

# 海富通欣享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

<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.....	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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告</b> .....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	50
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.....	50
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.....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	52
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>56</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	海富通欣享混合	
基金主代码	519228	
交易代码	519228	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 10 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	199,737,254.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C
下属分级基金的交易代码	519229	519228
报告期末下属分级基金的份额总额	172,050,840.97 份	27,686,413.25 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	《中国证券报》
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	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）	
	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C
本期已实现收益	4,906,766.48	1,142,848.64
本期利润	6,313,193.10	3,101,961.42
加权平均基金份额本期利润	0.0295	0.0589
本期加权平均净值利润率	2.75%	5.31%
本期基金份额净值增长率	2.27%	2.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C
期末可供分配利润	9,804,298.32	2,625,770.55
期末可供分配基金份额利润	0.0570	0.0948
期末基金资产净值	185,160,809.73	30,828,810.37
期末基金份额净值	1.0762	1.1135
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C
基金份额累计净值增长率	50.16%	52.88%

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

#### 海富通欣享混合 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	0.37%	0.16%	0.85%	0.43%	-0.48%	-0.27%
过去三个月	-0.12%	0.16%	-1.59%	0.41%	1.47%	-0.25%
过去六个月	2.27%	0.16%	1.22%	0.42%	1.05%	-0.26%
过去一年	-0.64%	0.20%	-4.86%	0.49%	4.22%	-0.29%
过去三年	16.21%	0.25%	3.56%	0.60%	12.65%	-0.35%
自基金合同生效起至今	50.16%	0.25%	24.60%	0.60%	25.56%	-0.35%

#### 海富通欣享混合 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	0.36%	0.16%	0.85%	0.43%	-0.49%	-0.27%
过去三个月	-0.14%	0.16%	-1.59%	0.41%	1.45%	-0.25%
过去六个月	2.22%	0.16%	1.22%	0.42%	1.00%	-0.26%
过去一年	-0.74%	0.20%	-4.86%	0.49%	4.12%	-0.29%
过去三年	15.87%	0.25%	3.56%	0.60%	12.31%	-0.35%
自基金合同生效起至今	52.88%	0.25%	24.60%	0.60%	28.28%	-0.35%

### 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

海富通欣享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

(2017 年 3 月 10 日至 2023 年 6 月 30 日)

海富通欣享混合 A



海富通欣享混合 C





注：本基金合同于 2017 年 3 月 10 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		
朱斌全	本基金的基金经理	2020-10-29	-	16 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投

					<p>资经理、基金经理助理。2018 年 11 月至 2022 年 8 月任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月至 2022 年 12 月兼任海富通富祥混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通沪深 300 增强(原海富通富睿混合)、海富通量化多因子混合及海富通欣益混合的基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通欣享混合的基金经理。2020 年 10 月至 2022 年 8 月兼任海富通新内需混合基金经理。2022 年 8 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2022 年 12 月起兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。</p>
谈云飞	本基金的基金经理	2017-03-10	-	18 年	<p>硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 4 月至 2014 年 6 月就职于华宝兴业基金管理有限公司，曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2014 年 7 月至 2015 年 10 月任海富通现金管理货币基金经理。2014 年 9 月至 2020 年 9 月任海富通季季增利理财债券基金经理。2015 年 1 月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015 年 4 月至 2020 年 1 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 2 月起兼任海富通货币基金经理。2016 年 4 月至 2017 年 6 月兼任海富通纯债债券、海富通双福债券(原海富通双福分级债券)、海富通双利债券基金经理。2016 年 4 月至 2020 年 1 月兼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 9 月起兼任海富通聚利债券基金经理。2016 年 9 月至 2020 年 1 月兼任海富通欣荣混合基金经理。2016 年 9 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合基金经理。2017 年 2 月至 2021 年 10 月兼任海富通强化回报混合基金经理。2017 年 3 月起兼任海富通欣享混合基金经</p>

				理。2017 年 3 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 7 月至 2020 年 9 月任海富通季季通利理财债券基金经理。2019 年 9 月至 2023 年 1 月兼任海富通中短债债券基金经理。2021 年 2 月起兼任海富通惠睿精选混合基金经理。2022 年 3 月起兼任海富通欣润混合基金经理。2022 年 3 月至 2023 年 5 月兼任海富通惠鑫混合基金经理。2022 年 5 月起兼任海富通恒益一年定开债券发起式基金经理。
--	--	--	--	--

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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间交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

##### 4.3.2 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

固定收益方面，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。财政政策总量较去年有所回落，但使用效率有所提升。资金价格与流动性方面，1 季度信贷天量投放，资金价格中枢普遍明显回升；2 季度投放压力减弱，4-5 月资金价格中枢普遍回落；6 月是传统信贷投放大月，抽水效应导致资金价格有所抬升，但总体仍在政策利率附近波动。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。

信用债方面，上半年整体走强，背后原因在于多方需求共振修复，信用债供不应求。需求端，“大行放贷、小行买债”成为重要推动力，叠加理财规模回升、保险开门红等，信用利差持续压降；供给端，实体融资需求不足，债券供给随利率下行略有修复。整体而言，“资产荒”行情沿着先拉久期、后沉资质的逻辑演绎，高等级短久期-高等级长久期-低等级短久期信用利差依次下行。6 月中旬，央行先后下调 OMO、MLF、LPR 利率，投资者止盈+博弈稳经济政策+资金偏紧，利率带动信用调整。

本基金债券部分继续以中等期限、中高等级的信用债为主要配置，上半年保持一定的杠杆，获得了较好的收益。

权益部分，本组合量化模型在上半年表现较好。一季度有明显超额收益，二季度由于较早看空了人工智能相关股票，超额收益不明显。但从 6 月中下旬开始，超额收益开始回升。期间，我们开发了以深度学习为基础的 AI 选股模型，在实盘运用中取得了理想的效果，未来会更多使用这种数据驱动的智能决策。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通欣享混合 A 净值增长率为 2.27%，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 1.05 个百分点。海富通欣享混合 C 净值增长率为 2.22%，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 1.00 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 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。具体来看，投资方面，基建在有增量政策的支持下仍保持较高的景气度；制造业投资在高新技术领域持续发力，但总体增速或有所回落；地产投资可以预期政策端还有一定的调整。通胀方面，消费需求不足的情况短期较难逆转，CPI 有短期转负的风险，但随着基数走低下半年是温和回升的趋势；PPI 的需求端难有明显好转，同样由于基数走低通缩的情况会有所好转，但年内或难回正。货币政策方面，流动性的合理充裕或维持，由于政策需要观察期，6 月降息后再次在 3 季度降息的概率偏低，但通过降准补充基础货币消耗的可能性较大。财政方面政策性金融工具与特别国债可能发力。

下半年对债券市场中性偏乐观，把握逢高配置的机会。2 季度经济修复放缓后，货币政策先行落地，7 月召开的政治局会议将是政策出台的高峰期，市场担忧政策力度超预期，因此债市短期可能承压。但中期来看，本轮经济由于房地产周期缺位，并且政策的调整在房地产市场也比较掣肘，经济向上修复的空间与弹性有限。资产荒的逻辑大概率贯穿全年，收益率仍然呈现易下难上的格局。增量政策落地后可积极把握调整后的配置机会。

信用债方面，供需仍有利，理财配置压力大，货币难紧，票息策略有惯性；但利差低位叠加信用风险分化，挖掘难度加大，需要兼顾挖掘和防风险。

下半年，本基金债券部分仍将以中高等级、中等久期信用债为主，力求在控制风险的基础上获得更高的配置收益。久期策略保持中性，积极参与利率债的波段交易。

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。

在 6 月末的时间点上，本基金的量化模型偏向于高分红、低估值、低 beta 类型的股票。从风格上看，模型对后市偏谨慎一些，更偏好机构资金持仓较少的板块。在当下市场缺少增量资金的大环境下，预计这种风格偏好会持续一段时间。

#### 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

根据本基金的基金合同约定，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%；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

#### 4.8 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享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享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的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通欣享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：海富通欣享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
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,625,424.51	1,042,677.78
结算备付金		4,798,568.60	4,642,181.12
存出保证金		56,852.34	85,842.24
交易性金融资产	6.4.7.2	234,903,978.50	536,922,797.49
其中：股票投资		36,749,834.63	84,437,458.83
基金投资		-	-
债券投资		198,154,143.87	452,485,338.66
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		146,493.03	1,493,796.38
应收股利		-	-
应收申购款		28.50	1,229.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		241,531,345.48	544,188,524.91
<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		24,492,773.76	13,096,898.20
应付清算款		667,808.53	-
应付赎回款		38,305.18	11,970,744.62
应付管理人报酬		106,700.73	305,636.39
应付托管费		26,675.18	76,409.10
应付销售服务费		2,566.06	25,925.39
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13,825.50	25,724.66
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	193,070.44	403,409.31
负债合计		25,541,725.38	25,904,747.67
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	199,737,254.22	484,773,234.18
未分配利润	6.4.7.8	16,252,365.88	33,510,543.06
净资产合计		215,989,620.10	518,283,777.24
负债和净资产总计		241,531,345.48	544,188,524.91

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0762 元，C 类基金份额净值 1.1135 元。

基金份额总额 199,737,254.22 份，其中 A 类基金份额 172,050,840.97 份，C 类基金份额 27,686,413.25 份。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通欣享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
<b>一、营业总收入</b>		11,037,219.76	-6,879,866.53
1.利息收入		45,449.11	212,890.09
其中：存款利息收入	6.4.7.9	44,847.96	159,118.73
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		601.15	53,771.36
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,510,541.69	-1,118,747.59
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,901,812.39	-15,369,425.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	5,189,597.52	13,225,283.18
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	-	-
股利收益	6.4.7.14	419,131.78	1,025,394.26
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	3,365,539.40	-5,992,704.98
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	115,689.56	18,695.95
<b>减：二、营业总支出</b>		1,622,065.24	3,804,894.59
1. 管理人报酬		865,952.45	2,640,399.14
2. 托管费		216,488.10	660,099.77
3. 销售服务费		30,026.68	111,229.00
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		382,801.52	238,693.29
其中：卖出回购金融资产支出		382,801.52	238,693.29
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		13,676.92	37,846.61
8. 其他费用	6.4.7.17	113,119.57	116,626.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>9,415,154.52</b>	<b>-10,684,761.12</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>9,415,154.52</b>	<b>-10,684,761.12</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		9,415,154.52	-10,684,761.12

## 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海富通欣享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）	484,773,234.18	-	33,510,543.06	518,283,777.24
二、本期期初净资产（基金净值）	484,773,234.18	-	33,510,543.06	518,283,777.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-285,035,979.96	-	-17,258,177.18	-302,294,157.14
（一）、综合收益总额	-	-	9,415,154.52	9,415,154.52
（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）	-285,035,979.96	-	-26,673,331.70	-311,709,311.66
其中：1.基金申购款	1,588,783.16	-	164,498.79	1,753,281.95
2.基金赎回款	-286,624,763.12	-	-26,837,830.49	-313,462,593.61
（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）	199,737,254.22	-	16,252,365.88	215,989,620.10
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 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）	900,476,420.33	-	204,851,694.38	1,105,328,114.71

值)				
二、本期期初净资产(基金净值)	900,476,420.33	-	204,851,694.38	1,105,328,114.71
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-288,751,248.37	-	-78,730,221.01	-367,481,469.38
(一)、综合收益总额	-	-	-10,684,761.12	-10,684,761.12
(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)	-288,751,248.37	-	-68,045,459.89	-356,796,708.26
其中：1.基金申购款	18,905,774.30	-	4,284,117.87	23,189,892.17
2.基金赎回款	-307,657,022.67	-	-72,329,577.76	-379,986,600.43
(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)	611,725,171.96	-	126,121,473.37	737,846,645.33

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

海富通欣享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]2661号《关于准予海富通欣享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《海富通欣享灵活配置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，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 600,023,657.86 元。经向中国证监会备案，《海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 600,104,660.77 份基金份额，其中认购资金利息折合 81,002.91 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《海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《海富通欣享灵活配置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《海富通欣享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、债券（包括国债、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、次级债）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、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。在正常市场情况下，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，其中现金资产不包括结算备付金、存出保证金、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。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

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况、2023 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 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:

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

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

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

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

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

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

## 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	1,625,424.51
等于：本金	1,624,770.52
加：应计利息	653.99
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	1,625,424.51

### 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	38,340,626.08	-	36,749,834.63	-1,590,791.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	1,071,044.74		
	市场	94,930,482.86	96,199,995.68	198,468.08
	银行间		1,183,148.19	
	市场	99,998,680.36	101,954,148.19	772,319.64
合计	194,929,163.22	2,254,192.93	198,154,143.87	970,787.72
资产支持证券	-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	233,269,789.30	2,254,192.93	234,903,978.50	-620,003.73

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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	103,810.29
其中：交易所市场	102,585.29
银行间市场	1,225.00
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	193,070.44

#### 6.4.7.7 实收基金

海富通欣享混合 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	264,307,305.66	264,307,305.66
本期申购	431,121.06	431,121.06
本期赎回（以“-”号填列）	-92,687,585.75	-92,687,585.75
本期末	172,050,840.97	172,050,840.97

海富通欣享混合 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	220,465,928.52	220,465,928.52
本期申购	1,157,662.10	1,157,662.10
本期赎回（以“-”号填列）	-193,937,177.37	-193,937,177.37
本期末	27,686,413.25	27,686,413.25

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**

海富通欣享混合 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	9,075,097.01	4,749,628.85	13,824,725.86
本期利润	4,906,766.48	1,406,426.62	6,313,193.10
本期基金份额交易产生的变动数	-4,177,565.17	-2,850,385.03	-7,027,950.20
其中：基金申购款	17,725.18	12,722.45	30,447.63
基金赎回款	-4,195,290.35	-2,863,107.48	-7,058,397.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,804,298.32	3,305,670.44	13,109,968.76

海富通欣享混合 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	15,858,442.06	3,827,375.14	19,685,817.20
本期利润	1,142,848.64	1,959,112.78	3,101,961.42
本期基金份额交易产生的	-14,375,520.15	-5,269,861.35	-19,645,381.50

变动数			
其中：基金申购款	100,072.25	33,978.91	134,051.16
基金赎回款	-14,475,592.40	-5,303,840.26	-19,779,432.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,625,770.55	516,626.57	3,142,397.12

#### 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	19,093.01
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	25,078.03
其他	676.92
合计	44,847.96

#### 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	207,076,198.79
减：卖出股票成本总额	204,676,293.44
减：交易费用	498,092.96
买卖股票差价收入	1,901,812.39

#### 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	4,502,898.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	686,699.02
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	5,189,597.52

##### 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	282,846,427.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	277,945,624.72
减：应计利息总额	4,211,779.09
减：交易费用	2,325.00
买卖债券差价收入	686,699.02

**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**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**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	419,131.78
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	419,131.78

**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	3,365,539.40
——股票投资	2,383,640.83
——债券投资	981,898.57
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
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	3,365,539.40

#### 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	115,689.56
合计	115,689.56

#### 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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	5,259.42
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	18,000.00
合计	113,119.57

### 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

截至财务报表批准日，本基金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	5,837,239.96	1.61%	63,635,245.04	10.65%

##### 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	4,269.14	1.63%	-	-
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	45,264.28	10.47%	-	-

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

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用海通证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从海通证券获得研究综合服务。

##### 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	865,952.45	2,640,399.14
其中：支付销售机构的客户维护费	71,771.02	124,863.83

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	216,488.10	660,099.77

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		
	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C	合计
交通银行	-	256.88	256.88
海通证券	-	452.90	452.90
海富通	-	8,619.06	8,619.06
合计	-	9,328.84	9,328.84
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		
	海富通欣享混合A	海富通欣享混合C	合计
交通银行	-	706.98	706.98
海通证券	-	672.56	672.56
海富通	-	65,748.89	65,748.89
合计	-	67,128.43	67,128.43

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 0.10%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.10% 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  $\times$  0.10% / 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	1,625,424.51	19,093.01	10,324,636.16	45,101.48

#### 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
海通证券	-	-	-	-	-
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	6,324	523,563.96
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

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

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款总额 24,492,773.76 元，于 2023 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 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 84.49%（2022 年 12 月 31 日：61.94%）。

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	15,657,214.85	37,040,447.27
合计	15,657,214.85	37,040,447.27

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、政策性金融债。

#### 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	120,640,613.12	219,810,937.17
AAA 以下	20,940,149.54	40,993,556.96
未评级	40,916,166.36	154,640,397.26
合计	182,496,929.02	415,444,891.39

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、政策性金融债、中期票据。

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

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、存出保证金及债券投资等。

#### 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	1,625,424.51	-	-	-	1,625,424.51
结算备付金	4,798,568.60	-	-	-	4,798,568.60
存出保证金	56,852.34	-	-	-	56,852.34
交易性金融资产	112,307,107.84	85,719,784.96	127,251.07	36,749,834.63	234,903,978.50
应收清算款	-	-	-	146,493.03	146,493.03
应收申购款	-	-	-	28.50	28.50
资产总计	118,787,953.29	85,719,784.96	127,251.07	36,896,356.16	241,531,345.48
负债					
卖出回购金融资产款	24,492,773.76	-	-	-	24,492,773.76
应付清算款	-	-	-	667,808.53	667,808.53
应付赎回款	-	-	-	38,305.18	38,305.18
应付管理人报酬	-	-	-	106,700.73	106,700.73
应付托管费	-	-	-	26,675.18	26,675.18
应付销售服务费	-	-	-	2,566.06	2,566.06
应交税费	-	-	-	13,825.50	13,825.50
其他负债	-	-	-	193,070.44	193,070.44
负债总计	24,492,773.76	-	-	1,048,951.62	25,541,725.38
利率敏感度缺口	94,295,179.53	85,719,784.96	127,251.07	35,847,404.54	215,989,620.10

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	1,042,677.78	-	-	-	1,042,677.78
结算备付金	4,642,181.12	-	-	-	4,642,181.12
存出保证金	85,842.24	-	-	-	85,842.24
交易性金融资产	91,391,819.59	361,047,321.64	46,197.43	84,437,458.83	536,922,797.49
应收清算款	-	-	-	1,493,796.38	1,493,796.38
应收申购款	-	-	-	1,229.90	1,229.90
资产总计	97,162,520.73	361,047,321.64	46,197.43	85,932,485.11	544,188,524.91
负债					
卖出回购金融资产款	13,096,898.20	-	-	-	13,096,898.20
应付赎回款	-	-	-	11,970,744.62	11,970,744.62
应付管理人报酬	-	-	-	305,636.39	305,636.39
应付托管费	-	-	-	76,409.10	76,409.10
应付销售服务费	-	-	-	25,925.39	25,925.39
应交税费	-	-	-	25,724.66	25,724.66
其他负债	-	-	-	403,409.31	403,409.31
负债总计	13,096,898.20	-	-	12,807,849.47	25,904,747.67
利率敏感度缺口	84,065,622.53	361,047,321.64	46,197.43	73,124,635.64	518,283,777.24

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	-749,918.90	-1,798,695.79
市场利率下降 25 个基点	755,582.24	1,812,285.63	

#### 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交易的股票，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，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，形成对不同市场周期的预测和判断，通过灵活主动且有纪律的资产配置，确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例，追求较高的收益，同时规避市场的系统性风险。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。本基金投资组合中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。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。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	36,749,834.6 3	17.01	84,437,458.83	16.29
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	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>36,749,834.6</b>	<b>17.01</b>	<b>84,437,458.83</b>	<b>16.29</b>
	3			

#### 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%	1,728,953.34	4,360,488.00
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-1,728,953.34	-4,360,488.00

#### 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。

三个层次输入值的定义如下:

第一层次输入值: 在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次输入值: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值;

第三层次输入值: 相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 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	41,058,816.41	88,159,146.12
第二层次	193,845,162.09	448,506,794.25
第三层次	-	256,857.12
<b>合计</b>	<b>234,903,978.50</b>	<b>536,922,797.49</b>

**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可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

**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、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

**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，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

**§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	36,749,834.63	15.22
	其中：股票	36,749,834.63	15.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	198,154,143.87	82.04
	其中：债券	198,154,143.87	82.04
	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	6,423,993.11	2.66
8	其他各项资产	203,373.87	0.08
9	合计	241,531,345.48	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	9,120.00	0.00
B	采矿业	1,250,329.00	0.58
C	制造业	26,178,573.90	12.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	527,028.00	0.24
E	建筑业	363,137.00	0.17
F	批发和零售业	282,041.00	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	351,048.00	0.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,039,497.07	0.48
J	金融业	3,917,147.50	1.81
K	房地产业	791,184.00	0.37
L	租赁和商务服务业	535,420.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	1,165,169.66	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	87,969.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	252,170.50	0.12
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	36,749,834.63	17.01

### 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	600519	贵州茅台	600	1,014,600.00	0.47
2	300750	宁德时代	3,420	782,461.80	0.36
3	000858	五粮液	4,600	752,422.00	0.35
4	601318	中国平安	13,800	640,320.00	0.30
5	300059	东方财富	44,500	631,900.00	0.29
6	002049	紫光国微	6,400	596,800.00	0.28
7	000333	美的集团	10,100	595,092.00	0.28
8	300124	汇川技术	9,200	590,732.00	0.27
9	600893	航发动力	13,500	570,510.00	0.26
10	002594	比亚迪	2,000	516,540.00	0.24
11	601012	隆基绿能	17,608	504,821.36	0.23
12	000063	中兴通讯	9,300	423,522.00	0.20
13	600919	江苏银行	56,700	416,745.00	0.19
14	600309	万华化学	4,400	386,496.00	0.18
15	600900	长江电力	17,400	383,844.00	0.18
16	600036	招商银行	11,600	380,016.00	0.18
17	600048	保利发展	28,800	375,264.00	0.17
18	600887	伊利股份	12,900	365,328.00	0.17
19	000568	泸州老窖	1,700	356,269.00	0.16
20	601988	中国银行	88,300	345,253.00	0.16
21	600690	海尔智家	13,800	324,024.00	0.15
22	300433	蓝思科技	24,400	286,944.00	0.13
23	601899	紫金矿业	24,400	277,428.00	0.13
24	000932	华菱钢铁	57,900	276,183.00	0.13
25	002304	洋河股份	2,100	275,835.00	0.13
26	600104	上汽集团	19,300	273,481.00	0.13
27	002179	中航光电	5,940	269,379.00	0.12
28	600276	恒瑞医药	5,600	268,240.00	0.12
29	600150	中国船舶	8,000	263,280.00	0.12
30	300316	晶盛机电	3,700	262,330.00	0.12
31	601117	中国化学	31,300	259,164.00	0.12
32	601398	工商银行	53,700	258,834.00	0.12
33	600938	中国海油	14,000	253,680.00	0.12
34	002415	海康威视	7,500	248,325.00	0.11
35	688008	澜起科技	4,290	246,331.80	0.11
36	600028	中国石化	38,500	244,860.00	0.11
37	002410	广联达	7,520	244,324.80	0.11
38	603259	药明康德	3,900	243,009.00	0.11

39	300760	迈瑞医疗	800	239,840.00	0.11
40	601211	国泰君安	17,000	237,830.00	0.11
41	002027	分众传媒	34,800	236,988.00	0.11
42	600030	中信证券	11,875	234,887.50	0.11
43	600999	招商证券	16,300	221,191.00	0.10
44	601888	中国中免	1,900	210,007.00	0.10
45	600009	上海机场	4,600	208,932.00	0.10
46	300347	泰格医药	3,200	206,528.00	0.10
47	601225	陕西煤业	10,900	198,271.00	0.09
48	002636	金安国纪	20,700	191,061.00	0.09
49	600741	华域汽车	9,800	180,908.00	0.08
50	000338	潍柴动力	14,400	179,424.00	0.08
51	002389	航天彩虹	7,800	173,238.00	0.08
52	601288	农业银行	47,500	167,675.00	0.08
53	600809	山西汾酒	900	166,563.00	0.08
54	002064	华峰化学	24,100	165,326.00	0.08
55	300012	华测检测	8,300	161,850.00	0.07
56	300015	爱尔眼科	8,710	161,570.50	0.07
57	002371	北方华创	500	158,825.00	0.07
58	600219	南山铝业	52,100	157,342.00	0.07
59	600586	金晶科技	20,300	156,716.00	0.07
60	002271	东方雨虹	5,600	152,656.00	0.07
61	600546	山煤国际	10,200	147,594.00	0.07
62	002129	TCL 中环	4,375	145,250.00	0.07
63	000883	湖北能源	31,400	143,184.00	0.07
64	600436	片仔癀	500	143,180.00	0.07
65	601100	恒立液压	2,200	141,526.00	0.07
66	601088	中国神华	4,600	141,450.00	0.07
67	002139	拓邦股份	10,800	140,940.00	0.07
68	000683	远兴能源	19,300	138,767.00	0.06
69	605499	东鹏饮料	800	138,320.00	0.06
70	600570	恒生电子	3,100	137,299.00	0.06
71	600031	三一重工	8,200	136,366.00	0.06
72	600660	福耀玻璃	3,800	136,230.00	0.06
73	000725	京东方 A	33,100	135,379.00	0.06
74	600131	国网信通	6,700	135,273.00	0.06
75	300724	捷佳伟创	1,200	134,820.00	0.06
76	600426	华鲁恒升	4,400	134,772.00	0.06
77	600188	兖矿能源	4,500	134,640.00	0.06
78	000963	华东医药	3,100	134,447.00	0.06
79	002402	和而泰	7,900	134,142.00	0.06
80	603806	福斯特	3,600	133,884.00	0.06
81	300896	爱美客	300	133,485.00	0.06
82	601633	长城汽车	5,300	133,401.00	0.06

83	300223	北京君正	1,500	132,465.00	0.06
84	601688	华泰证券	9,600	132,192.00	0.06
85	688273	麦澜德	3,568	132,051.68	0.06
86	002601	龙佰集团	8,000	132,000.00	0.06
87	688063	派能科技	665	131,836.25	0.06
88	600176	中国巨石	9,300	131,688.00	0.06
89	600588	用友网络	6,400	131,200.00	0.06
90	601865	福莱特	3,400	130,934.00	0.06
91	603659	璞泰来	3,400	129,948.00	0.06
92	002459	晶澳科技	3,100	129,270.00	0.06
93	603290	斯达半导	600	129,120.00	0.06
94	002938	鹏鼎控股	5,300	128,737.00	0.06
95	603799	华友钴业	2,800	128,548.00	0.06
96	000902	新洋丰	12,500	128,500.00	0.06
97	300661	圣邦股份	1,560	128,122.80	0.06
98	603986	兆易创新	1,200	127,500.00	0.06
99	000786	北新建材	5,200	127,452.00	0.06
100	300803	指南针	2,600	126,334.00	0.06
101	600559	老白干酒	5,100	125,001.00	0.06
102	300957	贝泰妮	1,400	124,432.00	0.06
103	002142	宁波银行	4,900	123,970.00	0.06
104	000002	万科A	8,800	123,376.00	0.06
105	300628	亿联网络	3,500	122,745.00	0.06
106	600383	金地集团	17,000	122,570.00	0.06
107	600745	闻泰科技	2,500	122,250.00	0.06
108	603288	海天味业	2,600	121,810.00	0.06
109	688385	复旦微电	2,376	119,037.60	0.06
110	600782	新钢股份	31,500	116,865.00	0.05
111	002126	银轮股份	6,600	116,820.00	0.05
112	688196	卓越新能	2,458	113,682.50	0.05
113	002815	崇达技术	9,000	112,050.00	0.05
114	600941	中国移动	1,200	111,960.00	0.05
115	300759	康龙化成	2,900	111,012.00	0.05
116	300014	亿纬锂能	1,800	108,900.00	0.05
117	601728	中国电信	19,300	108,659.00	0.05
118	300443	金雷股份	3,000	106,350.00	0.05
119	002050	三花智控	3,500	105,910.00	0.05
120	600820	隧道股份	17,300	103,973.00	0.05
121	300009	安科生物	10,200	102,000.00	0.05
122	603308	应流股份	5,400	98,820.00	0.05
123	688239	航宇科技	1,402	98,069.90	0.05
124	601137	博威合金	6,300	98,028.00	0.05
125	605123	派克新材	900	97,785.00	0.05
126	600399	抚顺特钢	9,500	96,900.00	0.04

127	001270	铖昌科技	1,100	96,030.00	0.04
128	603758	秦安股份	9,000	95,760.00	0.04
129	605369	拱东医疗	1,700	95,268.00	0.04
130	002073	软控股份	14,300	94,666.00	0.04
131	688059	华锐精密	1,124	94,135.00	0.04
132	688016	心脉医疗	519	93,357.72	0.04
133	603896	寿仙谷	2,100	93,030.00	0.04
134	600582	天地科技	15,900	92,697.00	0.04
135	002242	九阳股份	6,200	92,690.00	0.04
136	688559	海目星	1,971	92,656.71	0.04
137	688776	国光电气	1,114	92,328.32	0.04
138	603348	文灿股份	2,100	92,001.00	0.04
139	300206	理邦仪器	6,100	91,988.00	0.04
140	603396	金辰股份	1,400	91,840.00	0.04
141	000921	海信家电	3,400	91,630.00	0.04
142	688680	海优新材	752	91,608.64	0.04
143	603267	鸿远电子	1,400	91,420.00	0.04
144	002011	盾安环境	6,600	91,278.00	0.04
145	002929	润建股份	2,100	91,161.00	0.04
146	601058	赛轮轮胎	8,000	91,120.00	0.04
147	603882	金域医学	1,200	90,600.00	0.04
148	300034	钢研高纳	2,300	90,597.00	0.04
149	688598	金博股份	527	90,380.50	0.04
150	003043	华亚智能	1,600	90,352.00	0.04
151	002690	美亚光电	3,500	90,125.00	0.04
152	300777	中简科技	1,900	89,794.00	0.04
153	688526	科前生物	3,766	89,593.14	0.04
154	002043	兔宝宝	8,200	89,462.00	0.04
155	002483	润邦股份	15,400	89,320.00	0.04
156	300679	电连技术	2,700	89,235.00	0.04
157	002859	洁美科技	3,200	88,640.00	0.04
158	688617	惠泰医疗	237	88,578.75	0.04
159	300114	中航电测	1,800	88,470.00	0.04
160	300662	科锐国际	2,500	88,425.00	0.04
161	603612	索通发展	5,100	88,383.00	0.04
162	002705	新宝股份	4,900	88,347.00	0.04
163	002518	科士达	2,200	88,022.00	0.04
164	002266	浙富控股	21,300	87,969.00	0.04
165	002353	杰瑞股份	3,500	87,955.00	0.04
166	301080	百普赛斯	1,400	87,948.00	0.04
167	603297	永新光学	1,100	87,890.00	0.04
168	002829	星网宇达	2,000	87,860.00	0.04
169	600038	中直股份	2,200	87,604.00	0.04
170	002851	麦格米特	2,400	87,528.00	0.04

171	600562	国睿科技	5,400	87,480.00	0.04
172	600879	航天电子	10,300	87,447.00	0.04
173	300357	我武生物	2,600	87,438.00	0.04
174	603983	丸美股份	2,700	87,345.00	0.04
175	002925	盈趣科技	4,500	87,300.00	0.04
176	603938	三孚股份	4,400	87,076.00	0.04
177	002176	江特电机	7,300	87,016.00	0.04
178	688696	极米科技	624	86,979.36	0.04
179	300894	火星人	3,400	86,836.00	0.04
180	002413	雷科防务	16,600	86,818.00	0.04
181	600702	舍得酒业	700	86,765.00	0.04
182	605020	永和股份	3,360	86,721.60	0.04
183	300438	鹏辉能源	1,800	86,472.00	0.04
184	605089	味知香	2,200	86,460.00	0.04
185	601208	东材科技	6,800	86,360.00	0.04
186	600223	福瑞达	8,400	86,184.00	0.04
187	688116	天奈科技	1,883	86,147.25	0.04
188	002508	老板电器	3,400	85,986.00	0.04
189	300653	正海生物	2,500	85,975.00	0.04
190	601717	郑煤机	6,900	85,905.00	0.04
191	002507	涪陵榨菜	4,680	85,690.80	0.04
192	688676	金盘科技	2,825	85,569.25	0.04
193	688586	江航装备	6,150	85,546.50	0.04
194	002572	索菲亚	4,900	85,358.00	0.04
195	300035	中科电气	7,100	85,342.00	0.04
196	000739	普洛药业	4,800	85,152.00	0.04
197	002291	遥望科技	6,500	85,150.00	0.04
198	688390	固德威	509	84,931.74	0.04
199	300685	艾德生物	3,500	84,910.00	0.04
200	300737	科顺股份	9,200	84,272.00	0.04
201	688356	键凯科技	790	84,174.50	0.04
202	688499	利元亨	1,322	83,973.44	0.04
203	002244	滨江集团	9,500	83,790.00	0.04
204	300767	震安科技	3,300	83,688.00	0.04
205	002461	珠江啤酒	9,400	82,814.00	0.04
206	002335	科华数据	2,300	82,685.00	0.04
207	688131	皓元医药	1,450	82,621.00	0.04
208	688345	博力威	2,221	82,421.31	0.04
209	300850	新强联	2,200	82,236.00	0.04
210	603866	桃李面包	8,100	81,972.00	0.04
211	300298	三诺生物	3,000	81,120.00	0.04
212	688202	美迪西	940	80,135.00	0.04
213	688508	芯朋微	1,373	79,620.27	0.04
214	601975	招商南油	27,800	79,508.00	0.04

215	300203	聚光科技	3,900	79,053.00	0.04
216	002135	东南网架	12,200	78,812.00	0.04
217	688161	威高骨科	1,816	78,650.96	0.04
218	688065	凯赛生物	1,177	73,280.02	0.03
219	688621	阳光诺和	1,228	72,230.96	0.03
220	688133	泰坦科技	830	70,707.70	0.03
221	603501	韦尔股份	700	68,628.00	0.03
222	603786	科博达	1,000	65,700.00	0.03
223	603678	火炬电子	1,900	65,474.00	0.03
224	600233	圆通速递	4,300	62,608.00	0.03
225	601222	林洋能源	7,600	62,244.00	0.03
226	002475	立讯精密	1,600	51,920.00	0.02
227	300820	英杰电气	600	49,428.00	0.02
228	003035	南网能源	6,900	49,128.00	0.02
229	601126	四方股份	3,200	48,608.00	0.02
230	603008	喜临门	1,800	45,324.00	0.02
231	600197	伊力特	1,500	40,755.00	0.02
232	300327	中颖电子	1,400	39,144.00	0.02
233	002202	金风科技	1,600	16,992.00	0.01
234	301121	紫建电子	290	14,685.60	0.01
235	300511	雪榕生物	1,200	9,120.00	0.00
236	001238	浙江正特	374	8,800.22	0.00
237	603151	邦基科技	535	8,741.90	0.00
238	688357	建龙微纳	42	2,716.98	0.00
239	600416	湘电股份	100	1,909.00	0.00
240	000012	南玻 A	100	596.00	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	601318	中国平安	3,312,867.60	0.64
2	000858	五粮液	1,889,804.00	0.36
3	300316	晶盛机电	1,485,130.00	0.29
4	002049	紫光国微	1,449,596.00	0.28
5	300059	东方财富	1,405,317.00	0.27
6	601668	中国建筑	1,320,712.00	0.25
7	601728	中国电信	1,254,151.00	0.24
8	600809	山西汾酒	1,132,351.00	0.22
9	600519	贵州茅台	1,042,349.00	0.20

10	000063	中兴通讯	914,201.00	0.18
11	601166	兴业银行	901,686.00	0.17
12	600048	保利发展	850,775.00	0.16
13	002415	海康威视	840,443.00	0.16
14	000568	泸州老窖	834,865.00	0.16
15	300496	中科创达	807,631.00	0.16
16	600050	中国联通	806,324.00	0.16
17	688008	澜起科技	802,968.19	0.15
18	002371	北方华创	799,401.00	0.15
19	300751	迈为股份	798,972.00	0.15
20	002304	洋河股份	780,070.00	0.15

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	601318	中国平安	4,615,959.00	0.89
2	000858	五粮液	3,433,676.00	0.66
3	601888	中国中免	2,822,372.00	0.54
4	300122	智飞生物	2,554,863.00	0.49
5	600519	贵州茅台	2,188,562.00	0.42
6	300760	迈瑞医疗	1,757,420.00	0.34
7	300750	宁德时代	1,715,613.00	0.33
8	300059	东方财富	1,516,185.17	0.29
9	600048	保利发展	1,409,620.00	0.27
10	002271	东方雨虹	1,360,838.28	0.26
11	600036	招商银行	1,355,321.97	0.26
12	002475	立讯精密	1,349,083.88	0.26
13	601728	中国电信	1,344,094.00	0.26
14	600919	江苏银行	1,314,855.00	0.25
15	000333	美的集团	1,307,148.00	0.25
16	601668	中国建筑	1,278,323.00	0.25
17	300316	晶盛机电	1,231,966.00	0.24
18	601166	兴业银行	912,563.00	0.18
19	600809	山西汾酒	906,526.00	0.17
20	600031	三一重工	897,890.00	0.17

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	154,605,028.41
卖出股票的收入（成交）总额	207,076,198.79

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	5,497,086.08	2.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,610,421.92	23.43
	其中：政策性金融债	10,160,128.77	4.70
4	企业债券	66,019,034.67	30.57
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	71,718,619.42	33.20
7	可转债（可交换债）	4,308,981.78	1.99
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	198,154,143.87	91.74

### 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	102103229	21 太仓城投 MTN002	200,000	20,461,875.07	9.47
2	175441	21 湖州 01	200,000	20,415,533.15	9.45
3	185097	21 中金 G7	200,000	20,374,893.15	9.43
4	102001939	20 苏元禾 MTN001	100,000	10,320,144.66	4.78
5	102102246	21 晋江城	100,000	10,316,009.32	4.78

		投 MTN003			
--	--	----------	--	--	--

### 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

本基金的股指期货投资将用于套期保值。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将以风险管理为原则，以套期保值为目的。管理人将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

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的 21 中金 G7（185097）的发行人，作为华晨汽车集团控股有限公司申请公开发行 2019 年公司债券的牵头主承销商和 2019 年第一期债券（债券简称 19 华集 01）的主承销商，存在对承销业务中涉及的部分事项尽职调查不充分等未履行勤勉尽责义务的情况，于 2022 年 8 月 9 日被中国证券监督管理委员会辽宁监管局出具警示函。因信息披露违规，于 2022 年 8 月 5 日被北京证券交易所口头警示。因子公司中金前海(深圳)私募股权基金管理有限公司与中金前海(深圳)股权投资基金管理有限公司及管理的 15 只产品未按期完成整改,相关产品涉及底层项目较多,且产品间存在嵌套投资、交叉投资底层项目的复杂情况,“逆回购”交易超过客户账户当日可用资金,公司系统未能识别并拦截,客户账户出现透支等行为,于 2022 年 11 月 22 日被中国证券监督管理委员会

北京监管局责令改正。

对该证券的投资决策程序的说明：公司整体信用水平高，为全国大型证券公司，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	56,852.34
2	应收清算款	146,493.03
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	28.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	203,373.87

### 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	110059	浦发转债	3,096,843.65	1.43
2	110053	苏银转债	754,296.99	0.35
3	110077	洪城转债	247,926.41	0.11
4	110076	华海转债	82,663.66	0.04
5	123161	强联转债	33,792.91	0.02
6	113661	福 22 转债	15,736.09	0.01

### 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
海富通欣享混合 A	403	426,925.16	163,407,742.85	94.98%	8,643,098.12	5.02%
海富通欣享混合 C	3,399	8,145.46	3,093,342.39	11.17%	24,593,070.86	88.83%
合计	3,802	52,534.79	166,501,085.24	83.36%	33,236,168.98	16.64%

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	海富通欣享混合 A	1,877,825.54	1.0914%
	海富通欣享混合 C	603,549.33	2.1799%
	合计	2,481,374.87	1.2423%

### 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	海富通欣享混合 A	>100
	海富通欣享混合 C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通欣享混合 A	0
	海富通欣享混合 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 10 日）基金份额总额	600,098,340.00	6,320.77
本报告期期初基金份额总额	264,307,305.66	220,465,928.52
本报告期基金总申购份额	431,121.06	1,157,662.10
减：本报告期基金总赎回份额	92,687,585.75	193,937,177.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	172,050,840.97	27,686,413.25

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

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

### 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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
国泰君安	2	162,295,440.29	44.89%	118,238.18	45.04%	-
华创证券	1	71,677,537.72	19.83%	51,701.86	19.69%	-
长江证券	1	43,386,756.65	12.00%	31,728.10	12.08%	-
国金证券	1	37,441,574.15	10.36%	27,007.29	10.29%	-
招商证券	1	28,840,260.35	7.98%	20,802.09	7.92%	-
申万宏源	1	7,245,833.51	2.00%	5,299.67	2.02%	-
海通证券	2	5,837,239.96	1.61%	4,269.14	1.63%	-
太平洋证券	2	4,784,149.52	1.32%	3,498.03	1.33%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

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
国泰君安	28,093,414.00	33.63%	1,868,900,000.00	49.36%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	30,282,190.1	36.25%	1,217,300,	32.15%	-	-

	3		000.00			
国金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	20,155,854.79	24.13%	216,300,000.00	5.71%	-	-
海通证券	5,000,000.00	5.99%	188,000,000.00	4.97%	-	-
太平洋证券	-	-	295,500,000.00	7.81%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

## 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	海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购和转换转入业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-16
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-22
5	海富通基金管理有限公司关于海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金新增第一创业证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-03
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增济安财富（北京）基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-29
7	海富通基金管理有限公司关于终止部分代销	中国证券报、基金管理人	2023-03-30

	机构办理旗下基金相关销售业务的公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中证金牛（北京）基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-11
9	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-25
10	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-08
11	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-15
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-19
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-22
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海挖财基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-07
15	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023/1/3-2023/6/30	94,763,901.96	-	-	94,763,901.96	47.44%
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</p>							



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