

海富通欣利混合型证券投资基金
2023 年第 1 季度报告
2023 年 3 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年四月二十二日

§1 重要提示

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

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 海富通欣利混合 |
| 基金主代码 | 011554 |
| 交易代码 | 011554 |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 9 月 14 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 67,234,218.48 份 |
| 投资目标 | 本基金通过积极主动的资产配置与严谨的风险管理，在严格控制风险的前提下，积极把握证券市场的投资机会，追求资产的保值增值。 |
| 投资策略 | 本基金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。 在大类资产配置的框架下，本基金投资策略还包括股票 |

| | | |
|-----------------|--|-----------------|
| | 投资策略、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、股票期权投资策略、存托凭证投资策略等。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×20%+中证综合债指数收益率×75%+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。 | |
| 基金管理人 | 海富通基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 华夏银行股份有限公司 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 海富通欣利混合 A | 海富通欣利混合 C |
| 下属两级基金的交易代码 | 011554 | 011555 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 54,761,959.39 份 | 12,472,259.09 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日) | |
|----------------|---|---------------|
| | 海富通欣利混合 A | 海富通欣利混合 C |
| 1.本期已实现收益 | 1,434,027.83 | 250,041.32 |
| 2.本期利润 | 2,767,846.96 | 373,586.25 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0480 | 0.0341 |
| 4.期末基金资产净值 | 58,514,154.56 | 13,285,450.97 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0685 | 1.0652 |

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

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动

收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、海富通欣利混合 A:

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 4.05% | 0.34% | 1.73% | 0.22% | 2.32% | 0.12% |
| 过去六个月 | 6.00% | 0.38% | 2.84% | 0.29% | 3.16% | 0.09% |
| 过去一年 | 6.22% | 0.41% | 2.18% | 0.29% | 4.04% | 0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.85% | 0.38% | -0.34% | 0.29% | 7.19% | 0.09% |

2、海富通欣利混合 C:

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 4.00% | 0.34% | 1.73% | 0.22% | 2.27% | 0.12% |
| 过去六个月 | 5.90% | 0.39% | 2.84% | 0.29% | 3.06% | 0.10% |
| 过去一年 | 6.01% | 0.41% | 2.18% | 0.29% | 3.83% | 0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.52% | 0.38% | -0.34% | 0.29% | 6.86% | 0.09% |

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

海富通欣利混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1. 海富通欣利混合 A

(2021 年 9 月 14 日至 2023 年 3 月 31 日)



2. 海富通欣利混合 C

(2021 年 9 月 14 日至 2023 年 3 月 31 日)



注：本基金合同于 2021 年 9 月 14 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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 江勇 | 本基金的基金经理 | 2021-09-14 | - | 11 年 | 经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师，资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2018 年 7 月起任海富通上证非周期 ETF 联接基金经理。2018 年 7 月至 2022 年 5 月任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF、海富通中证 100 指数(LOF)基金经理。2018 年 7 月至 2020 年 3 月任海富通中证内地低碳指数（现海富通中证 500 增强）基金经理。2020 年 8 月至 2023 年 3 月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。2023 年 1 月起 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|------------------|
| | | | | | 兼任海富通强化回报混合基金经理。 |
|--|--|--|--|--|------------------|

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度，A 股市场经受住了外围市场的动荡与冲击，取得了一个不错的开局。万得全 A 指数本季度涨幅 6.47%，其余主要市场指数当中，除了创业板 50 指数和创成长指数表现相对疲弱以外，均取得正收益。分行业看，计算机、传媒和通信位列一季度申万一级行业涨幅前三名，分别达到 37%、34% 和 30%。而地产、商贸零售和银行居跌幅前三，分别约 -6%、-5% 和 -3%。

国际因素方面，其一，一季度美国硅谷银行危机引发的欧美多家银行连锁风险事件显著地改变了全球投资人对于美联储利率走向的预期，衰退预期及由此而来的流动性宽松预期显著上升。其二，chatGPT 发布刺激全球 ICT 大厂竞相发布自家的 open AI 产品或计划，全球投资者对于人工智能带来的人类社会深刻变革的无限憧憬被显著激发出来。

国内因素方面，前两个月投放的流动性和信贷结构的优化阶段性地稳定了投资人对于今年经济复苏的信心。但是，针对房地产市场回暖程度的担忧并未解除。同时，在市场进入年报和季报期，以银行地产为代表的传统实体行业的报表当中的负面因素被不断定价，诸如银行息差下降的拖累、开发商拿地能力的下降等构成对于此类资产负面定价的主要驱动因素。而中国特色估值体系所代表的传统实体行业正在被市场一部分“聪明钱”定价，后续可能成为市场最有持续性的一条结构主线。

报告期间，本基金权益仓位有所上升，在控制回撤的基础上，积极寻找估值盈利匹配的股票以赚取绝对收益，行业分布上较为均衡，持仓个股较为分散。继续保持了较高的转债仓位，转债的配置主要以绝对价格较低的转债标的为主，希望在不大幅增加组合波动的前提下增厚组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通欣利混合 A 净值增长率为 4.05%，同期业绩比较基准收益率为 1.73%，基金净值跑赢业绩比较基准 2.32 个百分点。海富通欣利混合 C 净值增长率为 4.00%，同期业绩比较基准收益率为 1.73%，基金净值跑赢业绩比较基准 2.27 个百分点。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|----------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 28,101,834.24 | 38.97 |
| | 其中：股票 | 28,101,834.24 | 38.97 |
| 2 | 固定收益投资 | 25,643,511.80 | 35.57 |
| | 其中：债券 | 25,643,511.80 | 35.57 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 10,996,085.75 | 15.25 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金 | - | - |

| | | | |
|---|--------------|---------------|--------|
| | 融资产 | | |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 5,200,102.43 | 7.21 |
| 7 | 其他资产 | 2,161,663.32 | 3.00 |
| 8 | 合计 | 72,103,197.54 | 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3,567,504.73元，占资产净值比例为4.97%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 114,070.00 | 0.16 |
| B | 采矿业 | 958,757.00 | 1.34 |
| C | 制造业 | 12,703,295.31 | 17.69 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,201,453.40 | 1.67 |
| E | 建筑业 | 2,407,792.00 | 3.35 |
| F | 批发和零售业 | 1,276,929.00 | 1.78 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,514,446.00 | 2.11 |
| H | 住宿和餐饮业 | 154,044.00 | 0.21 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,282,541.60 | 1.79 |
| J | 金融业 | 1,260,517.00 | 1.76 |
| K | 房地产业 | 271,245.00 | 0.38 |
| L | 租赁和商务服务业 | 518,757.00 | 0.72 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 336,223.20 | 0.47 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 86,688.00 | 0.12 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 447,571.00 | 0.62 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 24,534,329.51 | 34.17 |

5.2.2 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 | 15,699.60 | 0.02 |
| 能源 | 81,658.24 | 0.11 |
| 金融 | 1,229,556.24 | 1.71 |
| 医疗保健 | 64,465.19 | 0.09 |
| 工业 | 2,133,580.53 | 2.97 |
| 通信服务 | 42,544.93 | 0.06 |
| 合计 | 3,567,504.73 | 4.97 |

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------|------------|--------------|
| 1 | 300601 | 康泰生物 | 18,700 | 591,668.00 | 0.82 |
| 2 | 601377 | 兴业证券 | 93,100 | 569,772.00 | 0.79 |
| 3 | 002352 | 顺丰控股 | 9,400 | 520,572.00 | 0.73 |
| 4 | 000090 | 天健集团 | 91,300 | 489,368.00 | 0.68 |
| 5 | 601668 | 中国建筑 | 84,000 | 487,200.00 | 0.68 |
| 6 | 600803 | 新奥股份 | 22,300 | 464,955.00 | 0.65 |
| 7 | 000937 | 冀中能源 | 67,400 | 461,016.00 | 0.64 |
| 8 | 06198 | 青岛港 | 126,000 | 452,236.81 | 0.63 |
| 9 | 01186 | 中国铁建 | 81,500 | 405,958.26 | 0.57 |
| 10 | 600548 | 深高速 | 39,400 | 342,780.00 | 0.48 |
| 10 | 00548 | 深圳高速公路股份 | 8,000 | 48,882.89 | 0.07 |

注：深高速同时在A+H股上市，合并计算其公允价值参与排序。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 1,902,730.27 | 2.65 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 4,847,883.89 | 6.75 |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |

| | | | |
|----|-----------|---------------|-------|
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 18,892,897.64 | 26.31 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 25,643,511.80 | 35.72 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 110059 | 浦发转债 | 63,890 | 6,783,420.10 | 9.45 |
| 2 | 018008 | 国开 1802 | 47,000 | 4,847,883.89 | 6.75 |
| 3 | 113042 | 上银转债 | 18,040 | 1,910,742.43 | 2.66 |
| 4 | 019670 | 22 国债 05 | 19,000 | 1,902,730.27 | 2.65 |
| 5 | 110073 | 国投转债 | 13,500 | 1,403,056.11 | 1.95 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量 | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|---------------|--------|-------|---------------|-----------|-----------|
| IM2304 | IM2304 | -1.00 | -1,373,200.00 | -4,320.00 | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | -4,320.00 |
| 股指期货投资本期收益(元) | | | | | 40,842.57 |

| | |
|-------------------|-----------|
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | -4,320.00 |
|-------------------|-----------|

注：股指期货投资本期收益中已扣除本期股指期货差价收入应缴纳增值税额。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金管理人将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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的重银转债（113056）的发行人，因未按照规定履行客户身份识别义务，未按规定保存客户身份资料和交易记录，未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告，与身份不明的客户进行交易等违法违规行为，于2022年6月8日被中国人民银行重庆营业管理部处罚款395万元。因通过手机银行客户端向投资者销售基金过程中，未按照《适当性办法》向投资者告知信息，未针对销售公募基金产品准入设立产品准入委员会或专门小组，指定的基金销售合规风控人员未对新销售基金产品准入进行合规审查并出具合规审查意见，未对部分基金产品宣传材料进行合规审查并出具合规审查意见，未通过专门的技术系统对员工使用微信开展基金营销宣传活动进行统一管理，手机银行客户端销售界面中缺少个别基金产品的资料概要等违法违规行为，于2023年3月10日被中国证券监督管理委员会重庆监管局出具警示函。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为地区中大型银行，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。

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

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 247,800.26 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,913,183.06 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 680.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 2,161,663.32 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------------|--------------|
| 1 | 110059 | 浦发转债 | 6,783,420.10 | 9.45 |
| 2 | 113042 | 上银转债 | 1,910,742.43 | 2.66 |
| 3 | 110073 | 国投转债 | 1,403,056.11 | 1.95 |
| 4 | 113050 | 南银转债 | 1,003,677.37 | 1.40 |
| 5 | 113056 | 重银转债 | 827,287.07 | 1.15 |
| 6 | 113021 | 中信转债 | 740,995.77 | 1.03 |
| 7 | 127034 | 绿茵转债 | 738,312.85 | 1.03 |
| 8 | 128108 | 蓝帆转债 | 737,725.40 | 1.03 |
| 9 | 110053 | 苏银转债 | 682,813.90 | 0.95 |
| 10 | 113640 | 苏利转债 | 667,628.82 | 0.93 |
| 11 | 113584 | 家悦转债 | 662,670.34 | 0.92 |
| 12 | 127024 | 盈峰转债 | 511,404.68 | 0.71 |
| 13 | 128125 | 华阳转债 | 464,102.85 | 0.65 |
| 14 | 113057 | 中银转债 | 241,834.03 | 0.34 |
| 15 | 113044 | 大秦转债 | 225,833.42 | 0.31 |
| 16 | 123113 | 仙乐转债 | 202,043.64 | 0.28 |
| 17 | 113532 | 海环转债 | 135,404.05 | 0.19 |
| 18 | 120002 | 18 中原 EB | 124,886.63 | 0.17 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 19 | 127018 | 本钢转债 | 120,197.40 | 0.17 |
| 20 | 110080 | 东湖转债 | 116,747.95 | 0.16 |
| 21 | 128105 | 长集转债 | 114,407.04 | 0.16 |
| 22 | 113633 | 科沃转债 | 110,203.70 | 0.15 |
| 23 | 113013 | 国君转债 | 104,464.79 | 0.15 |
| 24 | 113043 | 财通转债 | 104,087.29 | 0.14 |
| 25 | 123128 | 首华转债 | 60,843.29 | 0.08 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 海富通欣利混合A | 海富通欣利混合C |
|---------------|---------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 78,815,958.40 | 11,295,733.31 |
| 本报告期基金总申购份额 | 5,101,075.87 | 5,565,286.09 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 29,155,074.88 | 4,388,760.31 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 54,761,959.39 | 12,472,259.09 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 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 | 2023/1/1-2023/3/31 | 22,086,181.00 | - | - | 22,086,181.00 | 32.85% |

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 109 只公募基金。截至 2023 年 3 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1346 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年

12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金再度被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·成长基金管理公司奖。

2020 年 3 月，由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金牛进取奖”，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖项。2020 年 7 月，由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金基金·股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获“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”。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 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

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇二三年四月二十二日