

**海富通策略收益债券型证券投资基金**  
**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：中信证券股份有限公司

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。

基金托管人中信证券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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	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合规守信情况的说明.....	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.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
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.....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	21
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.....	21
<b>§6 审计报告</b> .....	21
6.1 审计意见.....	22
6.2 形成审计意见的基础.....	22
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	22
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	22
<b>§7 年度财务报表</b> .....	24
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	25
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	28
<b>§8 投资组合报告</b> .....	57
8.1 期末基金资产组合情况.....	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	58
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.....	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67

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 .....	67
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 .....	68
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 .....	68
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 .....	68
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	68
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	68
8.12	投资组合报告附注 .....	68
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>70</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	70
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	70
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 .....	70
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>71</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>71</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	71
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 .....	71
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	71
11.4	基金投资策略的改变 .....	71
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	71
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 .....	72
11.6.1	管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	72
11.6.2	托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	72
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	72
11.8	其他重大事件 .....	73
<b>12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>74</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>77</b>
13.1	备查文件目录 .....	77
13.2	存放地点 .....	77
13.3	查阅方式 .....	77

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通策略收益债券型证券投资基金	
基金简称	海富通策略收益债券	
基金主代码	010260	
交易代码	010260	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 3 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	84,240,221.54 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通策略收益债券 A	海富通策略收益债券 C
下属分级基金的交易代码	010260	010261
报告期末下属分级基金的份 额总额	55,108,373.75 份	29,131,847.79 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金为债券型基金,对债券的投资比例不低于基金资产的 80%,对股票资产的投资比例不超过基金资产的 20%。在此约束下,本基金基于风险平价理论寻找股债的相对价值,从而实现股债轮动配置。</p> <p>债券投资主要采取利率策略、信用策略、收益率曲线策略以及杠杆策略,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>股票投资策略主要包括量化选股策略、风险估测模型——有效控制预期风险、交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩。</p>
业绩比较基准	中证中信证券量化债股联动稳健策略指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。
--------	---

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	杨军智
	联系电话	021-38650788	010-60834299
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	yjz@citics.com
客户服务电话		40088-40099	95548-3
传真		021-33830166	010-60834004
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	广东省深圳市福田区中心三 路8号卓越时代广场（二期） 北座
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	北京市朝阳区亮马桥路48号 中信证券大厦5层
邮政编码		200120	100125
法定代表人		杨仓兵	张佑君

### 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	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
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	普华永道中天会计师事务所 （特殊普通合伙）	上海市浦东新区东育路 588 号 前滩中心 42 楼
注册登记机构	海富通基金管理有限公司	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
--	--	---

### §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 6 月 3 日（基金合同生效日） 至 2021 年 12 月 31 日	
	海富通策略收 益债券 A	海富通策略收 益债券 C	海富通策略收益 债券 A	海富通策略收益 债券 C
本期已实 现收益	-4,257,841.54	-73,734.42	5,317,805.22	584,235.43
本期利润	-4,560,104.23	-488,147.67	4,944,333.19	684,572.94
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	-0.0339	-0.0294	0.0205	0.0221
本 期 加 权 平 均 净 值 利 润 率	-3.36%	-2.94%	2.03%	2.19%
本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率	-2.82%	-3.11%	2.13%	1.96%
3.1.2 期末数 据和指标	2022 年末		2021 年末	
	海富通策略收益 债券 A	海富通策略收益 债券 C	海富通策略收益债 券 A	海富通策略收益债 券 C
期 末 可 供 分 配 利 润	-412,935.14	-353,058.89	3,797,589.14	323,311.00

期末可供分配基金份额利润	-0.0075	-0.0121	0.0213	0.0196
期末基金资产净值	54,695,438.61	28,778,788.90	181,885,995.18	16,843,967.66
期末基金份额净值	0.9925	0.9879	1.0213	1.0196
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末	
	海富通策略收益债券 A	海富通策略收益债券 C	海富通策略收益债券 A	海富通策略收益债券 C
基金份额累计净值增长率	-0.75%	-1.21%	2.13%	1.96%

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）。

4、本基金合同生效日为 2021 年 6 月 3 日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

### 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. 海富通策略收益债券 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	-0.26%	0.13%	0.08%	0.08%	-0.34%	0.05%

月						
过去六个月	-1.98%	0.14%	-0.38%	0.08%	-1.60%	0.06%
过去一年	-2.82%	0.14%	0.82%	0.09%	-3.64%	0.05%
自基金合同生效起至今	-0.75%	0.12%	2.92%	0.08%	-3.67%	0.04%

## 2. 海富通策略收益债券 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	-0.33%	0.13%	0.08%	0.08%	-0.41%	0.05%
过去六个月	-2.13%	0.14%	-0.38%	0.08%	-1.75%	0.06%
过去一年	-3.11%	0.14%	0.82%	0.09%	-3.93%	0.05%
自基金合同生效起至今	-1.21%	0.12%	2.92%	0.08%	-4.13%	0.04%

### 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

海富通策略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的历史走势对比图

#### 1. 海富通策略收益债券 A

(2021 年 6 月 3 日至 2022 年 12 月 31 日)



## 2. 海富通策略收益债券 C

(2021 年 6 月 3 日至 2022 年 12 月 31 日)

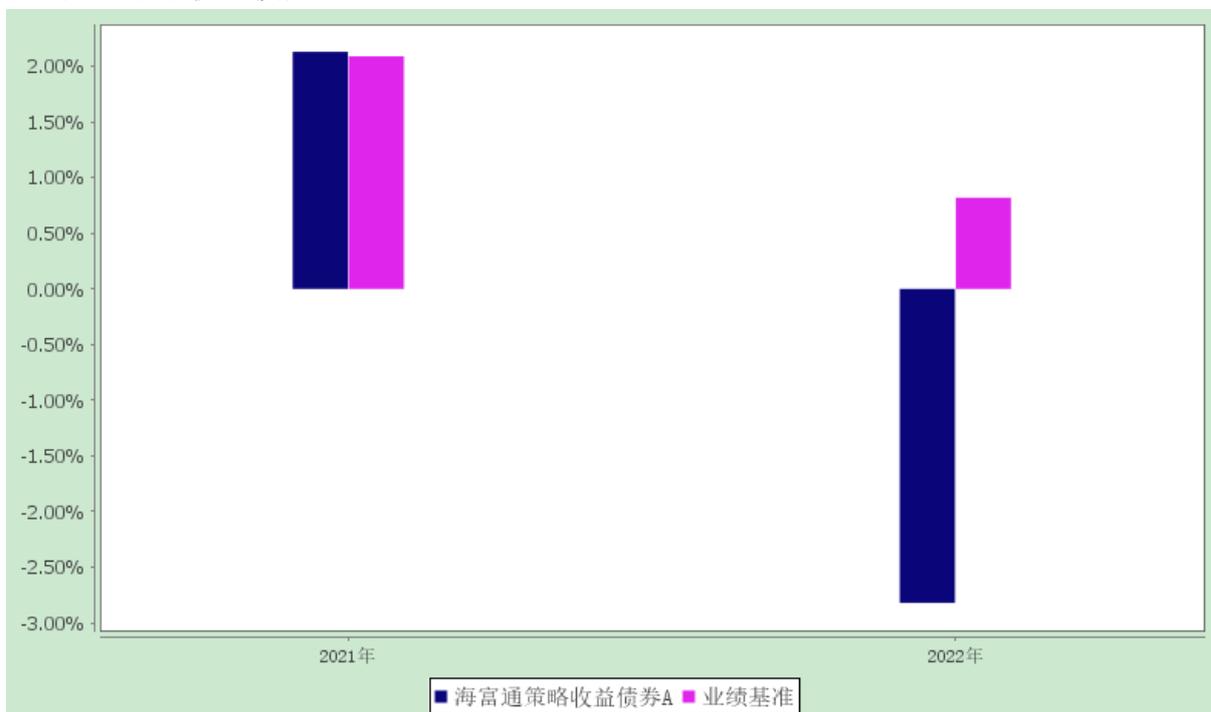


注：本基金合同于 2021 年 6 月 3 日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

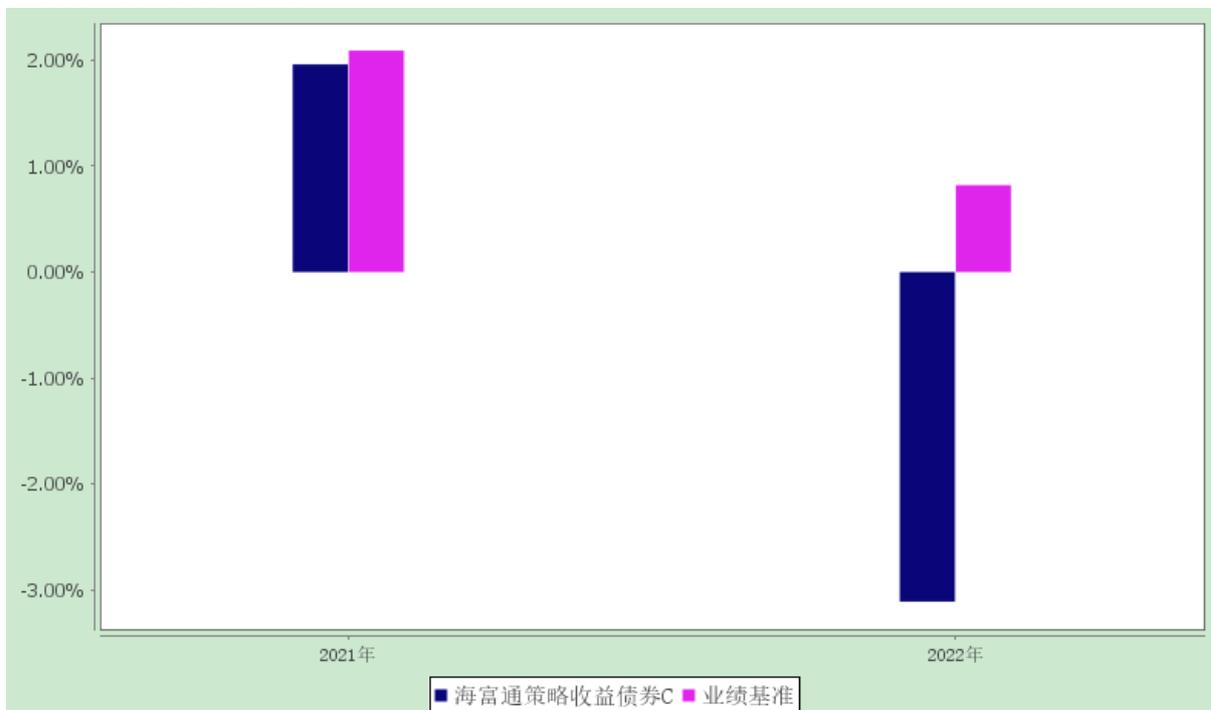
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通策略收益债券型证券投资基金  
自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1. 海富通策略收益债券 A



2. 海富通策略收益债券 C



注：图中列示的 2021 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 6 月 3 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 1、海富通策略收益债券 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	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

#### 2、海富通策略收益债券 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	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金自基金合同生效日（2021 年 6 月 3 日）至本报告期末未发生利润分配。

## §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		
陆丛凡	本基金的基金经理	2021-06-03	2022-07-21	10 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。曾任瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益定量分析师，2015 年 4 月加入海富通基金管理有限公司。2015 年 6 月至 2019 年 7 月任海富通固定收益部基金经理助理。2019 年 7 月至 2022 年 7 月任海富通上证城投债 ETF、海富通上证 10 年期地方政府债 ETF、海富通上清所短融债券的基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 5 月任海富通美元债（QDII）基金经理。2019 年 11 月至 2022 年 7 月兼任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金经理。2020 年 5 月至 2021 年 9 月兼任海富通中债 1-3 年国开债基金经理。2020 年 7 月至 2022 年 7 月兼任海富通上证投资级可转债 ETF 基金经理。2020 年 8 月至 2021 年 7 月兼任海富通中债 3-5 年国开债基金经理。2020 年 8 月至 2022 年 7 月兼任海富通中证短融 ETF 基金经理。2021 年 4 月至 2022 年 7 月兼任海富通中债 1-3 年农发基金经理。2021 年 6 月至 2022

					年 7 月兼任海富通策略收益债券基金经理。
江勇	本基金的基金经理	2021-06-03	-	11 年	<p>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。</p>
夏妍妍	本基金的基金经理	2022-07-18	-	8 年	<p>上海交通大学经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生，西门子财务租赁有限公司上海分公司高级财务分析师，2014 年加入海富通基金管理有限公司，历任固定收益投资部固定收益分析师、基金经理助理。</p>

					<p>2018 年 1 月起任海富通欣益混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2018 年 4 月至 2021 年 5 月任海富通融丰定开债券基金经理。2019 年 5 月起兼任海富通安颐收益混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通聚合纯债、海富通富祥混合的基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 9 月任海富通瑞合纯债基金经理。2019 年 10 月至 2020 年 11 月任海富通瑞丰债券基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2021 年 5 月起兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2021 年 8 月起兼任海富通瑞兴 3 个月定开债券基金经理。2022 年 7 月起兼任海富通策略收益债券基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，随着债市剧烈调整，信用利差快速走阔。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。可转债方面，2022 年转债市场一波三折，各个转债板块均录得负收益。但全年整体来看，转债指数跌幅远小于主要股指，“债底保护”的加持下超额收益显著。

2022 年，本基金债券部分配置以中高等级信用债为主，适度参与利率债交易。

权益方面，宏观经济和政策层面，2022 年海外需求逐步回落，通胀压力依然较强。美国依然处于“类滞胀”阶段，美联储缩减购债规模加速、加息预期持续上升，全球流动性进入收缩周期。相比而言，受美联储加息、俄乌冲突、疫情、地产等多重因素制约，2022 年我国经济持续超预期走弱，消费、地产疲软、三重压力凸显，本质是需求不足和

信心不足，但是全年看国内 GDP 仍实现 3% 的增长，四季度下行至 2.9%。

2022 年 A 股市场呈现“W”型走势，全年市场面临内忧外患的局面，市场走势也很震荡。年初指数开始先一路下探，其中成长板块领跌。2 月份俄乌战争全面爆发，油气和部分农产品、金属价格暴涨，全球滞胀格局加剧。随后在 4 月底经历了国内疫情反复之后，疫后复工复产开启，中下游制造率先企稳反弹。7 月份国内经济内生动能走弱，市场重新开始下行。10 月份地产融资改善，“三支箭”陆续发射，疫情防控调整开始酝酿，市场开始重新转向乐观的经济复苏预期。A 股主要指数方面，上证指数下跌 15.13%，沪深 300 下跌 21.63%，中证 800 下跌 21.32%，中小综指下跌 20.06%，创业板指下跌 29.37%。分行业看，周期行业表现相对较好，成长板块明显落后。

从全年市场内部结构看，逆周期的建筑地产和通胀交易的煤炭等大宗商品成为市场两条重要的投资主线。年初在俄乌冲突加剧全球通胀的背景下，周期板块表现尤为突出。以半导体和汽车零部件为代表的成长板块，在国内疫情爆发、上游大宗商品涨价和美联储持续加息的多重预期下，走势明显偏弱。而储能、光伏等板块景气度不受下游消费需求减弱的影响，表现更为强势。年底，由于金融地产政策的持续改善以及疫情防控政策的调整，市场开始交易复苏的预期，消费板块走势强劲。

报告期间，本基金权益仓位根据市场状态有所调整，但整体处于较低位置，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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通策略收益债券 A 净值增长率为-2.82%，同期业绩比较基准收益率为 0.82%，基金净值跑输业绩比较基准 3.64 个百分点。海富通策略收益债券 C 净值增长率为-3.11%，同期业绩比较基准收益率为 0.82%，基金净值跑输业绩比较基准 3.93 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；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。

可转债方面，从供需角度来看，根据当前待发行的转债规模供给数据，预计 2023 年全年转债供给仍将保持正常水平；公募基金和自然人增持较多，需求端承接整体良好。估值方面，2022 年转债估值高位波动，站在 2023 年 3 月的时间点来看，转债绝对价格难言低估，但是相比 2022 年年初及 7 月份性价比已有所好转，安全垫或逐渐增厚。

2023 年，本基金债券部分将精选高等级信用债作为底仓配置，并视市场环境适度参与利率债波段交易，争取获得稳定较高收益。同时，配合股票部分投资策略，做好流动性管理。

权益方面，展望 2023 年，在美国加息放缓的大背景下，预期通胀将持续回落。海外需求在 2023 年开始转弱，内需有望接力。国家 2023 年主要目标也是保障经济增长的稳定性，预期 2023 年 GDP 同比增长 5% 左右。在经济弱复苏+通胀可控的环境下，货币政策也将维持宽松，有利于成长风格。

预计 2023 年国内经济复苏将贯穿全年的投资主线，包括消费场景的复苏、工业复苏，。投资方面预计也会保持较大的投入，特别是新型基建的投入，包括国家持续推进数字经济建设和高端制造、科技的持续补短板，相应的行业扶持政策预期也会持续推出。

2023 年，本基金将继续在控制风险的基础上，积极寻找市场的结构性机会，力争跑赢市场。

#### 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估工作、机构洗钱和恐怖融资风险自评估工作。

### 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

根据基金合同的规定，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；本基金不同份额类别基金份额，其分红相互独立、互不影响；投资者不同基金交易账户设置的基金分红相互独立、互不影响。

本基金报告期内未进行过利润分配，但符合基金合同规定。

#### 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，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对海富通策略收益债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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，海富通基金管理有限公司在海富通策略收益债券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、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 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，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策略收益债券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

普华永道中天审字(2023)第 21642 号

海富通策略收益债券型证券投资基金全体基金份额持有人：

## 6.1 审计意见

### (一)我们审计的内容

我们审计了海富通策略收益债券型证券投资基金(以下简称“海富通策略收益债券基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### (二)我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了海富通策略收益债券基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 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。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。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于海富通策略收益债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

## 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

海富通策略收益债券基金的基金管理人海富通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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,基金管理人管理层负责评估海富通策略收益债券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,除非基金管理人管理层计划清算海富通策略收益债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督海富通策略收益债券基金的财务报告过程。

## 6.4 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：

(一) 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。

(二) 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。

(三) 评价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。

(四) 对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，就可能导致对海富通策略收益债券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海富通策略收益债券基金不能持续经营。

(五) 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

朱宏宇 胡莲莲

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2023 年 3 月 29 日

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：海富通策略收益债券型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	219,305.57	8,217.32
结算备付金		566,452.12	3,120,813.86
存出保证金		47,698.62	59,233.92
交易性金融资产	7.4.7.2	85,388,957.68	224,370,933.72
其中：股票投资		11,146,112.76	16,283,033.72
基金投资		-	-
债券投资		74,242,844.92	208,087,900.00
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		26,654.42	204,336.76
应收股利		-	-
应收申购款		330.00	1,630.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	4,056,096.31
资产总计		86,249,398.41	231,821,261.89
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,500,963.69	32,700,000.00
应付清算款		30,296.90	69,146.71
应付赎回款		2,073.86	36,013.53
应付管理人报酬		46,576.69	109,844.03
应付托管费		7,762.79	18,307.36
应付销售服务费		7,364.38	4,371.96

应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,861.50	16,560.71
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	178,271.09	137,054.75
负债合计		2,775,170.90	33,091,299.05
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	84,240,221.54	194,609,062.70
未分配利润	7.4.7.8	-765,994.03	4,120,900.14
净资产合计		83,474,227.51	198,729,962.84
负债和净资产总计		86,249,398.41	231,821,261.89

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 0.9925 元，C 类基金份额净值 0.9879 元。基金份额总额 84,240,221.54 份，其中 A 类基金份额 55,108,373.75 份，C 类基金份额 29,131,847.79 份。

## 7.2 利润表

会计主体：海富通策略收益债券型证券投资基金

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 6 月 3 日(基 金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-3,251,599.54	7,922,994.94
1.利息收入		93,851.14	6,116,438.12
其中：存款利息收入	7.4.7.9	72,696.82	197,187.36
债券利息收入		-	5,818,576.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		21,154.32	100,674.36
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,630,047.21	2,079,562.85
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,669,347.52	1,029,965.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-1,340,298.90	975,892.78
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	-	-

股利收益	7.4.7.14	379,599.21	73,704.43
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	-716,675.94	-273,134.52
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	1,272.47	128.49
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,796,652.36</b>	<b>2,294,088.81</b>
1. 管理人报酬		924,450.20	955,086.46
2. 托管费		154,075.03	159,181.14
3. 销售服务费		50,080.78	53,619.36
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		451,257.20	872,142.37
其中：卖出回购金融资产支出		451,257.20	872,142.37
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		14,739.15	17,025.29
8. 其他费用	7.4.7.17	202,050.00	237,034.19
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-5,048,251.90</b>	<b>5,628,906.13</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-5,048,251.90</b>	<b>5,628,906.13</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-5,048,251.90</b>	<b>5,628,906.13</b>

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海富通策略收益债券型证券投资基金

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）	194,609,062.70	-	4,120,900.14	198,729,962.84
二、本期期初净资产（基金净值）	194,609,062.70	-	4,120,900.14	198,729,962.84
三、本期增减变	-110,368,841.16	-	-4,886,894.17	-115,255,735

动额（减少以“-”号填列）				.33
（一）、综合收益总额	-	-	-5,048,251.90	-5,048,251.90
（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）	-110,368,841.16	-	161,357.73	-110,207,483.43
其中：1.基金申购款	88,305,132.41	-	683,566.67	88,988,699.08
2.基金赎回款	-198,673,973.57	-	-522,208.94	-199,196,182.51
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	84,240,221.54	-	-765,994.03	83,474,227.51
项目	上年度可比期间 2021年6月3日（基金合同生效日）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）	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	363,512,667.24	-	-	363,512,667.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-168,903,604.54	-	4,120,900.14	-164,782,704.40
（一）、综合收益总额	-	-	5,628,906.13	5,628,906.13
（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）	-168,903,604.54	-	-1,508,005.99	-170,411,610.53
其中：1.基金申购款	3,205,351.66	-	33,141.63	3,238,493.29

2.基金赎回款	-172,108,956.20	-	-1,541,147.62	-173,650,103.82
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	194,609,062.70	-	4,120,900.14	198,729,962.84

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

海富通策略收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]2158 号《关于准予海富通策略收益债券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《海富通策略收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 363,494,102.45 元，其中海富通策略收益债券 A 类为人民币 303,046,076.71 元，海富通策略收益债券 C 类为人民币 60,448,025.74 元。经向中国证监会备案，《海富通策略收益债券型证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 3 日正式生效，基金合同生效日的海富通策略收益债券 A 类基金份额总额为 303,061,293.84 份，其中认购资金利息折合 15,217.13 份基金份额，海富通策略收益债券 C 类基金份额总额为 60,451,373.40 份，其中认购资金利息折合 3,347.66 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《海富通策略收益债券型证券投资基金基金合同》和《海富通策略收益债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，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《海富通策略收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括债券（国债、央行票据、金融债、企业

债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股票（包括主板、中小板、创业板以及其他依法发行上市的股票）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资的信用债，其债项评级或主体评级或担保人评级不得低于 AA。信用评级参照国内评级机构（中债资信除外）评定的最新评级结果。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金对股票资产的投资比例不超过基金资产的 20%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证中信证券量化债股联动稳健策略指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2023 年 3 月 29 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通策略收益债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2021 年 6 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产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。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

##### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动

计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易

价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 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。由于申购和赎回引起的实收基金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

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额

确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 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确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 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：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》(财会[2022]14 号)，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和

新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 8,217.32 元、3,120,813.86 元、59,233.92 元、4,056,096.31 元、204,336.76 元和 1,630.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 12,086.48 元、3,122,358.70 元、59,263.29 元、0.00 元、204,336.76 元和 1,630.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 224,370,933.72 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 228,421,586.66 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债，金额分别为 32,700,000.00 元、69,146.71 元、36,013.53 元、109,844.03 元、18,307.36 元、4,371.96 元、29,159.23 元、-12,105.23 元和 120,000.75 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债，金额分别为 32,687,894.77 元、69,146.71 元、36,013.53 元、109,844.03 元、18,307.36 元、4,371.96 元、29,159.23 元、0.00 元和 120,000.75 元。

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

#### (b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 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：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

## 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日

活期存款	219,305.57	8,217.32
等于：本金	218,786.32	8,217.32
加：应计利息	519.25	-
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	219,305.57	8,217.32

## 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	11,618,776.10	-	11,146,112.76	-472,663.34	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	33,980,756.53	366,770.92	33,838,842.72	-508,684.73
	银行间市场	40,104,462.39	308,002.20	40,404,002.20	-8,462.39
	合计	74,085,218.92	674,773.12	74,242,844.92	-517,147.12
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	85,703,995.02	674,773.12	85,388,957.68	-989,810.46
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	15,880,815.04	-	16,283,033.72	402,218.68
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	142,510,628.13	141,879,400.00	-631,228.13
	银行间市场	66,252,625.07	66,208,500.00	-44,125.07
	合计	208,763,253.20	208,087,900.00	-675,353.20
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	224,644,068.24	-	224,370,933.72	-273,134.52

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/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未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有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	-	4,056,096.31
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	4,056,096.31

#### 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	-	0.75
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	13,271.09	29,159.23
其中：交易所市场	12,933.59	24,984.23
银行间市场	337.50	4,175.00
应付利息	-	-12,105.23
预提费用	165,000.00	120,000.00
合计	178,271.09	137,054.75

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 海富通策略收益债券 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	178,088,406.04	178,088,406.04
本期申购	57,937,844.86	57,937,844.86
本期赎回（以“-”号填列）	-180,917,877.15	-180,917,877.15
本期末	55,108,373.75	55,108,373.75

## 海富通策略收益债券 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	16,520,656.66	16,520,656.66
本期申购	30,367,287.55	30,367,287.55
本期赎回（以“-”号填列）	-17,756,096.42	-17,756,096.42
本期末	29,131,847.79	29,131,847.79

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.8 未分配利润

## 海富通策略收益债券 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	4,086,039.41	-288,450.27	3,797,589.14
本期利润	-4,257,841.54	-302,262.69	-4,560,104.23
本期基金份额交易产生的变动数	280,531.39	69,048.56	349,579.95
其中：基金申购款	1,514,788.57	-811,908.60	702,879.97
基金赎回款	-1,234,257.18	880,957.16	-353,300.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	108,729.26	-521,664.40	-412,935.14

## 海富通策略收益债券 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	350,032.42	-26,721.42	323,311.00
本期利润	-73,734.42	-414,413.25	-488,147.67
本期基金份额交易产生的变动数	-354,259.31	166,037.09	-188,222.22
其中：基金申购款	-84,748.44	65,435.14	-19,313.30
基金赎回款	-269,510.87	100,601.95	-168,908.92

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-77,961.31	-275,097.58	-353,058.89

#### 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6月3日（基金合同 生效日）至2021年12月31 日
活期存款利息收入	39,868.67	165,690.22
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	30,375.71	30,981.76
其他	2,452.44	515.38
合计	72,696.82	197,187.36

#### 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6月3日（基金合 同生效日）至2021年12 月31日
卖出股票成交总额	59,128,098.42	32,032,170.55
减：卖出股票成本总额	60,645,155.04	31,002,204.91
减：交易费用	152,290.90	-
买卖股票差价收入	-1,669,347.52	1,029,965.64

#### 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6月3日（基金合 同生效日）至2021年12 月31日
----	---------------------------------	---

债券投资收益——利息收入	5,569,241.26	-
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	-6,909,540.16	975,892.78
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	-1,340,298.90	975,892.78

#### 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6月3日(基金合同 生效日)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	417,248,991.91	458,235,601.21
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	417,415,872.87	451,358,358.74
减: 应计利息总额	6,735,327.13	5,901,349.69
减: 交易费用	7,332.07	-
买卖债券差价收入	-6,909,540.16	975,892.78

#### 7.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 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6月3日(基金合同生 效日)至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	379,599.21	73,704.43
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	379,599.21	73,704.43
----	------------	-----------

#### 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6月3日（基金合同生 效日）至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-716,675.94	-273,134.52
——股票投资	-874,882.02	402,218.68
——债券投资	158,206.08	-675,353.20
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-716,675.94	-273,134.52

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年6月3日（基金合同生 效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	1,272.47	128.49
合计	1,272.47	128.49

#### 7.4.7.17 其他费用

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6月3日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	45,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	70,000.00
证券出借违约金	-	-
其他费用	1,200.00	700.00
债券托管账户维护费	35,850.00	9,000.00
交易费用	-	107,334.19
合计	202,050.00	237,034.19

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 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、登记机构
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金托管人
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 Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东
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	上年度可比期间
-------	----	---------

	2022年1月1日至2022年12月31日		2021年6月3日（基金合同生效日）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
中信证券	115,511,214.52	100.00%	78,897,017.80	100.00%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 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
中信证券	83,840.15	100.00%	12,933.59	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021年6月3日（基金合同生效日）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
中信证券	57,030.27	100.00%	24,984.23	100.00%

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

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

#### 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6月3日（基金合 同生效日）至2021年12

		月31日
当期发生的基金应支付的管理费	924,450.20	955,086.46
其中：支付销售机构的客户维护费	50,295.09	46,980.06

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6月3日（基金合 同生效日）至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	154,075.03	159,181.14

注：支付基金托管人中信证券的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 X0.10%/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		
	海富通策略收益债券A	海富通策略收益债券C	合计
海富通	-	4,199.34	4,199.34
合计	-	4,199.34	4,199.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年6月3日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通策略收益债券A	海富通策略收益债券C	合计
海富通	-	27,143.49	27,143.49
合计	-	27,143.49	27,143.49

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 0.30%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.30% 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 X0.30%/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

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

#### 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

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

##### 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

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

#### 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自有资金投资本基金的情况

份额单位:份

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6月3日(基金合同生效日)至2021年12月31日	
	海富通策略收益债券 A	海富通策略收益债券 C	海富通策略收益债券 A	海富通策略收益债券 C
基金合同生效日 (2021年6月3日) 持有的基金份额	-	-	20,002,700.14	-
报告期初持有的基金份额	20,002,700.14	-	-	-
报告期间申购/买入 总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动 份额	-	-	-	-
减:报告期间赎回/卖	-	-	-	-

出总份额				
报告期末持有的基金份额	20,002,700.14	-	20,002,700.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	36.30%	-	11.23%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

#### 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

##### 海富通策略收益债券 A

份额单位：份

关联方名称	海富通策略收益债券A本期末 2022年12月31日		海富通策略收益债券A上年度末 2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信证券	15,000,350.00	27.22%	30,000,350.00	16.85%
合计	15,000,350.00	27.22%	30,000,350.00	16.85%

注：上述关联方投资本基金的相关费用符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

#### 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6月3日（基金合同生效日）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
中信证券	219,305.57	39,868.67	8,217.32	165,690.22

注：本基金的银行存款由基金托管人中信证券保管，存放在具有基金托管资格的工商银行，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 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

中信证券	127056	中特转债	网上配售	24	2,400.00
上年度可比期间 2021年6月3日（基金合同生效日）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
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

###### 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 2,500,963.69 元，截至 2023 年 1 月 5 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

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

### 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

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在严格控制风险的基础上，追求基金资产长期稳定增值，力争实现高于业绩比较基准的投资收益。

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 52.43%（2021 年 12 月 31 日：88.48%）。

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	10,060,550.68	25,103,500.00
合计	10,060,550.68	25,103,500.00

注：未评级部分为短期融资券。

**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	4,980,381.66	-
合计	4,980,381.66	-

**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	26,200,148.61	130,526,000.00
AAA 以下	2,527,736.57	20,198,100.00
未评级	30,474,027.40	32,260,300.00
合计	59,201,912.58	182,984,400.00

注：未评级部分为国债、政策性金融债。

**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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 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 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	219,305.57	-	-	-	219,305.57
结算备付金	566,452.12	-	-	-	566,452.12
存出保证金	47,698.62	-	-	-	47,698.62
交易性金融资产	25,216,061.11	37,678,850.80	11,347,933.01	11,146,112.76	85,388,957.68
应收清算款	-	-	-	26,654.42	26,654.42
应收申购款	-	-	-	330.00	330.00
资产总计	26,049,517.42	37,678,850.80	11,347,933.01	11,173,097.18	86,249,398.41
负债					
卖出回购金融资产款	2,500,963.69	-	-	-	2,500,963.69
应付清算款	-	-	-	30,296.90	30,296.90
应付赎回款	-	-	-	2,073.86	2,073.86

应付管理人报酬	-	-	-	46,576.69	46,576.69
应付托管费	-	-	-	7,762.79	7,762.79
应付销售服务费	-	-	-	7,364.38	7,364.38
应交税费	-	-	-	1,861.50	1,861.50
其他负债	-	-	-	178,271.09	178,271.09
负债总计	2,500,963.69	-	-	274,207.21	2,775,170.90
利率敏感度缺口	23,548,553.73	37,678,850.80	11,347,933.01	10,898,889.97	83,474,227.51
<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	8,217.32	-	-	-	8,217.32
结算备付金	3,120,813.86	-	-	-	3,120,813.86
存出保证金	59,233.92	-	-	-	59,233.92
交易性金融资产	126,534,800.00	60,395,000.00	21,158,100.00	16,283,033.72	224,370,933.72
应收清算款	-	-	-	204,336.76	204,336.76
应收申购款	-	-	-	1,630.00	1,630.00
其他资产	-	-	-	4,056,096.31	4,056,096.31
资产总计	129,723,065.10	60,395,000.00	21,158,100.00	20,545,096.79	231,821,261.89
负债					
卖出回购金融资产款	32,700,000.00	-	-	-	32,700,000.00
应付清算款	-	-	-	69,146.71	69,146.71
应付赎回款	-	-	-	36,013.53	36,013.53
应付管理人报酬	-	-	-	109,844.03	109,844.03
应付托管费	-	-	-	18,307.36	18,307.36
应付销售服务费	-	-	-	4,371.96	4,371.96
应交税费	-	-	-	16,560.71	16,560.71
其他负债	-	-	-	137,054.75	137,054.75
负债总计	32,700,000.00	-	-	391,299.05	33,091,299.05
利率敏感度缺口	97,023,065.10	60,395,000.00	21,158,100.00	20,153,797.74	198,729,962.84

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

或到期日孰早予以分类。

#### 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	-352,813.79	-1,079,852.79
市场利率下降 25 个基点	356,761.16	1,092,351.84	

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，对股票资产的投资比例不超过基金资产的 20%，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 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	11,146,112.76	13.35	16,283,033.72	8.19
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	11,146,112.76	13.35	16,283,033.72	8.19

#### 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%	553,555.90	655,111.15
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-553,555.90	-655,111.15

### 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的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 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	14,546,606.71	16,283,033.72
第二层次	70,842,350.97	208,087,900.00
第三层次	-	-
合计	85,388,957.68	224,370,933.72

##### 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债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃

日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 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，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §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	11,146,112.76	12.92
	其中：股票	11,146,112.76	12.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	74,242,844.92	86.08
	其中：债券	74,242,844.92	86.08
	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	785,757.69	0.91

8	其他各项资产	74,683.04	0.09
9	合计	86,249,398.41	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	146,198.00	0.18
B	采矿业	240,351.00	0.29
C	制造业	6,912,497.03	8.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	334,662.40	0.40
E	建筑业	372,554.00	0.45
F	批发和零售业	257,075.00	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	512,872.00	0.61
H	住宿和餐饮业	24,800.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	425,272.13	0.51
J	金融业	1,216,031.00	1.46
K	房地产业	304,836.00	0.37
L	租赁和商务服务业	211,582.20	0.25
M	科学研究和技术服务业	147,144.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	30,668.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	9,570.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	11,146,112.76	13.35

### 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	600919	江苏银行	43,200	314,928.00	0.38
2	002475	立讯精密	5,900	187,325.00	0.22
3	000002	万科 A	9,500	172,900.00	0.21
4	300601	康泰生物	5,040	158,911.20	0.19
5	002352	顺丰控股	2,700	155,952.00	0.19
6	000001	平安银行	11,400	150,024.00	0.18
7	600153	建发股份	10,500	143,325.00	0.17
8	601318	中国平安	2,700	126,900.00	0.15
9	600036	招商银行	3,400	126,684.00	0.15
10	000937	冀中能源	16,600	105,576.00	0.13
11	300014	亿纬锂能	1,200	105,480.00	0.13
12	600079	人福医药	4,400	105,116.00	0.13
13	601688	华泰证券	8,200	104,468.00	0.13
14	688268	华特气体	1,336	99,198.00	0.12
15	605189	富春染织	5,000	92,400.00	0.11
16	000858	五粮液	500	90,345.00	0.11
17	688029	南微医学	1,093	89,768.09	0.11
18	603300	华铁应急	14,080	89,267.20	0.11
19	000090	天健集团	16,200	88,452.00	0.11
20	600901	江苏租赁	15,800	86,584.00	0.10
21	002011	盾安环境	6,500	85,345.00	0.10
22	002597	金禾实业	2,600	84,500.00	0.10
23	300873	海晨股份	3,100	84,165.00	0.10
24	603035	常熟汽饰	3,900	82,875.00	0.10
25	688518	联赢激光	2,771	80,940.91	0.10
26	601717	郑煤机	7,200	80,352.00	0.10
27	300750	宁德时代	200	78,684.00	0.09
28	000933	神火股份	5,100	76,296.00	0.09
29	688016	心脉医疗	400	75,616.00	0.09
30	002142	宁波银行	2,240	72,688.00	0.09
31	002595	豪迈科技	3,100	71,765.00	0.09
32	002100	天康生物	8,600	71,466.00	0.09
33	300122	智飞生物	800	70,264.00	0.08
34	300059	东方财富	3,600	69,840.00	0.08
35	600483	福能股份	6,600	69,828.00	0.08
36	601668	中国建筑	12,800	69,504.00	0.08
37	300481	濮阳惠成	2,600	69,498.00	0.08
38	002555	三七互娱	3,800	68,780.00	0.08
39	600048	保利发展	4,500	68,085.00	0.08

40	603129	春风动力	600	67,512.00	0.08
41	600598	北大荒	4,800	66,048.00	0.08
42	603237	五芳斋	1,400	66,010.00	0.08
43	002517	恺英网络	10,000	65,600.00	0.08
44	002460	赣锋锂业	920	63,949.20	0.08
45	603896	寿仙谷	1,600	63,456.00	0.08
46	688063	派能科技	200	63,130.00	0.08
47	603180	金牌厨柜	2,200	63,074.00	0.08
48	001323	慕思股份	1,900	62,928.00	0.08
49	600580	卧龙电驱	5,000	62,300.00	0.07
50	301115	建科股份	2,500	62,075.00	0.07
51	002984	森麒麟	2,000	61,580.00	0.07
52	000726	鲁泰 A	8,300	61,254.00	0.07
53	605368	蓝天燃气	4,900	60,515.00	0.07
54	688296	和达科技	2,299	59,475.13	0.07
55	000785	居然之家	14,500	59,305.00	0.07
56	601615	明阳智能	2,300	58,098.00	0.07
57	688007	光峰科技	2,329	57,898.94	0.07
58	603348	文灿股份	1,000	57,570.00	0.07
59	300073	当升科技	1,000	56,400.00	0.07
60	000902	新洋丰	4,800	55,248.00	0.07
61	002511	中顺洁柔	4,000	54,960.00	0.07
62	603612	索通发展	2,100	54,642.00	0.07
63	603105	芯能科技	3,700	54,501.00	0.07
64	000807	云铝股份	4,900	54,488.00	0.07
65	600502	安徽建工	11,100	53,280.00	0.06
66	300673	佩蒂股份	3,000	52,950.00	0.06
67	000913	钱江摩托	2,800	51,744.00	0.06
68	688599	天合光能	800	51,008.00	0.06
69	603809	豪能股份	4,600	48,944.00	0.06
70	601699	潞安环能	2,900	48,865.00	0.06
71	002179	中航光电	840	48,518.40	0.06
72	600219	南山铝业	14,800	48,396.00	0.06
73	600879	航天电子	7,100	48,280.00	0.06
74	603987	康德莱	3,500	48,230.00	0.06
75	300761	立华股份	1,400	47,950.00	0.06
76	002752	昇兴股份	9,200	47,840.00	0.06
77	300258	精锻科技	4,100	47,683.00	0.06
78	002484	江海股份	2,100	46,977.00	0.06
79	002567	唐人神	6,600	46,728.00	0.06
80	002043	兔宝宝	4,300	46,698.00	0.06
81	603565	中谷物流	3,200	46,528.00	0.06
82	601369	陕鼓动力	4,000	45,840.00	0.05
83	000012	南玻 A	6,800	45,628.00	0.05

84	300775	三角防务	1,200	45,600.00	0.05
85	688778	厦钨新能	586	45,520.48	0.05
86	300476	胜宏科技	3,500	45,290.00	0.05
87	002371	北方华创	200	45,060.00	0.05
88	688556	高测股份	600	45,012.00	0.05
89	002039	黔源电力	2,920	44,442.40	0.05
90	601231	环旭电子	2,700	43,821.00	0.05
91	601888	中国中免	200	43,206.00	0.05
92	601137	博威合金	2,900	42,949.00	0.05
93	002273	水晶光电	3,600	42,444.00	0.05
94	600037	歌华有线	5,200	42,328.00	0.05
95	300752	隆利科技	2,500	42,025.00	0.05
96	000776	广发证券	2,700	41,823.00	0.05
97	603876	鼎胜新材	1,000	41,040.00	0.05
98	300443	金雷股份	1,000	40,280.00	0.05
99	300496	中科创达	400	40,120.00	0.05
100	002839	张家港行	8,700	40,107.00	0.05
101	600150	中国船舶	1,800	40,104.00	0.05
102	000400	许继电气	2,000	39,940.00	0.05
103	601298	青岛港	7,100	39,831.00	0.05
104	688023	安恒信息	200	39,600.00	0.05
105	002812	恩捷股份	300	39,387.00	0.05
106	600008	首创环保	13,800	39,054.00	0.05
107	600481	双良节能	3,000	38,820.00	0.05
108	600522	中天科技	2,400	38,760.00	0.05
109	003006	百亚股份	2,800	38,668.00	0.05
110	600612	老凤祥	900	38,520.00	0.05
111	300748	金力永磁	1,300	38,038.00	0.05
112	301177	迪阿股份	600	37,788.00	0.05
113	000921	海信家电	2,800	36,876.00	0.04
114	002756	永兴材料	400	36,868.00	0.04
115	000333	美的集团	700	36,260.00	0.04
116	603043	广州酒家	1,400	36,148.00	0.04
117	000065	北方国际	4,300	35,475.00	0.04
118	600325	华发股份	3,900	35,334.00	0.04
119	601211	国泰君安	2,600	35,334.00	0.04
120	300806	斯迪克	1,500	35,175.00	0.04
121	603600	永艺股份	3,600	35,100.00	0.04
122	603127	昭衍新药	600	35,046.00	0.04
123	603713	密尔克卫	300	34,998.00	0.04
124	000049	德赛电池	800	34,784.00	0.04
125	688559	海目星	600	34,704.00	0.04
126	002422	科伦药业	1,300	34,593.00	0.04
127	603011	合锻智能	4,200	34,314.00	0.04

128	002258	利尔化学	1,900	34,124.00	0.04
129	603690	至纯科技	900	34,056.00	0.04
130	002993	奥海科技	1,000	34,010.00	0.04
131	603368	柳药集团	1,800	33,606.00	0.04
132	601390	中国中铁	5,900	32,804.00	0.04
133	600461	洪城环境	4,700	32,665.00	0.04
134	601869	长飞光纤	1,000	32,630.00	0.04
135	000977	浪潮信息	1,500	32,280.00	0.04
136	300087	荃银高科	2,000	32,200.00	0.04
137	002154	报喜鸟	7,800	32,136.00	0.04
138	601669	中国电建	4,500	31,860.00	0.04
139	603185	上机数控	300	31,755.00	0.04
140	002929	润建股份	800	31,408.00	0.04
141	601899	紫金矿业	3,100	31,000.00	0.04
142	601128	常熟银行	4,100	30,955.00	0.04
143	002483	润邦股份	6,100	30,683.00	0.04
144	002034	旺能环境	1,700	30,668.00	0.04
145	601877	正泰电器	1,100	30,470.00	0.04
146	600496	精工钢构	7,700	30,415.00	0.04
147	002444	巨星科技	1,600	30,368.00	0.04
148	603236	移远通信	300	30,246.00	0.04
149	002111	威海广泰	3,000	29,910.00	0.04
150	300957	贝泰妮	200	29,848.00	0.04
151	601567	三星医疗	2,200	29,656.00	0.04
152	002821	凯莱英	200	29,600.00	0.04
153	002867	周大生	2,100	29,463.00	0.04
154	603871	嘉友国际	1,300	29,380.00	0.04
155	600820	隧道股份	5,500	28,985.00	0.03
156	600487	亨通光电	1,900	28,614.00	0.03
157	600330	天通股份	2,700	28,458.00	0.03
158	603556	海兴电力	1,600	28,160.00	0.03
159	002013	中航机电	2,800	28,140.00	0.03
160	000963	华东医药	600	28,080.00	0.03
161	600160	巨化股份	1,800	27,918.00	0.03
162	300394	天孚通信	1,100	27,885.00	0.03
163	002508	老板电器	1,000	27,760.00	0.03
164	600873	梅花生物	2,700	27,486.00	0.03
165	000708	中信特钢	1,600	27,456.00	0.03
166	600803	新奥股份	1,700	27,370.00	0.03
167	600970	中材国际	3,200	27,264.00	0.03
168	300416	苏试试验	900	27,135.00	0.03
169	300121	阳谷华泰	2,600	26,936.00	0.03
170	301004	嘉益股份	900	26,802.00	0.03
171	300305	裕兴股份	1,800	26,658.00	0.03

172	605123	派克新材	200	26,580.00	0.03
173	603806	福斯特	400	26,576.00	0.03
174	300685	艾德生物	1,000	26,450.00	0.03
175	300232	洲明科技	4,800	26,352.00	0.03
176	300856	科思股份	500	26,075.00	0.03
177	300811	铂科新材	300	25,941.00	0.03
178	600060	海信视像	1,900	25,726.00	0.03
179	603681	永冠新材	1,200	25,656.00	0.03
180	000811	冰轮环境	2,300	25,530.00	0.03
181	300494	盛天网络	1,700	25,381.00	0.03
182	002314	南山控股	6,600	25,212.00	0.03
183	002318	久立特材	1,500	24,960.00	0.03
184	600258	首旅酒店	1,000	24,800.00	0.03
185	600585	海螺水泥	900	24,642.00	0.03
186	600063	皖维高新	4,200	24,570.00	0.03
187	600888	新疆众和	3,000	24,570.00	0.03
188	603885	吉祥航空	1,500	24,270.00	0.03
189	300643	万通智控	1,700	24,174.00	0.03
190	300504	天邑股份	1,500	24,075.00	0.03
191	002085	万丰奥威	4,000	23,800.00	0.03
192	600380	健康元	2,100	23,709.00	0.03
193	300360	炬华科技	1,600	23,280.00	0.03
194	600428	中远海特	3,900	23,244.00	0.03
195	688196	卓越新能	400	23,208.00	0.03
196	300146	汤臣倍健	1,000	22,820.00	0.03
197	301087	可孚医疗	600	21,888.00	0.03
198	000932	华菱钢铁	4,600	21,620.00	0.03
199	300595	欧普康视	600	21,420.00	0.03
200	601816	京沪高铁	4,300	21,156.00	0.03
201	301076	新瀚新材	900	20,817.00	0.02
202	600885	宏发股份	600	20,046.00	0.02
203	603019	中科曙光	900	19,926.00	0.02
204	001228	永泰运	400	19,804.00	0.02
205	600642	申能股份	3,600	19,764.00	0.02
206	600497	驰宏锌锗	3,900	19,734.00	0.02
207	600886	国投电力	1,800	19,494.00	0.02
208	688299	长阳科技	1,116	18,246.60	0.02
209	002915	中欣氟材	900	18,171.00	0.02
210	002507	涪陵榨菜	700	18,039.00	0.02
211	688399	硕世生物	200	17,542.00	0.02
212	300019	硅宝科技	1,100	17,292.00	0.02
213	300130	新国都	1,400	16,898.00	0.02
214	600779	水井坊	200	16,884.00	0.02
215	603610	麒盛科技	1,400	16,870.00	0.02

216	600985	淮北矿业	1,300	16,640.00	0.02
217	603259	药明康德	200	16,200.00	0.02
218	603345	安井食品	100	16,188.00	0.02
219	300725	药石科技	200	16,100.00	0.02
220	688550	瑞联新材	345	16,080.45	0.02
221	601058	赛轮轮胎	1,600	16,032.00	0.02
222	600926	杭州银行	1,200	15,696.00	0.02
223	301179	泽宇智能	400	15,268.00	0.02
224	688300	联瑞新材	313	15,236.84	0.02
225	600316	洪都航空	600	15,114.00	0.02
226	601598	中国外运	3,900	14,976.00	0.02
227	300777	中简科技	300	14,745.00	0.02
228	301190	善水科技	800	14,384.00	0.02
229	002611	东方精工	3,500	14,210.00	0.02
230	002985	北摩高科	300	13,530.00	0.02
231	002271	东方雨虹	400	13,428.00	0.02
232	300575	中旗股份	600	13,122.00	0.02
233	601021	春秋航空	200	12,850.00	0.02
234	300363	博腾股份	300	12,255.00	0.01
235	600009	上海机场	200	11,542.00	0.01
236	600236	桂冠电力	2,000	11,520.00	0.01
237	600582	天地科技	2,100	10,920.00	0.01
238	600548	深高速	1,200	10,776.00	0.01
239	603558	健盛集团	1,300	10,712.00	0.01
240	000989	九芝堂	1,200	10,572.00	0.01
241	600486	扬农化工	100	10,390.00	0.01
242	600021	上海电力	1,000	10,010.00	0.01
243	002884	凌霄泵业	600	9,966.00	0.01
244	002045	国光电器	800	9,912.00	0.01
245	002384	东山精密	400	9,892.00	0.01
246	688166	博瑞医药	431	9,727.67	0.01
247	002498	汉缆股份	2,300	9,614.00	0.01
248	600373	中文传媒	1,000	9,570.00	0.01
249	002601	龙佰集团	500	9,460.00	0.01
250	600729	重庆百货	400	9,460.00	0.01
251	002132	恒星科技	2,100	9,324.00	0.01
252	000983	山西焦煤	800	9,320.00	0.01
253	300351	永贵电器	600	9,282.00	0.01
254	600968	海油发展	3,200	9,216.00	0.01
255	300369	绿盟科技	900	9,189.00	0.01
256	002777	久远银海	600	9,000.00	0.01
257	600990	四创电子	300	8,940.00	0.01
258	003019	宸展光电	400	8,524.00	0.01
259	002487	大金重工	200	8,274.00	0.01

260	002649	博彦科技	800	8,232.00	0.01
261	300787	海能实业	300	8,151.00	0.01
262	603228	景旺电子	400	8,096.00	0.01
263	002478	常宝股份	1,400	7,882.00	0.01
264	688087	英科再生	219	7,610.25	0.01
265	300684	中石科技	500	7,405.00	0.01
266	300938	信测标准	200	6,688.00	0.01
267	603305	旭升集团	200	6,448.00	0.01
268	301302	华如科技	100	6,403.00	0.01
269	603658	安图生物	100	6,185.00	0.01
270	000789	万年青	700	5,978.00	0.01
271	002402	和而泰	400	5,832.00	0.01
272	300982	苏文电能	100	4,930.00	0.01
273	002419	天虹股份	700	4,816.00	0.01
274	603866	桃李面包	300	4,620.00	0.01
275	600131	国网信通	300	4,488.00	0.01
276	002698	博实股份	300	4,203.00	0.01
277	002139	拓邦股份	400	4,148.00	0.00
278	002543	万和电气	400	3,408.00	0.00
279	600064	南京高科	500	3,305.00	0.00
280	600018	上港集团	600	3,204.00	0.00
281	300569	天能重工	200	1,610.00	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	002539	云图控股	831,953.00	0.42
2	300601	康泰生物	416,559.00	0.21
3	002555	三七互娱	387,564.00	0.20
4	300122	智飞生物	386,068.00	0.19
5	600153	建发股份	380,864.00	0.19
6	600519	贵州茅台	369,429.00	0.19
7	300398	飞凯材料	360,396.00	0.18
8	688598	金博股份	346,075.47	0.17

9	300481	濮阳惠成	307,715.00	0.15
10	002043	兔宝宝	302,976.00	0.15
11	600325	华发股份	296,900.00	0.15
12	601186	中国铁建	288,972.00	0.15
13	688201	信安世纪	287,670.16	0.14
14	600908	无锡银行	284,006.00	0.14
15	601339	百隆东方	275,983.00	0.14
16	600383	金地集团	273,656.00	0.14
17	300502	新易盛	268,614.00	0.14
18	601318	中国平安	268,409.00	0.14
19	000932	华菱钢铁	267,979.00	0.13
20	600422	昆药集团	267,198.00	0.13

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	002539	云图控股	897,202.00	0.45
2	600519	贵州茅台	560,361.00	0.28
3	002142	宁波银行	430,166.10	0.22
4	600438	通威股份	401,017.00	0.20
5	300481	濮阳惠成	378,838.00	0.19
6	688598	金博股份	359,050.96	0.18
7	601225	陕西煤业	353,441.00	0.18
8	300398	飞凯材料	351,214.00	0.18
9	300059	东方财富	335,711.00	0.17
10	601677	明泰铝业	324,935.00	0.16
11	300122	智飞生物	319,106.00	0.16
12	600089	特变电工	316,921.00	0.16
13	600886	国投电力	314,785.00	0.16
14	600325	华发股份	310,945.00	0.16
15	600422	昆药集团	305,645.00	0.15
16	601668	中国建筑	303,694.80	0.15
17	300737	科顺股份	303,377.00	0.15
18	601009	南京银行	302,509.00	0.15
19	688201	信安世纪	301,681.19	0.15
20	002727	一心堂	299,750.00	0.15

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	56,383,116.10
卖出股票的收入（成交）总额	59,128,098.42

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	10,175,128.77	12.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	25,363,069.86	30.38
	其中：政策性金融债	20,298,898.63	24.32
4	企业债券	20,263,220.00	24.27
5	企业短期融资券	10,060,550.68	12.05
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,400,493.95	4.07
8	同业存单	4,980,381.66	5.97
9	其他	-	-
10	合计	74,242,844.92	88.94

**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	210209	21 国开 09	100,000	10,203,753.42	12.22
2	019656	21 国债 08	100,000	10,175,128.77	12.19
3	210218	21 国开 18	100,000	10,095,145.21	12.09
4	149538	21 招路 02	50,000	5,093,062.74	6.10
5	188341	21 宁铁 13	50,000	5,076,940.82	6.08

### 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

根据合同规定，本基金不投资股指期货。

### 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

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 报告期内本基金投资的 22 交通银行小微债 01 (2228037)的发行人，因监管标准化数据 (EAST) 系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，于 2022 年 3 月 21 日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 420 万元的行政处罚。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为全国大型银行，综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**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	47,698.62
2	应收清算款	26,654.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	330.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	74,683.04

## 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	113060	浙 22 转债	538,759.57	0.65
2	127006	敖东转债	468,964.05	0.56
3	127049	希望转 2	333,997.81	0.40
4	110086	精工转债	327,381.04	0.39
5	110081	闻泰转债	323,156.47	0.39
6	110087	天业转债	278,038.98	0.33
7	113621	彤程转债	258,525.21	0.31
8	127050	麒麟转债	253,371.78	0.30
9	123090	三诺转债	251,028.22	0.30
10	128141	旺能转债	247,005.75	0.30
11	128122	兴森转债	120,265.07	0.14

## 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的情况。

## §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
海富通策略收益债券 A	31	1,777,689.48	55,002,950.14	99.81%	105,423.61	0.19%
海富通策略收益债券 C	1,538	18,941.38	24,995,001.00	85.80%	4,136,846.79	14.20%
合计	1,569	53,690.39	79,997,951.14	94.96%	4,242,270.40	5.04%

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	海富通策略收益债券 A	0.00	0.0000%
	海富通策略收益债券 C	50.01	0.0002%
	合计	50.01	0.0001%

### 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	海富通策略收益债券 A	0
	海富通策略收益债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通策略收益债券 A	0
	海富通策略收益债券 C	0
	合计	0

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	海富通策略收益债券 A	海富通策略收益债券 C
基金合同生效日（2021 年 6 月 3 日）基金份额总额	303,061,293.84	60,451,373.40
本报告期期初基金份额总额	178,088,406.04	16,520,656.66
本报告期基金总申购份额	57,937,844.86	30,367,287.55
减：本报告期基金总赎回份额	180,917,877.15	17,756,096.42
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	55,108,373.75	29,131,847.79

注：总申购份额含转换入份额，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，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**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 45,000.00 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	
中信证券	2	115,511,214.52	100.00%	83,840.15	100.00%	-

注：1、本基金本报告期内租用券商交易单元没有发生变更。

#### 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
中信证券	255,094,193.80	100.00%	3,479,120,000.00	100.00%	-	-

### 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部分基金新增宁波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	2022-04-13
3	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
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海攀赢基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	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	2022-07-15
5	海富通策略收益债券型证券投资基金基金经理变更公告	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	2022-07-20
6	海富通策略收益债券型证券投资基金基	中国证券报、基金管	2022-07-22

	金经理变更公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泰信财富基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	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	2022-08-02
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	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	2022-08-24
9	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
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行招赢通为销售平台的公告	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	2022-09-26
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通证券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	2022-11-03
12	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
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增杭州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	2022-11-23
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	2022-12-01
15	海富通基金管理有限公司关于调整旗下部分基金场外份额单笔申购、单笔追加申购、单笔定期定额申购、单笔赎回和持有份额最低数量限制的公告	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	2022-12-13

## 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	2022/8/19-2022/12/31	-	24,995,001.00	-	24,995,001.00	29.67%
	2	2022/8/1-2022/8/10,2022/8/12-2022/8/18,2022/10/13-2022/12/31	20,002,700.14	-	-	20,002,700.14	23.74%
	3	2022/8/1-2022/8/10,2022/8/12-2022/8/18,2022/10/13-2022/12/31	19,999,900.00	-	-	19,999,900.00	23.74%
	4	2022/8/1-2022/8/10,2022/8/12-2022/8/18,2022/10/13-2022/10/31	30,000,350.00	-	15,000,000.00	15,000,350.00	17.81%
	5	2022/8/1-2022/8/10	19,999,900.00	-	19,999,900.00	-	-
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>							

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

### 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