

海富通富泽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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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.....	7
§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.....	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
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
§5 托管人报告.....	21
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	21
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	22
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.....	22
§6 审计报告.....	22
6.1 审计意见.....	22
6.2 形成审计意见的基础.....	22
6.3 其他信息.....	23
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任.....	23
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任.....	23
§7 年度财务报表.....	24
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	26
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	27
7.4 报表附注.....	29
§8 投资组合报告.....	64
8.1 期末基金资产组合情况.....	64
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	65
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.....	66
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	75

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	77
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	77
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	78
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	78
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	78
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	78
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
8.12 投资组合报告附注	78
§9 基金份额持有人信息	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
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	80
§10 开放式基金份额变动	80
§11 重大事件揭示	81
11.1 基金份额持有人大会决议	81
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	81
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
11.4 基金投资策略的改变	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	81
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	81
11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	81
11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	82
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	82
11.8 其他重大事件	83
12 影响投资者决策的其他重要信息	85
§13 备查文件目录	87
13.1 备查文件目录	87
13.2 存放地点	87
13.3 查阅方式	87

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通富泽混合型证券投资基金	
基金简称	海富通富泽混合	
基金主代码	009156	
交易代码	009156	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 6 月 22 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	192,470,315.78 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
下属分级基金的交易代码	009156	009157
报告期末下属分级基金的份 额总额	162,273,200.70 份	30,197,115.08 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制下跌风险的前提下,通过量化选股和主动债券投资相结合的投资策略,力争实现战胜业绩比较基准的目标,追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金以在风险可控下寻求稳定的超额收益作为投资理念,采用稳健的大类资产配置和股票投资策略。本基金通过对宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究,同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素,兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动,结合投资时钟理论,确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例。并随着各类证券风险收益特征的相对变化,动态调整组合中各类资产的比例,或借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应,以规避或分散市场风险。股票投资方面,本基金将采用量化选股方法构建股票组合,以价值投资作为

	核心理念，通过量化模型构建多因子 alpha 模型。本基金投资策略还包括债券投资组合策略、资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略、流通受限证券投资策略。
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	朱萍
	联系电话	021-38650788	021-61618888
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	Zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95528
传真		021-33830166	021-63602540
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	上海市中山东一路12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	上海市北京东路689号
邮政编码		200120	200001
法定代表人		杨仓兵	郑杨

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	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		2020 年 6 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
本期已实现收益	5,474,619.97	1,677,111.32	37,824,427.62	15,641,827.66	16,015,839.33	7,388,485.07
本期利润	-15,628,524.51	-5,394,636.93	37,270,225.92	16,153,568.05	34,549,700.75	15,917,563.34
加权平均基金份额本期利润	-0.0560	-0.0837	0.0575	0.0585	0.0471	0.0449

本期加权平均净值利润率	-5.18%	-7.79%	5.38%	5.49%	4.61%	4.40%
本期基金份额净值增长率	-4.54%	-4.92%	5.74%	5.32%	4.58%	4.36%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
期末可供分配利润	9,024,971.33	1,357,799.86	36,792,996.72	14,042,775.49	25,163,418.02	10,489,149.55
期末可供分配基金份额利润	0.0556	0.0450	0.0909	0.0841	0.0246	0.0225
期末基金资产净值	171,298,172.03	31,554,914.94	447,782,326.20	183,464,207.32	1,069,015,363.84	487,220,409.28
期末基金份额净值	1.0556	1.0450	1.1058	1.0991	1.0458	1.0436
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
基金份额累计净值增	5.56%	4.50%	10.58%	9.91%	4.58%	4.36%

长率						
----	--	--	--	--	--	--

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 2020 年 6 月 22 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. 海富通富泽混合 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	-1.47%	0.22%	0.61%	0.29%	-2.08%	-0.07%
过去六个月	-4.12%	0.26%	-2.38%	0.24%	-1.74%	0.02%
过去一年	-4.54%	0.29%	-3.57%	0.27%	-0.97%	0.02%
自基金合同生效起至今	5.56%	0.26%	0.44%	0.24%	5.12%	0.02%

2. 海富通富泽混合 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	-1.55%	0.22%	0.61%	0.29%	-2.16%	-0.07%
过去六个月	-4.31%	0.26%	-2.38%	0.24%	-1.93%	0.02%

过去一年	-4.92%	0.29%	-3.57%	0.27%	-1.35%	0.02%
自基金合同生效起至今	4.50%	0.26%	0.44%	0.24%	4.06%	0.02%

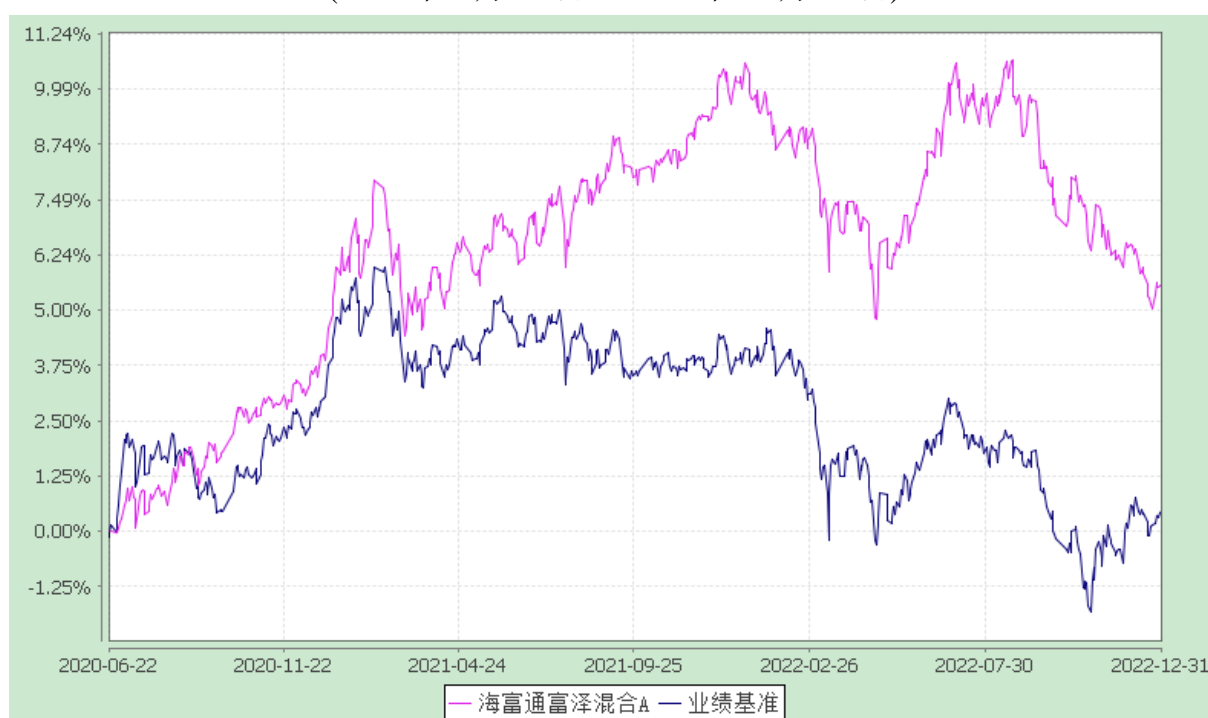
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通富泽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. 海富通富泽混合 A

(2020 年 6 月 22 日至 2022 年 12 月 31 日)



2. 海富通富泽混合 C

(2020 年 6 月 22 日至 2022 年 12 月 31 日)



注：本基金合同于2020年6月22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

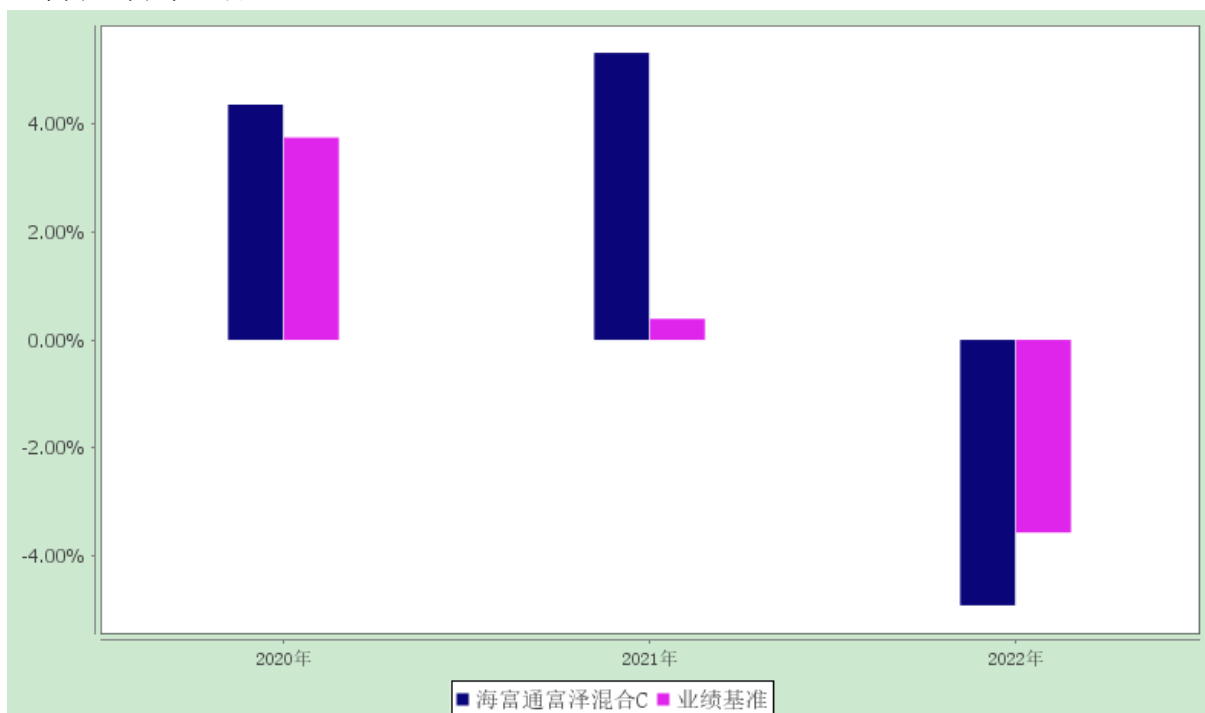
海富通富泽混合型证券投资基金

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. 海富通富泽混合 A



2. 海富通富泽混合 C



注：图中列示的 2020 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 6 月 22 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、海富通富泽混合 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	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

2、海富通富泽混合 C：

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分	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

	红数				
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金过去三年未发生利润分配。

§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		
张靖爽	本基金的基金经理；债券基金部副总监。	2020-06-22	-	12 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中银基金管理有限公司研究员，交银施罗德基金管理有限公司投资经理、基金经理助理、研究员。2016 年 7 月至 2017 年 10 月任海富通

					<p>双利债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 11 月兼任海富通纯债债券基金经理。2017 年 8 月起兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）和海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2018 年 2 月至 2021 年 2 月任海富通融丰定开债券基金经理。2018 年 11 月至 2020 年 10 月任海富通鼎丰定开债券基金经理。2019 年 5 月至 2022 年 12 月兼任海富通新内需混合基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 4 月任海富通聚合纯债基金经理。2019 年 12 月起兼任海富通裕通 30 个月定开债券基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通裕昇三年定开债券基金经理。2020 年 5 月至 2021 年 7 月兼任海富通瑞弘 6 个月定开债券基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。2022 年 8 月起兼任海富通添鑫收益债券基金经理。</p>
杜晓海	本基金的基金经理；总经理助理兼量化投资部总监。	2020-06-22	-	22 年	<p>硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富</p>

				<p>通基金管理有限公司总经理助理兼量化投资部总监。2016年6月起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6月至2020年10月兼任海富通新内需混合基金经理。2016年9月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017年4月至2018年1月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017年5月至2019年10月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深300增强）基金经理。2018年3月至2019年10月兼任海富通富祥混合基金经理。2018年4月至2018年7月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018年4月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018年4月至2020年10月兼任海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018年4月至2019年10月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019年6月至2020年10月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020年1月至2022年8月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020年3月至2021年7月兼任海富通中证500增强（原海富通中证内地低碳指数）基金经理。2020年4月至2021年7月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020年5月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年6月</p>
--	--	--	--	---

					起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

本组合在 2022 年参与利率债和高等级债券的投资，灵活调整仓位应对市场的风险。

权益部分，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。

本报告期,本基金在控制回撤的基础上,力图寻找合适的股票投资机会以赚取绝对收益。同时,本基金积极参与新股申购,以增强投资收益。不过,报告期内市场的预期博弈强于基本面,全年市场风格波动剧烈,组合没能及时做出相应调整,导致股票部分表现不佳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通富泽混合 A 净值增长率为-4.54%,同期业绩比较基准收益率为-3.57%,基金净值跑输业绩比较基准 0.97 个百分点。海富通富泽混合 C 净值增长率为-4.92%,同期业绩比较基准收益率为-3.57%,基金净值跑输业绩比较基准 1.35 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。

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,本基金的投资思路为在控制风险的基础上,积极地捕捉市场的结构性机会,力争跑赢市场。同时,本基金依然会积极参与新股申购,努力增厚收益。本基金也将利

用动态的仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。

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

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配后份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

4.9 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对海富通富泽混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对海富通富泽混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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本托管人复核的本报告中的财务指标、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 2300337 号

海富通富泽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富泽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：海富通富泽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	6,170,100.70	1,376,689.69
结算备付金		18,436,961.77	16,969,532.93
存出保证金		43,478.92	3,600,959.15
交易性金融资产	7.4.7.2	155,669,760.46	633,427,244.72
其中：股票投资		47,963,573.71	174,684,839.67
基金投资		-	-
债券投资		107,706,186.75	458,742,405.05
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	22,993,081.09	-
应收清算款		275,631.28	2,268,273.00
应收股利		-	-
应收申购款		-	334,451.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	7,359,230.49
资产总计		203,589,014.22	665,336,381.73
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		-	31,000,000.00
应付清算款		150,015.75	0.86
应付赎回款		112,468.39	2,224,655.72
应付管理人报酬		151,907.83	437,184.49
应付托管费		37,976.95	109,296.17
应付销售服务费		11,025.60	64,049.62
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13,306.44	32,986.93
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	259,226.29	221,674.42
负债合计		735,927.25	34,089,848.21
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	192,470,315.78	571,864,059.97
未分配利润	7.4.7.8	10,382,771.19	59,382,473.55
净资产合计		202,853,086.97	631,246,533.52
负债和净资产总计		203,589,014.22	665,336,381.73

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0556 元，C 类基金份额净值 1.0450 元。基金份额总额 192,470,315.78 份，其中 A 类基金份额 162,273,200.70 份，C 类基金份额 30,197,115.08 份。

7.2 利润表

会计主体：海富通富泽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		-16,594,865.59	66,133,230.08
1.利息收入		737,344.24	26,707,576.79
其中：存款利息收入	7.4.7.9	468,944.35	629,361.66
债券利息收入		-	25,170,005.76
资产支持证券利息收入		-	281,918.56
买入返售金融资产收入		268,399.89	626,290.81
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,763,021.75	38,718,780.26
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-7,430,951.19	32,006,936.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	11,495,663.47	4,360,002.23
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-199.45
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	5,053,995.96	-1,022,944.27
股利收益	7.4.7.15	1,644,313.51	3,374,984.98
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-28,174,892.73	-42,461.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	79,661.15	749,334.34
减：二、营业总支出		4,428,295.85	12,709,436.11
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	3,016,839.03	7,945,458.11
2. 托管费	7.4.10.2. 2	754,209.75	1,986,364.63

3. 销售服务费		285,384.17	1,184,981.38
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		105,513.36	634,812.29
其中：卖出回购金融资产支出		105,513.36	634,812.29
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		43,851.39	58,282.83
8. 其他费用	7.4.7.18	222,498.15	899,536.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-21,023,161.44	53,423,793.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-21,023,161.44	53,423,793.97
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-21,023,161.44	53,423,793.97

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海富通富泽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）	571,864,059.97	-	59,382,473.55	631,246,533.52
二、本期期初净资产（基金净值）	571,864,059.97	-	59,382,473.55	631,246,533.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-379,393,744.19	-	-48,999,702.36	-428,393,446.55
（一）、综合收益总额	-	-	-21,023,161.44	-21,023,161.44
（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）	-379,393,744.19	-	-27,976,540.92	-407,370,285.11
其中：1.基金申	51,528,564.36	-	4,615,721.55	56,144,285.91

购款				1
2. 基金赎回款	-430,922,308.55	-	-32,592,262.47	-463,514,571.02
(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)	192,470,315.78	-	10,382,771.19	202,853,086.97
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)	1,489,041,898.24	-	67,193,874.88	1,556,235,773.12
二、本期期初净资产(基金净值)	1,489,041,898.24	-	67,193,874.88	1,556,235,773.12
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-917,177,838.27	-	-7,811,401.33	-924,989,239.60
(一)、综合收益总额	-	-	53,423,793.97	53,423,793.97
(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)	-917,177,838.27	-	-61,235,195.30	-978,413,033.57
其中：1. 基金申购款	396,590,469.73	-	27,304,029.45	423,894,499.18
2. 基金赎回款	-1,313,768,308.00	-	-88,539,224.75	-1,402,307,532.75
(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)	571,864,059.97	-	59,382,473.55	631,246,533.52

值)				
----	--	--	--	--

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

海富通富泽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[2020]126 号《关于准予海富通富泽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《海富通富泽混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 903,252,947.38 元，其中海富通富泽混合 A 为人民币 570,320,022.61 元，海富通富泽混合 C 为人民币 332,932,924.77 元。经向中国证监会备案，《海富通富泽混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 6 月 22 日正式生效，基金合同生效日的海富通富泽混合 A 基金份额总额为 570,462,800.39 份，其中认购资金利息折合 142,777.78 份基金份额，海富通富泽混合 C 基金份额总额为 332,998,748.80 份，其中认购资金利息折合 65,824.03 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《海富通富泽混合型证券投资基金基金合同》及《海富通富泽混合型证券投资基金基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通富泽混合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国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产及存托凭证的比例占基金资产的比例为 0%-40%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%，投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终，扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，

基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金业绩比较基准为：中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 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

根据《海富通富泽混合型证券投资基金基金合同》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对应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金各类份额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；若《海富通富泽混合型证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；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。本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.14 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 1,376,689.69 元、16,969,532.93 元、3,600,959.15 元、2,268,273.00 元、7,359,230.49 元和 334,451.75 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 1,376,862.96 元、16,979,783.40 元、3,600,977.19 元、2,268,273.00 元、0.00 元和 334,451.75 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 633,427,244.72 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 640,776,033.43 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 31,000,000.00 元、0.86 元、2,224,655.72 元、437,184.49 元、109,296.17 元、64,049.62 元、49,784.01 元、-13,109.59 元和 185,000.00 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 30,986,890.41 元、0.86 元、2,224,655.72 元、437,184.49 元 109,296.17 元、64,049.62 元、49,784.01 元、0.00 元和 185,000.00 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

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 [2014]

81 号文《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税 [2016] 127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	6,170,100.70	1,376,689.69
等于：本金	6,168,836.04	1,376,689.69
加：应计利息	1,264.66	-
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	6,170,100.70	1,376,689.69

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	48,882,743.28	-	47,963,573.71	-919,169.57	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	26,061,107.55	345,049.18	26,328,271.68	-77,885.05
	银行间市场	80,433,359.73	1,101,915.07	81,377,915.07	-157,359.73

	合计	106,494,467.28	1,446,964.25	107,706,186.75	-235,244.78
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		155,377,210.56	1,446,964.25	155,669,760.46	-1,154,414.35
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		149,523,353.72	-	174,684,839.67	25,161,485.95
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	211,130,306.03	-	211,003,405.05	-126,900.98
	银行间市场	245,703,366.59	-	247,739,000.00	2,035,633.41
	合计	456,833,672.62	-	458,742,405.05	1,908,732.43
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		606,357,026.34	-	633,427,244.72	27,070,218.38

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日

	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-29,653,860.00	-	-	-
——股指期货	-29,653,860.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-29,653,860.00	-	-	-

按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	22,993,081.09	-
银行间市场	-	-
合计	22,993,081.09	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

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	-	7,359,230.49
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	7,359,230.49

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	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	84,226.29	49,784.01
其中：交易所市场	81,876.29	48,709.01
银行间市场	2,350.00	1,075.00
应付利息	-	-13,109.59
预提费用	175,000.00	185,000.00
合计	259,226.29	221,674.42

7.4.7.7 实收基金

海富通富泽混合 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	404,938,067.45	404,938,067.45
本期申购	45,645,890.94	45,645,890.94
本期赎回（以“-”号填列）	-288,310,757.69	-288,310,757.69
本期末	162,273,200.70	162,273,200.70

海富通富泽混合 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	166,925,992.52	166,925,992.52
本期申购	5,882,673.42	5,882,673.42
本期赎回（以“-”号填列）	-142,611,550.86	-142,611,550.86
本期末	30,197,115.08	30,197,115.08

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

海富通富泽混合 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	36,792,996.72	6,051,262.03	42,844,258.75
本期利润	5,474,619.97	-21,103,144.48	-15,628,524.51
本期基金份额交易产生的变动数	-25,209,661.87	7,018,898.96	-18,190,762.91
其中：基金申购款	4,670,522.36	-502,800.70	4,167,721.66
基金赎回款	-29,880,184.23	7,521,699.66	-22,358,484.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,057,954.82	-8,032,983.49	9,024,971.33

海富通富泽混合 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	14,042,775.49	2,495,439.31	16,538,214.80
本期利润	1,677,111.32	-7,071,748.25	-5,394,636.93
本期基金份额交易产生的变动数	-12,882,204.83	3,096,426.82	-9,785,778.01
其中：基金申购款	549,937.84	-101,937.95	447,999.89
基金赎回款	-13,432,142.67	3,198,364.77	-10,233,777.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,837,681.98	-1,479,882.12	1,357,799.86

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	20,845.58	86,462.17
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	445,593.48	531,273.49
其他	2,505.29	11,626.00
合计	468,944.35	629,361.66

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	321,789,896.53	261,502,762.06
减：卖出股票成本总额	328,437,735.56	229,495,825.29
减：交易费用	783,112.16	-
买卖股票差价收入	-7,430,951.19	32,006,936.77

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	8,777,420.28	-
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	2,718,243.19	4,360,002.23
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	11,495,663.47	4,360,002.23

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	710,976,038.34	1,207,966,672.27
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	697,948,725.21	1,184,883,895.33
减：应计利息总额	10,299,246.46	18,722,774.71
减：交易费用	9,823.48	-
买卖债券差价收入	2,718,243.19	4,360,002.23

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证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
资产支持证券投资收益——利息收入	-	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-	-199.45

资产支持证券投资收益 ——赎回差价收入	-	-
资产支持证券投资收益 ——申购差价收入	-	-
合计	-	-199.45

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

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
卖出资产支持证券成交总额	-	10,018,010.38
减：卖出资产支持证券成本总额	-	10,000,199.45
减：应计利息总额	-	18,010.38
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	-199.45

7.4.7.13 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。

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	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
股指期货投资收益（税前）	5,213,580.00	-1,001,600.00
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	151,851.84	21,344.27
减：交易费用	7,732.20	-
合计	5,053,995.96	-1,022,944.27

7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	1,644,313.51	3,374,984.98
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	1,644,313.51	3,374,984.98

7.4.7.16 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	-28,224,632.73	-2,190,401.31
——股票投资	-26,080,655.52	-5,183,006.77
——债券投资	-2,143,977.21	3,025,406.01
——资产支持证券投资	-	-32,800.55
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	49,740.00	2,147,940.00
——权证投资	-	-
——股指期货	49,740.00	2,147,940.00
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	-28,174,892.73	-42,461.31

7.4.7.17 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1月1日至2021年12月31 日
基金赎回费收入	7,391.15	749,053.57
基金转换费收入	72,270.00	280.77

合计	79,661.15	749,334.34
----	-----------	------------

7.4.7.18 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	55,000.00	65,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
证券组合费	118.89	722.49
银行划款手续费	10,179.26	23,288.92
其他费用	1,200.00	1,200.00
债券托管账户维护费	36,000.00	35,880.00
开户费	-	400.00
交易费用	-	653,045.46
合计	222,498.15	899,536.87

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、登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	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 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 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	541,352,533.96	100.00%	355,944,695.17	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
海通证券	393,162.85	100.00%	81,876.29	100.00%
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	259,642.34	100.00%	48,709.01	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、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	3,016,839.03	7,945,458.11
其中：支付销售机构的客户维护费	1,104,829.94	3,252,995.80

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 0.80% 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 X0.80%/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	754,209.75	1,986,364.63

注：支付基金托管人浦发银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 X0.20%/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		
	海富通富泽混合A	海富通富泽混合C	合计
浦发银行	-	176,251.37	176,251.37
海通证券	-	58.27	58.27

海富通	-	84,011.17	84,011.17
合计	-	260,320.81	260,320.81
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		
	海富通富泽混合A	海富通富泽混合C	合计
浦发银行	-	601,213.90	601,213.90
海通证券	-	1,757.94	1,757.94
海富通	-	504,984.97	504,984.97
合计	-	1,107,956.81	1,107,956.81

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 0.40%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 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 0.40% / 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
浦发银行	6,170,100.70	20,845.58	1,376,689.69	86,462.17

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	3,573	295,808.67
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	13,320	417,981.60
海通证券	300981	中红医疗	网下发行	6,003	291,685.77
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

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

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
300850	新强联	2022-12-30	筹划重大事项	53.28	2023-01-10	56.88	170	13,838.32	9,057.60	-

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

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

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

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本

基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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同责任，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 9.17%（2021 年 12 月 31 日：66.87%）。

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	18,123,410.96	36,610,980.00
合计	18,123,410.96	36,610,980.00

注：未评级部分为国债。

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	-	9,981,000.00
合计	-	9,981,000.00

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	18,581,376.55	282,405,120.00
AAA 以下	19,426.64	129,745,305.05
未评级	70,981,972.60	-
合计	89,582,775.79	412,150,425.05

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

本基金所持的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。

本基金持有及承担的大部分权益类金融资产和金融负债不计息，该部分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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种存在相应的利率风险，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。

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	6,170,100.70	-	-	-	6,170,100.70
结算备付金	18,436,961.77	-	-	-	18,436,961.77
存出保证金	43,478.92	-	-	-	43,478.92
交易性金融资产	26,308,845.04	81,377,915.07	19,426.64	47,963,573.71	155,669,760.46
买入返售金融资产	22,993,081.09	-	-	-	22,993,081.09
应收清算款	-	-	-	275,631.28	275,631.28
资产总计	73,952,467.52	81,377,915.07	19,426.64	48,239,204.99	203,589,014.22
负债					
应付清算款	-	-	-	150,015.75	150,015.75
应付赎回款	-	-	-	112,468.39	112,468.39
应付管理人报酬	-	-	-	151,907.83	151,907.83
应付托管费	-	-	-	37,976.95	37,976.95
应付销售服务费	-	-	-	11,025.60	11,025.60
应交税费	-	-	-	13,306.44	13,306.44

其他负债	-	-	-	259,226.29	259,226.29
负债总计	-	-	-	735,927.25	735,927.25
利率敏感度缺口	73,952,467.52	81,377,915.07	19,426.64	47,503,277.74	202,853,086.97
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	1,376,689.69	-	-	-	1,376,689.69
结算备付金	16,969,532.93	-	-	-	16,969,532.93
存出保证金	36,527.15	-	-	3,564,432.00	3,600,959.15
交易性金融资产	86,809,980.00	371,711,453.85	220,971.20	174,684,839.67	633,427,244.72
应收清算款	-	-	-	2,268,273.00	2,268,273.00
应收申购款	-	-	-	334,451.75	334,451.75
其他资产	-	-	-	7,359,230.49	7,359,230.49
资产总计	105,192,729.77	371,711,453.85	220,971.20	188,211,226.91	665,336,381.73
负债					
卖出回购金融资产款	31,000,000.00	-	-	-	31,000,000.00
应付清算款	-	-	-	0.86	0.86
应付赎回款	-	-	-	2,224,655.72	2,224,655.72
应付管理人报酬	-	-	-	437,184.49	437,184.49
应付托管费	-	-	-	109,296.17	109,296.17
应付销售服务费	-	-	-	64,049.62	64,049.62
应交税费	-	-	-	32,986.93	32,986.93
其他负债	-	-	-	221,674.42	221,674.42
负债总计	31,000,000.00	-	-	3,089,848.21	34,089,848.21
利率敏感度缺口	74,192,729.77	371,711,453.85	220,971.20	185,121,378.70	631,246,533.52

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

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	-403,396.08	-2,908,249.37
	市场利率下降 25 个基点	406,406.27	2,953,660.04

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	1,422,058.16	1,422,058.16
资产合计	-	1,422,058.16	1,422,058.16
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	-	1,422,058.16	1,422,058.16
项目	上年度末 2021年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	3,921,103.32	3,921,103.32

资产合计	-	3,921,103.32	3,921,103.32
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	3,921,103.32	3,921,103.32

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	71,102.91	196,055.17
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-71,102.91	-196,055.17

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	47,963,573.71	23.64	174,684,839.67	27.67
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	47,963,573.71	23.64	174,684,839.67	27.67

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%	2,421,192.41	7,271,046.03
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-2,421,192.41	-7,271,046.03

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	47,973,942.75	177,442,526.43
第二层次	107,695,817.71	455,984,718.29

第三层次	-	-
合计	155,669,760.46	633,427,244.72

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	-	1,422,633.45	1,422,633.45
转出第三层次	-	2,039,911.72	2,039,911.72
当期利得或损失总额	-	617,278.27	617,278.27
其中：计入损益的利得或损失	-	617,278.27	617,278.27
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	-	-	-
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，本基金未持有第三层次的交易性金融资产。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。

7.4.14.3 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、买入返售金融资产、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	47,963,573.71	23.56
	其中：股票	47,963,573.71	23.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	107,706,186.75	52.90
	其中：债券	107,706,186.75	52.90
	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	22,993,081.09	11.29
	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	24,607,062.47	12.09
8	其他各项资产	319,110.20	0.16
9	合计	203,589,014.22	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 1,422,058.16 元，占资产净值比例为 0.70%。

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	179,353.00	0.09
B	采矿业	1,949,335.60	0.96
C	制造业	29,741,288.16	14.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,437,266.90	0.71
E	建筑业	1,174,715.00	0.58
F	批发和零售业	1,591,555.00	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	1,453,285.00	0.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,533,893.38	0.76
J	金融业	3,739,440.50	1.84
K	房地产业	1,991,465.00	0.98
L	租赁和商务服务业	568,135.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	1,044,092.01	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	137,691.00	0.07

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	46,541,515.55	22.94

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	36,016.65	0.02
金融	694,512.07	0.34
工业	512,518.13	0.25
通信服务	179,011.31	0.09
合计	1,422,058.16	0.70

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	600153	建发股份	101,500	1,385,475.00	0.68
2	600519	贵州茅台	500	863,500.00	0.43
3	300750	宁德时代	1,800	708,156.00	0.35
4	000858	五粮液	3,800	686,622.00	0.34
5	601318	中国平安	14,100	662,700.00	0.33
6	600048	保利发展	42,500	643,025.00	0.32
7	600887	伊利股份	20,100	623,100.00	0.31
8	002142	宁波银行	19,190	622,715.50	0.31
9	300760	迈瑞医疗	1,700	537,149.00	0.26
10	600036	招商银行	14,000	521,640.00	0.26
11	002897	意华股份	8,800	517,352.00	0.26
12	000002	万科 A	28,400	516,880.00	0.25
13	002484	江海股份	22,400	501,088.00	0.25
14	600079	人福医药	20,700	494,523.00	0.24
15	600803	新奥股份	30,600	492,660.00	0.24
16	600426	华鲁恒升	14,170	469,735.50	0.23
17	002039	黔源电力	28,980	441,075.60	0.22
18	300408	三环集团	13,900	426,869.00	0.21
19	300347	泰格医药	4,000	419,200.00	0.21
20	002050	三花智控	18,900	401,058.00	0.20
21	600919	江苏银行	53,200	387,828.00	0.19

22	601799	星宇股份	3,000	382,110.00	0.19
23	002597	金禾实业	11,700	380,250.00	0.19
24	600690	海尔智家	15,500	379,130.00	0.19
25	601088	中国神华	13,200	364,584.00	0.18
26	600233	圆通速递	17,800	357,602.00	0.18
27	601688	华泰证券	27,800	354,172.00	0.17
28	002541	鸿路钢构	11,960	350,308.40	0.17
29	300014	亿纬锂能	3,900	342,810.00	0.17
30	300601	康泰生物	10,680	336,740.40	0.17
31	002594	比亚迪	1,300	334,061.00	0.16
32	600309	万华化学	3,600	333,540.00	0.16
33	300979	华利集团	5,800	331,238.00	0.16
34	600325	华发股份	36,200	327,972.00	0.16
35	002126	银轮股份	26,400	327,624.00	0.16
36	601888	中国中免	1,500	324,045.00	0.16
37	600938	中国海油	21,004	319,260.80	0.16
38	601669	中国电建	44,800	317,184.00	0.16
39	600885	宏发股份	9,200	307,372.00	0.15
40	002929	润建股份	7,600	298,376.00	0.15
41	603596	伯特利	3,700	295,260.00	0.15
42	300358	楚天科技	20,000	295,000.00	0.15
43	600438	通威股份	7,600	293,208.00	0.14
44	002460	赣锋锂业	4,140	287,771.40	0.14
45	601615	明阳智能	11,300	285,438.00	0.14
46	688320	禾川科技	6,048	283,046.40	0.14
47	601668	中国建筑	51,900	281,817.00	0.14
48	600562	国睿科技	16,600	281,370.00	0.14
49	600765	中航重机	8,700	270,483.00	0.13
50	002352	顺丰控股	4,600	265,696.00	0.13
51	600900	长江电力	12,600	264,600.00	0.13
52	300682	朗新科技	12,000	263,760.00	0.13
53	688063	派能科技	819	258,517.35	0.13
54	600926	杭州银行	19,500	255,060.00	0.13
55	601012	隆基绿能	5,976	252,545.76	0.12
56	600487	亨通光电	16,500	248,490.00	0.12
57	603300	华铁应急	38,500	244,090.00	0.12
58	603259	药明康德	3,000	243,000.00	0.12
59	603345	安井食品	1,500	242,820.00	0.12
60	000708	中信特钢	14,100	241,956.00	0.12
61	300316	晶盛机电	3,800	241,528.00	0.12
62	300122	智飞生物	2,700	237,141.00	0.12
63	603129	春风动力	2,100	236,292.00	0.12
64	601117	中国化学	29,400	233,436.00	0.12
65	600383	金地集团	22,700	232,221.00	0.11

66	601899	紫金矿业	23,200	232,000.00	0.11
67	600875	东方电气	11,000	231,220.00	0.11
68	002271	东方雨虹	6,700	224,919.00	0.11
69	000090	天健集团	38,900	212,394.00	0.10
70	601699	潞安环能	12,600	212,310.00	0.10
71	001979	招商蛇口	16,500	208,395.00	0.10
72	600988	赤峰黄金	11,500	207,575.00	0.10
73	601225	陕西煤业	11,000	204,380.00	0.10
74	000937	冀中能源	32,100	204,156.00	0.10
75	600496	精工钢构	51,000	201,450.00	0.10
76	300274	阳光电源	1,800	201,240.00	0.10
77	002318	久立特材	11,900	198,016.00	0.10
78	301179	泽宇智能	5,100	194,667.00	0.10
79	300873	海晨股份	7,100	192,765.00	0.10
80	000739	普洛药业	8,900	191,706.00	0.09
81	002475	立讯精密	6,000	190,500.00	0.09
82	688033	天宜上佳	8,400	182,868.00	0.09
83	600566	济川药业	6,700	182,374.00	0.09
84	600380	健康元	15,900	179,511.00	0.09
85	00700	腾讯控股	600	179,011.31	0.09
86	002049	紫光国微	1,340	176,638.80	0.09
87	06818	中国光大银行	83,000	176,456.56	0.09
88	300121	阳谷华泰	17,000	176,120.00	0.09
89	603043	广州酒家	6,800	175,576.00	0.09
90	000902	新洋丰	15,200	174,952.00	0.09
91	06881	中国银河	51,000	173,571.29	0.09
92	01186	中国铁建	41,500	173,120.19	0.09
93	03958	东方证券	51,600	172,386.82	0.08
94	02328	中国财险	26,000	172,097.40	0.08
95	01800	中国交通建设	51,000	170,837.89	0.08
96	00995	安徽皖通高速公路	30,000	168,560.05	0.08
97	688093	世华科技	9,443	166,763.38	0.08
98	002984	森麒麟	5,400	166,266.00	0.08
99	000589	贵州轮胎	33,900	162,381.00	0.08
100	600009	上海机场	2,800	161,588.00	0.08
101	002180	纳思达	3,100	160,859.00	0.08
102	600662	外服控股	26,800	159,996.00	0.08
103	002709	天赐材料	3,640	159,650.40	0.08
104	605123	派克新材	1,200	159,480.00	0.08
105	603105	芯能科技	10,800	159,084.00	0.08
106	002011	盾安环境	12,100	158,873.00	0.08
107	601166	兴业银行	9,000	158,310.00	0.08
108	603180	金牌厨柜	5,500	157,685.00	0.08

109	603712	七一二	4,500	157,140.00	0.08
110	600999	招商证券	11,800	156,940.00	0.08
111	000301	东方盛虹	12,000	156,480.00	0.08
112	601717	郑煤机	13,800	154,008.00	0.08
113	688016	心脉医疗	808	152,744.32	0.08
114	300494	盛天网络	10,200	152,286.00	0.08
115	603690	至纯科技	4,000	151,360.00	0.07
116	300416	苏试试验	5,020	151,353.00	0.07
117	600366	宁波韵升	14,200	149,810.00	0.07
118	603806	福斯特	2,200	146,168.00	0.07
119	300628	亿联网络	2,400	145,416.00	0.07
120	600196	复星医药	4,100	144,484.00	0.07
121	688123	聚辰股份	1,407	142,388.40	0.07
122	002311	海大集团	2,300	141,979.00	0.07
123	603228	景旺电子	7,000	141,680.00	0.07
124	600210	紫江企业	28,100	140,500.00	0.07
125	603558	健盛集团	17,000	140,080.00	0.07
126	600763	通策医疗	900	137,691.00	0.07
127	002179	中航光电	2,380	137,468.80	0.07
128	601877	正泰电器	4,953	137,198.10	0.07
129	002045	国光电器	11,000	136,290.00	0.07
130	002430	杭氧股份	3,400	133,824.00	0.07
131	603799	华友钴业	2,400	133,512.00	0.07
132	603305	旭升集团	4,100	132,184.00	0.07
133	002937	兴瑞科技	5,800	131,370.00	0.06
134	300481	濮阳惠成	4,900	130,977.00	0.06
135	002438	江苏神通	11,700	127,881.00	0.06
136	600582	天地科技	24,400	126,880.00	0.06
137	300258	精锻科技	10,900	126,767.00	0.06
138	600660	福耀玻璃	3,600	126,252.00	0.06
139	000733	振华科技	1,100	125,653.00	0.06
140	300775	三角防务	3,300	125,400.00	0.06
141	300124	汇川技术	1,800	125,100.00	0.06
142	300394	天孚通信	4,900	124,215.00	0.06
143	600012	皖通高速	16,600	121,346.00	0.06
144	002518	科士达	2,100	120,960.00	0.06
145	600109	国金证券	13,700	119,190.00	0.06
146	600985	淮北矿业	9,300	119,040.00	0.06
147	688626	翔宇医疗	3,652	116,425.76	0.06
148	603606	东方电缆	1,700	115,311.00	0.06
149	600486	扬农化工	1,100	114,290.00	0.06
150	601816	京沪高铁	23,200	114,144.00	0.06
151	300724	捷佳伟创	1,000	114,020.00	0.06
152	002384	东山精密	4,600	113,758.00	0.06

153	688355	明志科技	3,349	113,631.57	0.06
154	600549	厦门钨业	5,800	113,390.00	0.06
155	600030	中信证券	5,500	109,505.00	0.05
156	603035	常熟汽饰	5,100	108,375.00	0.05
157	002714	牧原股份	2,220	108,225.00	0.05
158	002444	巨星科技	5,700	108,186.00	0.05
159	600845	宝信软件	2,392	107,161.60	0.05
160	000596	古井贡酒	400	106,760.00	0.05
161	300059	东方财富	5,480	106,312.00	0.05
162	002727	一心堂	3,200	100,832.00	0.05
163	300496	中科创达	1,000	100,300.00	0.05
164	603520	司太立	5,100	99,807.00	0.05
165	688173	希荻微	4,236	96,284.28	0.05
166	300699	光威复材	1,300	93,925.00	0.05
167	601128	常熟银行	12,400	93,620.00	0.05
168	300294	博雅生物	2,500	91,400.00	0.05
169	603301	振德医疗	2,400	91,320.00	0.05
170	603260	合盛硅业	1,100	91,234.00	0.04
171	603529	爱玛科技	1,980	90,822.60	0.04
172	600905	三峡能源	16,000	90,400.00	0.04
173	600419	天润乳业	5,700	89,376.00	0.04
174	300680	隆盛科技	3,600	89,136.00	0.04
175	601677	明泰铝业	4,900	88,886.00	0.04
176	300759	康龙化成	1,300	88,400.00	0.04
177	000933	神火股份	5,900	88,264.00	0.04
178	600674	川投能源	7,100	86,833.00	0.04
179	000830	鲁西化工	6,900	85,491.00	0.04
180	300504	天邑股份	5,300	85,065.00	0.04
181	301190	善水科技	4,600	82,708.00	0.04
182	600760	中航沈飞	1,400	82,082.00	0.04
183	002960	青鸟消防	2,900	81,171.00	0.04
184	601868	中国能建	35,400	81,066.00	0.04
185	601567	三星医疗	6,000	80,880.00	0.04
186	300451	创业慧康	10,100	79,891.00	0.04
187	603667	五洲新春	6,000	79,860.00	0.04
188	002286	保龄宝	8,700	79,083.00	0.04
189	002273	水晶光电	6,600	77,814.00	0.04
190	688518	联赢激光	2,651	77,435.71	0.04
191	688029	南微医学	929	76,298.77	0.04
192	601369	陕鼓动力	6,400	73,344.00	0.04
193	603486	科沃斯	1,000	72,940.00	0.04
194	002611	东方精工	17,900	72,674.00	0.04
195	300354	东华测试	1,900	72,599.00	0.04
196	688012	中微公司	740	72,527.40	0.04

197	002959	小熊电器	1,200	72,384.00	0.04
198	002439	启明星辰	2,700	70,416.00	0.03
199	688560	明冠新材	1,506	69,727.80	0.03
200	000811	冰轮环境	6,200	68,820.00	0.03
201	600171	上海贝岭	3,900	67,977.00	0.03
202	600998	九州通	5,200	67,808.00	0.03
203	003043	华亚智能	1,100	67,089.00	0.03
204	300428	立中集团	2,700	66,825.00	0.03
205	603112	华翔股份	5,700	66,405.00	0.03
206	603681	永冠新材	3,100	66,278.00	0.03
207	002812	恩捷股份	500	65,645.00	0.03
208	002409	雅克科技	1,300	65,481.00	0.03
209	688390	固德威	200	64,618.00	0.03
210	301115	建科股份	2,600	64,558.00	0.03
211	601689	拓普集团	1,100	64,438.00	0.03
212	300360	炬华科技	4,400	64,020.00	0.03
213	688559	海目星	1,105	63,913.20	0.03
214	688677	海泰新光	557	62,941.00	0.03
215	002991	甘源食品	800	61,032.00	0.03
216	300498	温氏股份	3,100	60,853.00	0.03
217	601137	博威合金	4,100	60,721.00	0.03
218	002324	普利特	3,700	59,200.00	0.03
219	002867	周大生	4,200	58,926.00	0.03
220	000776	广发证券	3,800	58,862.00	0.03
221	300382	斯莱克	3,100	58,528.00	0.03
222	688296	和达科技	2,210	57,172.70	0.03
223	300725	药石科技	700	56,350.00	0.03
224	300767	震安科技	1,200	56,100.00	0.03
225	600376	首开股份	9,200	52,348.00	0.03
226	300450	先导智能	1,300	52,325.00	0.03
227	002036	联创电子	4,100	50,717.00	0.03
228	600570	恒生电子	1,200	48,552.00	0.02
229	002850	科达利	400	47,524.00	0.02
230	603871	嘉友国际	2,100	47,460.00	0.02
231	002966	苏州银行	5,900	45,902.00	0.02
232	600399	抚顺特钢	3,200	45,792.00	0.02
233	002463	沪电股份	3,800	45,220.00	0.02
234	002371	北方华创	200	45,060.00	0.02
235	002335	科华数据	900	44,901.00	0.02
236	000568	泸州老窖	200	44,856.00	0.02
237	300982	苏文电能	900	44,370.00	0.02
238	300101	振芯科技	1,800	44,100.00	0.02
239	600123	兰花科创	3,300	44,022.00	0.02
240	688128	中国电研	2,552	43,588.16	0.02

241	300146	汤臣倍健	1,900	43,358.00	0.02
242	300035	中科电气	2,100	43,218.00	0.02
243	300373	扬杰科技	800	42,080.00	0.02
244	300638	广和通	2,350	42,065.00	0.02
245	002918	蒙娜丽莎	2,300	41,354.00	0.02
246	603599	广信股份	1,400	41,160.00	0.02
247	600522	中天科技	2,500	40,375.00	0.02
248	000690	宝新能源	6,200	40,300.00	0.02
249	000881	中广核技	5,200	40,196.00	0.02
250	300083	创世纪	4,700	39,809.00	0.02
251	603227	雪峰科技	4,700	38,963.00	0.02
252	603392	万泰生物	300	38,010.00	0.02
253	603323	苏农银行	8,000	37,520.00	0.02
254	000963	华东医药	800	37,440.00	0.02
255	600989	宝丰能源	3,100	37,417.00	0.02
256	002487	大金重工	900	37,233.00	0.02
257	00826	天工国际	14,000	36,016.65	0.02
258	002777	久远银海	2,300	34,500.00	0.02
259	300938	信测标准	1,000	33,440.00	0.02
260	603290	斯达半导	100	32,930.00	0.02
261	300457	赢合科技	1,800	31,806.00	0.02
262	000657	中钨高新	2,000	31,680.00	0.02
263	300438	鹏辉能源	400	31,196.00	0.02
264	300470	中密控股	800	31,128.00	0.02
265	002601	龙佰集团	1,600	30,272.00	0.01
266	002056	横店东磁	1,600	29,984.00	0.01
267	002801	微光股份	1,200	29,772.00	0.01
268	600933	爱柯迪	1,600	29,136.00	0.01
269	600587	新华医疗	1,300	27,846.00	0.01
270	601126	四方股份	1,900	27,740.00	0.01
271	002738	中矿资源	400	26,664.00	0.01
272	002821	凯莱英	180	26,640.00	0.01
273	600908	无锡银行	4,500	23,715.00	0.01
274	301101	明月镜片	371	23,380.42	0.01
275	603379	三美股份	800	22,768.00	0.01
276	000683	远兴能源	2,900	22,736.00	0.01
277	600089	特变电工	1,100	22,088.00	0.01
278	002158	汉钟精机	900	21,555.00	0.01
279	301058	中粮科工	1,386	20,720.70	0.01
280	000932	华菱钢铁	4,400	20,680.00	0.01
281	000792	盐湖股份	900	20,421.00	0.01
282	002557	洽洽食品	400	20,000.00	0.01
283	002080	中材科技	900	19,287.00	0.01
284	601021	春秋航空	300	19,275.00	0.01

285	001323	慕思股份	573	18,977.76	0.01
286	002129	TCL 中环	500	18,830.00	0.01
287	600873	梅花生物	1,800	18,324.00	0.01
288	603612	索通发展	700	18,214.00	0.01
289	300763	锦浪科技	100	18,005.00	0.01
290	002807	江阴银行	4,500	17,865.00	0.01
291	301035	润丰股份	200	17,420.00	0.01
292	000049	德赛电池	400	17,392.00	0.01
293	002001	新和成	900	16,875.00	0.01
294	300119	瑞普生物	900	16,749.00	0.01
295	603078	江化微	800	16,408.00	0.01
296	002645	华宏科技	1,100	16,401.00	0.01
297	600406	国电南瑞	652	15,908.80	0.01
298	600063	皖维高新	2,700	15,795.00	0.01
299	600219	南山铝业	4,800	15,696.00	0.01
300	000625	长安汽车	1,200	14,772.00	0.01
301	000999	华润三九	300	14,043.00	0.01
302	688596	正帆科技	408	13,851.60	0.01
303	301096	百诚医药	201	13,730.31	0.01
304	000915	华特达因	300	13,650.00	0.01
305	000970	中科三环	1,000	13,640.00	0.01
306	603181	皇马科技	945	13,456.80	0.01
307	601702	华峰铝业	900	13,455.00	0.01
308	603688	石英股份	100	13,132.00	0.01
309	601231	环旭电子	800	12,984.00	0.01
310	601666	平煤股份	1,200	12,972.00	0.01
311	002472	双环传动	500	12,725.00	0.01
312	603809	豪能股份	1,140	12,129.60	0.01
313	002043	兔宝宝	1,100	11,946.00	0.01
314	300791	仙乐健康	300	11,031.00	0.01
315	300596	利安隆	200	10,914.00	0.01
316	003019	宸展光电	500	10,655.00	0.01
317	603659	璞泰来	200	10,378.00	0.01
318	300761	立华股份	300	10,275.00	0.01
319	600452	涪陵电力	668	10,086.80	0.00
320	002539	云图控股	900	10,008.00	0.00
321	688680	海优新材	54	10,006.20	0.00
322	603277	银都股份	600	9,858.00	0.00
323	601965	中国汽研	500	9,690.00	0.00
324	688667	菱电电控	110	9,572.20	0.00
325	002139	拓邦股份	900	9,333.00	0.00
326	002756	永兴材料	100	9,217.00	0.00
327	300850	新强联	170	9,057.60	0.00
328	600990	四创电子	300	8,940.00	0.00

329	600389	江山股份	200	8,816.00	0.00
330	600141	兴发集团	300	8,700.00	0.00
331	601233	桐昆股份	600	8,670.00	0.00
332	300833	浩洋股份	100	8,384.00	0.00
333	688598	金博股份	38	8,340.24	0.00
334	603987	康德莱	600	8,268.00	0.00
335	600585	海螺水泥	300	8,214.00	0.00
336	000983	山西焦煤	700	8,155.00	0.00
337	300587	天铁股份	699	8,052.48	0.00
338	601208	东材科技	700	8,001.00	0.00
339	688617	惠泰医疗	26	7,980.18	0.00
340	002138	顺络电子	300	7,854.00	0.00
341	300806	斯迪克	320	7,504.00	0.00
342	688556	高测股份	100	7,502.00	0.00
343	300393	中来股份	500	7,410.00	0.00
344	300630	普利制药	300	7,398.00	0.00
345	603209	兴通股份	200	7,264.00	0.00
346	600577	精达股份	1,700	7,208.00	0.00
347	603693	江苏新能	550	7,111.50	0.00
348	600641	万业企业	400	7,092.00	0.00
349	605305	中际联合	200	7,080.00	0.00
350	000975	银泰黄金	620	6,844.80	0.00
351	000807	云铝股份	600	6,672.00	0.00
352	000988	华工科技	400	6,564.00	0.00
353	600888	新疆众和	800	6,552.00	0.00
354	603067	振华股份	500	6,415.00	0.00
355	300568	星源材质	300	6,378.00	0.00
356	603993	洛阳钼业	1,400	6,370.00	0.00
357	603212	赛伍技术	200	6,340.00	0.00
358	002493	荣盛石化	500	6,150.00	0.00
359	601872	招商轮船	1,100	6,149.00	0.00
360	002459	晶澳科技	100	6,009.00	0.00
361	688085	三友医疗	200	5,550.00	0.00
362	300226	上海钢联	200	5,542.00	0.00
363	300787	海能实业	200	5,434.00	0.00
364	300383	光环新网	600	4,896.00	0.00
365	603901	永创智能	300	4,740.00	0.00
366	002752	昇兴股份	900	4,680.00	0.00
367	002839	张家港行	1,000	4,610.00	0.00
368	600521	华海药业	210	4,590.60	0.00
369	688599	天合光能	70	4,463.20	0.00
370	600039	四川路桥	400	4,448.00	0.00
371	000887	中鼎股份	300	4,341.00	0.00
372	002254	泰和新材	200	4,242.00	0.00

373	601985	中国核电	700	4,200.00	0.00
374	603876	鼎胜新材	100	4,104.00	0.00
375	601168	西部矿业	400	4,080.00	0.00
376	300476	胜宏科技	300	3,882.00	0.00
376	600481	双良节能	300	3,882.00	0.00
378	300772	运达股份	260	3,866.20	0.00
379	300224	正海磁材	300	3,759.00	0.00
380	603936	博敏电子	300	3,666.00	0.00
381	600458	时代新材	400	3,608.00	0.00
382	603619	中曼石油	200	3,586.00	0.00
383	002244	滨江集团	400	3,532.00	0.00
384	300738	奥飞数据	400	3,524.00	0.00
385	300752	隆利科技	200	3,362.00	0.00
386	603187	海容冷链	100	3,172.00	0.00
387	002057	中钢天源	300	3,150.00	0.00
388	601788	光大证券	200	2,974.00	0.00
389	002402	和而泰	200	2,916.00	0.00
390	300196	长海股份	200	2,826.00	0.00
391	600060	海信视像	200	2,708.00	0.00
392	600580	卧龙电驱	200	2,492.00	0.00
393	688300	联瑞新材	46	2,239.28	0.00
394	688378	奥来德	44	2,222.00	0.00
395	603600	永艺股份	200	1,950.00	0.00
396	300263	隆华科技	200	1,416.00	0.00
397	603086	先达股份	100	1,309.00	0.00
398	002517	恺英网络	100	656.00	0.00
399	688026	洁特生物	7	168.42	0.00

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	002142	宁波银行	3,184,916.50	0.50
2	601012	隆基绿能	2,531,529.00	0.40
3	600036	招商银行	2,322,168.00	0.37
4	600030	中信证券	2,169,731.10	0.34
5	600486	扬农化工	2,023,531.00	0.32
6	600089	特变电工	2,000,916.38	0.32

7	002643	万润股份	1,923,909.00	0.30
8	601615	明阳智能	1,918,034.00	0.30
9	600522	中天科技	1,902,655.00	0.30
10	002594	比亚迪	1,873,640.00	0.30
11	002460	赣锋锂业	1,738,531.80	0.28
12	000932	华菱钢铁	1,710,441.00	0.27
13	600803	新奥股份	1,658,151.00	0.26
14	603799	华友钴业	1,557,703.00	0.25
15	600487	亨通光电	1,549,981.00	0.25
16	002597	金禾实业	1,509,303.92	0.24
17	600941	中国移动	1,488,068.27	0.24
18	600887	伊利股份	1,459,954.00	0.23
19	600153	建发股份	1,412,265.00	0.22
20	300601	康泰生物	1,407,799.20	0.22

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	601012	隆基绿能	7,051,215.80	1.12
2	600036	招商银行	6,427,039.00	1.02
3	600900	长江电力	5,885,746.00	0.93
4	002142	宁波银行	5,162,855.00	0.82
5	600048	保利发展	4,617,342.00	0.73
6	600519	贵州茅台	3,922,346.00	0.62
7	600438	通威股份	3,856,490.00	0.61
8	600887	伊利股份	3,776,177.67	0.60
9	000568	泸州老窖	3,653,368.00	0.58
10	600030	中信证券	3,391,186.00	0.54
11	600309	万华化学	3,136,853.88	0.50
12	000858	五粮液	3,034,727.00	0.48
13	600741	华域汽车	2,905,696.00	0.46
14	002271	东方雨虹	2,865,186.00	0.45
15	300014	亿纬锂能	2,859,213.00	0.45
16	600803	新奥股份	2,764,665.00	0.44
17	002332	仙琚制药	2,698,214.00	0.43
18	300316	晶盛机电	2,458,458.00	0.39
19	600406	国电南瑞	2,418,080.20	0.38
20	600522	中天科技	2,408,576.34	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	227,797,125.12
卖出股票的收入（成交）总额	321,789,896.53

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	68,647,821.92	33.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,457,561.64	10.08
	其中：政策性金融债	20,457,561.64	10.08
4	企业债券	18,581,376.55	9.16
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	19,426.64	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	107,706,186.75	53.10

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	210012	21 付息国债 12	500,000	50,524,410.96	24.91
2	220202	22 国开 02	200,000	20,457,561.64	10.08
3	019679	22 国债 14	180,000	18,123,410.96	8.93
4	2180012	21 福州新区债 01	100,000	10,395,942.47	5.12
5	127424	PR 惠开债	200,000	4,095,742.90	2.02

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

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

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，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	43,478.92
2	应收清算款	275,631.28
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	319,110.20

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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
海富通富泽混合 A	1,225	132,467.92	17,469,418.25	10.77%	144,803,782.45	89.23%
海富通富泽混合 C	374	80,740.95	128,021.14	0.42%	30,069,093.94	99.58%
合计	1,599	120,369.18	17,597,439.39	9.14%	174,872,876.39	90.86%

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	海富通富泽混合 A	275,108.18	0.1695%
	海富通富泽混合 C	121.01	0.0004%
	合计	275,229.19	0.1430%

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	海富通富泽混合 A	10~50
	海富通富泽混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通富泽混合 A	10~50
	海富通富泽混合 C	0
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
基金合同生效日（2020 年 6 月 22 日）基金份额总额	570,462,800.39	332,998,748.80
本报告期期初基金份额总额	404,938,067.45	166,925,992.52
本报告期基金总申购份额	45,645,890.94	5,882,673.42
减：本报告期基金总赎回份额	288,310,757.69	142,611,550.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	162,273,200.70	30,197,115.08

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，基金管理人无重大人事变动；

本基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司决定，总行资产托管部原总经理孔建同志自 2022 年 11 月 7 日起不再担任资产托管部总经理职务，由李国光同志担任部门负责人。

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 55,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 3 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	541,352,533.96	100.00%	393,162.85	100.00%	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行主观性评议，形成证券公司交易单元租用意见。

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

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

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

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	成交金额	占当期回购成交总	成交金额	占当期权证成交总

		交总额的比例		额的比例		额的比例
海通证券	205,460,969.25	100.00%	4,177,900,000.00	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海富通富泽混合型证券投资基金新增北京雪球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	2022-02-18
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华泰期货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	2022-03-14
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中邮证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	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	2022-04-01
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增英大证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	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	2022-05-17
9	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	2022-05-23

		网站	
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	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	2022-05-26
11	海富通基金管理有限公司关于海富通富泽混合型证券投资基金新增珠海盈米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	2022-05-27
12	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
13	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
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海好买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	2022-06-21
15	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
16	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
17	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
18	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
19	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京汇成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	2022-09-26
20	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	2022-10-13

21	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理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	2022-11-18
22	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
23	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	2022/3/28-2022/6/6	92,369,296.14	-	92,369,296.14	-	-

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。
- 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。
- 4、其他可能的风险。

另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

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富泽混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通富泽混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通富泽混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通富泽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

