

# 海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金

**2023 年中期报告**

**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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

## §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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§4 管理人报告</b>	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 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	17
<b>§5 托管人报告</b>	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	21
<b>§7 投资组合报告</b>	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 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	53
7.7 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	54
7.8 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	54
7.9 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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
<b>§8 基金份额持有人信息</b>	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
8.3 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 .....	57
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>57</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
10.2 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 .....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
10.4 基金投资策略的改变 .....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.8 其他重大事件 .....	59
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>59</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	海富通富利三个月持有	
基金主代码	010850	
交易代码	010850	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 7 月 20 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	58,328,418.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
下属分级基金的交易代码	010850	010851
报告期末下属分级基金的份额总额	31,668,379.50 份	26,660,039.41 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。
投资策略	<p>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。</p> <p>股票投资方面，本基金将采用量化选股策略、风险估测模型——有效控制预期风险、交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩、投资组合的优化及调整、港股通标的股票的投资策略等策略；</p> <p>债券投资方面，本基金将采用利率策略、信用策略、收益率曲线策略、杠杆策略等策略。</p>
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	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	姜敏
	联系电话	021-38650788	4006800000
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		40088-40099	95558
传真		021-33830166	010-85230024
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	北京市朝阳区光华路10号院1 号楼6-30层、32-42层
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京市朝阳区光华路10号院1 号楼6-30层、32-42层
邮政编码		200120	100020
法定代表人		杨仓兵	朱鹤新

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
本期已实现收益	11,532.09	-45,048.92

本期利润	118,023.69	48,434.20
加权平均基金份额本期利润	0.0035	0.0017
本期加权平均净值利润率	0.36%	0.18%
本期基金份额净值增长率	0.22%	0.03%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
期末可供分配利润	-1,136,900.36	-1,157,882.54
期末可供分配基金份额利润	-0.0359	-0.0434
期末基金资产净值	30,531,479.14	25,502,156.87
期末基金份额净值	0.9641	0.9566
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
基金份额累计净值增长率	-3.59%	-4.34%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通富利三个月持有 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
过去一个月	0.20%	0.30%	0.62%	0.19%	-0.42%	0.11%
过去三个月	-0.87%	0.24%	-0.12%	0.17%	-0.75%	0.07%
过去六个月	0.22%	0.21%	0.89%	0.17%	-0.67%	0.04%
过去一年	-4.60%	0.25%	-1.30%	0.21%	-3.30%	0.04%
自基金合同生效起至今	-3.59%	0.28%	-2.89%	0.23%	-0.70%	0.05%

海富通富利三个月持有 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
过去一个月	0.17%	0.30%	0.62%	0.19%	-0.45%	0.11%

过去三个月	-0.97%	0.24%	-0.12%	0.17%	-0.85%	0.07%
过去六个月	0.03%	0.21%	0.89%	0.17%	-0.86%	0.04%
过去一年	-4.99%	0.25%	-1.30%	0.21%	-3.69%	0.04%
自基金合同生效起至今	-4.34%	0.28%	-2.89%	0.23%	-1.45%	0.05%

### 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

海富通富利三个月持有期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历史走势对比图  
 (2021年7月20日至2023年6月30日)

海富通富利三个月持有 A



海富通富利三个月持有 C





注：本基金合同于 2021 年 7 月 20 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 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 90 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。	2021-07-20	-	13 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。
杜晓海	本基金的基金经理；总经理	2021-07-20	-	23 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research

	助理兼量化投资部总监。				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 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。
林立禾	本基金的基金经理助理	2023-03-22	-	4 年	美国密歇根大学定量金融与风险管理硕士。历任中欧基金管理有限

					公司风险管理部量化风控岗。2020年8月加入海富通基金管理有限公司，任量化研究员。2022年10月起任海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金的基金经理助理。2022年12月起兼任海富通中证500增强型证券投资基金、海富通量化先锋股票型证券投资基金的基金经理助理。2023年3月起兼任海富通富利三个月持有期基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

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 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

上半年经济由一季度脉冲式修复，再到二季度修复速度有所放缓。整体来看对经济拉动的点在于服务业与消费，房地产与出口偏弱。从 PMI 来看，2 月与 3 月 PMI 大超预期，但随后 4-6 月 PMI 重回收缩区间。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；地产投资受到保交楼政策的支持仅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。出口方面受到海外需求不足的影响下行压力不减，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，主要由于工业消费品价格偏弱；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，上半年货币政策维持宽松，年初降准 25bp 释放中长期流动性约 5000 亿，MLF 超量续作，6 月调降 OMO 与 MLF 利率 10bp。

债券市场方面，上半年总体市场震荡偏强，年初经济复苏预期成为市场主流，1-2 月债市总体承压，10 年期国债到期收益率最高回到 2.9% 的水平。3 月以来随着贷款投放节奏趋缓，央行主动投放中长期流动性，基本面数据普遍回落，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政策的出台，收益率承压小幅震荡上行。

组合在上半年通过利率债券的投资，捕捉了资本利得的机会。

权益方面，2023 年上半年，国内经济总体呈现复苏态势，其中一季度由于积压需求释放表现尤其明显。3 月后经济运行有所放缓，总需求的修复本身需要一个过程，经济仍在主动去库存阶段，价格端呈现下行态势，但总体来说，上半年宏观经济呈现稳中向好态势，政策定力较足。海外方面，美国一季度发生银行业危机事件，美联储降息的预期时点一度被提前。但美国经济在二季度仍表现较强韧性，通胀读数仍偏高，市场对美国经济衰退的预期不断延后，相应利率终点的预期也后移，影响全球资产价格。产业端，上半年 AI 浪潮席卷全球，全球科技巨头大量增加相关资本开支，一些 AI 应用逐渐涌现，全球主要科技巨头走出牛市行情。

A 股市场整体表现稍弱，风格出现明显切换。春节前，顺周期风格下消费、金融、部分周期品、地产链涨幅靠前，出行链、新能源等资产表现较弱。随着 3 月后国内经济走弱以及 AI 科技浪潮爆发，权益市场出现明显风格切换，以 TMT 为代表的科技成长板块及以低估值、高股息为代表的“中特估”板块表现较好。二季度市场呈现了主题投资活跃的状态。

上半年 A 股主要指数表现方面，上证指数上涨 3.65%，沪深 300 下跌 0.75%，中证 800 上涨 0.02%，

中小综指上涨 2.25%，创业板指下跌 5.61%。分行业看，成长板块表现较强，通信、传媒、计算机行业分别上涨 50.7%、42.8%、27.6%；顺周期与消费板块相对落后，房地产和建筑材料行业分别下跌 14.3%、10.5%，商贸零售、美容护理、食品饮料行业分别下跌 23.4%、13.6%、9.1%。

从上半年市场内部结构来看，主线还是在成长，中字头央企行情也表现亮眼。成长主线基本从 2 月份开始演绎，随着 OpenAI 的 AI 软件全球用户数量的快速上升，3-4 月市场沿着应用-大模型-基础算力的产业变化在传媒、计算机、通信等板块寻找投资机会。由于全球科技龙头相关资本开支的快速增加，算力板块表现尤其突出。另外，由于消费疫后复苏条线预期充分，白酒、航空、机场等相关板块上半年表现弱势，而新能源板块跟随自身产业周期，调整幅度也较大。整体而言，市场上半年反映了中国经济内在结构调整的运行节奏，也反映了市场对产业优化升级的期待，产业逻辑仍是主导市场的线索。

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。投资操作中，本基金逐渐从基本面量化选股策略转变为依赖深度学习的高频量化选股策略，主要的股票策略对标偏股基金指数，并辅以多个低相关的卫星策略，包括红利、事件驱动策略等。基金整体持股分散，股票策略相对基准来说，在行业和风格上暴露有限，主要依靠模型的个股选择能力获取超额收益。基于股债性价比分析，报告期内本基金适当增加了权益仓位和转债仓位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通富利三个月持有 A 净值增长率为 0.22%，同期业绩比较基准收益率为 0.89%，基金净值跑输业绩比较基准 0.67 个百分点。海富通富利三个月持有 C 净值增长率为 0.03%，同期业绩比较基准收益率为 0.89%，基金净值跑输业绩比较基准 0.86 个百分点。报告期内，市场的预期博弈强于基本面，上半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，基金净值跑输基准。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年，经济进入平台期，同比增速回落。本轮经济修复的特征在于服务业与消费驱动，地产与出口偏弱，总体弹性不高。

下半年对债券市场中性偏乐观，把握逢高配置的机会。

权益方面，展望下半年，随着宏观政策基调转向稳增长，国内经济预期企稳，将进入自然复苏阶段，经济复苏的态势将延续。从库存周期看，下半年中美经济周期均将进入被动去库存阶段，今年年底明年年初可能进入主动补库存阶段，内需将逐步企稳回升，外需保持较强韧性。同时，在房

地产市场托底、地方债务化解背景下，国内货币政策将保持宽松状态，流动性合理充裕，对 A 股较为偏正面。海外，美联储加息周期也行至尾声，对全球风险资产估值的压制减轻。同时，随着国内外政策态度的明朗，上半年市场风险偏好逐步下行的过程基本结束，下半年风险偏好有望回升。

下半年，继续关注政策驱动、产业驱动的投资主线。结构上，受益于近期宏观政策的调整，顺周期核心资产包括消费、地产链、部分库存偏低的商品及制造业，将有修复性机会。以 AI 为代表的 TMT 板块，更多地需要关注其自身的技术、产品等产业周期发展，关注国内外 AI 应用的进展。中期看，经济结构变化带来的红利较为确定，汽车、半导体等受益于产业趋势及政策导向的行业，或更加容易把握。

展望后市，随着国内经济逐步企稳，企业盈利将逐渐修复，传统行业的盈利或将回升，股票市场短期仍然有波动，从估值来看，A 股整体估值水平较低，已经具备较好的性价比。具体操作上，基金未来主要依赖深度学习模型和高频选股策略，并根据市场情况，在一定范围内调整核心策略和卫星策略的相对权重。

#### 4.6 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

- 一、本基金本报告期内无应分配的收益。
- 二、已实施的利润分配：无。
- 三、不存在应分配但尚未实施的利润。



#### 4.8 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金 2023 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，海富通基金管理有限公司在海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，海富通基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2023 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	1,424,250.86	2,974,578.07
结算备付金		2,457,751.12	4,751,046.31

存出保证金		374,682.97	17,575.30
交易性金融资产	6.4.7.2	49,059,533.53	41,109,442.82
其中：股票投资		18,607,088.59	13,374,692.55
基金投资		-	-
债券投资		30,452,444.94	27,734,750.27
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,999,013.70	15,995,186.86
应收清算款		-	1,939.15
应收股利		4,356.62	-
应收申购款		234.99	469.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		56,319,823.79	64,850,238.42
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		100,174.84	57,768.31
应付赎回款		-	10,457.97
应付管理人报酬		36,926.05	44,648.32
应付托管费		6,923.65	8,371.59
应付销售服务费		8,365.76	10,063.41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		341.33	1,048.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	133,456.15	185,824.90
负债合计		286,187.78	318,182.79
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	58,328,418.91	67,259,915.49
未分配利润	6.4.7.8	-2,294,782.90	-2,727,859.86
净资产合计		56,033,636.01	64,532,055.63
负债和净资产总计		56,319,823.79	64,850,238.42

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 0.9641 元，C 类基金份额净值 0.9566 元。

基金份额总额 58,328,418.91 份，其中 A 类基金份额 31,668,379.50 份，C 类基金份额 26,660,039.41 份。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		585,821.57	-2,757,288.17
1.利息收入		156,329.71	217,949.29
其中：存款利息收入	6.4.7.9	34,418.72	169,480.78
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		121,910.99	48,468.51
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		229,507.04	-2,385,722.51
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-312,248.46	-5,366,489.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	376,413.14	1,129,198.24
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-38,255.03	1,615,285.53
股利收益	6.4.7.14	203,597.39	236,282.90
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	199,974.72	-643,460.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	10.10	53,945.09
<b>减：二、营业总支出</b>		419,363.68	985,429.94
1. 管理人报酬		236,444.62	579,700.87
2. 托管费		44,333.37	108,693.91
3. 销售服务费		53,062.34	165,829.36
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	12,612.62
其中：卖出回购金融资产支出		-	12,612.62
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		802.61	6,777.67
8. 其他费用	6.4.7.17	84,720.74	111,815.51
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>166,457.89</b>	<b>-3,742,718.11</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>166,457.89</b>	<b>-3,742,718.11</b>

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		166,457.89	-3,742,718.11

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	67,259,915.49	-	-2,727,859.86	64,532,055.63
二、本期期初净资产（基金净值）	67,259,915.49	-	-2,727,859.86	64,532,055.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,931,496.58	-	433,076.96	-8,498,419.62
（一）、综合收益总额	-	-	166,457.89	166,457.89
（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）	-8,931,496.58	-	266,619.07	-8,664,877.51
其中：1.基金申购款	711,435.89	-	-28,961.55	682,474.34
2.基金赎回款	-9,642,932.47	-	295,580.62	-9,347,351.85
（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）	58,328,418.91	-	-2,294,782.90	56,033,636.01
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合	未分配利润	净资产合计

		收益（若有）		
一、上期期末净资产（基金净值）	207,575,568.82	-	4,613,851.49	212,189,420.31
二、本期期初净资产（基金净值）	207,575,568.82	-	4,613,851.49	212,189,420.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-88,886,920.49	-	-3,602,022.98	-92,488,943.47
（一）、综合收益总额	-	-	-3,742,718.11	-3,742,718.11
（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）	-88,886,920.49	-	140,695.13	-88,746,225.36
其中：1.基金申购款	8,919,994.16	-	109,788.14	9,029,782.30
2.基金赎回款	-97,806,914.65	-	30,906.99	-97,776,007.66
（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）	118,688,648.33	-	1,011,828.51	119,700,476.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

海富通富利三个月持有期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]第 3093 号《关于准予海富通富利三个月持有期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《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，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 277,601,007.94

元。经向中国证监会备案，《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 7 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 277,641,140.11 份，其中认购资金利息折合 40,132.17 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/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/申购基金份额时不收取认/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。

本基金对每份基金份额设置三个月的最短持有期。对于每份基金份额，最短持有期起始日指基金合同生效日（对认购份额而言）、基金份额申购申请确认日（对申购份额而言）或基金份额转换转入确认日（对转换转入份额而言）；最短持有期到期日指该基金份额持有期起始日起三个月后的对应日（指某一个特定日期在后续月份中的对应日期），如该对应日为非工作日，则顺延至下一工作日。如无此对应日期，则取该月份的最后一日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含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、股票期权、国债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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产及存托凭证投资占基金资产的比例为 0-40%（其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%）；本基金投资同业存单不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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 8 月 30 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 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[2014]81 号《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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会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]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、

财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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。

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日



活期存款	1,424,250.86
等于：本金	1,424,153.04
加：应计利息	97.82
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	1,424,250.86

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	18,893,526.67	-	18,607,088.59	-286,438.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	100,263.10		
	市场	9,796,969.36	9,854,028.50	-43,203.96
	银行间		304,416.44	
	市场	20,380,146.67	20,598,416.44	-86,146.67
合计	30,177,116.03	404,679.54	30,452,444.94	-129,350.63
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	49,070,642.70	404,679.54	49,059,533.53	-415,788.71

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-2,042,100.00	-	-	-
——国债期货	-4,077,400.00	-	-	-
——国债期货	2,035,300.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-2,630,310.00	-	-	-
——股指期货	-2,630,310.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-4,672,410.00	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IH2308	IH2308	-1.00	-744,840.00	-660.00
IH2309	IH2309	-1.00	-746,640.00	-2,670.00
IF2308	IF2308	-1.00	-1,149,900.00	-7,740.00
TF2309	TF2309	-2.00	-2,043,300.00	-4,800.00
TF2312	TF2312	-2.00	-2,037,600.00	1,300.00
T2312	T2312	2.00	2,031,500.00	-3,800.00
合计	-	-	-	-18,370.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-18,370.00
净额	-	-	-	-

注：1.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。

2.按照国债期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金国债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——国债期货投资”与“证券清算款——国债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——国债期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 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 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,999,013.70	-
银行间市场	-	-

合计	2,999,013.70	-
----	--------------	---

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30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	68,989.38
其中：交易所市场	68,989.38
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	64,466.77
合计	133,456.15

#### 6.4.7.7 实收基金

海富通富利三个月持有 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,082,795.54	37,082,795.54
本期申购	18,662.57	18,662.57
本期赎回（以“-”号填列）	-5,433,078.61	-5,433,078.61
本期末	31,668,379.50	31,668,379.50

海富通富利三个月持有 C

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,177,119.95	30,177,119.95
本期申购	692,773.32	692,773.32
本期赎回（以“-”号填列）	-4,209,853.86	-4,209,853.86
本期末	26,660,039.41	26,660,039.41

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

海富通富利三个月持有 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	-636,480.51	-774,083.17	-1,410,563.68
本期利润	11,532.09	106,491.60	118,023.69
本期基金份额交易产生的变动数	86,901.12	68,738.51	155,639.63
其中：基金申购款	-298.50	-269.39	-567.89
基金赎回款	87,199.62	69,007.90	156,207.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-538,047.30	-598,853.06	-1,136,900.36

海富通富利三个月持有 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	-690,734.28	-626,561.90	-1,317,296.18
本期利润	-45,048.92	93,483.12	48,434.20
本期基金份额交易产生的变动数	79,171.33	31,808.11	110,979.44
其中：基金申购款	-13,920.92	-14,472.74	-28,393.66
基金赎回款	93,092.25	46,280.85	139,373.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-656,611.87	-501,270.67	-1,157,882.54

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	2,981.76
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	31,353.96
其他	83.00
合计	34,418.72

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	64,767,583.18
减：卖出股票成本总额	64,903,580.27
减：交易费用	176,251.37
买卖股票差价收入	-312,248.46

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	384,277.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-7,863.92
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	376,413.14

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,631,377.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,572,130.67
减：应计利息总额	66,222.73
减：交易费用	888.24
买卖债券差价收入	-7,863.92

**6.4.7.12 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.13 衍生工具收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益（税前）	-30,230.00
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	2,896.31
减：股指期货交易费用	6,973.64
国债期货投资收益（税前）	1,900.00
减：国债期货差价收入应缴纳增值税额	-
减：国债期货交易费用	55.08
合计	-38,255.03

**6.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	203,597.39
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	203,597.39

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	218,344.72
——股票投资	251,961.27
——债券投资	-33,616.55
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-18,370.00
——权证投资	-
——股指期货	-11,070.00
——国债期货	-7,300.00
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	199,974.72

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	10.08
基金转换费收入	0.02
合计	10.10

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
证券组合费	29.26
银行划款手续费	1,624.71
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	18,000.00
合计	84,720.74

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、注册登记机构、基金销售机构

中信银行股份有限公司(“中信银行”)	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

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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	134,651,598.22	100.00%	98,823,671.62	100.00%

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30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	98,064.04	100.00%	68,989.38	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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	71,943.97	100.00%	33,520.34	100.00%

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

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

##### 6.4.10.2 关联方报酬



**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	236,444.62	579,700.87
其中：支付销售机构的客户维护费	101,923.66	190,837.27

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。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	44,333.37	108,693.91

注：支付基金托管人中信银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 x0.15%/当年天数。

**6.4.10.2.3 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		
	2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C	合计
中信银行	-	39,579.74	39,579.74
海通证券	-	33.65	33.65
海富通基金	-	7,351.55	7,351.55
合计	-	46,964.94	46,964.94
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C	合计
中信银行	-	73,799.69	73,799.69
海通证券	-	447.30	447.30
海富通基金	-	65,869.52	65,869.52
合计	-	140,116.51	140,116.51

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  $\times$  0.40% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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。

##### 6.4.10.5.2 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。

#### 6.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	1,424,250.86	2,981.76	971,028.08	2,426.22

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

#### 6.4.10.8.1 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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、债券型基金，低于股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2023 年 6 月 30 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 8.87%（2022 年 12 月 31 日：0.08%）。

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。

##### 6.4.13.2.1 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,886,298.74	6,755,511.76
合计	4,886,298.74	6,755,511.76

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债。

##### 6.4.13.2.2 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	2,168,154.11	49,167.28
AAA 以下	2,799,575.65	-
未评级	20,598,416.44	20,930,071.23
合计	25,566,146.20	20,979,238.51

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为政策性金融债。

### 6.4.13.3 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在满足基金合同规定的持有期后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 6.4.12 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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,424,250.86	-	-	-	1,424,250.86

结算备付金	2,457,751.12	-	-	-	2,457,751.12
存出保证金	374,682.97	-	-	-	374,682.97
交易性金融资产	5,050,093.83	24,902,423.11	499,928.00	18,607,088.59	49,059,533.53
买入返售金融资产	2,999,013.70	-	-	-	2,999,013.70
应收股利	-	-	-	4,356.62	4,356.62
应收申购款	-	-	-	234.99	234.99
资产总计	12,305,792.48	24,902,423.11	499,928.00	18,611,680.20	56,319,823.79
负债					
应付清算款	-	-	-	100,174.84	100,174.84
应付管理人报酬	-	-	-	36,926.05	36,926.05
应付托管费	-	-	-	6,923.65	6,923.65
应付销售服务费	-	-	-	8,365.76	8,365.76
应交税费	-	-	-	341.33	341.33
其他负债	-	-	-	133,456.15	133,456.15
负债总计	-	-	-	286,187.78	286,187.78
利率敏感度缺口	12,305,792.48	24,902,423.11	499,928.00	18,325,492.42	56,033,636.01
<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	2,974,578.07	-	-	-	2,974,578.07
结算备付金	4,751,046.31	-	-	-	4,751,046.31
存出保证金	17,575.30	-	-	-	17,575.30
交易性金融资产	6,804,679.04	20,930,071.23	-	13,374,692.55	41,109,442.82
买入返售金融资产	15,995,186.86	-	-	-	15,995,186.86
应收清算款	-	-	-	1,939.15	1,939.15
应收申购款	-	-	-	469.91	469.91
资产总计	30,543,065.58	20,930,071.23	-	13,377,101.61	64,850,238.42
负债					
应付清算款	-	-	-	57,768.31	57,768.31
应付赎回款	-	-	-	10,457.97	10,457.97
应付管理人报酬	-	-	-	44,648.32	44,648.32
应付托管费	-	-	-	8,371.59	8,371.59
应付销售服务费	-	-	-	10,063.41	10,063.41
应交税费	-	-	-	1,048.29	1,048.29
其他负债	-	-	-	185,824.90	185,824.90

负债总计	-	-	-	318,182.79	318,182.79
利率敏感度缺口	30,543,065.58	20,930,071.23	-	13,058,918.82	64,532,055.63

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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	上年度末
		2023年6月30日	2022年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-119,749.79	-103,765.79
	市场利率下降 25 个基点	120,763.82	104,502.61

#### 6.4.13.4.2 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末		
	2023年6月30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	-	298,352.73	298,352.73
资产合计	-	298,352.73	298,352.73
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	-	298,352.73	298,352.73
项目	上年度末 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	-	392,833.37	392,833.37
资产合计	-	392,833.37	392,833.37
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	-	392,833.37	392,833.37

#### 6.4.13.4.2.2 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	14,917.64	19,641.67
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-14,917.64	-19,641.67	

#### 6.4.13.4.3 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。本基金股票资产及存托凭证投资占基金资产的比例为 0-40%（其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%）；本基金投资同业存单不超过基金资产的 20%。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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	18,607,088.59	33.21	13,374,692.55	20.73
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	18,607,088.59	33.21	13,374,692.55	20.73

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)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	上年度末

		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	556,546.37	671,806.04
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-556,546.37	-671,806.04

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	23,574,818.35	13,423,859.83
第二层次	25,484,715.18	27,685,582.99
第三层次	-	-
合计	49,059,533.53	41,109,442.82

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2022 年 12 月 31 日：无)。

###### 6.4.14.4 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买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 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	18,607,088.59	33.04
	其中：股票	18,607,088.59	33.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,452,444.94	54.07
	其中：债券	30,452,444.94	54.07
	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	2,999,013.70	5.32
	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	3,882,001.98	6.89
8	其他各项资产	379,274.58	0.67
9	合计	56,319,823.79	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 298,352.73 元，占资产净值比例为 0.53%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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	30,510.00	0.05
B	采矿业	1,038,138.00	1.85
C	制造业	9,957,531.38	17.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	851,391.80	1.52
E	建筑业	431,419.00	0.77
F	批发和零售业	407,754.00	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	771,286.60	1.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,070,533.42	3.70
J	金融业	1,450,032.20	2.59
K	房地产业	283,545.00	0.51
L	租赁和商务服务业	204,940.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	123,627.46	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	40,110.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	71,739.00	0.13
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	576,178.00	1.03
S	综合	-	-
	合计	18,308,735.86	32.67

### 7.2.2 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（%）
工业	194,906.57	0.35
信息技术	103,446.16	0.18
合计	298,352.73	0.53

注：以上分类采用国际通用的具有权威性的行业分类标准。

### 7.3 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	601186	中国铁建	18,700	184,195.00	0.33

1	01186	中国铁建	17,500	92,935.58	0.17
2	300750	宁德时代	1,100	251,669.00	0.45
3	601006	大秦铁路	32,400	240,732.00	0.43
4	601601	中国太保	8,300	215,634.00	0.38
5	000858	五粮液	1,300	212,641.00	0.38
6	000157	中联重科	31,100	209,925.00	0.37
7	688009	中国通号	35,301	204,745.80	0.37
8	601000	唐山港	57,900	204,387.00	0.36
9	601857	中国石油	26,700	199,449.00	0.36
10	601668	中国建筑	32,600	187,124.00	0.33
11	600028	中国石化	28,700	182,532.00	0.33
12	300760	迈瑞医疗	600	179,880.00	0.32
13	600757	长江传媒	20,700	178,020.00	0.32
14	601098	中南传媒	14,900	172,840.00	0.31
15	601766	中国中车	26,200	170,300.00	0.30
16	600519	贵州茅台	100	169,100.00	0.30
17	002028	思源电气	3,600	168,192.00	0.30
18	600941	中国移动	1,800	167,940.00	0.30
19	601728	中国电信	26,900	151,447.00	0.27
20	600637	东方明珠	18,200	142,324.00	0.25
21	000156	华数传媒	16,100	140,070.00	0.25
22	603605	珀莱雅	1,240	139,376.00	0.25
23	600183	生益科技	9,800	139,160.00	0.25
24	002415	海康威视	4,200	139,062.00	0.25
25	600398	海澜之家	19,900	136,912.00	0.24
26	002839	张家港行	32,300	136,629.00	0.24
27	600582	天地科技	22,300	130,009.00	0.23
28	601012	隆基绿能	4,500	129,015.00	0.23
29	601988	中国银行	32,700	127,857.00	0.23
30	002563	森马服饰	20,500	127,510.00	0.23
31	601818	光大银行	41,500	127,405.00	0.23
32	601899	紫金矿业	11,200	127,344.00	0.23
33	600438	通威股份	3,700	126,947.00	0.23
34	600879	航天电子	14,600	123,954.00	0.22
35	600309	万华化学	1,400	122,976.00	0.22
36	600085	同仁堂	2,100	120,876.00	0.22
37	000531	穗恒运 A	16,700	120,741.00	0.22
38	600050	中国联通	25,100	120,480.00	0.22
39	601965	中国汽研	5,700	117,705.00	0.21
40	603679	华体科技	7,800	116,376.00	0.21
41	002027	分众传媒	17,000	115,770.00	0.21
42	600410	华胜天成	15,600	115,752.00	0.21
43	002410	广联达	3,540	115,014.60	0.21
44	002587	奥拓电子	15,400	114,576.00	0.20

45	001210	金房能源	5,080	114,096.80	0.20
46	000338	潍柴动力	9,100	113,386.00	0.20
47	600019	宝钢股份	20,000	112,400.00	0.20
48	600489	中金黄金	10,800	111,564.00	0.20
49	000975	银泰黄金	9,500	111,150.00	0.20
50	300638	广和通	4,900	111,132.00	0.20
51	300119	瑞普生物	6,200	110,360.00	0.20
52	002152	广电运通	9,400	110,168.00	0.20
53	600025	华能水电	15,400	109,802.00	0.20
54	601077	渝农商行	29,900	107,341.00	0.19
55	600875	东方电气	5,700	106,305.00	0.19
56	605218	伟时电子	6,800	105,400.00	0.19
57	688079	美迪凯	9,401	105,197.19	0.19
58	603309	维力医疗	6,800	105,196.00	0.19
59	603811	诚意药业	8,400	104,412.00	0.19
60	600285	羚锐制药	6,500	104,390.00	0.19
61	300407	凯发电气	11,400	104,082.00	0.19
62	301186	超达装备	2,900	103,994.00	0.19
63	605499	东鹏饮料	600	103,740.00	0.19
64	002809	红墙股份	9,600	103,680.00	0.19
65	601567	三星医疗	8,200	103,566.00	0.18
66	00981	中芯国际	5,500	103,446.16	0.18
67	600016	民生银行	27,500	103,125.00	0.18
68	300493	润欣科技	11,300	103,056.00	0.18
69	601600	中国铝业	18,700	102,663.00	0.18
70	603228	景旺电子	4,000	102,600.00	0.18
71	002388	新亚制程	14,400	102,528.00	0.18
72	00144	招商局港口	10,000	101,970.99	0.18
73	300510	金冠股份	14,600	101,908.00	0.18
74	601086	国芳集团	22,800	101,460.00	0.18
75	601717	郑煤机	8,100	100,845.00	0.18
76	300226	上海钢联	3,100	100,440.00	0.18
77	000895	双汇发展	4,100	100,409.00	0.18
78	000333	美的集团	1,700	100,164.00	0.18
79	601512	中新集团	10,500	97,965.00	0.17
80	600613	神奇制药	14,500	97,440.00	0.17
81	603166	福达股份	14,200	95,708.00	0.17
82	603027	千禾味业	4,500	95,040.00	0.17
83	002032	苏泊尔	1,900	95,000.00	0.17
84	002938	鹏鼎控股	3,900	94,731.00	0.17
85	688111	金山办公	200	94,444.00	0.17
86	300845	捷安高科	4,300	93,439.00	0.17
87	002867	周大生	5,200	92,456.00	0.17
88	605089	味知香	2,346	92,197.80	0.16

89	300781	因赛集团	3,700	89,170.00	0.16
90	600845	宝信软件	1,712	86,986.72	0.16
91	000938	紫光股份	2,700	85,995.00	0.15
92	600373	中文传媒	6,400	85,248.00	0.15
93	600694	大商股份	4,800	85,104.00	0.15
94	000651	格力电器	2,300	83,973.00	0.15
95	600368	五洲交通	22,840	83,137.60	0.15
96	000650	仁和药业	13,400	82,276.00	0.15
97	000685	中山公用	10,600	80,242.00	0.14
98	603773	沃格光电	2,500	78,900.00	0.14
99	002465	海格通信	7,600	78,584.00	0.14
100	600548	深高速	8,700	78,126.00	0.14
101	603486	科沃斯	1,000	77,770.00	0.14
102	300418	昆仑万维	1,900	76,532.00	0.14
103	601225	陕西煤业	4,200	76,398.00	0.14
104	300036	超图软件	3,200	75,872.00	0.14
105	603990	麦迪科技	3,400	74,970.00	0.13
106	000712	锦龙股份	6,000	74,880.00	0.13
107	300700	岱勒新材	3,900	74,295.00	0.13
108	603808	歌力思	5,600	73,528.00	0.13
109	002306	中科云网	17,400	73,254.00	0.13
110	000739	普洛药业	4,100	72,734.00	0.13
111	603708	家家悦	5,800	72,732.00	0.13
112	600642	申能股份	10,300	71,997.00	0.13
113	000526	学大教育	2,700	71,739.00	0.13
114	603367	辰欣药业	4,700	71,346.00	0.13
115	003816	中国广核	22,900	71,219.00	0.13
116	600035	楚天高速	17,400	70,992.00	0.13
117	301021	英诺激光	2,700	70,578.00	0.13
118	300773	拉卡拉	4,000	69,760.00	0.12
119	600562	国睿科技	4,300	69,660.00	0.12
120	601992	金隅集团	31,900	69,542.00	0.12
121	002911	佛燃能源	5,400	69,444.00	0.12
122	600308	华泰股份	18,500	68,820.00	0.12
123	002128	电投能源	5,200	68,744.00	0.12
124	603115	海星股份	4,400	67,628.00	0.12
125	600048	保利发展	5,100	66,453.00	0.12
126	300919	中伟股份	1,100	66,275.00	0.12
127	002108	沧州明珠	14,600	66,138.00	0.12
128	300311	任子行	11,100	66,045.00	0.12
129	002105	信隆健康	11,100	66,045.00	0.12
130	600526	菲达环保	13,700	66,034.00	0.12
131	600738	丽尚国潮	12,600	65,772.00	0.12
132	000919	金陵药业	8,400	65,688.00	0.12



133	001218	丽臣实业	2,900	65,569.00	0.12
134	603239	浙江仙通	4,000	65,080.00	0.12
135	300440	运达科技	9,200	65,044.00	0.12
136	601997	贵阳银行	12,600	65,016.00	0.12
137	300074	华平股份	15,000	64,650.00	0.12
138	002374	中锐股份	16,300	64,222.00	0.11
139	600971	恒源煤电	8,200	63,878.00	0.11
140	600999	招商证券	4,700	63,779.00	0.11
141	000630	铜陵有色	21,900	63,291.00	0.11
142	002271	东方雨虹	2,300	62,698.00	0.11
143	000559	万向钱潮	11,400	62,130.00	0.11
144	000900	现代投资	15,400	62,062.00	0.11
145	600900	长江电力	2,800	61,768.00	0.11
146	600688	上海石化	19,500	60,645.00	0.11
147	601211	国泰君安	4,300	60,157.00	0.11
148	600820	隧道股份	10,000	60,100.00	0.11
149	301002	崧盛股份	2,900	59,856.00	0.11
150	003023	彩虹集团	2,900	59,479.00	0.11
151	600007	中国国贸	3,200	59,264.00	0.11
152	603878	武进不锈	7,000	59,150.00	0.11
153	688682	霍莱沃	700	58,618.00	0.10
154	603369	今世缘	1,100	58,080.00	0.10
155	000898	鞍钢股份	20,800	57,824.00	0.10
156	600886	国投电力	4,500	56,925.00	0.10
157	600711	盛屯矿业	11,700	56,862.00	0.10
158	300808	久量股份	4,200	56,700.00	0.10
159	300248	新开普	5,400	56,322.00	0.10
160	002736	国信证券	6,400	55,872.00	0.10
161	000401	冀东水泥	7,500	55,275.00	0.10
162	600479	千金药业	4,900	55,272.00	0.10
163	603886	元祖股份	3,000	55,020.00	0.10
164	688355	明志科技	1,800	54,756.00	0.10
165	601216	君正集团	13,200	54,120.00	0.10
166	600967	内蒙一机	5,300	53,530.00	0.10
167	600908	无锡银行	9,500	50,920.00	0.09
168	301300	远翔新材	1,600	50,560.00	0.09
169	000725	京东方 A	12,200	49,898.00	0.09
170	600674	川投能源	3,300	49,665.00	0.09
171	300183	东软载波	3,000	49,530.00	0.09
172	000528	柳工	6,200	48,980.00	0.09
173	688130	晶华微	1,100	48,510.00	0.09
174	002966	苏州银行	7,400	48,470.00	0.09
175	688511	天微电子	1,400	47,740.00	0.09
176	600180	瑞茂通	7,800	46,644.00	0.08

177	600929	雪天盐业	5,800	46,052.00	0.08
178	000063	中兴通讯	1,000	45,540.00	0.08
179	600027	华电国际	6,800	45,492.00	0.08
180	600030	中信证券	2,200	43,516.00	0.08
181	603156	养元饮品	1,700	41,990.00	0.07
182	600968	海油发展	13,100	40,217.00	0.07
183	300452	山河药辅	2,300	40,112.00	0.07
184	000888	峨眉山 A	3,500	40,110.00	0.07
185	301116	益客食品	2,600	40,040.00	0.07
186	300115	长盈精密	3,200	38,112.00	0.07
187	002179	中航光电	800	36,280.00	0.06
188	300838	浙江力诺	1,800	32,886.00	0.06
189	300822	贝仕达克	2,400	32,736.00	0.06
190	601727	上海电气	7,000	31,990.00	0.06
191	600350	山东高速	5,000	31,850.00	0.06
192	301089	拓新药业	500	30,970.00	0.06
193	002772	众兴菌业	2,700	30,510.00	0.05
194	603883	老百姓	1,000	29,850.00	0.05
195	600276	恒瑞医药	600	28,740.00	0.05
196	603861	白云电器	2,900	27,840.00	0.05
197	600177	雅戈尔	4,400	27,764.00	0.05
198	601288	农业银行	7,800	27,534.00	0.05
199	002156	通富微电	1,200	27,120.00	0.05
200	600210	紫江企业	5,000	26,600.00	0.05
201	000596	古井贡酒	100	24,738.00	0.04
202	600356	恒丰纸业	3,000	23,490.00	0.04
203	600376	首开股份	5,800	22,620.00	0.04
204	601328	交通银行	3,800	22,040.00	0.04
205	601169	北京银行	4,600	21,298.00	0.04
206	002110	三钢闽光	5,000	21,100.00	0.04
207	000568	泸州老窖	100	20,957.00	0.04
208	605336	帅丰电器	1,200	20,640.00	0.04
209	600282	南钢股份	6,100	20,557.00	0.04
210	000581	威孚高科	1,200	18,900.00	0.03
211	603580	艾艾精工	1,300	18,499.00	0.03
212	300684	中石科技	800	17,680.00	0.03
213	300491	通合科技	600	17,220.00	0.03
214	600273	嘉化能源	1,800	16,956.00	0.03
215	001979	招商蛇口	1,300	16,939.00	0.03
216	601688	华泰证券	1,200	16,524.00	0.03
217	002367	康力电梯	1,800	16,434.00	0.03
218	600390	五矿资本	2,900	15,602.00	0.03
219	603506	南都物业	1,300	15,379.00	0.03
220	300546	雄帝科技	800	14,744.00	0.03

221	605066	天正电气	1,400	13,174.00	0.02
222	603323	苏农银行	3,100	13,051.00	0.02
223	600919	江苏银行	1,700	12,495.00	0.02
224	002948	青岛银行	3,900	12,207.00	0.02
225	601126	四方股份	800	12,152.00	0.02
226	601398	工商银行	2,300	11,086.00	0.02
227	301135	瑞德智能	400	10,968.00	0.02
228	600901	江苏金租	2,540	10,490.20	0.02
229	301041	金百泽	300	9,936.00	0.02
230	600755	厦门国贸	800	6,192.00	0.01
231	003008	开普检测	200	5,746.00	0.01
232	600325	华发股份	500	4,925.00	0.01
233	601229	上海银行	800	4,600.00	0.01
234	002233	塔牌集团	400	3,088.00	0.01
235	601939	建设银行	400	2,504.00	0.00
236	688015	交控科技	94	1,642.18	0.00
237	688599	天合光能	38	1,619.18	0.00
238	688329	艾隆科技	49	1,587.60	0.00
239	688518	联赢激光	37	1,030.82	0.00
240	688678	福立旺	40	850.00	0.00
241	688389	普门科技	36	845.64	0.00
242	002312	川发龙蟒	100	813.00	0.00
243	688128	中国电研	31	790.50	0.00
244	688208	道通科技	23	697.13	0.00
245	688033	天宜上佳	36	688.32	0.00
246	688332	中科蓝讯	8	669.44	0.00
247	688226	威腾电气	12	261.84	0.00
248	688621	阳光诺和	3	176.46	0.00
249	688078	龙软科技	2	103.10	0.00
250	688819	天能股份	1	36.84	0.00
251	688597	煜邦电力	1	10.10	0.00

注：中国铁建同时在 A+H 股上市，合并计算其公允价值参与排序。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	300750	宁德时代	529,584.00	0.82
2	002415	海康威视	409,975.00	0.64
3	002304	洋河股份	392,885.00	0.61

4	300760	迈瑞医疗	378,953.00	0.59
5	601728	中国电信	373,566.00	0.58
6	600519	贵州茅台	368,271.00	0.57
7	601186	中国铁建	365,740.00	0.57
8	600941	中国移动	360,231.00	0.56
9	601098	中南传媒	352,438.00	0.55
10	002410	广联达	350,532.00	0.54
11	000568	泸州老窖	339,080.00	0.53
12	601668	中国建筑	329,931.00	0.51
13	601601	中国太保	313,784.00	0.49
14	688009	中国通号	300,209.39	0.47
15	000858	五粮液	295,358.00	0.46
16	601318	中国平安	285,529.00	0.44
17	601006	大秦铁路	275,886.00	0.43
18	600919	江苏银行	275,210.00	0.43
19	002938	鹏鼎控股	273,906.00	0.42
20	603466	风语筑	267,080.00	0.41

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。

#### 7.4.2 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	600519	贵州茅台	517,400.00	0.80
2	300750	宁德时代	486,661.00	0.75
3	601318	中国平安	436,633.00	0.68
4	000858	五粮液	396,360.00	0.61
5	002304	洋河股份	370,026.00	0.57
6	601888	中国中免	362,926.00	0.56
7	000568	泸州老窖	326,478.00	0.51
8	002555	三七互娱	307,477.00	0.48
9	600048	保利发展	306,342.00	0.47
10	600383	金地集团	301,055.00	0.47
11	300628	亿联网络	283,435.00	0.44
12	00700	腾讯控股	277,241.60	0.43
13	601668	中国建筑	275,395.00	0.43
14	600887	伊利股份	269,171.00	0.42
15	688599	天合光能	256,172.52	0.40
16	600919	江苏银行	254,263.00	0.39
17	603466	风语筑	251,639.00	0.39
18	01800	中国交通建设	250,925.58	0.39

19	600325	华发股份	250,747.00	0.39
20	600038	中直股份	245,077.00	0.38

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	69,884,015.04
卖出股票的收入（成交）总额	64,767,583.18

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。

#### 7.5 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	4,886,298.74	8.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,598,416.44	36.76
	其中：政策性金融债	20,598,416.44	36.76
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）	4,967,729.76	8.87
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,452,444.94	54.35

#### 7.6 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	200203	20 国开 03	200,000	20,598,416.44	36.76

2	019679	22 国债 14	48,000	4,886,298.74	8.72
3	113542	好客转债	1,500	170,697.12	0.30
4	110064	建工转债	1,500	169,359.04	0.30
5	128136	立讯转债	1,500	168,776.71	0.30

#### 7.7 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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。

#### 7.10 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。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据风险管理原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期，本基金未参与国债期货投资。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

##### 7.12.3 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	374,682.97
2	应收清算款	-
3	应收股利	4,356.62
4	应收利息	-
5	应收申购款	234.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	379,274.58

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113542	好客转债	170,697.12	0.30
2	110064	建工转债	169,359.04	0.30
3	128136	立讯转债	168,776.71	0.30
4	113046	金田转债	168,507.35	0.30
5	113065	齐鲁转债	167,881.47	0.30
6	127017	万青转债	167,703.08	0.30
7	110081	闻泰转债	167,592.25	0.30
8	113037	紫银转债	167,315.42	0.30
9	113033	利群转债	167,278.68	0.30
10	127056	中特转债	165,300.70	0.30
11	110067	华安转债	164,721.95	0.29
12	113045	环旭转债	163,795.09	0.29
13	113054	绿动转债	163,590.70	0.29
14	110089	兴发转债	163,325.42	0.29
15	110087	天业转债	162,985.52	0.29
16	113616	韦尔转债	162,964.60	0.29
17	113052	兴业转债	162,740.91	0.29
18	113042	上银转债	162,324.25	0.29
19	110073	国投转债	162,269.63	0.29
20	113056	重银转债	161,884.27	0.29

21	113044	大秦转债	161,722.63	0.29
22	113627	太平转债	160,992.52	0.29
23	113053	隆 22 转债	160,732.77	0.29
24	127015	希望转债	160,261.19	0.29
25	113043	财通转债	160,255.44	0.29
26	127024	盈峰转债	159,958.60	0.29
27	127025	冀东转债	159,556.06	0.28
28	127018	本钢转债	157,030.53	0.28
29	127042	嘉美转债	146,012.44	0.26
30	113049	长汽转债	61,472.31	0.11

### 7.12.5 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。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
海富通富利三个月持有 A	1,075	29,458.96	12,092.61	0.04%	31,656,286.89	99.96%
海富通富利三个月持有 C	307	86,840.52	3,000,540.00	11.25%	23,659,499.41	88.75%
合计	1,382	42,205.80	3,012,632.61	5.16%	55,315,786.30	94.84%

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)。

### 8.2 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	海富通富利三个月持有 A	209,959.23	0.6630%



	海富通富利三个月持有 C	894.15	0.0034%
	合计	210,853.38	0.3615%

**8.3 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	海富通富利三个月持有 A	10~50
	海富通富利三个月持有 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通富利三个月持有 A	10~50
	海富通富利三个月持有 C	0
	合计	10~50

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
基金合同生效日（2021 年 7 月 20 日）基金份额总额	120,616,157.58	157,024,982.53
本报告期期初基金份额总额	37,082,795.54	30,177,119.95
本报告期基金总申购份额	18,662.57	692,773.32
减：本报告期基金总赎回份额	5,433,078.61	4,209,853.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	31,668,379.50	26,660,039.41

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

**§10 重大事件揭示****10.1 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。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 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。

#### 10.4 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。

#### 10.5 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。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

##### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 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	134,651,598.22	100.00%	98,064.04	100.00%	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-

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。

##### 10.7.2 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	成交金额	占当期回	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		购成交总 额的比例		证成交总 额的比例
海通证券	22,598,788.36	100.00%	1,106,500,000.00	100.00%	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 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终止部分代销机构办理旗下基金相关销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-06
2	海富通基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-22
3	海富通基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-22
4	海富通基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理旗下基金相关销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
5	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加兴业银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-19
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海长量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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-26

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 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”。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通富利三个月持有期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

## 12.2 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

## 12.3 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

二〇二三年八月三十一日