基金投资		-	-
债券投资		452,485,338.66	876,298,833.92
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		1,493,796.38	185,765.54
应收股利		-	-
应收申购款		1,229.90	706,318.91

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	11,915,921.02
资产总计		544,188,524.91	1,152,453,012.77
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		13,096,898.20	45,000,000.00
应付清算款		-	679,938.96
应付赎回款		11,970,744.62	227,628.27
应付管理人报酬		305,636.39	552,690.11
应付托管费		76,409.10	138,172.54
应付销售服务费		25,925.39	29,920.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		25,724.66	53,883.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	403,409.31	442,663.77
负债合计		25,904,747.67	47,124,898.06
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	484,773,234.18	900,476,420.33
未分配利润	7.4.7.8	33,510,543.06	204,851,694.38
净资产合计		518,283,777.24	1,105,328,114.71
负债和净资产总计		544,188,524.91	1,152,453,012.77

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0523 元，C 类基金份额净值 1.0893 元。基金份额总额 484,773,234.18 份，其中 A 类基金份额 264,307,305.66 份，C 类基金份额 220,465,928.52 份。

7.2 利润表

会计主体：海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-20,838,179.95	66,940,317.07
1.利息收入		366,062.20	23,764,435.46

其中：存款利息收入	7.4.7.9	265,067.88	337,421.67
债券利息收入		-	23,067,564.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		100,994.32	359,448.96
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,891,505.93	53,549,518.08
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-16,911,559.50	55,662,699.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	22,500,418.06	-1,175,768.32
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	215,445.92	-3,684,645.71
股利收益	7.4.7.14	2,087,201.45	2,747,232.37
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-29,491,399.18	-10,479,817.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	395,651.10	106,180.93
减：二、营业总支出		6,126,605.40	9,458,429.46
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,235,035.25	5,443,400.79
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,058,758.81	1,360,850.26
3. 销售服务费		202,901.38	356,048.88
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		342,859.89	739,817.50
其中：卖出回购金融资产支出		342,859.89	739,817.50
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		57,785.03	65,626.71
8. 其他费用	7.4.7.17	229,265.04	1,492,685.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-26,964,785.35	57,481,887.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-26,964,785.35	57,481,887.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-26,964,785.35	57,481,887.61

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	900,476,420.33	-	204,851,694.38	1,105,328,114.71
二、本期期初净资产（基金净值）	900,476,420.33	-	204,851,694.38	1,105,328,114.71
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-415,703,186.15	-	-171,341,151.32	-587,044,337.47
（一）、综合收益总额	-	-	-26,964,785.35	-26,964,785.35
（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）	-415,703,186.15	-	-78,692,154.04	-494,395,340.19
其中：1.基金申购款	453,611,437.12	-	94,202,680.05	547,814,117.17
2.基金赎回款	-869,314,623.27	-	-172,894,834.09	-1,042,209,457.36
（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）	-	-	-65,684,211.93	-65,684,211.93
四、本期期末净资产（基金净值）	484,773,234.18	-	33,510,543.06	518,283,777.24
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	581,844,151.39	-	160,267,293.20	742,111,444.59

二、本期期初净资产（基金净值）	581,844,151.39	-	160,267,293.20	742,111,444.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	318,632,268.94	-	44,584,401.18	363,216,670.12
（一）、综合收益总额	-	-	57,481,887.61	57,481,887.61
（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）	318,632,268.94	-	91,461,760.74	410,094,029.68
其中：1.基金申购款	591,987,478.82	-	192,033,016.34	784,020,495.16
2.基金赎回款	-273,355,209.88	-	-100,571,255.60	-373,926,465.48
（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）	-	-	-104,359,247.17	-104,359,247.17
四、本期期末净资产（基金净值）	900,476,420.33	-	204,851,694.38	1,105,328,114.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海富通欣享灵活配置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[2016]2661 号《关于准予海富通欣享灵活配置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《海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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 600,023,657.86 元。经向中国证监会备案，《海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 600,104,660.77 份基金份额，其中认购资金利息折合 81,002.91 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，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《海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货，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，但须符合中国证监会的相关规定。在正常市场情况下，本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

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 2023 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况、2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券投资、衍生工具、买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被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，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所

有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。

但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基

金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金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；同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年 1 月 1 日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。

(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项目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

执行上述会计政策对本基金资产负债表的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则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、应收证券清算款、应收利息和应收申购款，对应的账面价值分别为人民币 4,237,888.79 元、12,624,737.28 元、83,541.54 元、185,765.54 元、11,915,921.02 元和 706,318.91 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则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、应收清算款、其他资产-应收利息和应收申购款，对应的账面价值分别为人民币 4,239,415.92 元、12,671,734.22 元、83,579.14 元、185,765.54 元、0.00 元和 706,318.91 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 1,122,698,839.69 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 1,134,566,199.04 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则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，对应的账面价值分别为人民币 45,000,000.00 元、679,938.96 元、227,628.27 元、552,690.11 元、138,172.54 元、29,920.85 元、283,450.29 元、-20,794.50 元和 180,007.98 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则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，对应的账面价值分别为人民币 44,979,205.50 元、679,938.96 元、227,628.27 元、552,690.11 元、138,172.54 元、29,920.85 元、283,450.29 元、0.00 元和 180,007.98 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 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：

(a)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。

(b)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。

(c)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。

(d)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。

(e)本基金城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
活期存款	1,042,677.78	4,237,888.79
等于：本金	1,041,154.37	4,237,888.79
加：应计利息	1,523.41	-
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	1,042,677.78	4,237,888.79

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变 动
股票	88,411,891.11	-	84,437,458.83	-3,974,432.28
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	2,948,963.30	167,638,338.1 0	126,274.08
	银行间市场	281,244,384.93	3,740,000.56	284,847,000.5 6

	合计	445,807,485.65	6,688,963.86	452,485,338.66	-11,110.85
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
	合计	534,219,376.76	6,688,963.86	536,922,797.49	-3,985,543.13
项目		上年度末			
		2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		227,183,518.08	-	246,400,005.77	19,216,487.69
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	248,469,501.51	-	250,441,833.92	1,972,332.41
	银行间市场	621,539,964.05	-	625,857,000.00	4,317,035.95
	合计	870,009,465.56	-	876,298,833.92	6,289,368.36
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
	合计	1,097,192,983.64	-	1,122,698,839.69	25,505,856.05

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有任何买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	11,915,921.02
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	11,915,921.02

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	7.98
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	223,409.31	283,450.29
其中：交易所市场	219,364.35	279,970.48
银行间市场	4,044.96	3,479.81
应付利息	-	-20,794.50
预提费用	180,000.00	180,000.00
合计	403,409.31	442,663.77

7.4.7.7 实收基金

海富通欣享混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	634,262,370.83	634,262,370.83
本期申购	254,877,387.76	254,877,387.76
本期赎回（以“-”号填列）	-624,832,452.93	-624,832,452.93
本期末	264,307,305.66	264,307,305.66

海富通欣享混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	266,214,049.50	266,214,049.50
本期申购	198,734,049.36	198,734,049.36
本期赎回（以“-”号填列）	-244,482,170.34	-244,482,170.34
本期末	220,465,928.52	220,465,928.52

注：此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

海富通欣享混合 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	74,132,798.12	43,128,842.31	117,261,640.43
本期利润	1,419,076.54	-17,697,309.79	-16,278,233.25
本期基金份额交易产生的变动数	-42,147,011.55	-20,681,903.67	-62,828,915.22
其中：基金申购款	30,756,757.50	7,195,063.66	37,951,821.16
基金赎回款	-72,903,769.05	-27,876,967.33	-100,780,736.38
本期已分配利润	-24,329,766.10	-	-24,329,766.10
本期末	9,075,097.01	4,749,628.85	13,824,725.86

海富通欣享混合 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	67,943,466.31	19,646,587.64	87,590,053.95
本期利润	1,107,537.29	-11,794,089.39	-10,686,552.10
本期基金份额交易产生的变动数	-11,838,115.71	-4,025,123.11	-15,863,238.82
其中：基金申购款	51,187,319.34	5,063,539.55	56,250,858.89
基金赎回款	-63,025,435.05	-9,088,662.66	-72,114,097.71
本期已分配利润	-41,354,445.83	-	-41,354,445.83
本期末	15,858,442.06	3,827,375.14	19,685,817.20

7.4.7.9 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12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
活期存款利息收入	99,657.84	95,494.84
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	154,959.18	198,194.34
其他	10,450.86	43,732.49
合计	265,067.88	337,421.67

7.4.7.10 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
卖出股票成交总额	668,853,905.82	445,246,382.97
减：卖出股票成本总额	684,086,500.84	389,583,683.23
减：交易费用	1,678,964.48	-
买卖股票差价收入	-16,911,559.50	55,662,699.74

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
债券投资收益——利息收入	18,894,002.04	-
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	3,606,416.02	-1,175,768.32
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	22,500,418.06	-1,175,768.32

7.4.7.11.2 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 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	768,735,941.97	458,533,516.21
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	753,695,552.63	452,767,576.97
减：应计利息总额	11,424,302.70	6,941,707.56
减：交易费用	9,670.62	-
买卖债券差价收入	3,606,416.02	-1,175,768.32

7.4.7.12 贵金属投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间收益金额 2021年1月1日至2021年12月31 日
股指期货投资收益(税前)	223,140.00	-3,684,645.71
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	6,499.22	-
减：交易费用	1,194.86	-
合计	215,445.92	-3,684,645.71

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	2,087,201.45	2,747,232.37
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	2,087,201.45	2,747,232.37

7.4.7.15 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12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
1.交易性金融资产	-29,491,399.18	-14,116,383.11
——股票投资	-23,190,919.97	-25,365,657.95
——债券投资	-6,300,479.21	11,249,274.84
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	3,636,565.71
——权证投资	-	-
——股指期货	-	3,636,565.71
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	-29,491,399.18	-10,479,817.40

7.4.7.16 其他收入

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12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	390,628.96	101,757.49
基金转换费收入	5,022.14	4,423.44
合计	395,651.10	106,180.93

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	12,065.04	13,163.75
其他费用	1,200.00	1,200.00
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
交易费用	-	1,262,321.57
合计	229,265.04	1,492,685.32

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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
法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas)	基金管理人的股东

Asset Management BE Holding)	
上海富诚海富通资产管理有限公司	基金管理人的子公司
海富通资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司

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。海富通资产管理（香港）有限公司已于 2022 年 12 月 31 日公告注销，除上述变化外，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	219,363,161.02	18.30%	85,698,131.97	9.57%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.3 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12月31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	157,591.50	18.14%	59,780.94	27.25%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	62,668.98	9.69%	58,601.35	20.93%
------	-----------	-------	-----------	--------

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、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用海通证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从海通证券获得研究综合服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,235,035.25	5,443,400.79
其中：支付销售机构的客户维护费	274,214.19	277,166.72

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 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X0.60%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,058,758.81	1,360,850.26

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 X0.15%/当年天数。

7.4.10.2.3 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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通欣享混合A	海富通欣享混合C	合计

交通银行	-	1,413.15	1,413.15
海通证券	-	6,104.86	6,104.86
海富通	-	111,411.74	111,411.74
合计	-	118,929.75	118,929.75
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通欣享混合A	海富通欣享混合C	合计
交通银行	-	1,636.66	1,636.66
海通证券	-	50.61	50.61
海富通	-	241,698.17	241,698.17
合计	-	243,385.44	243,385.44

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.10%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.10% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。销售服务费的计算方法如下：日销售服务费 = 前一日 C 类份额的基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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及上年度可比期间均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。

7.4.10.4.2 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及上年度可比期间均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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	1,042,677.78	99,657.84	4,237,888.79	95,494.84

7.4.10.7 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 2022年1月1日至2022年12月31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: 股/张)	总金额
海通证券	688234	天岳先进	网下发行	6,324	523,563.96
海通证券	688259	创耀科技	网下发行	1,595	106,227.00
海通证券	301228	实朴检测	网下发行	3,721	74,717.68
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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: 股/张)	总金额
海通证券	688187	时代电气	网下发行	17,327	543,721.26
海通证券	300981	中红医疗	网下发行	5,831	283,328.29
海通证券	688680	海优新材	网下发行	2,795	195,482.30
海通证券	301039	中集车辆	网下发行	20,640	143,654.40
海通证券	601825	沪农商行	网下发行	15,480	137,772.00
海通证券	688626	翔宇医疗	网下发行	3,652	105,250.64
海通证券	688687	凯因科技	网下发行	5,354	101,618.92
海通证券	688630	芯碁微装	网下发行	3,397	51,736.31
海通证券	688665	四方光电	网下发行	1,687	49,817.11
海通证券	688682	霍莱沃	网下发行	946	43,251.12
海通证券	300940	南极光	网下发行	3,068	39,147.68
海通证券	300933	中辰股份	网下发行	11,117	37,464.29
海通证券	688092	爱科科技	网下发行	1,137	21,728.07
海通证券	688217	睿昂基因	网下发行	1,040	19,156.80
海通证券	688038	中科通达	网下发行	2,132	18,335.20
海通证券	688701	卓锦股份	网下发行	2,340	17,503.20

7.4.10.8 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均无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

海富通欣享混合 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额 分红 数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	本期利润 分配合计	备注
1	2022-12-23	2022-12-23	0.924	12,080,410 .30	12,249,355 .80	24,329,766 .10	-
合计			0.924	12,080,410 .30	12,249,355 .80	24,329,766 .10	-

海富通欣享混合 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额 分红 数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	本期利润 分配合计	备注
1	2022-12-23	2022-12-23	1.930	33,851,318 .93	7,503,126. 90	41,354,445 .83	-
合计			1.930	33,851,318 .93	7,503,126. 90	41,354,445 .83	-

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：股)	期末 成本	期末 估值	备注

				限类 型				总额	总额	
30112 1	紫建 电子	2022- 08-01	6 个 月	新股 锁定	61.07	49.77	290	17,71 0.30	14,43 3.30	-
30117 5	中科 环保	2022- 06-30	6 个 月	新股 锁定	3.82	6.01	6,370	24,33 3.40	38,28 3.70	-
30119 7	工大 科雅	2022- 07-29	6 个 月	新股 锁定	25.50	20.08	380	9,690. 00	7,630. 40	-
30123 3	盛帮 股份	2022- 06-24	6 个 月	新股 锁定	41.52	34.30	158	6,560. 16	5,419. 40	-
30126 9	华大 九天	2022- 07-21	6 个 月	新股 锁定	32.69	87.94	701	22,91 5.69	61,64 5.94	-
30130 0	远翔 新材	2022- 08-09	6 个 月	新股 锁定	36.15	29.37	211	7,627. 65	6,197. 07	-
30130 6	西测 测试	2022- 07-19	6 个 月	新股 锁定	43.23	42.29	255	11,02 3.65	10,78 3.95	-
68827 3	麦澜 德	2022- 08-04	6 个 月	新股 锁定	40.29	31.52	3,568	143,7 54.72	112,4 63.36	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算，在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的或询价转让方式受让的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金持有的上市公司非公开发行股份，减持采取集中竞价交易方式或采取大宗交易方式的根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由法规规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌 开 盘单 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
30085 0	新强 联	2022-1 2-30	重大事 项停牌	53.28	2023- 01-10	56.88	1,500	91,919.32	79,920.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2022 年 12 月 31 日,本基金无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 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 13,096,898.20 元,于 2023 年 1 月 3 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2022 年 12 月 31 日,本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型的证券投资基金,属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内,使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

7.4.13.2 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 12 月 31 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 61.94%（2021 年 12 月 31 日：71.39%）。

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。

7.4.13.2.1 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	37,040,447.27	26,983,400.00
合计	37,040,447.27	26,983,400.00

注：未评级部分为国债、政策性金融债。

7.4.13.2.2 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	39,027,000.00
合计	-	39,027,000.00

7.4.13.2.3 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	219,810,937.17	495,926,498.70
AAA 以下	40,993,556.96	163,309,935.22
未评级	154,640,397.26	151,052,000.00
合计	415,444,891.39	810,288,433.92

注：未评级部分为国债、政策性金融债、中期票据。

7.4.13.3 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 7.4.12 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出

回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

31 日					
资产					
银行存款	1,042,677.78	-	-	-	1,042,677.78
结算备付金	4,642,181.12	-	-	-	4,642,181.12
存出保证金	85,842.24	-	-	-	85,842.24
交易性金融资产	91,391,819.59	361,047,321.64	46,197.43	84,437,458.83	536,922,797.49
应收清算款	-	-	-	1,493,796.38	1,493,796.38
应收申购款	-	-	-	1,229.90	1,229.90
资产总计	97,162,520.73	361,047,321.64	46,197.43	85,932,485.11	544,188,524.91
负债					
卖出回购金融资产款	13,096,898.20	-	-	-	13,096,898.20
应付赎回款	-	-	-	11,970,744.62	11,970,744.62
应付管理人报酬	-	-	-	305,636.39	305,636.39
应付托管费	-	-	-	76,409.10	76,409.10
应付销售服务费	-	-	-	25,925.39	25,925.39
应交税费	-	-	-	25,724.66	25,724.66
其他负债	-	-	-	403,409.31	403,409.31
负债总计	13,096,898.20	-	-	12,807,849.47	25,904,747.67
利率敏感度缺口	84,065,622.53	361,047,321.64	46,197.43	73,124,635.64	518,283,777.24
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	4,237,888.79	-	-	-	4,237,888.79
结算备付金	12,624,737.28	-	-	-	12,624,737.28
存出保证金	83,541.54	-	-	-	83,541.54
交易性金融资产	198,254,590.00	647,522,605.70	30,521,638.22	246,400,005.77	1,122,698,839.69
应收清算款	-	-	-	185,765.54	185,765.54
其他资产	-	-	-	11,915,921.02	11,915,921.02
应收申购款	-	-	-	706,318.91	706,318.91
资产总计	215,200,757.61	647,522,605.70	30,521,638.22	259,208,011.24	1,152,453,012.77

负债					
卖出回购金融资产款	45,000,000.00	-	-	-	45,000,000.00
应付清算款	-	-	-	679,938.96	679,938.96
应付赎回款	-	-	-	227,628.27	227,628.27
应付管理人报酬	-	-	-	552,690.11	552,690.11
应付托管费	-	-	-	138,172.54	138,172.54
应付销售服务费	-	-	-	29,920.85	29,920.85
应交税费	-	-	-	53,883.56	53,883.56
其他负债	-	-	-	442,663.77	442,663.77
负债总计	45,000,000.00	-	-	2,124,898.06	47,124,898.06
利率敏感度缺口	170,200,757.61	647,522,605.70	30,521,638.22	257,083,113.18	1,105,328,114.71

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进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-1,798,695.79	-5,379,118.68
市场利率下降 25 个基点	1,812,285.63	5,443,072.62	

7.4.13.4.2 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。

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，基于定量与定性相结合的宏

观及市场分析，形成对不同市场周期的预测和判断，通过灵活主动且有纪律的资产配置，确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例，追求较高的收益，同时规避市场的系统性风险。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。本基金投资组合中股票及存托凭证投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	84,437,458.83	16.29	246,400,005.77	22.29
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	84,437,458.83	16.29	246,400,005.77	22.29

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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12月31日	上年度末 2021年12月31日
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	4,360,488.00	13,475,846.06
2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-4,360,488.00	-13,475,846.06	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	88,159,146.12	245,291,725.50
第二层次	448,506,794.25	877,407,114.19
第三层次	256,857.12	-
合计	536,922,797.49	1,122,698,839.69

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,224,157.83	3,224,157.83
转出第三层次	-	4,425,542.96	4,425,542.96
当期利得或损失总额	-	1,458,242.25	1,458,242.25
其中：计入损益的利得或损失	-	1,458,242.25	1,458,242.25
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	256,857.12	256,857.12
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	13,241.55	13,241.55
项目	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于2022年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2022年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失计入利润表中的公允价值变动损益项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

股票投资	256,857.12	亚式期权模型	预期年化波动率	20.63%~45.99%	负相关
------	------------	--------	---------	---------------	-----

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 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)。

7.4.14.4 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应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 12 月 31 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	84,437,458.83	15.52
	其中：股票	84,437,458.83	15.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	452,485,338.66	83.15
	其中：债券	452,485,338.66	83.15
	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	5,684,858.90	1.04
8	其他各项资产	1,580,868.52	0.29
9	合计	544,188,524.91	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	331,788.00	0.06
B	采矿业	2,176,336.40	0.42
C	制造业	55,038,757.62	10.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	701,229.00	0.14
E	建筑业	645,981.00	0.12
F	批发和零售业	1,185,914.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	265,466.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,810,838.88	0.93
J	金融业	9,381,976.65	1.81
K	房地产业	1,845,614.00	0.36
L	租赁和商务服务业	3,291,821.00	0.64
M	科学研究和技术服务业	2,358,088.58	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	1,057,279.70	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	743,212.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	603,156.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	84,437,458.83	16.29

8.2.2 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。

8.3 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	601888	中国中免	13,500	2,916,405.00	0.56
2	300122	智飞生物	26,100	2,292,363.00	0.44
3	000858	五粮液	12,500	2,258,625.00	0.44
4	601318	中国平安	44,900	2,110,300.00	0.41
5	600519	贵州茅台	1,200	2,072,400.00	0.40
6	300760	迈瑞医疗	6,100	1,927,417.00	0.37
7	300750	宁德时代	4,800	1,888,416.00	0.36
8	600036	招商银行	47,700	1,777,302.00	0.34
9	002271	东方雨虹	43,000	1,443,510.00	0.28
10	000333	美的集团	24,000	1,243,200.00	0.24
11	600919	江苏银行	142,900	1,041,741.00	0.20
12	600048	保利发展	61,300	927,469.00	0.18
13	300347	泰格医药	7,900	827,920.00	0.16
14	688297	中无人机	16,909	759,721.37	0.15
15	002475	立讯精密	22,778	723,201.50	0.14
16	300059	东方财富	37,216	721,990.40	0.14
17	300014	亿纬锂能	8,000	703,200.00	0.14
18	600309	万华化学	7,100	657,815.00	0.13
19	300015	爱尔眼科	20,200	627,614.00	0.12
20	600887	伊利股份	20,000	620,000.00	0.12
21	601012	隆基绿能	14,508	613,108.08	0.12
22	600438	通威股份	15,300	590,274.00	0.11
23	601088	中国神华	21,200	585,544.00	0.11
24	601838	成都银行	37,600	575,280.00	0.11
25	600030	中信证券	28,675	570,919.25	0.11
26	002920	德赛西威	5,100	537,234.00	0.10
27	300124	汇川技术	7,100	493,450.00	0.10
28	002142	宁波银行	15,100	489,995.00	0.09
29	600426	华鲁恒升	13,300	440,895.00	0.09
30	002555	三七互娱	24,100	436,210.00	0.08
31	600926	杭州银行	33,300	435,564.00	0.08
32	000661	长春高新	2,300	382,835.00	0.07
33	002027	分众传媒	56,200	375,416.00	0.07
34	601669	中国电建	52,000	368,160.00	0.07
35	000513	丽珠集团	11,300	367,024.00	0.07
36	600660	福耀玻璃	10,400	364,728.00	0.07
37	601225	陕西煤业	19,600	364,168.00	0.07
38	601211	国泰君安	25,700	349,263.00	0.07
39	002311	海大集团	5,500	339,515.00	0.07
40	002594	比亚迪	1,300	334,061.00	0.06
41	603986	兆易创新	3,200	327,904.00	0.06

42	601702	华峰铝业	21,900	327,405.00	0.06
43	603799	华友钴业	5,600	311,528.00	0.06
44	603806	福斯特	4,600	305,624.00	0.06
45	600460	士兰微	9,300	304,947.00	0.06
46	001979	招商蛇口	24,100	304,383.00	0.06
47	601688	华泰证券	23,800	303,212.00	0.06
48	601899	紫金矿业	30,000	300,000.00	0.06
49	600031	三一重工	18,900	298,620.00	0.06
50	600729	重庆百货	12,600	297,990.00	0.06
51	300725	药石科技	3,600	289,800.00	0.06
52	300413	芒果超媒	9,600	288,192.00	0.06
53	300601	康泰生物	9,000	283,770.00	0.05
54	300274	阳光电源	2,500	279,500.00	0.05
55	300855	图南股份	5,900	276,061.00	0.05
56	002956	西麦食品	18,000	267,660.00	0.05
57	600009	上海机场	4,600	265,466.00	0.05
58	000848	承德露露	31,100	263,728.00	0.05
59	603856	东宏股份	22,700	263,093.00	0.05
60	603808	歌力思	28,900	262,990.00	0.05
61	002968	新大正	11,800	257,122.00	0.05
62	002605	姚记科技	18,200	255,710.00	0.05
63	600176	中国巨石	18,600	255,006.00	0.05
64	603533	掌阅科技	17,500	253,575.00	0.05
65	300616	尚品宅配	12,900	253,356.00	0.05
66	688066	航天宏图	2,959	252,994.50	0.05
67	300384	三联虹普	16,600	252,486.00	0.05
68	600795	国电电力	58,900	251,503.00	0.05
69	300856	科思股份	4,800	250,320.00	0.05
70	600210	紫江企业	49,900	249,500.00	0.05
71	603297	永新光学	3,000	249,030.00	0.05
72	603558	健盛集团	30,200	248,848.00	0.05
73	600901	江苏租赁	45,300	248,244.00	0.05
74	300358	楚天科技	16,800	247,800.00	0.05
75	002106	莱宝高科	32,200	247,296.00	0.05
76	002714	牧原股份	5,072	247,260.00	0.05
77	300416	苏试试验	8,200	247,230.00	0.05
78	688389	普门科技	13,817	246,357.11	0.05
79	688518	联赢激光	8,414	245,772.94	0.05
80	002392	北京利尔	70,400	245,696.00	0.05
81	300119	瑞普生物	13,200	245,652.00	0.05
82	300130	新国都	20,300	245,021.00	0.05
83	300232	洲明科技	44,600	244,854.00	0.05
84	300031	宝通科技	17,700	244,791.00	0.05
85	002734	利民股份	26,100	244,296.00	0.05

86	002991	甘源食品	3,200	244,128.00	0.05
87	603681	永冠新材	11,400	243,732.00	0.05
88	300642	透景生命	11,600	241,164.00	0.05
89	600909	华安证券	52,100	239,139.00	0.05
90	603179	新泉股份	6,200	238,638.00	0.05
91	002602	世纪华通	62,600	238,506.00	0.05
92	603324	盛剑环境	6,800	238,476.00	0.05
93	002975	博杰股份	7,500	237,525.00	0.05
94	601898	中煤能源	27,400	236,188.00	0.05
95	605208	永茂泰	17,600	234,784.00	0.05
96	002439	启明星辰	9,000	234,720.00	0.05
97	600158	中体产业	26,800	233,964.00	0.05
98	605111	新洁能	3,000	232,740.00	0.04
99	300284	苏交科	41,200	230,720.00	0.04
100	601877	正泰电器	8,300	229,910.00	0.04
101	002649	博彦科技	22,100	227,409.00	0.04
102	002415	海康威视	6,500	225,420.00	0.04
103	300454	深信服	2,000	225,100.00	0.04
104	002777	久远银海	15,000	225,000.00	0.04
105	002302	西部建设	30,900	224,025.00	0.04
106	600109	国金证券	25,700	223,590.00	0.04
107	300219	鸿利智汇	33,400	223,112.00	0.04
108	601827	三峰环境	34,600	222,478.00	0.04
109	600011	华能国际	29,200	222,212.00	0.04
110	002549	凯美特气	14,500	219,095.00	0.04
111	300379	东方通	10,700	218,601.00	0.04
112	688078	龙软科技	6,818	217,971.46	0.04
113	601799	星宇股份	1,700	216,529.00	0.04
114	600893	航发动力	5,100	215,628.00	0.04
115	000933	神火股份	14,400	215,424.00	0.04
116	601100	恒立液压	3,400	214,710.00	0.04
117	601717	郑煤机	19,200	214,272.00	0.04
118	000596	古井贡酒	800	213,520.00	0.04
119	600690	海尔智家	8,700	212,802.00	0.04
120	300401	花园生物	14,000	201,460.00	0.04
121	600496	精工钢构	50,700	200,265.00	0.04
122	002050	三花智控	9,400	199,468.00	0.04
123	688133	泰坦科技	1,414	195,796.58	0.04
124	603833	欧派家居	1,600	194,448.00	0.04
125	002675	东诚药业	11,700	193,752.00	0.04
126	002637	赞宇科技	15,500	190,340.00	0.04
127	601126	四方股份	13,000	189,800.00	0.04
128	002129	TCL 中环	4,900	184,534.00	0.04
129	600908	无锡银行	34,800	183,396.00	0.04

130	688356	键凯科技	1,166	182,537.30	0.04
131	603429	集友股份	16,700	181,696.00	0.04
132	601137	博威合金	12,200	180,682.00	0.03
133	000630	铜陵有色	57,800	180,336.00	0.03
134	600419	天润乳业	11,500	180,320.00	0.03
135	300595	欧普康视	5,000	178,500.00	0.03
136	603081	大丰实业	14,100	175,686.00	0.03
137	600285	羚锐制药	13,400	174,736.00	0.03
138	000906	浙商中拓	19,300	173,893.00	0.03
139	002752	昇兴股份	33,400	173,680.00	0.03
140	603018	华设集团	22,900	173,582.00	0.03
141	002815	崇达技术	17,500	173,425.00	0.03
142	688085	三友医疗	6,248	173,382.00	0.03
143	300790	宇瞳光学	11,600	172,840.00	0.03
144	688006	杭可科技	3,944	172,628.88	0.03
145	000708	中信特钢	10,000	171,600.00	0.03
146	603489	八方股份	1,600	171,184.00	0.03
147	600820	隧道股份	32,100	169,167.00	0.03
148	603583	捷昌驱动	6,600	168,696.00	0.03
149	300378	鼎捷软件	11,000	168,630.00	0.03
150	600694	大商股份	9,300	168,330.00	0.03
151	603630	拉芳家化	10,700	167,883.00	0.03
152	600449	宁夏建材	13,900	164,993.00	0.03
153	603960	克来机电	9,300	164,889.00	0.03
154	300259	新天科技	49,600	164,672.00	0.03
155	688568	中科星图	2,653	164,592.12	0.03
156	300543	朗科智能	19,700	164,298.00	0.03
157	000717	中南股份	57,600	164,160.00	0.03
158	002624	完美世界	12,900	164,088.00	0.03
159	000060	中金岭南	40,000	164,000.00	0.03
160	603667	五洲新春	12,300	163,713.00	0.03
161	688685	迈信林	7,063	163,437.82	0.03
162	300815	玉禾田	10,700	162,961.00	0.03
163	002221	东华能源	21,300	162,519.00	0.03
164	300735	光弘科技	18,300	162,504.00	0.03
165	603611	诺力股份	10,000	161,900.00	0.03
166	600963	岳阳林纸	29,500	160,775.00	0.03
167	600073	上海梅林	20,000	159,000.00	0.03
168	603328	依顿电子	24,400	158,356.00	0.03
169	688016	心脉医疗	835	157,848.40	0.03
170	002371	北方华创	700	157,710.00	0.03
171	600720	祁连山	15,800	156,894.00	0.03
172	002970	锐明技术	8,100	156,411.00	0.03
173	002891	中宠股份	7,000	156,170.00	0.03

174	603987	康德莱	11,300	155,714.00	0.03
175	000301	东方盛虹	11,900	155,176.00	0.03
176	000910	大亚圣象	18,200	155,064.00	0.03
177	002810	山东赫达	6,900	154,698.00	0.03
178	600089	特变电工	7,700	154,616.00	0.03
179	603112	华翔股份	13,200	153,780.00	0.03
180	688233	神工股份	3,761	153,448.80	0.03
181	002677	浙江美大	13,800	152,904.00	0.03
182	300319	麦捷科技	19,600	152,488.00	0.03
183	300447	全信股份	9,900	152,460.00	0.03
184	600581	八一钢铁	38,400	152,064.00	0.03
185	002753	永东股份	17,300	144,628.00	0.03
186	603890	春秋电子	15,800	144,412.00	0.03
187	300190	维尔利	34,600	143,590.00	0.03
188	002977	天箭科技	3,900	143,130.00	0.03
189	002585	双星新材	11,200	142,800.00	0.03
190	600064	南京高科	21,600	142,776.00	0.03
191	300258	精锻科技	12,200	141,886.00	0.03
192	300349	金卡智能	15,100	141,487.00	0.03
193	002391	长青股份	20,100	141,303.00	0.03
194	300572	安车检测	12,300	140,835.00	0.03
195	600742	一汽富维	16,800	140,448.00	0.03
196	688127	蓝特光学	8,790	140,024.70	0.03
197	600114	东睦股份	16,300	138,550.00	0.03
198	603309	维力医疗	6,900	137,862.00	0.03
199	002887	绿茵生态	16,200	137,376.00	0.03
200	003019	宸展光电	6,400	136,384.00	0.03
201	002876	三利谱	3,700	134,680.00	0.03
202	002100	天康生物	16,200	134,622.00	0.03
203	300552	万集科技	7,500	134,475.00	0.03
204	002034	旺能环境	7,400	133,496.00	0.03
205	603626	科森科技	20,300	133,168.00	0.03
206	603920	世运电路	9,200	132,296.00	0.03
207	002541	鸿路钢构	4,500	131,805.00	0.03
208	603290	斯达半导	400	131,720.00	0.03
209	688550	瑞联新材	2,821	131,486.81	0.03
210	300494	盛天网络	8,800	131,384.00	0.03
211	603337	杰克股份	6,800	129,472.00	0.02
212	300800	力合科技	11,100	129,204.00	0.02
213	002833	弘亚数控	10,434	128,651.22	0.02
214	002428	云南锗业	13,800	128,616.00	0.02
215	600971	恒源煤电	17,900	128,164.00	0.02
216	002413	雷科防务	28,900	127,738.00	0.02
217	600315	上海家化	4,000	127,400.00	0.02

218	000976	华铁股份	34,700	127,349.00	0.02
219	000937	冀中能源	19,900	126,564.00	0.02
220	688677	海泰新光	1,115	125,995.00	0.02
221	603997	继峰股份	8,200	125,296.00	0.02
222	300453	三鑫医疗	14,500	124,990.00	0.02
223	300360	炬华科技	8,500	123,675.00	0.02
224	002570	贝因美	22,600	122,266.00	0.02
225	603809	豪能股份	11,400	121,296.00	0.02
226	300723	一品红	3,500	121,030.00	0.02
227	300443	金雷股份	3,000	120,840.00	0.02
228	002851	麦格米特	4,600	119,416.00	0.02
229	002768	国恩股份	4,100	118,982.00	0.02
230	603896	寿仙谷	3,000	118,980.00	0.02
231	600580	卧龙电驱	9,500	118,370.00	0.02
232	600458	时代新材	13,100	118,162.00	0.02
233	300326	凯利泰	16,400	118,080.00	0.02
234	002042	华孚时尚	38,700	118,035.00	0.02
235	002929	润建股份	3,000	117,780.00	0.02
236	601311	骆驼股份	14,400	117,504.00	0.02
237	600059	古越龙山	12,100	117,491.00	0.02
238	601339	百隆东方	20,600	117,420.00	0.02
239	603187	海容冷链	3,700	117,364.00	0.02
240	601689	拓普集团	2,000	117,160.00	0.02
241	002582	好想你	12,300	116,973.00	0.02
242	002293	罗莱生活	10,400	116,688.00	0.02
243	002727	一心堂	3,700	116,587.00	0.02
244	300224	正海磁材	9,290	116,403.70	0.02
245	688586	江航装备	7,131	116,235.30	0.02
246	688626	翔宇医疗	3,636	115,915.68	0.02
247	300244	迪安诊断	4,600	115,598.00	0.02
248	002273	水晶光电	9,800	115,542.00	0.02
249	300684	中石科技	7,800	115,518.00	0.02
250	300440	运达科技	16,700	115,230.00	0.02
251	002402	和而泰	7,900	115,182.00	0.02
252	688001	华兴源创	4,252	114,378.80	0.02
253	600803	新奥股份	7,100	114,310.00	0.02
254	600507	方大特钢	18,900	113,778.00	0.02
255	688179	阿拉丁	3,147	113,764.05	0.02
256	002611	东方精工	28,000	113,680.00	0.02
257	002438	江苏神通	10,400	113,672.00	0.02
258	002507	涪陵榨菜	4,400	113,388.00	0.02
259	603393	新天然气	5,200	113,204.00	0.02
260	301080	百普赛斯	1,100	112,959.00	0.02
261	601677	明泰铝业	6,200	112,468.00	0.02

262	688273	麦澜德	3,568	112,463.36	0.02
263	002110	三钢闽光	23,900	112,330.00	0.02
264	002055	得润电子	13,000	112,060.00	0.02
265	000728	国元证券	17,700	112,041.00	0.02
266	002287	奇正藏药	4,900	111,965.00	0.02
267	000983	山西焦煤	9,600	111,840.00	0.02
268	600366	宁波韵升	10,600	111,830.00	0.02
269	688029	南微医学	1,361	111,778.93	0.02
270	300610	晨化股份	8,900	111,606.00	0.02
271	603313	梦百合	10,500	111,300.00	0.02
272	002967	广电计量	6,600	110,748.00	0.02
273	688399	硕世生物	1,256	110,163.76	0.02
274	600750	江中药业	7,600	109,820.00	0.02
275	688266	泽璟制药	2,630	109,671.00	0.02
276	002085	万丰奥威	18,400	109,480.00	0.02
277	603180	金牌厨柜	3,800	108,946.00	0.02
278	000090	天健集团	19,900	108,654.00	0.02
279	300729	乐歌股份	6,700	108,339.00	0.02
280	002705	新宝股份	6,500	108,225.00	0.02
281	688128	中国电研	6,327	108,065.16	0.02
282	600325	华发股份	11,900	107,814.00	0.02
283	600546	山煤国际	7,400	107,226.00	0.02
284	000887	中鼎股份	7,400	107,078.00	0.02
285	000402	金融街	20,200	106,050.00	0.02
286	002645	华宏科技	7,100	105,861.00	0.02
287	002798	帝欧家居	13,900	104,945.00	0.02
288	002179	中航光电	1,800	103,968.00	0.02
289	300666	江丰电子	1,500	103,800.00	0.02
290	002821	凯莱英	700	103,600.00	0.02
291	688408	中信博	1,041	102,434.40	0.02
292	002925	盈趣科技	6,200	102,424.00	0.02
293	600085	同仁堂	2,100	93,828.00	0.02
294	688159	有方科技	6,406	93,207.30	0.02
295	000733	振华科技	800	91,384.00	0.02
296	000049	德赛电池	2,100	91,308.00	0.02
297	603267	鸿远电子	900	91,044.00	0.02
298	600123	兰花科创	6,700	89,378.00	0.02
299	688100	威胜信息	3,787	87,441.83	0.02
300	300770	新媒股份	2,300	86,618.00	0.02
301	300653	正海生物	2,000	86,000.00	0.02
302	000034	神州数码	3,900	85,566.00	0.02
303	300726	宏达电子	1,900	83,866.00	0.02
304	300394	天孚通信	3,300	83,655.00	0.02
305	600562	国睿科技	4,900	83,055.00	0.02

306	300624	万兴科技	2,800	82,208.00	0.02
307	300215	电科院	14,900	82,099.00	0.02
308	300788	中信出版	4,000	81,000.00	0.02
309	601168	西部矿业	7,882	80,396.40	0.02
310	300504	天邑股份	5,000	80,250.00	0.02
311	300850	新强联	1,500	79,920.00	0.02
312	002906	华阳集团	2,400	79,728.00	0.02
313	300213	佳讯飞鸿	16,400	79,540.00	0.02
314	688002	睿创微纳	2,120	78,842.80	0.02
315	300638	广和通	4,400	78,760.00	0.02
316	300115	长盈精密	7,600	78,508.00	0.02
317	300570	太辰光	5,400	78,084.00	0.02
318	600985	淮北矿业	6,100	78,080.00	0.02
319	600528	中铁工业	10,200	77,826.00	0.02
320	300590	移为通信	7,900	77,499.00	0.01
321	000401	冀东水泥	9,400	77,362.00	0.01
322	300183	东软载波	6,400	77,120.00	0.01
323	600888	新疆众和	9,400	76,986.00	0.01
324	603686	福龙马	8,900	76,807.00	0.01
325	600975	新五丰	10,800	76,788.00	0.01
326	002635	安洁科技	6,200	76,570.00	0.01
327	601101	昊华能源	12,300	76,014.00	0.01
328	300127	银河磁体	5,000	75,950.00	0.01
329	300571	平治信息	2,700	75,600.00	0.01
330	300193	佳士科技	10,300	74,984.00	0.01
331	300767	震安科技	1,600	74,800.00	0.01
332	600267	海正药业	6,700	73,834.00	0.01
333	603108	润达医疗	7,300	73,803.00	0.01
334	300457	赢合科技	4,100	72,447.00	0.01
335	300738	奥飞数据	8,200	72,242.00	0.01
336	300829	金丹科技	3,300	71,973.00	0.01
337	603601	再升科技	13,220	69,801.60	0.01
338	000030	富奥股份	14,600	64,240.00	0.01
339	301269	华大九天	701	61,645.94	0.01
340	688012	中微公司	505	49,495.05	0.01
341	002895	川恒股份	1,700	44,319.00	0.01
342	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.01
343	688019	安集科技	132	23,760.00	0.00
344	688201	信安世纪	407	23,109.46	0.00
345	600422	昆药集团	1,600	22,592.00	0.00
346	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
347	301112	信邦智能	399	12,404.91	0.00
348	603151	邦基科技	535	11,256.40	0.00
349	001238	浙江正特	374	10,797.38	0.00

350	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
351	001222	源飞宠物	434	10,758.86	0.00
352	300511	雪榕生物	1,200	7,740.00	0.00
353	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
354	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
355	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
356	603228	景旺电子	200	4,048.00	0.00
357	688357	建龙微纳	30	3,327.00	0.00
358	600416	湘电股份	100	1,880.00	0.00
359	000012	南玻 A	100	671.00	0.00
360	688396	华润微	9	473.85	0.00
361	688388	嘉元科技	1	44.85	0.00

注：根据江苏金融租赁股份有限公司于 2023 年 1 月 4 日发布的《关于变更公司证券简称的实施公告》，自 2023 年 1 月 9 日起，公司的证券简称由“江苏租赁”变更为“江苏金租”，证券代码“600901”保持不变。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300059	东方财富	8,541,300.88	0.77
2	600030	中信证券	6,064,041.00	0.55
3	601211	国泰君安	5,919,885.00	0.54
4	300760	迈瑞医疗	5,557,347.00	0.50
5	300122	智飞生物	5,313,023.09	0.48
6	601888	中国中免	5,065,999.00	0.46
7	002271	东方雨虹	4,869,965.00	0.44
8	002594	比亚迪	4,843,573.00	0.44
9	600048	保利发展	4,232,832.00	0.38
10	000858	五粮液	3,696,088.00	0.33
11	601088	中国神华	3,410,256.00	0.31
12	601225	陕西煤业	3,166,861.00	0.29
13	300014	亿纬锂能	3,144,767.00	0.28
14	600036	招商银行	3,090,364.00	0.28
15	300769	德方纳米	3,057,134.00	0.28
16	001979	招商蛇口	2,944,729.00	0.27
17	601688	华泰证券	2,871,859.00	0.26
18	000568	泸州老窖	2,853,884.00	0.26

19	600958	东方证券	2,852,292.56	0.26
20	600460	士兰微	2,847,626.31	0.26

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。

8.4.2 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	600036	招商银行	11,162,987.00	1.01
2	300059	东方财富	10,484,460.00	0.95
3	000858	五粮液	7,487,664.00	0.68
4	600519	贵州茅台	7,355,901.00	0.67
5	600030	中信证券	7,010,435.00	0.63
6	000568	泸州老窖	6,950,514.06	0.63
7	600048	保利发展	6,123,160.00	0.55
8	603259	药明康德	5,681,641.44	0.51
9	002594	比亚迪	5,552,399.00	0.50
10	002142	宁波银行	5,531,487.70	0.50
11	300760	迈瑞医疗	5,467,876.00	0.49
12	300014	亿纬锂能	5,307,364.75	0.48
13	601211	国泰君安	5,093,444.00	0.46
14	601225	陕西煤业	5,066,804.00	0.46
15	600438	通威股份	4,912,639.00	0.44
16	300122	智飞生物	4,677,605.00	0.42
17	601166	兴业银行	4,574,643.00	0.41
18	300750	宁德时代	4,304,378.00	0.39
19	601012	隆基绿能	4,286,451.40	0.39
20	600958	东方证券	4,192,492.00	0.38

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。

8.4.3 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	545,314,873.87
卖出股票的收入（成交）总额	668,853,905.82

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。

8.5 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	19,885,996.85	3.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	183,040,270.70	35.32
	其中：政策性金融债	111,567,608.23	21.53
4	企业债券	102,720,347.08	19.82
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	142,185,592.33	27.43
7	可转债（可交换债）	4,653,131.70	0.90
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	452,485,338.66	87.30

8.6 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	2128004	21 招商银行小微债 01	300,000	31,093,800.00	6.00
2	190409	19 农发 09	300,000	30,765,821.92	5.94
3	220303	22 进出 03	300,000	30,442,027.40	5.87
4	220322	22 进出 22	300,000	30,152,769.86	5.82
5	101900134	19 首钢 MTN001	200,000	20,995,266.85	4.05

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资将用于套期保值。在预期市场上涨时，可以通过买入股指期货作为股票替代，增加股票仓位，同时提高资金的利用效率；在预期市场下跌时，可以通过卖出股指期货对冲股市整体下跌的系统性风险，对投资组合的价值进行保护。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金的国债期货投资将以风险管理为原则，以套期保值为目的。管理人将按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的 21 招商银行小微债 01（2128004）的发行人，因违反账户管理规定、违反清算管理规定、违反特约商户实名制管理规定、违反支付机构备付金管理规定、违反人民币反假有关规定、占压财政存款或者资金、违反国库科目设置和使用规定等问题，于 2022 年 8 月 31 日被中国人民银行警告，没收违法所得 5.692641 万元，罚款 3423.5 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。

报告期内本基金投资的 20 国君 G5（175099）的发行人，因在保荐力同科技股份有限公司首次公开发行股票并上市过程中，未勤勉尽责对发行人主要客户环球佳美与客户法力盈的关联关系履行充分的核查程序并合并披露相关信息，涉诉专利涉及产品金额前后披露不一致且差异大，对发行人相关流水核查存在依赖发行人提供资料的情形，于 2022 年 1 月 12 日被中国证券监督管理委员会出具警示函。因投资银行类业务内部控制不完善，质控、内核把关不严，且廉洁从业风险防控机制不完善，聘请第三方廉洁从业风险防控

不到位等问题，于 2022 年 11 月 9 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。

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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	85,842.24
2	应收清算款	1,493,796.38
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,229.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,580,868.52

8.12.4 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	3,006,220.95	0.58
2	110053	苏银转债	742,302.25	0.14
3	132015	18 中油 EB	564,837.84	0.11
4	110077	洪城转债	210,674.60	0.04
5	110076	华海转债	82,898.63	0.02

8.12.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通欣享混合 A	461	573,334.72	254,054,061.62	96.12%	10,253,244.04	3.88%
海富通欣享混合 C	4,315	51,092.92	187,608,106.79	85.10%	32,857,821.73	14.90%
合计	4,776	101,501.93	441,662,168.41	91.11%	43,111,065.77	8.89%

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)。

9.2 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	海富通欣享混合 A	1,878,030.70	0.7105%
	海富通欣享混合 C	603,663.17	0.2738%
	合计	2,481,693.87	0.5119%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海富通欣享混合 A	>100
	海富通欣享混合 C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开	海富通欣享混合 A	0

开放式基金	海富通欣享混合 C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 10 日）基金份额总额	600,098,340.00	6,320.77
本报告期期初基金份额总额	634,262,370.83	266,214,049.50
本报告期基金总申购份额	254,877,387.76	198,734,049.36
减：本报告期基金总赎回份额	624,832,452.93	244,482,170.34
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	264,307,305.66	220,465,928.52

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，本基金管理人无重大人事变动。

报告期内，徐铁任本基金托管人交通银行股份有限公司资产托管部总经理。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。本年度应支付的审计费用是 60,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 2 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	基金管理人及其高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2022-08-12
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	本基金管理人被采取责令改正并暂停受理及审核公司公募基金产品募集申请三个月的行政监管措施。相关高级管理人员对此负有责任,于 2022 年 7 月 26 日被出具警示函的行政监管措施。
受到稽查或处罚等措施的原因	中国证券监督管理委员会上海监管局对公司进行检查,指出公司在业务开展和内控管理中存在不足。
管理人采取整改措施的情况 (如提出整改意见)	公司已按法律法规和监管要求及时完成了整改并验收通过。
其他	-

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
海通证券	2	219,363,161.02	18.30%	157,591.50	18.14%	-

申万宏源(原申万)	1	210,179,666.75	17.53%	153,703.10	17.69%	-
国泰君安	2	207,680,282.12	17.33%	151,880.01	17.48%	-
太平洋证券	2	191,555,793.79	15.98%	138,237.86	15.91%	-
华创证券	1	102,859,207.95	8.58%	73,936.78	8.51%	-
国金证券	1	100,696,279.72	8.40%	72,590.00	8.35%	-
招商证券	1	66,080,275.49	5.51%	47,664.26	5.49%	-
华泰证券	1	44,257,094.15	3.69%	32,365.16	3.72%	-
川财证券	1	32,108,463.68	2.68%	23,481.36	2.70%	-
兴业证券	1	15,008,288.15	1.25%	10,975.17	1.26%	-
长江证券	1	7,559,444.63	0.63%	5,528.10	0.64%	-
光大证券	1	1,303,450.71	0.11%	940.17	0.11%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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。

11.7.2 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
海通证券	65,726,630.67	39.89%	-	-	-	-
申万宏源(原申万)	28,024,285.43	17.01%	1,209,800,000.00	32.08%	-	-
国泰君安	18,115,817	10.99%	859,280,	22.79%	-	-

	.70		000.00			
太平洋证券	1,106,811.09	0.67%	617,600,000.00	16.38%	-	-
华创证券	1,591.65	0.00%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	40,235,934.53	24.42%	-	-	-	-
华泰证券	11,579,231.24	7.03%	608,400,000.00	16.13%	-	-
川财证券	-	-	241,000,000.00	6.39%	-	-
兴业证券	-	-	135,000,000.00	3.58%	-	-
长江证券	-	-	100,000,000.00	2.65%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

11.8 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	中国证券报、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基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-07
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-07
4	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-25
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-11

		网站	
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	中国证券报、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旗下部分基金新增平安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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-15
8	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-16
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增九州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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-08-04
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华宝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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-08-26
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增湘财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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-09-07
12	海富通基金管理有限公司关于海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金新增销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-09-16
13	海富通基金管理有限公司关于提醒投资者警惕虚假 APP、客服热线诈骗的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-09-21
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-09-22
15	海富通基金管理有限公司关于海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金新增销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-10-20
16	海富通基金管理有限公司关于海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金新增销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-10-27

17	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东吴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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-10-31
18	海富通基金管理有限公司关于海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金新增销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-11-03
19	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通期货股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-11-08
20	海富通基金管理有限公司关于海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金新增东莞证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-11-10
21	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台开通交通银行快捷支付业务并开展申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-11-19
22	海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购和转换转入业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-11-26
23	海富通基金管理有限公司关于海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金新增中国银河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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-11-29
24	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华泰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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-12-02
25	海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金第四次分红公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-12-21

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2022/7/26-2022/9/29	74,238,121.75	-	34,760,000.00	39,478,121.75	8.14%
	2	2022/7/25-2022/9/29	106,266,025.56	2,708,685.59	85,550,000.00	23,424,711.15	4.83%
	3	2022/10/20-2022/11/20	-	86,347,465.68	86,347,465.68	-	-
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>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；</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4、其他可能的风险。</p> <p>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。</p>							

注：申购份额包含红利再投资确认份额。

12.2 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 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1410 亿元人民币。

海富通基金管理有限公司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”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通欣享灵活配置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

13.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

13.3 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
二〇二三年三月三十一日