

海富通欣荣灵活配置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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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

§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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	62
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	62
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
§9 开放式基金份额变动	65
§10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
10.8 其他重大事件	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息	69
§12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	海富通欣荣混合	
基金主代码	519223	
交易代码	519223	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2016年9月22日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	575,038,345.86 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
下属分级基金的交易代码	519224	519223
报告期末下属分级基金的份额总额	434,216,972.00 份	140,821,373.86 份

2.2 基金产品说明

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	本基金的资产配置策略以基金的投资目标为中心，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。债券投资采取“自上而下”的策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，在市场创新和变化中寻找投资机会，采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略和套利等积极投资管理方式，确定和构造合理的债券组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
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。

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	交通银行股份有限公司
信息披露	姓名	岳冲	陆志俊
	联系电话	021-38650788	95559

负责人	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559
传真		021-33830166	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		杨仓兵	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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）	
	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
本期已实现收益	1,270,893.86	390,243.69
本期利润	12,607,089.27	4,367,662.38
加权平均基金份额本期利润	0.0996	0.1355
本期加权平均净值利润率	6.51%	9.02%
本期基金份额净值增长率	3.84%	3.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
期末可供分配利润	85,502,029.86	26,472,867.62
期末可供分配基金份额利润	0.1969	0.1880
期末基金资产净值	540,479,575.59	174,182,529.86
期末基金份额净值	1.2447	1.2369
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
基金份额累计净值增长率	56.88%	56.10%

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

海富通欣荣混合 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
过去一个月	2.63%	0.82%	0.85%	0.43%	1.78%	0.39%
过去三个月	-0.65%	0.72%	-1.59%	0.41%	0.94%	0.31%
过去六个月	3.84%	0.74%	1.22%	0.42%	2.62%	0.32%
过去一年	-13.54%	0.91%	-4.86%	0.49%	-8.68%	0.42%
过去三年	7.80%	1.17%	3.56%	0.60%	4.24%	0.57%
自基金合同生效起至今	56.88%	1.07%	26.01%	0.58%	30.87%	0.49%

海富通欣荣混合 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
过去一个月	2.61%	0.83%	0.85%	0.43%	1.76%	0.40%
过去三个月	-0.70%	0.72%	-1.59%	0.41%	0.89%	0.31%
过去六个月	3.75%	0.74%	1.22%	0.42%	2.53%	0.32%
过去一年	-13.71%	0.91%	-4.86%	0.49%	-8.85%	0.42%
过去三年	7.17%	1.17%	3.56%	0.60%	3.61%	0.57%
自基金合同生效起至今	56.10%	1.07%	26.01%	0.58%	30.09%	0.49%

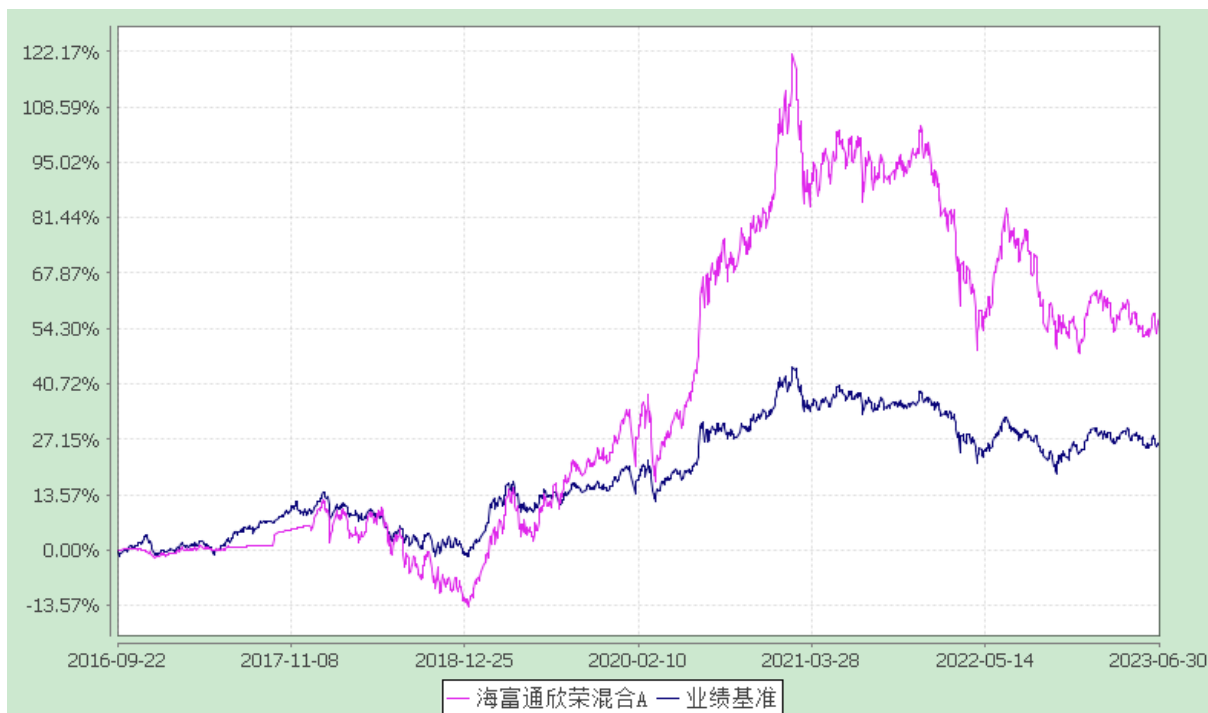
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通欣荣灵活配置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

(2016 年 9 月 22 日至 2023 年 6 月 30 日)

海富通欣荣混合 A



海富通欣荣混合 C



注：本基金合同于 2016 年 9 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。

§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		
杜晓海	本基金的基金经理；总经理助理兼量化投资部总监。	2016-09-28	-	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

				<p>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。</p>
--	--	--	--	---

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

2、证券从业年限的计算标准:自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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。

本报告期内, 市场风格轮动较快, 考虑到当前市场较为极致的交易结构以及后续基本面定价的回归, 在宏观经济复苏的前提下, 本基金积极配置拥挤度较低、盈利有预期改善的高性价比资产, 组合风格向均衡结构靠拢, 同时提升盈利质量和业绩因子的权重。

因子方面, 价值因子上半年表现较好, 模型中成长因子表现较差, 分析师预期类因子表现也较差, 老赛道成长股调整较多; 小市值因子、股息率、波动率因子在上半年表现较好。

组合风格上相对均衡, 在业绩和估值匹配的公司中寻找投资机会。本基金积极投资股票市场, 力争在风险可控的基础上跑赢市场。同时, 本基金积极参与新股申购, 以增强投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内, 海富通欣荣混合 A 净值增长率为 3.84%, 同期业绩比较基准收益率为 1.22%, 基金净值跑赢业绩比较基准 2.62 个百分点。海富通欣荣混合 C 净值增长率为 3.75%, 同期业绩比较基准收益率为 1.22%, 基金净值跑赢业绩比较基准 2.53 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

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，市场进入业绩披露期，投资主线重新回归到上市公司的业绩，短期关注景气改善品种。具体操作上，基金持仓会进一步聚焦在公司基本面向好，高股息或者改善、业绩确定性较强的标的上。同时，通过高频量化策略捕捉中小市值方面的投资机会。

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

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。

本基金报告期内进行过一次利润分配，以截止 2023 年 06 月 16 日本基金的可供分配利润为基准。本次分红于 2023 年 06 月 27 日完成权益登记，海富通欣荣混合 A 单位分红金额为 0.3159 元，海富通欣荣混合 C 单位分红金额为 0.3159 元。合计利润分配金额为 167,690,592.71 元。符合基金合

同规定。

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

本报告期内，基金托管人在海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，海富通基金管理有限公司在海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通欣荣灵活配置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	15,327,544.36	1,897,668.50
结算备付金		59,339,429.69	1,048,562.31
存出保证金		6,606,659.88	76,656.92

交易性金融资产	6.4.7.2	635,453,153.40	85,120,489.04
其中：股票投资		602,264,405.03	81,106,416.21
基金投资		-	-
债券投资		33,188,748.37	4,014,072.83
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	-	-
应收清算款		1,763,978.22	875,146.63
应收股利		-	-
应收申购款		509.68	67.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		718,491,275.23	89,018,591.39
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
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		2,271,646.01	-
应付赎回款		30.46	755,427.74
应付管理人报酬		397,968.30	71,839.45
应付托管费		99,492.08	17,959.86
应付销售服务费		34,772.68	4,189.53
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.13	0.49
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,025,260.12	489,465.89
负债合计		3,829,169.78	1,338,882.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	575,038,345.86	58,047,908.74
未分配利润	6.4.7.8	139,623,759.59	29,631,799.69
净资产合计		714,662,105.45	87,679,708.43
负债和净资产总计		718,491,275.23	89,018,591.39

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.2447 元，C 类基金份额净值 1.2369 元。

基金份额总额 575,038,345.86 份，其中 A 类基金份额 434,216,972.00 份，C 类基金份额 140,821,373.86 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通欣荣灵活配置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
一、营业总收入		18,007,943.92	-60,012,993.49
1.利息收入		194,056.08	114,994.83
其中：存款利息收入	6.4.7.9	192,613.07	108,033.19
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		1,443.01	6,961.64
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,500,150.26	-8,865,520.50
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,499,361.80	-11,744,214.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	127,160.60	468,781.35
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	-923,807.13	489,401.84
股利收益	6.4.7.14	6,796,158.59	1,920,510.55
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	15,313,614.10	-51,382,390.51
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	123.48	119,922.69
减：二、营业总支出		1,033,192.27	1,462,541.33
1. 管理人报酬		712,704.89	1,000,824.29
2. 托管费		178,176.21	250,206.10
3. 销售服务费		47,237.38	96,607.71
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		311.63	3,441.22
8. 其他费用	6.4.7.17	94,762.16	111,462.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,974,751.65	-61,475,534.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,974,751.65	-61,475,534.82

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		16,974,751.65	-61,475,534.82

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海富通欣荣灵活配置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）	58,047,908.74	-	29,631,799.69	87,679,708.43
二、本期期初净资产（基金净值）	58,047,908.74	-	29,631,799.69	87,679,708.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	516,990,437.12	-	109,991,959.90	626,982,397.02
（一）、综合收益总额	-	-	16,974,751.65	16,974,751.65
（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）	516,990,437.12	-	260,707,800.96	777,698,238.08
其中：1.基金申购款	532,190,821.33	-	269,497,339.99	801,688,161.32
2.基金赎回款	-15,200,384.21	-	-8,789,539.03	-23,989,923.24
（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）	-	-	-167,690,592.71	-167,690,592.71
四、本期期末净资产（基金净值）	575,038,345.86	-	139,623,759.59	714,662,105.45
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）	271,692,015.70	-	270,769,543.23	542,461,558.93
二、本期期初净资产（基金净值）	271,692,015.70	-	270,769,543.23	542,461,558.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-127,875,853.88	-	-153,837,916.29	-281,713,770.17
（一）、综合收益总额	-	-	-61,475,534.82	-61,475,534.82
（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）	-127,875,853.88	-	-92,362,381.47	-220,238,235.35
其中：1.基金申购款	6,322,378.60	-	5,388,514.82	11,710,893.42
2.基金赎回款	-134,198,232.48	-	-97,750,896.29	-231,949,128.77
（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）	143,816,161.82	-	116,931,626.94	260,747,788.76

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

海富通欣荣灵活配置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[2016]第 1480 号《关于准予海富通欣荣灵活配置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《海富通欣荣灵活配置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 450,020,570.20 元，业经普华永道中天会

会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1193 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 450,135,331.01 份,其中认购资金利息折合 114,760.81 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、权证、股指期货等权益类品种,债券等固定收益类品种(包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等),国债期货,以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。本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 50%+中证全债指数收益率 \times 50%。

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》、

《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

本基金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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

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

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,

债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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	15,327,544.36
等于：本金	15,321,067.77
加：应计利息	6,476.59
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	15,327,544.36

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	589,284,015.54	-	602,264,405.03	12,980,389.49

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	32,841,380.54	299,808.37	33,188,748.37	47,559.46
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	32,841,380.54	299,808.37	33,188,748.37	47,559.46
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		622,125,396.08	299,808.37	635,453,153.40	13,027,948.95

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	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	53,243,219.00	-	-	-
——股指期货	53,243,219.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	53,243,219.00	-	-	-

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
IM2309	IM2309	3.00	3,921,840.00	-7,560.00
IF2309	IF2309	43.00	49,523,100.00	209,281.00
合计	-	-	-	201,721.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	201,721.00
净额	-	-	-	-

注：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。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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	950,793.35
其中：交易所市场	950,793.35
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	74,466.77
合计	1,025,260.12

6.4.7.7 实收基金

海富通欣荣混合 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	56,248,162.23	56,248,162.23
本期申购	390,912,078.39	390,912,078.39

本期赎回（以“-”号填列）	-12,943,268.62	-12,943,268.62
本期末	434,216,972.00	434,216,972.00

海富通欣荣混合 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	1,799,746.51	1,799,746.51
本期申购	141,278,742.94	141,278,742.94
本期赎回（以“-”号填列）	-2,257,115.59	-2,257,115.59
本期末	140,821,373.86	140,821,373.86

注：申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

海富通欣荣混合 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	28,965,683.44	-242,041.53	28,723,641.91
本期利润	1,270,893.86	11,336,195.41	12,607,089.27
本期基金份额交易产生的变动数	178,543,697.74	9,666,419.85	188,210,117.59
其中：基金申购款	185,329,856.04	10,435,469.16	195,765,325.20
基金赎回款	-6,786,158.30	-769,049.31	-7,555,207.61
本期已分配利润	-123,278,245.18	-	-123,278,245.18
本期末	85,502,029.86	20,760,573.73	106,262,603.59

海富通欣荣混合 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	913,538.49	-5,380.71	908,157.78
本期利润	390,243.69	3,977,418.69	4,367,662.38
本期基金份额交易产生的变动数	69,581,432.97	2,916,250.40	72,497,683.37
其中：基金申购款	70,707,937.44	3,024,077.35	73,732,014.79
基金赎回款	-1,126,504.47	-107,826.95	-1,234,331.42
本期已分配利润	-44,412,347.53	-	-44,412,347.53
本期末	26,472,867.62	6,888,288.38	33,361,156.00

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	60,143.63
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	72,878.21
其他	59,591.23
合计	192,613.07

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	478,551,699.98
减：卖出股票成本总额	480,393,764.02
减：交易费用	1,657,297.76
买卖股票差价收入	-3,499,361.80

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	109,805.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	17,354.82
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	127,160.60

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	19,499,795.79

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	19,264,852.77
减：应计利息总额	217,453.67
减：交易费用	134.53
买卖债券差价收入	17,354.82

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）	-910,841.00
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	2,552.62
减：交易费用	10,413.51
合计	-923,807.13

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	6,796,158.59
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	6,796,158.59

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	15,111,893.10
——股票投资	15,071,806.93
——债券投资	40,086.17
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	201,721.00
——权证投资	-
——股指期货	201,721.00

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	15,313,614.10

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	123.48
合计	123.48

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	49,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,695.39
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	18,000.00
合计	94,762.16

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、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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	3,227,847.36	0.22%	82,927,201.95	13.16%

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	2,360.02	0.22%	-	-
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	58,985.75	12.93%	-	-

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	712,704.89	1,000,824.29
其中：支付销售机构的客户维护费	8,688.10	3,119.05

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 x 0.60%/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	178,176.21	250,206.10

注：支付基金托管人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 x 0.15%/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		
	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C	合计
交通银行	-	-	-
海通证券	-	1.81	1.81
海富通	-	44,743.30	44,743.30
合计	-	44,745.11	44,745.11
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		
	海富通欣荣混合A	海富通欣荣混合C	合计
交通银行	-	-	-
海通证券	-	1.76	1.76
海富通	-	95,794.00	95,794.00
合计	-	95,795.76	95,795.76

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 0.20%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.20% 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 0.20% / 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
交通银行	15,327,544.36	60,143.63	7,242,824.55	43,628.60

6.4.10.7 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

2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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	2,849	235,868.71
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

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

海富通欣荣混合 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	利润分配合 计	备注
1	2023-06-27	2023-06-27	3.159	68,964,400.2 0	54,313,844.9 8	123,278,245. 18	-
合计			3.159	68,964,400.2 0	54,313,844.9 8	123,278,245. 18	-

海富通欣荣混合 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	利润分配合计	备注
1	2023-06-27	2023-06-27	3.159	44,127,915.94	284,431.59	44,412,347.53	-
合计			3.159	44,127,915.94	284,431.59	44,412,347.53	-

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	新股锁定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新股未上市并锁定	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6 个月	新股锁定	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6 个月	新股锁定	35.66	33.26	129	4,600.14	4,290.54	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新股锁定	72.50	58.42	62	4,495.00	3,622.04	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	新股未上市并锁定	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内	新股未上	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-

			(含)	市						
30129 1	明阳 电气	2023-0 6-21	6 个月	新股 锁定	38.13	31.03	1,101	41,981 .13	34,164 .03	-
30129 2	海科 新源	2023-0 6-29	6 个月	新股 未上 市并 锁定	19.99	19.99	583	11,654 .17	11,654 .17	-
30129 2	海科 新源	2023-0 6-29	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	19.99	19.99	5,241	104,76 7.59	104,76 7.59	-
30131 5	威士 顿	2023-0 6-13	6 个月	新股 锁定	32.29	51.12	226	7,297. 54	11,553 .12	-
30137 6	致欧 科技	2023-0 6-14	6 个月	新股 锁定	24.66	22.51	420	10,357 .20	9,454. 20	-
30148 8	豪恩 汽电	2023-0 6-26	6 个月	新股 未上 市并 锁定	39.78	39.78	262	10,422 .36	10,422 .36	-
30148 8	豪恩 汽电	2023-0 6-26	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	39.78	39.78	2,356	93,721 .68	93,721 .68	-
68842 9	时创 能源	2023-0 6-20	6 个月	新股 锁定	19.20	25.53	346	6,643. 20	8,833. 38	-
68860 3	天承 科技	2023-0 6-30	6 个月	新股 未上 市并 锁定	55.00	55.00	140	7,700. 00	7,700. 00	-
68860 3	天承 科技	2023-0 6-30	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	55.00	55.00	1,251	68,805 .00	68,805 .00	-
68863 1	莱斯 信息	2023-0 6-19	6 个月	新股 锁定	25.28	29.87	336	8,494. 08	10,036 .32	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限 期	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
11803 6	力合 转债	2023-0 6-28	1 个月 内 (含)	老股 东配 债	100.00	100.00	2,270	227,00 0.00	227,00 4.48	-

6.4.12.2 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	股票	停牌	停牌	期末估	复牌	复牌	数量	期末	期末	备注
----	----	----	----	-----	----	----	----	----	----	----

代码	名称	日期	原因	值单价	日期	开 盘 单 价	(单位：股)	成本总额	估值总额	
601298	青岛港	2023-06-28	重大事项停牌	6.97	2023-07-03	7.40	28,800	166,257.00	200,736.00	-

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

本基金是一只混合型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”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 0.03%（2022 年 12 月 31 日：0.07%）。

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	32,961,743.89	3,950,079.21
合计	32,961,743.89	3,950,079.21

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	-	-
AAA 以下	227,004.48	63,993.62
未评级	-	-
合计	227,004.48	63,993.62

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。

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	15,327,544.36	-	-	-	15,327,544.36
结算备付金	59,339,429.69	-	-	-	59,339,429.69
存出保证金	193,267.08	-	-	6,413,392.80	6,606,659.88
交易性金融资产	32,961,743.89	-	227,004.48	602,264,405.03	635,453,153.40
应收清算款	-	-	-	1,763,978.22	1,763,978.22
应收申购款	-	-	-	509.68	509.68
资产总计	107,821,985.02	-	227,004.48	610,442,285.73	718,491,275.23

负债					
应付清算款	-	-	-	2,271,646.01	2,271,646.01
应付赎回款	-	-	-	30.46	30.46
应付管理人报酬	-	-	-	397,968.30	397,968.30
应付托管费	-	-	-	99,492.08	99,492.08
应付销售服务费	-	-	-	34,772.68	34,772.68
应交税费	-	-	-	0.13	0.13
其他负债	-	-	-	1,025,260.12	1,025,260.12
负债总计	-	-	-	3,829,169.78	3,829,169.78
利率敏感度缺口	107,821,985.02	-	227,004.48	606,613,115.95	714,662,105.45
上年度末 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	1,897,668.50	-	-	-	1,897,668.50
结算备付金	1,048,562.31	-	-	-	1,048,562.31
存出保证金	76,656.92	-	-	-	76,656.92
交易性金融资产	3,950,079.21	-	63,993.62	81,106,416.21	85,120,489.04
应收清算款	-	-	-	875,146.63	875,146.63
应收申购款	-	-	-	67.99	67.99
资产总计	6,972,966.94	-	63,993.62	81,981,630.83	89,018,591.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	755,427.74	755,427.74
应付管理人报酬	-	-	-	71,839.45	71,839.45
应付托管费	-	-	-	17,959.86	17,959.86
应付销售服务费	-	-	-	4,189.53	4,189.53
应交税费	-	-	-	0.49	0.49
其他负债	-	-	-	489,465.89	489,465.89
负债总计	-	-	-	1,338,882.96	1,338,882.96
利率敏感度缺口	6,972,966.94	-	63,993.62	80,642,747.87	87,679,708.43

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-46,919.34	-3,957.20
市场利率下降 25 个基点	47,140.32	3,982.85	

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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或银行间同业市场交易的股票和债券，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，采用“自上而下”的策略，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市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资及存托凭证比例为基金总资产的 0%-95%。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	602,264,405.03	84.27	81,106,416.21	92.50
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	602,264,405.03	84.27	81,106,416.21	92.50

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	27,537,713.38	4,269,362.33
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-27,537,713.38	-4,269,362.33

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	601,510,282.43	80,519,953.31
第二层次	33,838,368.07	4,074,951.21
第三层次	104,502.90	525,584.52
合计	635,453,153.40	85,120,489.04

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

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	602,264,405.03	83.82
	其中：股票	602,264,405.03	83.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	33,188,748.37	4.62
	其中：债券	33,188,748.37	4.62

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	74,666,974.05	10.39
8	其他各项资产	8,371,147.78	1.17
9	合计	718,491,275.23	100.00

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	681,920.00	0.10
B	采矿业	13,400,257.48	1.88
C	制造业	378,568,971.72	52.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,496,099.56	1.75
E	建筑业	29,186,034.80	4.08
F	批发和零售业	20,614,997.20	2.88
G	交通运输、仓储和邮政业	12,301,075.00	1.72
H	住宿和餐饮业	716,310.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,268,776.92	7.87
J	金融业	34,483,695.80	4.83
K	房地产业	12,334,751.00	1.73
L	租赁和商务服务业	9,936,395.20	1.39
M	科学研究和技术服务业	8,798,682.70	1.23
N	水利、环境和公共设施管理业	1,264,794.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	27,713.00	0.00
Q	卫生和社会工作	1,149,398.65	0.16
R	文化、体育和娱乐业	10,034,532.00	1.40
S	综合	-	-

	合计	602,264,405.03	84.27
--	----	----------------	-------

7.2.2 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。

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	300750	宁德时代	54,900	12,560,571.00	1.76
2	000063	中兴通讯	247,300	11,262,042.00	1.58
3	000333	美的集团	186,764	11,004,134.88	1.54
4	601668	中国建筑	1,759,200	10,097,808.00	1.41
5	600919	江苏银行	815,600	5,994,660.00	0.84
6	300760	迈瑞医疗	19,800	5,936,040.00	0.83
7	600519	贵州茅台	3,500	5,918,500.00	0.83
8	600941	中国移动	62,400	5,821,920.00	0.81
9	002126	银轮股份	327,700	5,800,290.00	0.81
10	002371	北方华创	17,000	5,400,050.00	0.76
11	600566	济川药业	183,500	5,328,840.00	0.75
12	601058	赛轮轮胎	456,500	5,199,535.00	0.73
13	002345	潮宏基	652,800	5,131,008.00	0.72
14	600131	国网信通	249,500	5,037,405.00	0.70
15	300274	阳光电源	42,800	4,991,764.00	0.70
16	601899	紫金矿业	430,600	4,895,922.00	0.69
17	600325	华发股份	459,100	4,522,135.00	0.63
18	300130	新国都	159,300	4,512,969.00	0.63
19	000400	许继电气	190,198	4,384,063.90	0.61
20	600415	小商品城	507,800	4,331,534.00	0.61
21	601567	三星医疗	341,700	4,315,671.00	0.60
22	600511	国药股份	109,500	4,254,075.00	0.60
23	600426	华鲁恒升	136,990	4,196,003.70	0.59
24	603129	春风动力	25,900	4,193,210.00	0.59
25	002984	森麒麟	133,200	4,190,472.00	0.59
26	002555	三七互娱	116,500	4,063,520.00	0.57
27	000589	贵州轮胎	721,200	4,038,720.00	0.57
28	603298	杭叉集团	169,300	3,987,015.00	0.56
29	002154	报喜鸟	720,000	3,974,400.00	0.56
30	600572	康恩贝	567,800	3,889,430.00	0.54
31	603035	常熟汽饰	199,400	3,874,342.00	0.54

32	603187	海容冷链	186,260	3,723,337.40	0.52
33	603993	洛阳钼业	681,600	3,632,928.00	0.51
34	002011	盾安环境	259,800	3,593,034.00	0.50
35	600048	保利发展	274,500	3,576,735.00	0.50
36	300223	北京君正	40,000	3,532,400.00	0.49
37	300146	汤臣倍健	144,700	3,469,906.00	0.49
38	002014	永新股份	398,000	3,454,640.00	0.48
39	605599	菜百股份	259,300	3,425,353.00	0.48
40	688009	中国通号	589,117	3,416,878.60	0.48
41	600036	招商银行	103,800	3,400,488.00	0.48
42	300316	晶盛机电	46,800	3,318,120.00	0.46
43	603444	吉比特	6,700	3,290,437.00	0.46
44	601318	中国平安	68,700	3,187,680.00	0.45
45	002867	周大生	179,000	3,182,620.00	0.45
46	600908	无锡银行	587,400	3,148,464.00	0.44
47	300982	苏文电能	51,500	3,118,840.00	0.44
48	600803	新奥股份	158,800	3,014,024.00	0.42
49	600570	恒生电子	66,700	2,954,143.00	0.41
50	002517	恺英网络	186,600	2,937,084.00	0.41
51	000960	锡业股份	188,600	2,932,730.00	0.41
52	000858	五粮液	17,800	2,911,546.00	0.41
53	601601	中国太保	107,900	2,803,242.00	0.39
54	000988	华工科技	73,500	2,793,735.00	0.39
55	600820	隧道股份	462,200	2,777,822.00	0.39
56	601838	成都银行	226,800	2,769,228.00	0.39
57	601689	拓普集团	33,800	2,727,660.00	0.38
58	605009	豪悦护理	56,600	2,716,800.00	0.38
59	601126	四方股份	178,200	2,706,858.00	0.38
60	605167	利柏特	279,400	2,704,592.00	0.38
61	600066	宇通客车	181,800	2,679,732.00	0.37
62	600901	江苏金租	647,780	2,675,331.40	0.37
63	688425	铁建重工	550,435	2,647,592.35	0.37
64	601186	中国铁建	264,900	2,609,265.00	0.37
65	600138	中青旅	208,400	2,607,084.00	0.36
66	603927	中科软	67,500	2,602,800.00	0.36
67	601398	工商银行	538,700	2,596,534.00	0.36
68	688128	中国电研	101,338	2,584,119.00	0.36
69	002705	新宝股份	142,700	2,572,881.00	0.36
70	300592	华凯易佰	93,800	2,553,236.00	0.36
71	002463	沪电股份	119,100	2,493,954.00	0.35
72	600861	北京人力	105,600	2,449,920.00	0.34
73	600872	中炬高新	66,500	2,446,535.00	0.34
74	688596	正帆科技	56,493	2,446,146.90	0.34
75	688589	力合微	59,899	2,440,285.26	0.34

76	600989	宝丰能源	193,500	2,440,035.00	0.34
77	002318	久立特材	142,200	2,421,666.00	0.34
78	002727	一心堂	90,500	2,389,200.00	0.33
79	002063	远光软件	271,100	2,353,148.00	0.33
80	600079	人福医药	86,400	2,327,616.00	0.33
81	603801	志邦家居	70,100	2,314,702.00	0.32
82	603043	广州酒家	81,700	2,308,842.00	0.32
83	002937	兴瑞科技	93,000	2,287,800.00	0.32
84	601816	京沪高铁	432,500	2,274,950.00	0.32
85	003006	百亚股份	129,100	2,230,848.00	0.31
86	688332	中科蓝讯	26,437	2,212,248.16	0.31
87	002158	汉钟精机	87,100	2,174,016.00	0.30
88	000338	潍柴动力	170,000	2,118,200.00	0.30
89	600970	中材国际	163,400	2,083,350.00	0.29
90	002439	启明星辰	69,300	2,062,368.00	0.29
91	601390	中国中铁	269,800	2,045,084.00	0.29
92	603486	科沃斯	26,100	2,029,797.00	0.28
93	601000	唐山港	572,600	2,021,278.00	0.28
94	600600	青岛啤酒	19,500	2,020,785.00	0.28
95	002050	三花智控	66,264	2,005,148.64	0.28
96	605368	蓝天燃气	208,800	1,998,216.00	0.28
97	603369	今世缘	37,400	1,974,720.00	0.28
98	002027	分众传媒	286,100	1,948,341.00	0.27
99	601766	中国中车	299,600	1,947,400.00	0.27
100	601138	工业富联	76,700	1,932,840.00	0.27
101	601857	中国石油	258,600	1,931,742.00	0.27
102	600582	天地科技	330,500	1,926,815.00	0.27
103	002410	广联达	58,680	1,906,513.20	0.27
104	002595	豪迈科技	52,800	1,854,864.00	0.26
105	002271	东方雨虹	68,025	1,854,361.50	0.26
106	600933	爱柯迪	79,500	1,851,555.00	0.26
107	601728	中国电信	327,000	1,841,010.00	0.26
108	688626	翔宇医疗	38,993	1,774,571.43	0.25
109	300408	三环集团	60,320	1,770,392.00	0.25
110	601006	大秦铁路	238,100	1,769,083.00	0.25
111	300866	安克创新	20,200	1,767,500.00	0.25
112	688239	航宇科技	25,132	1,757,983.40	0.25
113	002737	葵花药业	70,600	1,718,404.00	0.24
114	605377	华旺科技	94,900	1,712,945.00	0.24
115	600710	苏美达	199,700	1,709,432.00	0.24
116	603920	世运电路	87,300	1,704,969.00	0.24
117	601988	中国银行	433,500	1,694,985.00	0.24
118	601369	陕鼓动力	183,500	1,671,685.00	0.23
119	600674	川投能源	110,100	1,657,005.00	0.23

120	603889	新澳股份	217,500	1,633,425.00	0.23
121	000933	神火股份	123,600	1,606,800.00	0.22
122	688621	阳光诺和	27,105	1,594,316.10	0.22
123	601717	郑煤机	128,000	1,593,600.00	0.22
124	001979	招商蛇口	121,500	1,583,145.00	0.22
125	000938	紫光股份	49,120	1,564,472.00	0.22
126	300773	拉卡拉	88,900	1,550,416.00	0.22
127	002851	麦格米特	41,600	1,517,152.00	0.21
128	300118	东方日升	58,700	1,504,481.00	0.21
129	300627	华测导航	46,000	1,493,620.00	0.21
130	688376	美埃科技	37,698	1,488,694.02	0.21
131	300476	胜宏科技	61,300	1,477,943.00	0.21
132	600835	上海机电	85,800	1,474,044.00	0.21
133	000928	中钢国际	152,700	1,473,555.00	0.21
134	002430	杭氧股份	42,700	1,467,172.00	0.21
135	601800	中国交建	134,400	1,466,304.00	0.21
136	600885	宏发股份	46,000	1,465,100.00	0.21
137	300687	赛意信息	51,700	1,436,226.00	0.20
138	002170	芭田股份	208,600	1,433,082.00	0.20
139	603305	旭升集团	51,324	1,430,399.88	0.20
140	603338	浙江鼎力	25,400	1,422,654.00	0.20
141	300502	新易盛	20,800	1,413,776.00	0.20
142	600004	白云机场	98,500	1,412,490.00	0.20
143	002444	巨星科技	64,486	1,410,953.68	0.20
144	601872	招商轮船	237,300	1,373,967.00	0.19
145	000733	振华科技	14,200	1,361,070.00	0.19
146	688019	安集科技	8,234	1,357,210.22	0.19
147	600027	华电国际	201,600	1,348,704.00	0.19
148	300133	华策影视	190,000	1,347,100.00	0.19
149	688111	金山办公	2,836	1,339,215.92	0.19
150	000002	万科A	94,700	1,327,694.00	0.19
151	002987	京北方	60,500	1,326,160.00	0.19
152	300811	铂科新材	22,260	1,323,134.40	0.19
153	605133	嵘泰股份	38,002	1,320,949.52	0.18
154	002179	中航光电	29,126	1,320,864.10	0.18
155	600612	老凤祥	18,900	1,320,732.00	0.18
156	002429	兆驰股份	239,700	1,318,350.00	0.18
157	301061	匠心家居	35,600	1,315,420.00	0.18
158	300144	宋城演艺	106,000	1,314,400.00	0.18
159	603279	景津装备	41,900	1,313,984.00	0.18
160	300533	冰川网络	26,300	1,313,948.00	0.18
161	300031	宝通科技	52,600	1,300,272.00	0.18
162	600977	中国电影	91,700	1,288,385.00	0.18
163	688012	中微公司	7,997	1,251,130.65	0.18

164	300628	亿联网络	35,600	1,248,492.00	0.17
165	600862	中航高科	49,000	1,240,190.00	0.17
166	603018	华设集团	140,800	1,232,000.00	0.17
167	300406	九强生物	52,300	1,220,159.00	0.17
168	600248	陕建股份	255,500	1,218,735.00	0.17
169	002334	英威腾	95,600	1,217,944.00	0.17
170	002352	顺丰控股	26,900	1,212,921.00	0.17
171	300308	中际旭创	8,200	1,209,090.00	0.17
172	002266	浙富控股	291,000	1,201,830.00	0.17
173	603986	兆易创新	11,300	1,200,625.00	0.17
174	000028	国药一致	27,500	1,199,275.00	0.17
175	002965	祥鑫科技	21,400	1,191,552.00	0.17
176	603345	安井食品	8,000	1,174,400.00	0.16
177	300041	回天新材	99,450	1,173,510.00	0.16
178	600887	伊利股份	41,300	1,169,616.00	0.16
179	002611	东方精工	201,500	1,156,610.00	0.16
180	002046	国机精工	90,400	1,153,504.00	0.16
181	600580	卧龙电驱	78,900	1,152,729.00	0.16
182	300416	苏试试验	53,445	1,152,274.20	0.16
183	600373	中文传媒	86,100	1,146,852.00	0.16
184	603806	福斯特	30,800	1,145,452.00	0.16
185	002475	立讯精密	35,191	1,141,947.95	0.16
186	601117	中国化学	137,500	1,138,500.00	0.16
187	688680	海优新材	9,183	1,118,673.06	0.16
188	300820	英杰电气	13,500	1,112,130.00	0.16
189	603112	华翔股份	93,700	1,101,912.00	0.15
190	002674	兴业科技	88,500	1,092,975.00	0.15
191	688516	奥特维	5,784	1,089,705.60	0.15
192	300068	南都电源	56,200	1,088,032.00	0.15
193	601702	华峰铝业	78,900	1,079,352.00	0.15
194	002236	大华股份	54,200	1,070,450.00	0.15
195	300014	亿纬锂能	17,600	1,064,800.00	0.15
196	603239	浙江仙通	65,300	1,062,431.00	0.15
197	002068	黑猫股份	89,400	1,061,178.00	0.15
198	603966	法兰泰克	84,000	1,060,920.00	0.15
199	601333	广深铁路	266,300	1,054,548.00	0.15
200	601869	长飞光纤	28,200	1,043,682.00	0.15
201	600060	海信视像	42,100	1,041,975.00	0.15
202	688257	新锐股份	39,190	1,038,926.90	0.15
203	300351	永贵电器	63,200	1,038,376.00	0.15
204	002790	瑞尔特	107,900	1,035,840.00	0.14
205	688389	普门科技	43,672	1,025,855.28	0.14
206	601377	兴业证券	166,500	1,018,980.00	0.14
207	300291	百纳千成	144,300	1,015,872.00	0.14

208	600276	恒瑞医药	21,200	1,015,480.00	0.14
209	002276	万马股份	83,700	1,013,607.00	0.14
210	002028	思源电气	21,300	995,136.00	0.14
211	300494	盛天网络	39,960	990,608.40	0.14
212	002335	科华数据	27,500	988,625.00	0.14
213	300770	新媒股份	21,400	981,404.00	0.14
214	000997	新大陆	51,500	973,350.00	0.14
215	601288	农业银行	270,400	954,512.00	0.13
216	300124	汇川技术	14,750	947,097.50	0.13
217	603882	金域医学	12,200	921,100.00	0.13
218	601137	博威合金	58,700	913,372.00	0.13
219	603508	思维列控	53,400	910,470.00	0.13
220	603195	公牛集团	9,472	909,880.32	0.13
221	300860	锋尚文化	16,400	909,216.00	0.13
222	688556	高测股份	16,963	901,413.82	0.13
223	605168	三人行	10,480	900,651.20	0.13
224	600422	昆药集团	43,200	895,104.00	0.13
225	002648	卫星化学	59,352	887,905.92	0.12
226	601818	光大银行	286,100	878,327.00	0.12
227	002035	华帝股份	122,800	871,880.00	0.12
228	300887	谱尼测试	21,700	858,886.00	0.12
229	601012	隆基绿能	29,884	856,774.28	0.12
230	600765	中航重机	32,100	850,971.00	0.12
231	688588	凌志软件	53,578	833,137.90	0.12
232	000950	重药控股	123,200	829,136.00	0.12
233	000650	仁和药业	134,300	824,602.00	0.12
234	600900	长江电力	37,000	816,220.00	0.11
235	300908	仲景食品	17,800	807,230.00	0.11
236	600028	中国石化	124,100	789,276.00	0.11
237	002541	鸿路钢构	27,360	788,241.60	0.11
238	002130	沃尔核材	96,900	786,828.00	0.11
239	002990	盛视科技	21,000	772,800.00	0.11
240	301363	美好医疗	17,400	765,426.00	0.11
241	688385	复旦微电	14,923	747,642.30	0.10
242	300938	信测标准	17,000	744,600.00	0.10
243	603308	应流股份	39,800	728,340.00	0.10
244	300109	新开源	29,000	721,230.00	0.10
245	600258	首旅酒店	37,800	716,310.00	0.10
246	600845	宝信软件	14,067	714,744.27	0.10
247	002142	宁波银行	28,020	708,906.00	0.10
248	600030	中信证券	35,800	708,124.00	0.10
249	002508	老板电器	27,700	700,533.00	0.10
250	300951	博硕科技	12,800	699,264.00	0.10
251	688301	奕瑞科技	2,458	694,212.94	0.10

252	603605	珀莱雅	6,100	685,640.00	0.10
253	000543	皖能电力	101,500	669,900.00	0.09
254	002415	海康威视	20,176	668,027.36	0.09
255	002314	南山控股	197,500	651,750.00	0.09
256	000568	泸州老窖	3,100	649,667.00	0.09
257	002738	中矿资源	12,460	634,712.40	0.09
258	603667	五洲新春	42,600	633,888.00	0.09
259	300740	水羊股份	40,300	624,650.00	0.09
260	600458	时代新材	51,700	619,883.00	0.09
261	002015	协鑫能科	46,000	617,780.00	0.09
262	600011	华能国际	66,000	611,160.00	0.09
263	600085	同仁堂	10,600	610,136.00	0.09
264	000975	银泰黄金	52,000	608,400.00	0.09
265	002605	姚记科技	13,100	608,233.00	0.09
266	600183	生益科技	42,800	607,760.00	0.09
267	603596	伯特利	7,600	602,376.00	0.08
268	300532	今天国际	29,100	598,296.00	0.08
269	300718	长盛轴承	26,600	591,850.00	0.08
270	600285	羚锐制药	36,400	584,584.00	0.08
271	600875	东方电气	31,300	583,745.00	0.08
272	600406	国电南瑞	25,248	583,228.80	0.08
273	002772	众兴菌业	51,200	578,560.00	0.08
274	301013	利和兴	40,300	576,290.00	0.08
275	688390	固德威	3,449	575,500.14	0.08
276	600879	航天电子	67,100	569,679.00	0.08
277	600039	四川路桥	57,980	568,783.80	0.08
278	300119	瑞普生物	31,900	567,820.00	0.08
279	603179	新泉股份	12,900	566,181.00	0.08
280	000921	海信家电	20,900	563,255.00	0.08
281	603556	海兴电力	22,200	560,328.00	0.08
282	000425	徐工机械	82,600	559,202.00	0.08
283	300510	金冠股份	80,100	559,098.00	0.08
284	300753	爱朋医疗	30,400	557,232.00	0.08
285	600489	中金黄金	53,900	556,787.00	0.08
286	002283	天润工业	86,600	555,972.00	0.08
287	688800	瑞可达	8,869	551,208.35	0.08
288	601811	新华文轩	38,900	550,824.00	0.08
289	002697	红旗连锁	93,800	547,792.00	0.08
290	600025	华能水电	76,700	546,871.00	0.08
291	002484	江海股份	25,600	545,024.00	0.08
292	600009	上海机场	11,900	540,498.00	0.08
293	300452	山河药辅	30,800	537,152.00	0.08
294	600814	杭州解百	62,700	536,085.00	0.08
295	300896	爱美客	1,200	533,940.00	0.07

296	601949	中国出版	44,800	528,640.00	0.07
297	603027	千禾味业	25,000	528,000.00	0.07
298	601211	国泰君安	37,300	521,827.00	0.07
299	600587	新华医疗	14,700	519,351.00	0.07
300	601019	山东出版	56,300	516,271.00	0.07
301	600038	中直股份	12,800	509,696.00	0.07
302	002859	洁美科技	18,400	509,680.00	0.07
303	601928	凤凰传媒	44,700	509,580.00	0.07
304	003816	中国广核	162,800	506,308.00	0.07
305	002152	广电运通	43,100	505,132.00	0.07
306	688066	航天宏图	8,254	502,668.60	0.07
307	601618	中国中冶	126,600	502,602.00	0.07
308	300226	上海钢联	15,500	502,200.00	0.07
309	002938	鹏鼎控股	20,200	490,658.00	0.07
310	300286	安科瑞	12,900	488,394.00	0.07
311	603050	科林电气	30,040	483,944.40	0.07
312	000156	华数传媒	54,100	470,670.00	0.07
313	601939	建设银行	75,100	470,126.00	0.07
314	000528	柳 工	57,200	451,880.00	0.06
315	600050	中国联通	91,900	441,120.00	0.06
316	600809	山西汾酒	2,380	440,466.60	0.06
317	600694	大商股份	24,700	437,931.00	0.06
318	603507	振江股份	11,700	424,242.00	0.06
319	600109	国金证券	48,900	423,963.00	0.06
320	601098	中南传媒	36,300	421,080.00	0.06
321	603590	康辰药业	12,600	418,320.00	0.06
322	301129	瑞纳智能	5,200	383,084.00	0.05
323	601600	中国铝业	68,100	373,869.00	0.05
324	000922	佳电股份	28,100	369,796.00	0.05
325	002422	科伦药业	12,400	368,032.00	0.05
326	002449	国星光电	40,700	361,823.00	0.05
327	601699	潞安环能	21,900	357,408.00	0.05
328	000059	华锦股份	53,900	339,031.00	0.05
329	600886	国投电力	26,800	339,020.00	0.05
330	002839	张家港行	76,000	321,480.00	0.04
331	300569	天能重工	37,900	319,118.00	0.04
332	600496	精工钢构	85,100	317,423.00	0.04
333	300036	超图软件	13,300	315,343.00	0.04
334	002244	滨江集团	35,300	311,346.00	0.04
335	002270	华明装备	28,200	308,790.00	0.04
336	300360	炬华科技	16,900	302,172.00	0.04
337	000708	中信特钢	18,820	298,108.80	0.04
338	000729	燕京啤酒	23,600	294,292.00	0.04
339	600309	万华化学	3,300	289,872.00	0.04

340	603877	太平鸟	11,400	288,192.00	0.04
341	603309	维力医疗	18,600	287,742.00	0.04
342	605218	伟时电子	18,400	285,200.00	0.04
343	000811	冰轮环境	18,000	283,680.00	0.04
344	603811	诚意药业	22,800	283,404.00	0.04
345	603118	共进股份	21,300	283,077.00	0.04
346	002469	三维化学	46,000	282,900.00	0.04
347	603699	纽威股份	18,700	278,256.00	0.04
348	600125	铁龙物流	45,700	276,028.00	0.04
349	600064	南京高科	41,600	274,976.00	0.04
350	688663	新风光	8,537	271,391.23	0.04
351	601877	正泰电器	9,500	262,675.00	0.04
352	000725	京东方 A	63,900	261,351.00	0.04
353	605499	东鹏饮料	1,500	259,350.00	0.04
354	002594	比亚迪	1,000	258,270.00	0.04
355	600497	驰宏锌锗	50,200	252,004.00	0.04
356	603662	柯力传感	6,800	250,240.00	0.04
357	002360	同德化工	33,600	249,648.00	0.03
358	688109	品茗科技	9,594	248,484.60	0.03
359	688037	芯源微	1,453	248,390.35	0.03
360	002327	富安娜	27,900	234,918.00	0.03
361	600637	东方明珠	29,000	226,780.00	0.03
362	688777	中控技术	3,515	220,671.70	0.03
363	002384	东山精密	8,300	214,970.00	0.03
364	300853	申昊科技	6,100	214,110.00	0.03
365	301195	北路智控	4,500	209,520.00	0.03
366	301080	百普赛斯	3,300	207,306.00	0.03
367	300314	戴维医疗	9,500	200,830.00	0.03
368	601298	青岛港	28,800	200,736.00	0.03
369	300384	三联虹普	11,600	197,084.00	0.03
370	601985	中国核电	27,000	190,350.00	0.03
371	603589	口子窖	3,800	187,530.00	0.03
372	688100	威胜信息	6,253	186,401.93	0.03
373	300674	宇信科技	10,500	185,640.00	0.03
374	600720	祁连山	16,300	185,331.00	0.03
375	002829	星网宇达	4,200	184,506.00	0.03
376	603619	中曼石油	10,900	184,428.00	0.03
377	300059	东方财富	12,872	182,782.40	0.03
378	603227	雪峰科技	22,000	182,160.00	0.03
379	002533	金杯电工	22,200	181,152.00	0.03
380	603690	至纯科技	5,160	179,774.40	0.03
381	600267	海正药业	15,700	178,666.00	0.03
382	300856	科思股份	2,200	173,294.00	0.02
383	000596	古井贡酒	700	173,166.00	0.02

384	600398	海澜之家	24,400	167,872.00	0.02
385	300634	彩讯股份	6,200	163,680.00	0.02
386	688110	东芯股份	4,390	158,479.00	0.02
387	688080	映翰通	3,182	155,599.80	0.02
388	688099	晶晨股份	1,812	152,787.84	0.02
389	603300	华铁应急	27,300	148,785.00	0.02
390	688698	伟创电气	3,690	147,526.20	0.02
391	002483	润邦股份	24,900	144,420.00	0.02
392	300358	楚天科技	9,622	143,656.46	0.02
393	002832	比音勒芬	4,000	141,640.00	0.02
394	002841	视源股份	2,100	140,364.00	0.02
395	003000	劲仔食品	10,900	137,231.00	0.02
396	600562	国睿科技	8,400	136,080.00	0.02
397	603076	乐惠国际	2,800	133,868.00	0.02
398	002049	紫光国微	1,420	132,415.00	0.02
399	688208	道通科技	4,360	132,151.60	0.02
400	002073	软控股份	19,900	131,738.00	0.02
401	301179	泽宇智能	3,900	131,430.00	0.02
402	688167	炬光科技	1,216	130,780.80	0.02
403	000060	中金岭南	27,100	128,725.00	0.02
404	002044	美年健康	17,700	125,847.00	0.02
405	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
406	603587	地素时尚	7,600	111,264.00	0.02
407	002180	纳思达	3,200	109,600.00	0.02
408	300638	广和通	4,680	106,142.40	0.01
409	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
410	300511	雪榕生物	13,600	103,360.00	0.01
411	600755	厦门国贸	13,300	102,942.00	0.01
412	300015	爱尔眼科	5,523	102,451.65	0.01
413	000937	冀中能源	15,400	98,252.00	0.01
414	002391	长青股份	14,300	98,241.00	0.01
415	600012	皖通高速	9,200	96,416.00	0.01
416	600486	扬农化工	1,100	96,162.00	0.01
417	600487	亨通光电	6,500	95,290.00	0.01
418	600546	山煤国际	6,500	94,055.00	0.01
419	002487	大金重工	3,000	92,520.00	0.01
420	688599	天合光能	2,166	92,293.26	0.01
421	300442	润泽科技	3,000	92,280.00	0.01
422	688400	凌云光	3,004	91,561.92	0.01
423	002311	海大集团	1,920	89,932.80	0.01
424	600376	首开股份	22,300	86,970.00	0.01
425	000498	山东路桥	13,300	85,386.00	0.01
426	000603	盛达资源	7,000	84,630.00	0.01
427	688355	明志科技	2,780	84,567.60	0.01

428	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
429	000531	穗恒运 A	10,900	78,807.00	0.01
430	603501	韦尔股份	800	78,432.00	0.01
431	002777	久远银海	2,200	78,034.00	0.01
432	002461	珠江啤酒	8,800	77,528.00	0.01
433	300347	泰格医药	1,200	77,448.00	0.01
434	000690	宝新能源	11,000	77,220.00	0.01
435	000034	神州数码	2,900	77,111.00	0.01
436	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
437	600584	长电科技	2,400	74,808.00	0.01
438	300122	智飞生物	1,650	72,930.00	0.01
439	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
440	301208	中亦科技	1,300	71,929.00	0.01
441	300470	中密控股	1,500	69,330.00	0.01
442	001965	招商公路	7,100	68,160.00	0.01
443	603180	金牌厨柜	2,000	67,040.00	0.01
444	601208	东材科技	5,100	64,770.00	0.01
445	600475	华光环能	5,300	62,964.00	0.01
446	300925	法本信息	4,400	62,172.00	0.01
447	300129	泰胜风能	6,400	61,376.00	0.01
448	603799	华友钴业	1,244	57,112.04	0.01
449	300369	绿盟科技	4,442	54,947.54	0.01
450	605068	明新旭腾	2,200	53,812.00	0.01
451	600623	华谊集团	8,300	51,709.00	0.01
452	600893	航发动力	1,200	50,712.00	0.01
453	300019	硅宝科技	2,900	49,445.00	0.01
454	603833	欧派家居	500	47,900.00	0.01
455	688233	神工股份	1,496	47,243.68	0.01
456	300724	捷佳伟创	400	44,940.00	0.01
457	300138	晨光生物	2,300	41,170.00	0.01
458	300232	洲明科技	4,500	41,130.00	0.01
459	300443	金雷股份	1,000	35,450.00	0.00
460	600438	通威股份	1,000	34,310.00	0.00
461	301291	明阳电气	1,101	34,164.03	0.00
462	600019	宝钢股份	6,000	33,720.00	0.00
463	002138	顺络电子	1,200	28,692.00	0.00
464	605098	行动教育	700	27,713.00	0.00
465	600161	天坛生物	980	26,607.00	0.00
466	000821	京山轻机	1,300	26,598.00	0.00
467	603258	电魂网络	600	25,506.00	0.00
468	688617	惠泰医疗	68	25,415.00	0.00
469	600452	涪陵电力	1,152	24,514.56	0.00
470	603277	银都股份	1,000	21,840.00	0.00
471	688078	龙软科技	419	21,599.45	0.00

472	603203	快克智能	680	20,930.40	0.00
473	002056	横店东磁	1,100	20,031.00	0.00
474	603639	海利尔	1,100	19,712.00	0.00
475	301297	富乐德	870	19,583.70	0.00
476	600419	天润乳业	1,200	19,464.00	0.00
477	600529	山东药玻	680	18,509.60	0.00
478	603515	欧普照明	900	18,270.00	0.00
479	688268	华特气体	197	15,903.81	0.00
480	601921	浙版传媒	1,800	15,642.00	0.00
481	601009	南京银行	1,900	15,200.00	0.00
482	688378	奥来德	304	15,017.60	0.00
483	301165	锐捷网络	242	14,936.24	0.00
484	688550	瑞联新材	374	14,810.40	0.00
485	600745	闻泰科技	300	14,670.00	0.00
486	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
487	603566	普莱柯	500	11,625.00	0.00
488	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
489	688226	威腾电气	511	11,150.02	0.00
490	300833	浩洋股份	100	10,943.00	0.00
491	603730	岱美股份	675	10,665.00	0.00
492	603259	药明康德	170	10,592.70	0.00
493	002332	仙琚制药	785	10,401.25	0.00
494	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
495	000895	双汇发展	400	9,796.00	0.00
496	300196	长海股份	700	9,695.00	0.00
497	300601	康泰生物	380	9,648.20	0.00
498	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
499	603899	晨光股份	200	8,928.00	0.00
500	002807	江阴银行	2,400	8,856.00	0.00
501	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
502	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
503	601168	西部矿业	800	8,408.00	0.00
504	300596	利安隆	200	8,134.00	0.00
505	600586	金晶科技	1,000	7,720.00	0.00
506	002837	英维克	253	7,574.82	0.00
507	603816	顾家家居	190	7,248.50	0.00
508	688181	八亿时空	256	7,216.64	0.00
509	002001	新 和 成	456	7,022.40	0.00
510	600176	中国巨石	401	5,678.16	0.00
511	002810	山东赫达	300	5,400.00	0.00
512	600031	三一重工	300	4,989.00	0.00
513	688330	宏力达	130	4,560.40	0.00
514	301225	恒勃股份	129	4,290.54	0.00
515	600332	白云山	116	3,698.08	0.00

516	300806	斯迪克	196	3,669.12	0.00
517	301232	飞沃科技	62	3,622.04	0.00
518	002446	盛路通信	300	2,835.00	0.00
519	002078	太阳纸业	120	1,282.80	0.00
520	600938	中国海油	4	72.48	0.00

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	000333	美的集团	12,456,293.24	14.21
2	601668	中国建筑	11,589,016.47	13.22
3	300750	宁德时代	10,947,939.40	12.49
4	600941	中国移动	9,027,772.00	10.30
5	000063	中兴通讯	8,518,596.00	9.72
6	600131	国网信通	8,505,551.00	9.70
7	300760	迈瑞医疗	7,913,843.00	9.03
8	601601	中国太保	7,703,860.00	8.79
9	002126	银轮股份	7,564,511.00	8.63
10	603927	中科软	7,455,014.00	8.50
11	601899	紫金矿业	7,396,640.00	8.44
12	600511	国药股份	7,328,818.00	8.36
13	002555	三七互娱	7,323,732.00	8.35
14	600325	华发股份	6,542,845.00	7.46
15	002867	周大生	6,265,388.00	7.15
16	600566	济川药业	5,812,278.00	6.63
17	601398	工商银行	5,750,795.00	6.56
18	600415	小商品城	5,721,626.00	6.53
19	300866	安克创新	5,678,170.00	6.48
20	600519	贵州茅台	5,512,446.00	6.29
21	600820	隧道股份	5,494,241.00	6.27
22	600919	江苏银行	5,450,579.00	6.22
23	601318	中国平安	5,238,119.00	5.97
24	601567	三星医疗	5,231,049.00	5.97
25	002139	拓邦股份	5,067,010.00	5.78
26	002705	新宝股份	5,029,185.00	5.74
27	601058	赛轮轮胎	5,024,190.00	5.73
28	603508	思维列控	5,009,467.28	5.71
29	002984	森麒麟	4,950,266.00	5.65
30	002371	北方华创	4,910,303.00	5.60

31	603444	吉比特	4,878,476.00	5.56
32	600795	国电电力	4,844,251.00	5.52
33	603129	春风动力	4,749,174.00	5.42
34	002345	潮宏基	4,642,582.00	5.29
35	002439	启明星辰	4,607,141.00	5.25
36	600572	康恩贝	4,483,275.00	5.11
37	000400	许继电气	4,449,110.11	5.07
38	688596	正帆科技	4,389,772.11	5.01
39	002014	永新股份	4,369,113.60	4.98
40	601126	四方股份	4,324,728.00	4.93
41	002154	报喜鸟	4,281,498.00	4.88
42	000858	五粮液	4,199,041.00	4.79
43	300274	阳光电源	4,156,707.00	4.74
44	002236	大华股份	4,085,124.40	4.66
45	000028	国药一致	4,075,716.60	4.65
46	600036	招商银行	4,070,360.00	4.64
47	600710	苏美达	4,048,836.00	4.62
48	000988	华工科技	4,016,718.00	4.58
49	600600	青岛啤酒	3,968,199.00	4.53
50	603035	常熟汽饰	3,927,052.00	4.48
51	600426	华鲁恒升	3,853,657.00	4.40
52	300146	汤臣倍健	3,824,497.00	4.36
53	600449	宁夏建材	3,800,083.00	4.33
54	603993	洛阳钼业	3,791,169.00	4.32
55	601288	农业银行	3,738,688.00	4.26
56	601689	拓普集团	3,717,579.00	4.24
57	600048	保利发展	3,710,912.00	4.23
58	603187	海容冷链	3,692,911.00	4.21
59	601818	光大银行	3,676,830.00	4.19
60	000589	贵州轮胎	3,663,123.09	4.18
61	300118	东方日升	3,645,516.00	4.16
62	300740	水羊股份	3,640,082.00	4.15
63	300223	北京君正	3,635,227.00	4.15
64	688009	中国通号	3,604,707.28	4.11
65	605009	豪悦护理	3,589,987.90	4.09
66	300130	新国都	3,577,568.00	4.08
67	002737	葵花药业	3,550,807.00	4.05
68	002011	盾安环境	3,509,504.00	4.00
69	601186	中国铁建	3,507,128.00	4.00
70	605599	菜百股份	3,494,311.00	3.99
71	002410	广联达	3,447,378.00	3.93
72	600765	中航重机	3,431,685.00	3.91
73	603298	杭叉集团	3,413,048.00	3.89
74	601137	博威合金	3,357,435.00	3.83

75	002727	一心堂	3,347,932.00	3.82
76	601816	京沪高铁	3,280,673.00	3.74
77	300982	苏文电能	3,243,913.00	3.70
78	003006	百亚股份	3,212,470.00	3.66
79	600908	无锡银行	3,196,103.00	3.65
80	000338	潍柴动力	3,186,199.00	3.63
81	002648	卫星化学	3,120,502.20	3.56
82	002517	恺英网络	3,112,692.00	3.55
83	600803	新奥股份	3,059,145.00	3.49
84	003816	中国广核	3,048,913.00	3.48
85	688425	铁建重工	3,012,729.49	3.44
86	002179	中航光电	2,958,657.06	3.37
87	601000	唐山港	2,957,669.76	3.37
88	603050	科林电气	2,921,756.60	3.33
89	601916	浙商银行	2,895,377.00	3.30
90	600570	恒生电子	2,882,465.84	3.29
91	601838	成都银行	2,870,060.00	3.27
92	600861	北京城乡	2,848,272.00	3.25
93	300910	瑞丰新材	2,844,362.60	3.24
94	600901	江苏金租	2,813,682.00	3.21
95	600977	中国电影	2,792,133.00	3.18
96	300316	晶盛机电	2,788,100.59	3.18
97	603369	今世缘	2,781,617.00	3.17
98	002841	视源股份	2,780,388.00	3.17
99	000960	锡业股份	2,772,265.81	3.16
100	002352	顺丰控股	2,769,351.43	3.16
101	600138	中青旅	2,765,663.00	3.15
102	300026	红日药业	2,757,476.00	3.14
103	300592	华凯易佰	2,744,290.00	3.13
104	002444	巨星科技	2,740,699.00	3.13
105	002697	红旗连锁	2,737,332.00	3.12
106	603605	珀莱雅	2,697,352.40	3.08
107	002987	京北方	2,688,378.20	3.07
108	600989	宝丰能源	2,667,603.00	3.04
109	605337	李子园	2,664,647.83	3.04
110	688589	力合微	2,632,668.73	3.00
111	605167	利柏特	2,625,651.32	2.99
112	601766	中国中车	2,614,886.00	2.98
113	300628	亿联网络	2,608,501.00	2.98
114	002063	远光软件	2,555,426.00	2.91
115	603885	吉祥航空	2,510,134.50	2.86
116	688128	中国电研	2,494,461.29	2.84
117	601717	郑煤机	2,492,750.72	2.84
118	300533	冰川网络	2,484,551.00	2.83

119	600475	华光环能	2,475,881.00	2.82
120	605133	嵘泰股份	2,474,144.56	2.82
121	605168	三人行	2,470,667.00	2.82
122	600872	中炬高新	2,469,117.00	2.82
123	601728	中国电信	2,450,449.00	2.79
124	600085	同仁堂	2,441,128.00	2.78
125	300811	铂科新材	2,434,485.00	2.78
126	601006	大秦铁路	2,420,499.00	2.76
127	600276	恒瑞医药	2,395,887.60	2.73
128	002508	老板电器	2,384,842.00	2.72
129	001979	招商蛇口	2,353,748.00	2.68
130	300627	华测导航	2,348,617.00	2.68
131	300416	苏试试验	2,347,828.07	2.68
132	002851	麦格米特	2,329,869.75	2.66
133	600066	宇通客车	2,305,185.00	2.63
134	600970	中材国际	2,289,736.00	2.61
135	603043	广州酒家	2,288,906.00	2.61
136	002429	兆驰股份	2,278,342.00	2.60
137	002130	沃尔核材	2,270,056.51	2.59
138	000538	云南白药	2,234,867.00	2.55
139	603279	景津装备	2,233,409.00	2.55
140	002318	久立特材	2,232,063.00	2.55
141	002430	杭氧股份	2,227,086.00	2.54
142	300687	赛意信息	2,217,352.00	2.53
143	600582	天地科技	2,190,782.00	2.50
144	002271	东方雨虹	2,189,025.00	2.50
145	002463	沪电股份	2,170,061.00	2.47
146	002937	兴瑞科技	2,169,651.00	2.47
147	002027	分众传媒	2,136,718.00	2.44
148	601390	中国中铁	2,126,650.00	2.43
149	601019	山东出版	2,111,029.44	2.41
150	603801	志邦家居	2,106,251.00	2.40
151	688332	中科蓝讯	2,069,145.31	2.36
152	000650	仁和药业	2,055,429.00	2.34
153	002158	汉钟精机	2,048,857.00	2.34
154	601012	隆基绿能	2,048,008.00	2.34
155	603338	浙江鼎力	2,038,606.00	2.33
156	601377	兴业证券	2,037,156.00	2.32
157	605368	蓝天燃气	2,023,181.40	2.31
158	601857	中国石油	2,008,620.00	2.29
159	600885	宏发股份	1,993,536.00	2.27
160	605377	华旺科技	1,979,906.00	2.26
161	600079	人福医药	1,969,913.00	2.25
162	600933	爱柯迪	1,964,845.00	2.24

163	603486	科沃斯	1,932,174.00	2.20
164	002790	瑞尔特	1,932,173.72	2.20
165	600886	国投电力	1,932,073.00	2.20
166	688621	阳光诺和	1,920,362.44	2.19
167	688626	翔宇医疗	1,869,606.99	2.13
168	000950	重药控股	1,817,281.00	2.07
169	002415	海康威视	1,805,675.00	2.06
170	002050	三花智控	1,799,594.00	2.05
171	002966	苏州银行	1,791,976.00	2.04
172	603345	安井食品	1,787,274.00	2.04
173	603690	至纯科技	1,769,835.00	2.02
174	300773	拉卡拉	1,755,156.00	2.00

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	002139	拓邦股份	4,956,328.00	5.65
2	603927	中科软	4,814,791.00	5.49
3	300866	安克创新	4,617,495.44	5.27
4	601601	中国太保	4,588,678.00	5.23
5	600795	国电电力	4,496,351.00	5.13
6	002555	三七互娱	4,450,120.00	5.08
7	600449	宁夏建材	4,093,517.00	4.67
8	002126	银轮股份	4,055,471.00	4.63
9	600131	国网信通	3,921,866.00	4.47
10	603508	思维列控	3,735,852.39	4.26
11	600519	贵州茅台	3,718,947.00	4.24
12	601318	中国平安	3,340,877.00	3.81
13	000858	五粮液	3,318,604.00	3.78
14	600941	中国移动	3,249,531.00	3.71
15	601398	工商银行	3,177,066.00	3.62
16	002867	周大生	3,162,580.00	3.61
17	600710	苏美达	3,088,872.00	3.52
18	600325	华发股份	3,022,696.00	3.45
19	002236	大华股份	3,022,361.00	3.45
20	300740	水羊股份	3,017,061.00	3.44
21	600511	国药股份	3,011,819.32	3.44
22	600765	中航重机	2,971,064.60	3.39
23	601899	紫金矿业	2,911,192.00	3.32

24	601288	农业银行	2,893,162.00	3.30
25	600820	隧道股份	2,845,065.00	3.24
26	002841	视源股份	2,723,718.00	3.11
27	601818	光大银行	2,699,726.00	3.08
28	601916	浙商银行	2,690,961.00	3.07
29	000028	国药一致	2,689,082.40	3.07
30	000333	美的集团	2,684,847.00	3.06
31	605337	李子园	2,652,679.69	3.03
32	002705	新宝股份	2,637,356.34	3.01
33	603885	吉祥航空	2,620,542.00	2.99
34	600475	华光环能	2,603,097.00	2.97
35	300760	迈瑞医疗	2,560,120.00	2.92
36	601689	拓普集团	2,515,116.00	2.87
37	601137	博威合金	2,508,600.00	2.86
38	002439	启明星辰	2,482,170.00	2.83
39	002697	红旗连锁	2,456,768.00	2.80
40	003816	中国广核	2,441,523.00	2.78
41	002648	卫星化学	2,439,547.80	2.78
42	300026	红日药业	2,423,058.00	2.76
43	300910	瑞丰新材	2,399,321.98	2.74
44	603050	科林电气	2,326,934.40	2.65
45	000538	云南白药	2,131,195.60	2.43
46	600415	小商品城	2,110,880.82	2.41
47	688596	正帆科技	2,046,735.76	2.33
48	600600	青岛啤酒	2,016,928.00	2.30
49	601888	中国中免	2,009,431.00	2.29
50	603444	吉比特	2,005,247.00	2.29
51	300413	芒果超媒	1,997,873.00	2.28
52	300118	东方日升	1,953,226.00	2.23
53	002179	中航光电	1,919,391.01	2.19
54	000988	华工科技	1,909,484.00	2.18
55	603605	珀莱雅	1,863,465.80	2.13
56	600085	同仁堂	1,860,117.00	2.12
57	002142	宁波银行	1,808,423.00	2.06
58	601126	四方股份	1,804,081.10	2.06
59	002966	苏州银行	1,759,211.00	2.01

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	986,479,945.91
卖出股票的收入（成交）总额	478,551,699.98

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	32,961,743.89	4.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	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）	227,004.48	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	33,188,748.37	4.64

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	019694	23 国债 01	326,000	32,961,743.89	4.61
2	118036	力合转债	2,270	227,004.48	0.03

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投资。

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

本基金的股指期货投资用于套期保值。在预期市场上涨时，可以通过买入股指期货作为股票替代，增加股票仓位，同时提高资金的利用效率；在预期市场下跌时，可以通过卖出股指期货对冲股市整体下跌的系统性风险，对投资组合的价值进行保护。

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

本基金的国债期货投资以风险管理为原则，以套期保值为目的。管理人按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的江苏银行（600919），因零售业务部和网络金融部均负责基金销售业务，但未对基金销售产品实行集中统一准入管理，部分基金销售业务人员未取得基金从业资格，存在向普通投资者主动推介风险等级高于其风险承受能力的产品或服务的情况，于 2022 年 12 月 5 日被中国证券监督管理委员会江苏监管局责令改正。因个别债务融资工具未按照发行文件约定开展余额包销，低价包销多期债务融资工具，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。因违反账户管理规定、流通人民币管理规定、人民币反假有关规定、占压财政存款或者资金、违反国库科目设置和使用规定、未按规定履行反洗钱相关义务、对金融产品作出虚假或者引人误解的宣传等共计 9 项违法行为，于 2023 年 2 月 6 日被中国人民银行予以警告，并没收违法所得 42 元，罚款 773.6 万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高。江苏银行为地区中大型银行，业务和组织架构优秀，管理层稳定、企业文化稳健务实进取，整体综合实力强，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。

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	6,606,659.88
2	应收清算款	1,763,978.22
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	509.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,371,147.78

7.12.4 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。

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的情况。

§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
海富通欣荣混合	1,828	237,536.64	431,795,201.00	99.44%	2,421,771.00	0.56%

A						
海富通欣荣混合 C	846	166,455.52	138,185,714.84	98.13%	2,635,659.02	1.87%
合计	2,674	215,048.00	569,980,915.84	99.12%	5,057,430.02	0.88%

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	海富通欣荣混合 A	1,795,714.69	0.4136%
	海富通欣荣混合 C	9,853.13	0.0070%
	合计	1,805,567.82	0.3140%

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	海富通欣荣混合 A	>100
	海富通欣荣混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通欣荣混合 A	>100
	海富通欣荣混合 C	0
	合计	>100

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
基金合同生效日(2016年9月22日)基金份额总额	250,120,830.38	200,014,500.63
本报告期期初基金份额总额	56,248,162.23	1,799,746.51
本报告期基金总申购份额	390,912,078.39	141,278,742.94
减：本报告期基金总赎回份额	12,943,268.62	2,257,115.59
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	434,216,972.00	140,821,373.86

注：总申购份额含红利再投资、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	
国金证券	1	372,875,774.20	25.48%	268,959.05	25.30%	-
长江证券	1	343,322,277.82	23.46%	251,063.97	23.61%	-
国泰君安	2	335,116,193.21	22.90%	244,948.82	23.04%	-
华创证券	1	223,713,550.44	15.29%	161,367.28	15.18%	-
光大证券	1	74,628,252.64	5.10%	53,830.23	5.06%	-
太平洋证券	2	62,485,433.20	4.27%	45,694.80	4.30%	-
华泰证券	1	32,784,961.92	2.24%	23,975.86	2.25%	-
申万宏源	1	15,105,607.41	1.03%	11,046.12	1.04%	-
海通证券	2	3,227,847.36	0.22%	2,360.02	0.22%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

中信建投	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元没有发生变更。

2、(1)交易单元的选择标准

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

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

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

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

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国金证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	31,918,044.00	47.58%	-	-	-	-
国泰君安	16,904,330.67	25.20%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	34,905.78	0.05%	-	-	-	-
太平洋证券	6,005,772.00	8.95%	-	-	-	-
华泰证券	1,045,198.40	1.56%	7,000,000.00	100.00%	-	-
申万宏源	11,173,040.88	16.66%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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旗下部分基金新增海通期货股份有限公司为销售机构的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
2	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-06
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-08
4	海富通基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-22
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-13
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司为销售机构的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-22
7	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增南京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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-25
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海大智慧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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-08
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大连网金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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-15
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华西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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-17

12	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-19
13	海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购和转换转入业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-26
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-02
15	海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金第一次分红公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-21

§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

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	2023/5/24-2023/6/30	-	163,942,716.05	-	163,942,716.05	28.51%
	2	2023/5/23-2023/5/23	-	81,674,915.98	-	81,674,915.98	14.20%
	3	2023/5/11-2023/5/17	-	40,549,007.91	-	40,549,007.91	7.05%
	4	2023/4/25-2023/5/18	-	40,417,710.16	-	40,417,710.16	7.03%
	5	2023/5/22-2023/5/22	-	38,884,000.22	-	38,884,000.22	6.76%
	6	2023/1/1-2023/5/18	26,221,418.08	6,706,076.72	-	32,927,494.80	5.73%
	7	2023/2/15-2023/3/28	10,422,207.13	2,665,459.22	-	13,087,666.35	2.28%
	8	2023/1/1-2023/1/3	12,768,260.67	-	12,768,260.67	-	-
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；</p> <p>2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变</p>							

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的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。

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欣荣灵活配置混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通欣荣灵活配置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