

海富通安颐收益混合型证券投资基金
2023 年第 2 季度报告
2023 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十一日

§1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 20 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通安颐收益混合
基金主代码	519050
交易代码	519050
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 5 月 29 日
报告期末基金份额总额	149,013,178.03 份
投资目标	本基金坚持灵活的资产配置，在严格控制下跌风险的基础上，积极把握股票市场的投资机会，确保资产的保值增值，实现战胜绝对收益基准的目标，为投资者提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金的资产配置策略以基金的投资目标为中心，在实现既定的投资目标同时将可能的损失最小化。首先按照投资时钟理论，根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段，作出权益类资产的初步配置，并根据投资时钟判断大致的行业配置；其次结合证券市场趋势指标，判断证券市场指数的大致风险收益比，从而做出权益类资产的具体仓位选择。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+2%

风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
下属两级基金的交易代码	519050	002339
报告期末下属两级基金的份额总额	110,408,477.23 份	38,604,700.80 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 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
1. 本期已实现收益	374,641.86	119,610.64
2. 本期利润	650,113.03	212,915.42
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0056	0.0054
4. 期末基金资产净值	137,989,484.65	49,143,249.87
5. 期末基金份额净值	1.2498	1.2730

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）海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）于2016年1月6日刊登公告，自2016年1月8日起增加收取销售服务费的C类份额。

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、海富通安颐收益混合 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	0.45%	0.20%	1.16%	0.01%	-0.71%	0.19%
过去六个月	2.06%	0.20%	2.33%	0.02%	-0.27%	0.18%
过去一年	-2.73%	0.23%	4.75%	0.01%	-7.48%	0.22%
过去三年	8.18%	0.26%	14.94%	0.01%	-6.76%	0.25%
过去五年	26.88%	0.28%	26.13%	0.01%	0.75%	0.27%
自基金合同生效起至今	93.19%	0.37%	64.34%	0.02%	28.85%	0.35%

2、海富通安颐收益混合 C:

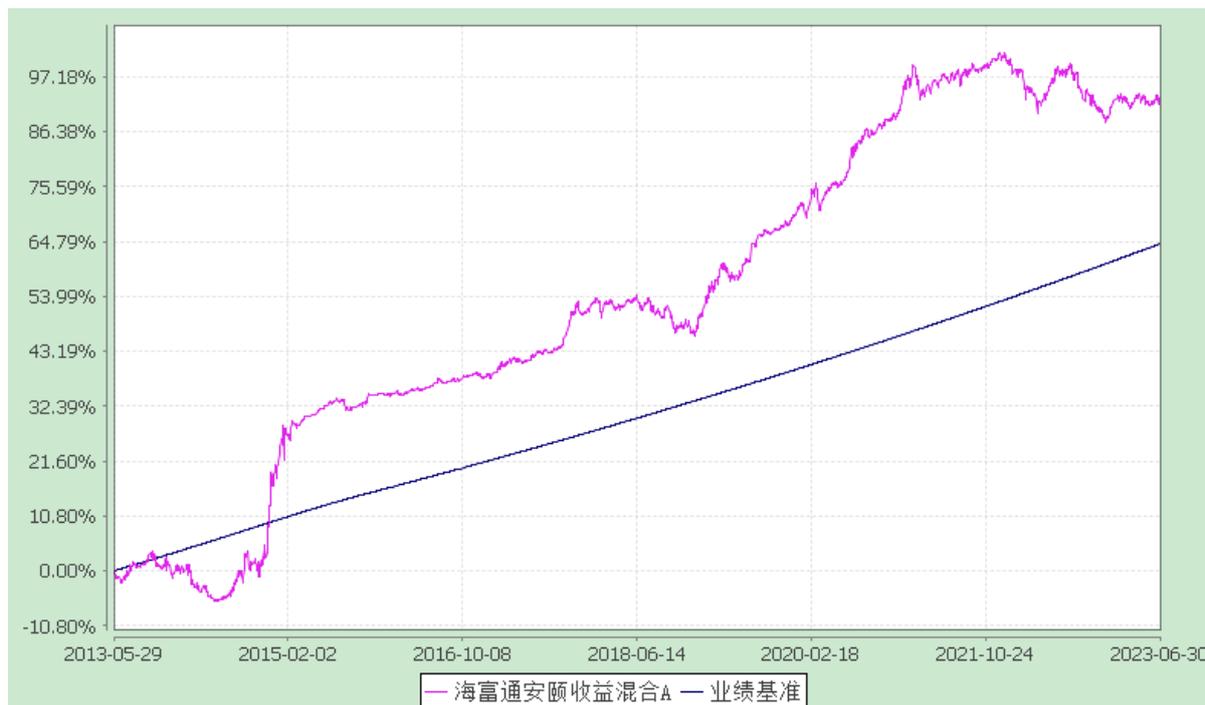
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.43%	0.20%	1.16%	0.01%	-0.73%	0.19%
过去六个月	2.01%	0.20%	2.33%	0.02%	-0.32%	0.18%
过去一年	-2.83%	0.23%	4.75%	0.01%	-7.58%	0.22%
过去三年	7.81%	0.26%	14.94%	0.01%	-7.13%	0.25%
过去五年	27.79%	0.28%	26.13%	0.01%	1.66%	0.27%
自基金合同生效起至今	46.05%	0.25%	41.51%	0.01%	4.54%	0.24%

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

海富通安颐收益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. 海富通安颐收益混合 A

(2013 年 5 月 29 日至 2023 年 6 月 30 日)



2. 海富通安颐收益混合 C

(2016 年 1 月 8 日至 2023 年 6 月 30 日)



注：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		
杜晓海	本基金的基金经理； 总经理助理兼 量化投资部总 监。	2016-06- 22	-	23 年	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

				<p>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。</p>
夏妍妍	本基金的基金经理	2019-05-22	-	<p>8 年</p> <p>上海交通大学经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生，西门子财务租赁有限公司上海分公司高级财务分析师，2014 年加入海富通基金管理有限公司，历任固定收益投资部固定收益分析师、基金经理助理。2018 年 1 月至 2023 年 1 月任海富通欣益混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2018 年 4 月至 2021 年 5 月任海富通融丰定开债券基金经理。2019 年 5 月起兼任海富通安颐收益混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通聚合纯债基金经理。2019 年 10 月至 2020 年 11 月兼任海富通瑞丰债券基金经理。2019 年 10 月</p>

					至 2021 年 9 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2019 年 10 月至 2023 年 4 月兼任海富通富祥混合基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2021 年 5 月起兼任海富通美元债 (QDII) 基金经理。2021 年 8 月起兼任海富通瑞兴 3 个月定开债券基金经理。2022 年 7 月起兼任海富通策略收益债券基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

二季度，A 股市场有所回调，万得全 A 本季度下跌 3.2%，其余主要指数也有一定

回调，其中上证指数下跌 2.16%，沪深 300 下跌 5.15%，中证 800 下跌 5.21%，创业板指下跌 7.69%，市场阶段性处于调整状态。分行业来看，通信、传媒、家用电器位列二季度申万一级行业涨幅前三名，分别上涨 16%、6%和 5%，而商贸零售、食品饮料、建筑材料分列跌幅前三，分别下跌 19%、13%和 12%。

国际因素方面，前期美国银行危机风险事件改变市场风险偏好，美联储降息预期提前，进入二季度后由于美国通胀持续高企，市场对利率定价出现反复，持续紧缩预期抬头；另外，产业层面的 AI 浪潮显著提高了互联网企业的资本开支倾向，从应用端的百花齐放到算力芯片的订单超出预期，市场对 AI 的发展将如何融合进各行各业，进而提高生产率充满期待。在上述市场主线下，全球科技板块走出独立行情，促升一轮全球创业浪潮。

国内因素来看，首先，经济复苏表现出韧性，但一季度由于春节节庆以及补偿性消费，市场对经济复苏的预期抬得比较充分，且市场对房地产市场仍存在一定担忧，二季度市场对复苏节奏存在一个重新再修正的过程。另外，中国目前处于经济增长驱动结构的转型优化期，也有较多企业深度融合本轮 AI 创新浪潮，从 AI+软件到算力产业链，再到更基础的半导体设计与设备，市场对国内增长新动能也存在较高期待。

最后，今年是共建“一带一路”倡议提出 10 周年，我们在相关各领域已取得丰硕成果，随着未来更高水平、更深层次的区域合作加深，中国传统优势企业存在新一轮增长机会，二级市场的优质公司存在被再定价的机会。

报告期内，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。

本基金的投资思路将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，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。

固定收益方面，2 季度国内经济修复放缓，债券收益率先下后上。整体来看，本轮经济修复地产板块缺位，工业生产偏弱，服务业与消费发力。从 PMI 来看，4 月-6 月 PMI 连续低于 50%；4-5 月经济数据也反映当前经济修复放缓的情况。投资方面，制造业投资维持韧性，高技术行业贡献突出；基建投资由于基数问题增速略有回落；地产投资拖累经济的情况没有改善，受到保交楼政策的支持在竣工端方面明显改善。消费方面，受益于消费场景的改善与小长假效应延续修复趋势。出口方面下行压力不减，但结构上新能源相关板块有一些亮点。通胀方面，CPI 总体维持弱势，主要受到非食品类消费品价格拖累；PPI 受到基数与国内外需求共振走弱的影响同比跌幅走扩。在此经济环境下，2 季度货币政策维持相对宽松，6 月调降 OMO 与 MLF 利率 10bp。财政政策总量较去年有所回落，但使用效率有所提升。资金价格与流动性方面，2 季度信贷投放压力明显减弱，4 月与 5 月资金价格中枢普遍回落，6 月是传统信贷投放大月，抽水效应导致资金价格有所抬升，但总体仍在政策利率附近波动。2 季度 DR001 与 DR007 均值为 1.46%和 1.93%，分别较 1 季度回落 16bp 与 9bp。对应债市而言，收益率先下，降息后表现偏

弱。2 季度基本面数据普遍走弱，同时信贷需求偏弱，流动性宽松助推债市行情。6 月降息预期逐渐发酵，13 号降息落地后 10 年期国债收益率一度下行至 2.62% 附近的水平。但随后市场交易未来增量刺激政策的出台，收益率承压小幅震荡上行。

信用债方面，机构“钱多”逻辑继续推动信用债“资产荒”行情演绎，整体而言，“资产荒”行情沿着先拉久期、后沉资质的逻辑演绎，高等级短久期-高等级长久期-低等级短久期信用利差依次下行。6 月中旬，央行先后下调 OMO、MLF、LPR 利率，投资者止盈+博弈稳经济政策+资金偏紧，利率带动信用债调整。截至 6 月末，各信用品种收益率普遍位于历史 15% 分位数以内；信用债表现滞后于利率债，信用利差多数走扩，1Y 信用利差整体位于历史 15-30% 分位数，3Y AAA 信用利差位于历史 45% 分位数附近，3Y AA+、AA 以及 5Y 信用利差位于历史 50-75% 分位数，利差保护空间相对较大。

可转债方面，2 季度转债市场总体震荡，中证转债指数小幅收跌 0.15%，转债市场估值也基本持平。板块方面，通信和传媒走出独立行情，相应转债标的表现出色，而顺周期转债则跌幅较大。

2 季度，本基金债券部分继续精选中高等级信用债进行配置，同时以适度仓位参与利率债交易增厚收益。

3 季度，本基金债券部分将在严格控制风险的前提下，配置中高等级信用个券。同时，继续关注利率债的交易性机会，并配合股票部分投资策略，做好流动性管理。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通安颐收益混合 A 净值增长率为 0.45%，同期业绩比较基准收益率为 1.16%，基金净值跑输业绩比较基准 0.71 个百分点；海富通安颐收益混合 C 净值增长率为 0.43%，同期业绩比较基准收益率为 1.16%，基金净值跑输业绩比较基准 0.73 个百分点。报告期内，市场的预期博弈强于基本面，2 季度市场风格波动较大，风格趋于极致化，组合没能及时做出相应调整，股票现货部分跑输市场，导致基金净值跑输基准。

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	50,828,524.34	25.47
	其中：股票	50,828,524.34	25.47

2	固定收益投资	134,495,214.07	67.40
	其中：债券	134,495,214.07	67.40
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,659,066.09	4.84
7	其他资产	4,568,104.51	2.29
8	合计	199,550,909.01	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,267,676.00	0.68
C	制造业	32,577,708.02	17.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,168,430.60	0.62
E	建筑业	2,204,905.00	1.18
F	批发和零售业	1,029,943.00	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	884,868.94	0.47
H	住宿和餐饮业	109,910.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,112,133.25	2.73
J	金融业	2,995,043.20	1.60
K	房地产业	1,574,106.00	0.84
L	租赁和商务服务业	521,947.90	0.28
M	科学研究和技术服务业	949,510.43	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	60,507.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	116,840.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	254,995.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	50,828,524.34	27.16

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	19,000	1,119,480.00	0.60
2	000063	中兴通讯	22,600	1,029,204.00	0.55
3	600519	贵州茅台	600	1,014,600.00	0.54
4	601668	中国建筑	149,900	860,426.00	0.46
5	300274	阳光电源	7,300	851,399.00	0.45
6	300750	宁德时代	3,440	787,037.60	0.42
7	600919	江苏银行	102,100	750,435.00	0.40
8	300760	迈瑞医疗	2,200	659,560.00	0.35
9	600941	中国移动	6,700	625,110.00	0.33
10	600325	华发股份	56,000	551,600.00	0.29

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	30,698,523.29	16.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	31,830,272.52	17.01
	其中：政策性金融债	10,213,898.63	5.46
4	企业债券	35,835,931.78	19.15
5	企业短期融资券	5,048,895.07	2.70
6	中期票据	20,495,953.97	10.95
7	可转债(可交换债)	737,080.39	0.39
8	同业存单	9,848,557.05	5.26

9	其他	-	-
10	合计	134,495,214.07	71.87

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	210012	21 付息国债 12	200,000	20,518,734.25	10.96
2	2121062	21 北京农商 二级	100,000	10,299,392.33	5.50
3	101900051	19 华润 MTN001	100,000	10,254,076.71	5.48
4	230203	23 国开 03	100,000	10,213,898.63	5.46
5	185016	21 电科 01	100,000	10,194,315.07	5.45

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
IF2309	IF2309	-3.00	-3,455,100.00	69,192.00	-
公允价值变动总额合计(元)					69,192.00
股指期货投资本期收益(元)					291,025.58
股指期货投资本期公允价值变动(元)					69,192.00

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

本基金的股指期货投资以套期保值为主要目的，并选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或者空头套期保值，符合既定投资政策及投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的21北京农商二级（2121062）的发行人，因EAST数据漏报及报送不一致、数据错报、其他与数据报送相关的违规问题，于2022年11月21日被北京银保监局责令改正，并处罚款630万元。

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

报告期内本基金投资的23交通银行CD099（112306099）的发行人，因个人经营贷款挪用至房地产市场、个人消费贷款违规流入房地产市场、总行对分支机构管控不力承担管理责任，于2022年9月9日被中国银行保险监督管理委员会罚款500万元。因多期债务融资工具未按照发行文件约定开展余额包销，个别债务融资工具挤占了其他投资人的正常投标，多期债务融资工具的簿记建档利率区间未在充分询价基础上形成，发行工作程序执行不到位、工作开展不规范等违规行为，于2023年1月18日被中国银行间市场交易商协会予以警告，责令整改。

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

报告期内本基金投资的21建设银行二级01（2128025）的发行人，因公司治理和内部控制制度与监管规定不符，监管发现问题屡查屡犯或未充分整改，向检查组提供企业出具

的虚假证明材料，未按规定及时报送案件信息，违规发放房地产贷款等共计38项违法行为，于2023年2月16日被中国银行保险监督管理委员会没收违法所得并处罚款合计19891.5626万元；其中总行7341.5626万元，分支机构12550万元。

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

报告期内本基金投资的21重庆农商绿色金融债02（2121025）的发行人，因存在审查审批不尽职，超需求发放流动资金贷款形成风险，掩盖不良贷款，拨备覆盖率指标虚假、贷款减值准备不足，未按规定对质押资产进行审查即向政府融资平台公司发放贷款，同业授信调查及审查审批不尽职，贷款“三查”不尽职导致形成重大信用风险，同业投资业务不合规，贷后管理不到位、信贷资金被挪用，未执行统一授信管理等事实，于2022年11月11日被中国银行保险监督管理委员会重庆监管局罚款共计1285万元。因向投资者销售基金前，未按照《证券期货投资者适当性管理办法》向投资者告知信息，支行个别员工在未取得基金从业资格的情况下进行了基金宣传推介活动等问题，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，且该银行为地方中型银行，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。

其余六名证券的发行主体本期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	444,444.05
2	应收证券清算款	4,099,396.99
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	24,263.47
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,568,104.51

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	110053	苏银转债	252,689.49	0.14
2	110079	杭银转债	194,375.05	0.10
3	113050	南银转债	112,584.55	0.06
4	127054	双箭转债	105,807.41	0.06
5	113043	财通转债	56,623.59	0.03

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	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
本报告期期初基金份额总额	121,917,579.90	40,985,113.32
本报告期基金总申购份额	1,151,434.80	468,558.02
减：本报告期基金总赎回份额	12,660,537.47	2,848,970.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	110,408,477.23	38,604,700.80

§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

单位：份

项目	海富通安颐收益混合A	海富通安颐收益混合C
报告期期初管理人持有的本 基金份额	14,780,873.55	-
本报告期买入/申购总份额	-	-
本报告期卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本 基金份额	14,780,873.55	-
报告期期末持有的本基金份 额占基金总份额比例（%）	13.39	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 109 只公募基金。截至 2023 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1649 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。

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”。

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长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型明星基金奖”。

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安颐收益混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通安颐收益混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通安颐收益混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通安颐收益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它文件

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
二〇二三年七月二十一日