

海富通安颐收益混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国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.....	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.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
§9 开放式基金份额变动	61
§10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息	65
§12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通安颐收益混合型证券投资基金	
基金简称	海富通安颐收益混合	
基金主代码	519050	
交易代码	519050	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 5 月 29 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	149,013,178.03 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
下属分级基金的交易代码	519050	002339
报告期末下属分级基金的份额总额	110,408,477.23 份	38,604,700.80 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，积极把握股票市场的投资机会，确保资产的保值增值，实现战胜绝对收益基准的目标，为投资者提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金的资产配置策略以基金的投资目标为中心，在实现既定的投资目标同时将可能的损失最小化。首先按照投资时钟理论，根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段，作出权益类资产的初步配置，并根据投资时钟判断大致的行业配置；其次结合证券市场趋势指标，判断证券市场指数的大致风险收益比，从而做出权益类资产的具体仓位选择。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	许俊
	联系电话	021-38650788	010-66596688
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京西城区复兴门内大街1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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	杨仓兵	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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）	
	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
本期已实现收益	819,810.07	284,470.55
本期利润	3,415,095.09	1,365,948.27
加权平均基金份额本期利润	0.0276	0.0311
本期加权平均净值利润率	2.22%	2.45%
本期基金份额净值增长率	2.06%	2.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
期末可供分配利润	18,191,033.73	7,198,043.64
期末可供分配基金份额利润	0.1648	0.1865
期末基金资产净值	137,989,484.65	49,143,249.87

期末基金份额净值	1.2498	1.2730
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
基金份额累计净值增长率	93.19%	46.05%

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)。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

海富通安颐收益混合 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	0.70%	0.21%	0.38%	0.01%	0.32%	0.20%
过去三个月	0.45%	0.20%	1.16%	0.01%	-0.71%	0.19%
过去六个月	2.06%	0.20%	2.33%	0.02%	-0.27%	0.18%
过去一年	-2.73%	0.23%	4.75%	0.01%	-7.48%	0.22%
过去三年	8.18%	0.26%	14.94%	0.01%	-6.76%	0.25%
自基金合同生效起至今	93.19%	0.37%	64.34%	0.02%	28.85%	0.35%

海富通安颐收益混合 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	0.70%	0.22%	0.38%	0.01%	0.32%	0.21%
过去三个月	0.43%	0.20%	1.16%	0.01%	-0.73%	0.19%
过去六个月	2.01%	0.20%	2.33%	0.02%	-0.32%	0.18%
过去一年	-2.83%	0.23%	4.75%	0.01%	-7.58%	0.22%
过去三年	7.81%	0.26%	14.94%	0.01%	-7.13%	0.25%
自基金合同生效起至今	46.05%	0.25%	41.51%	0.01%	4.54%	0.24%

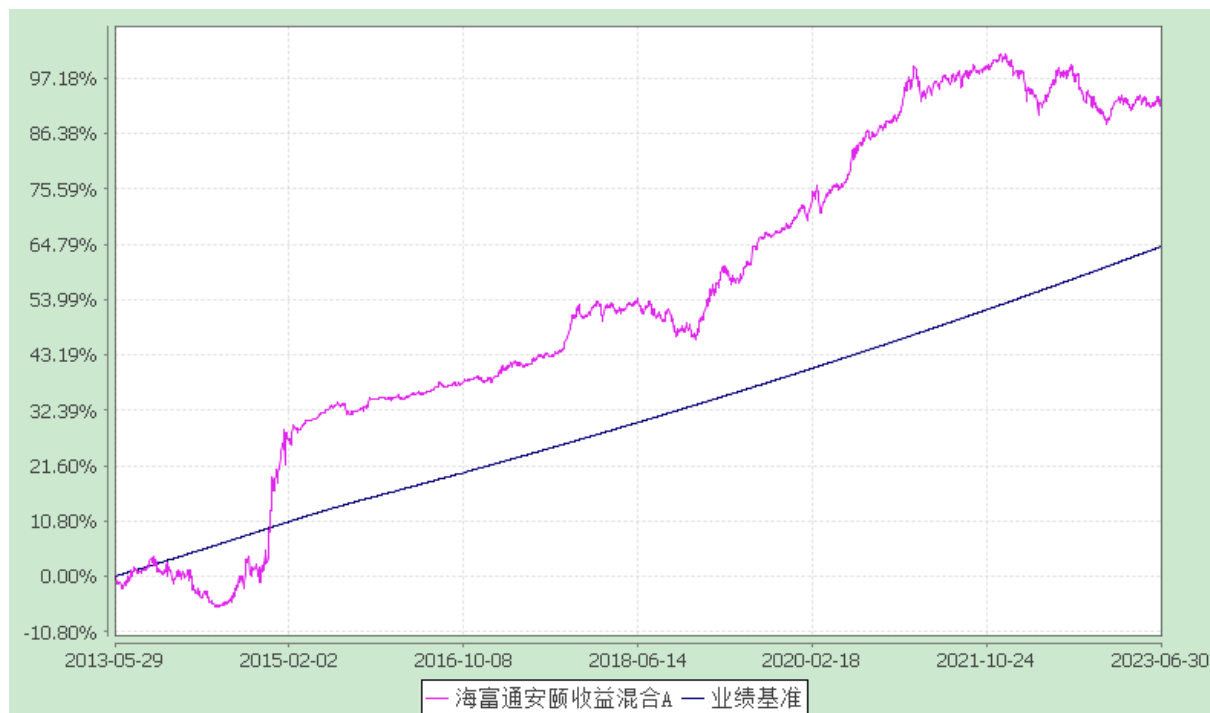
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通安颐收益混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 5 月 29 日至 2023 年 6 月 30 日)

海富通安颐收益混合 A



海富通安颐收益混合 C



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金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		
杜晓海	本基金的基金经理；总经理助理兼量化投资部总监。	2016-06-22	-	23 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通

					<p>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>
夏妍妍	本基金的基金经理	2019-05-22	-	8 年	<p>上海交通大学经济学硕士,持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生,西门子财务租赁有限公司上海分公司高级财务分析师,2014 年加入海富通基金管理有限公司,历任固定收益投资部固定收益分析师、基金经理助理。2018 年 1 月至 2023</p>

				<p>年 1 月任海富通欣益混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2018 年 4 月至 2021 年 5 月任海富通融丰定开债券基金经理。2019 年 5 月起兼任海富通安颐收益混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通聚合纯债基金经理。2019 年 10 月至 2020 年 11 月兼任海富通瑞丰债券基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 9 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2019 年 10 月至 2023 年 4 月兼任海富通富祥混合基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2021 年 5 月起兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2021 年 8 月起兼任海富通瑞兴 3 个月定开债券基金经理。2022 年 7 月起兼任海富通策略收益债券基金经理。</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

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。截至 6 月末，各信用品种收益率普遍位于历史 15% 分位数以内。

可转债方面，1 月市场对经济充满信心，转债指数级上涨；2 月初到 3 月中旬，转债市场震荡走

弱；3月中旬到4月中旬，AI和中特估主题活跃，转债市场随股市反弹，但弹性弱于股票；4月中旬到5月底，权益市场震荡回调，转债市场凸显韧性；6月份稳增长政策预期升温，转债市场小幅上行。截至6月30日，中证转债指数收涨3.37%。板块方面，上半年跌多涨少。

上半年，本基金债券部分视市场情况调整持仓结构，精选高等级信用债个券，以获得稳定较好的票息收益。

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

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

上半年A股主要指数表现方面，上证指数上涨3.65%，沪深300下跌0.75%，中证800上涨0.02%，中小综指上涨2.25%，创业板指下跌5.61%。分行业看，成长板块表现较强，通信、传媒、计算机行业分别上涨50.7%、42.8%、27.6%；顺周期与消费板块相对落后，房地产和建筑材料行业分别下跌14.3%、10.5%，商贸零售、美容护理、食品饮料行业分别下跌23.4%、13.6%、9.1%。

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

报告期内，本基金在控制回撤的基础上，力图寻找合适的股票投资机会以赚取绝对收益。同时，本基金积极参与新股申购，以增强投资收益。投资操作中，本基金在方向配置上保持一贯投资思路，股票投资组合仍然以业绩增长稳定或较低估值的蓝筹白马为主，结合公司盈利质量、盈利能力、成

长性、资产质量、估值等因素综合评估，同时继续保持组合中个股的分散度和保持行业均衡。基于股债性价比分析，本基金适当增加了权益仓位。在股票部分，增加了高股息策略和量化高频策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通安颐收益混合 A 净值增长率为 2.06%，同期业绩比较基准收益率为 2.33%，基金净值跑输业绩比较基准 0.27 个百分点。海富通安颐收益混合 C 净值增长率为 2.01%，同期业绩比较基准收益率为 2.33%，基金净值跑输业绩比较基准 0.32 个百分点。报告期内，市场的预期博弈强于基本面，上半年市场风格波动剧烈，组合没能及时做出相应调整，导致股票部分表现不佳，基金净值跑输基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

固定收益方面，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，同样由于基数走低下半年有望企稳，但年内或难回正。货币政策方面，流动性的合理充裕或维持。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。板块来看，城投核心矛盾短期难以解决，以时间换空间是当下最主要的化债思路，需防范尾部风险，适度挖掘积极化债、风险可控区域城投；地产弱修复持续，政策博弈从预期转为现实，后续关注地产政策如何演绎，关注次优档央国企地产债配置价值，不过度下沉；产业债可关注景气回升的电力、消费类行业，煤炭、电力可挖掘国企永续债机会；银行基本面仍有分化，把握高等级二永债波段交易机会，防范中小银行不赎回风险，关注资本新规潜在冲击。

可转债方面，估值或将继续维持高位窄幅波动，重视中报数据和稳增长政策。债市长端利率维

持较低水平叠加流动性充裕，对于转债市场估值有较强支撑。7、8 月是半年报披露期，需关注重点行业和个券的业绩表现，同时密切跟踪宏观预期变化，不排除市场风格从大科技向顺周期切换的可能性。半导体板块基本面大概率筑底，下半年或将迎来行业周期反转和主题催化的共振，值得重点关注。

下半年，本基金债券部分配置将以高等级债券为主。同时，积极关注利率债的交易性机会，并配合股票部分投资策略，做好流动性管理。

权益方面，展望下半年，随着宏观政策基调转向稳增长，国内经济预期企稳，将进入自然复苏阶段，经济复苏的态势将延续。从库存周期看，下半年中美经济周期均将进入被动去库存阶段，今年年底明年年初可能进入主动补库存阶段，内需将逐步企稳回升，外需保持较强韧性。同时，在房地产市场托底、地方债务化解背景下，国内货币政策将保持宽松状态，流动性合理充裕，对 A 股较为偏正面。海外，美联储加息周期也行至尾声，对全球风险资产估值的压制减轻。同时，随着国内外政策态度的明朗，上半年市场风险偏好逐步下行的过程基本结束，下半年风险偏好有望回升。

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

展望后市，随着国内经济逐步企稳，企业盈利将逐渐修复，传统行业的盈利或将回升，股票市场短期仍然有波动，从估值来看，A 股整体估值水平较低，已经具备较好的性价比，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 30%。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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：海富通安颐收益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	3,716,610.13	6,258,761.40
结算备付金		5,942,455.96	15,866,740.38
存出保证金		444,444.05	877,917.31
交易性金融资产	6.4.7.2	185,323,738.41	233,605,785.79
其中：股票投资		50,828,524.34	57,419,304.12
基金投资		-	-
债券投资		134,495,214.07	176,186,481.67
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		4,099,396.99	176,097.94
应收股利		-	-
应收申购款		24,263.47	39,255.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		199,550,909.01	256,824,558.12
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		7,497,703.49	13,996,250.65
应付清算款		4,031,926.95	151,381.87
应付赎回款		552,344.62	309,919.20
应付管理人报酬		155,395.14	282,881.69
应付托管费		38,848.81	70,720.39
应付销售服务费		4,057.55	12,317.00
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,947.53	9,260.27

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	132,950.40	471,754.24
负债合计		12,418,174.49	15,304,485.31
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	149,013,178.03	196,168,587.88
未分配利润	6.4.7.8	38,119,556.49	45,351,484.93
净资产合计		187,132,734.52	241,520,072.81
负债和净资产总计		199,550,909.01	256,824,558.12

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.2498 元，C 类基金份额净值 1.2730 元。

基金份额总额 149,013,178.03 份，其中 A 类基金份额 110,408,477.23 份，C 类基金份额 38,604,700.80 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通安颐收益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		6,284,773.91	-22,990,107.21
1.利息收入		165,073.03	744,258.69
其中：存款利息收入	6.4.7.9	103,543.38	212,415.14
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		61,529.65	531,843.55
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,426,249.83	4,744,920.45
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-517,179.00	-13,530,840.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,922,173.29	11,715,997.73
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	353,781.55	5,042,441.53
股利收益	6.4.7.14	667,473.99	1,517,321.36
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	3,676,762.74	-28,624,871.66
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	16,688.31	145,585.31
减：二、营业总支出		1,503,730.55	6,133,267.84
1. 管理人报酬		1,044,185.23	4,451,262.21
2. 托管费		261,046.34	1,112,815.59
3. 销售服务费		27,835.17	269,258.48
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		52,751.38	123,283.46
其中：卖出回购金融资产支出		52,751.38	123,283.46
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		4,159.02	45,577.08
8. 其他费用	6.4.7.17	113,753.41	131,071.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,781,043.36	-29,123,375.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,781,043.36	-29,123,375.05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,781,043.36	-29,123,375.05

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海富通安颐收益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）	196,168,587.88	-	45,351,484.93	241,520,072.81
二、本期期初净资产（基金净值）	196,168,587.88	-	45,351,484.93	241,520,072.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-47,155,409.85	-	-7,231,928.44	-54,387,338.29
（一）、综合收益总额	-	-	4,781,043.36	4,781,043.36
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-47,155,409.85	-	-12,012,971.80	-59,168,381.65

(净值减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	3,771,631.59	-	952,982.82	4,724,614.41
2.基金赎回款	-50,927,041.44	-	-12,965,954.62	-63,892,996.06
(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)	149,013,178.03	-	38,119,556.49	187,132,734.52
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)	1,207,692,587.39	-	488,194,517.28	1,695,887,104.67
二、本期期初净资产(基金净值)	1,207,692,587.39	-	488,194,517.28	1,695,887,104.67
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-722,808,557.83	-	-342,640,417.38	-1,065,448,975.21
(一)、综合收益总额	-	-	-29,123,375.05	-29,123,375.05
(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)	-722,808,557.83	-	-275,871,036.84	-998,679,594.67
其中：1.基金申购款	109,754,638.19	-	39,327,227.60	149,081,865.79
2.基金赎回款	-832,563,196.02	-	-315,198,264.44	-1,147,761,460.46
(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)	-	-	-37,646,005.49	-37,646,005.49
四、本期期末净资产(基金净值)	484,884,029.56	-	145,554,099.90	630,438,129.46

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

海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）（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[2013] 299 号文核准，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《海富通养老收益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 850,131,326.99 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 328 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通养老收益混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 5 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 850,399,612.86 份基金份额，其中认购资金利息折合 268,285.87 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据本基金管理人海富通基金管理有限公司 2016 年 1 月 6 日《关于海富通养老收益混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2016 年 1 月 8 日起对本基金增加 C 类份额并相应修改基金合同。本基金原有的基金份额类别更名为 A 类基金份额，新增的基金份额类别命名为 C 类基金份额，并对 C 级份额收取销售服务费。

根据本基金管理人海富通基金管理有限公司 2018 年 6 月 1 日《海富通基金管理有限公司关于海富通养老收益混合型证券投资基金更名的公告》，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2018 年 6 月 1 日起，海富通养老收益混合型证券投资基金更名为海富通安颐收益混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通安颐收益混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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(包含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转换债券、分离交易可转换债券、次级债券、中小企业私募债券、债券回购、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、银行存款、货币市场工具、权证、股指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,本基金投资组合的比例范围为:本基金股票投资及存托凭证占基金资产的比例为 0%~95%,权证投资占基金资产净值的比例为 0%~3%,债券、银行存款、货币市场工具、现金及其它资产合计占基金资产的比例为 5%~100%,其中每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:三年期银行定期存款利率(税后)+ 2%。

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》、《海富通安颐收益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、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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,以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	3,716,610.13
等于: 本金	3,716,288.16
加: 应计利息	321.97

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	3,716,610.13

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		49,470,398.39	-	50,828,524.34	1,358,125.95
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所 市场	46,102,157.26	819,472.21	46,752,801.21	-168,828.26
	银行间 市场	86,132,333.07	1,260,012.86	87,742,412.86	350,066.93
	合计	132,234,490.33	2,079,485.07	134,495,214.07	181,238.67
	资产支持证券	-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		181,704,888.72	2,079,485.07	185,323,738.41	1,539,364.62

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			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-3,524,292.00	-	-	-
——股指期货	-3,524,292.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-3,524,292.00	-	-	-

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
IF2309	IF2309	-3.00	-3,455,100.00	69,192.00
合计	-	-	-	69,192.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	69,192.00
净额	-	-	-	0.00

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	207.65
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	45,962.30
其中：交易所市场	45,672.26

银行间市场	290.04
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	132,950.40

6.4.7.7 实收基金

海富通安颐收益混合 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	140,634,947.89	140,634,947.89
本期申购	2,514,720.13	2,514,720.13
本期赎回（以“-”号填列）	-32,741,190.79	-32,741,190.79
本期末	110,408,477.23	110,408,477.23

海富通安颐收益混合 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	55,533,639.99	55,533,639.99
本期申购	1,256,911.46	1,256,911.46
本期赎回（以“-”号填列）	-18,185,850.65	-18,185,850.65
本期末	38,604,700.80	38,604,700.80

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

海富通安颐收益混合 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	22,267,423.68	9,316,735.66	31,584,159.34
本期利润	819,810.07	2,595,285.02	3,415,095.09
本期基金份额交易产生的变动数	-4,896,200.02	-2,522,046.99	-7,418,247.01

其中：基金申购款	405,896.85	209,914.66	615,811.51
基金赎回款	-5,302,096.87	-2,731,961.65	-8,034,058.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,191,033.73	9,389,973.69	27,581,007.42

海富通安颐收益混合 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	10,025,811.31	3,741,514.28	13,767,325.59
本期利润	284,470.55	1,081,477.72	1,365,948.27
本期基金份额交易产生的变动数	-3,112,238.22	-1,482,486.57	-4,594,724.79
其中：基金申购款	230,272.37	106,898.94	337,171.31
基金赎回款	-3,342,510.59	-1,589,385.51	-4,931,896.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,198,043.64	3,340,505.43	10,538,549.07

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	11,058.79
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	92,096.41
其他	388.18
合计	103,543.38

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	90,387,069.44
减：卖出股票成本总额	90,682,981.45
减：交易费用	221,266.99
买卖股票差价收入	-517,179.00

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	1,729,083.31
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	193,089.98
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	1,922,173.29

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	140,574,001.66
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	138,482,123.88
减：应计利息总额	1,895,380.11
减：交易费用	3,407.69
买卖债券差价收入	193,089.98

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）	369,548.00
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	10,763.53
减：交易费用	5,002.92
合计	353,781.55

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	667,473.99
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	667,473.99

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	3,629,730.74
——股票投资	2,772,001.59
——债券投资	857,729.15
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	47,032.00
——权证投资	-
——股指期货	47,032.00
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	3,676,762.74

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	16,643.78
基金转换费收入	44.53
合计	16,688.31

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	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	8,372.96
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	18,000.00
合计	113,753.41

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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	29,122,913.27	16.98%	123,822,919.48	24.42%

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	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
海通证券	21,006.75	17.90%	-	-
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	88,831.13	27.20%	18,328.92	11.57%

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,044,185.23	4,451,262.21
其中：支付销售机构的客户维护费	347,927.55	770,056.62

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 1.00% 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 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	261,046.34	1,112,815.59

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 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

	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C	合计
海通证券	-	3,849.81	3,849.81
海富通基金	-	4,087.61	4,087.61
合计	-	7,937.42	7,937.42
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		
	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C	合计
海通证券	-	8,953.18	8,953.18
海富通基金	-	149,283.98	149,283.98
合计	-	158,237.16	158,237.16

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

份额单位：份

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

	海富通安颐收益混合A	海富通安颐收益混合C	海富通安颐收益混合A	海富通安颐收益混合C
期初持有的基金份额	14,780,873.55	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	14,780,873.55	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	14,780,873.55	-	14,780,873.55	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.39%	-	7.75%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,716,610.13	11,058.79	8,701,182.68	30,547.16

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	6,759	559,577.61
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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
118036	力合转债	2023-06-28	1 个月内(含)	老股东配债	100.00	100.00	150	15,000.00	15,000.30	-

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

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023-06-28	重大事项停牌	6.97	2023-07-03	7.40	20,900	119,786.00	145,673.00	-

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

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

证券款余额 7,497,703.49 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

本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。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在严格控制下跌风险的基础上，积极把握股票市场的投资机会，确保资产的保值增值，实现战胜绝对收益基准的目标，为投资者提供稳健的养老理财工具。

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 50.01%（2022 年 12 月 31 日：58.29%）。

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	15,228,684.11	20,232,098.63
合计	15,228,684.11	20,232,098.63

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为短期融资券、国债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

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	9,848,557.05	-
合计	9,848,557.05	-

6.4.13.2.3 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	73,485,453.14	101,339,789.03
AAA 以下	120,807.71	34,404,829.63
未评级	35,811,712.06	20,209,764.38
合计	109,417,972.91	155,954,383.04

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上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足

额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有及承担的大部分权益类金融资产和金融负债不计息，该部分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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种存在相应的利率风险，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。

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	3,716,610.13	-	-	-	3,716,610.13
结算备付金	5,942,455.96	-	-	-	5,942,455.96
存出保证金	29,832.05	-	-	414,612.00	444,444.05
交易性金融资产	40,381,447.38	94,098,766.39	15,000.30	50,828,524.34	185,323,738.41
应收清算款	-	-	-	4,099,396.99	4,099,396.99
应收申购款	-	-	-	24,263.47	24,263.47
资产总计	50,070,345.52	94,098,766.39	15,000.30	55,366,796.80	199,550,909.01
负债					
卖出回购金融资	7,497,703.49	-	-	-	7,497,703.49

产款					
应付清算款	-	-	-	4,031,926.95	4,031,926.95
应付赎回款	-	-	-	552,344.62	552,344.62
应付管理人报酬	-	-	-	155,395.14	155,395.14
应付托管费	-	-	-	38,848.81	38,848.81
应付销售服务费	-	-	-	4,057.55	4,057.55
应交税费	-	-	-	4,947.53	4,947.53
其他负债	-	-	-	132,950.40	132,950.40
负债总计	7,497,703.49	-	-	4,920,471.00	12,418,174.49
利率敏感度缺口	42,572,642.03	94,098,766.39	15,000.30	50,446,325.80	187,132,734.52
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	6,258,761.40	-	-	-	6,258,761.40
结算备付金	15,866,740.38	-	-	-	15,866,740.38
存出保证金	55,501.31	-	-	822,416.00	877,917.31
交易性金融资产	24,388,577.75	151,767,049.85	30,854.07	57,419,304.12	233,605,785.79
应收清算款	-	-	-	176,097.94	176,097.94
应收申购款	-	-	-	39,255.30	39,255.30
资产总计	46,569,580.84	151,767,049.85	30,854.07	58,457,073.36	256,824,558.12
负债					
卖出回购金融资产款	13,996,250.65	-	-	-	13,996,250.65
应付清算款	-	-	-	151,381.87	151,381.87
应付赎回款	-	-	-	309,919.20	309,919.20
应付管理人报酬	-	-	-	282,881.69	282,881.69
应付托管费	-	-	-	70,720.39	70,720.39
应付销售服务费	-	-	-	12,317.00	12,317.00
应交税费	-	-	-	9,260.27	9,260.27
其他负债	-	-	-	471,754.24	471,754.24
负债总计	13,996,250.65	-	-	1,308,234.66	15,304,485.31
利率敏感度缺口	32,573,330.19	151,767,049.85	30,854.07	57,148,838.70	241,520,072.81

					1
--	--	--	--	--	---

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 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	-675,525.38	-1,324,099.93
市场利率下降 25 个基点	685,048.35	1,347,413.22	

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 0%~95%，权证投资 0%~3%，债券、银行存款、货币市场工具、现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)及其它资产 5%~100%。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	50,828,524.34	27.16	57,419,304.12	23.77
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	50,828,524.34	27.16	57,419,304.12	23.77

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%	1,991,463.32	2,561,984.59
2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-1,991,463.32	-2,561,984.59	

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	51,404,931.43	56,673,502.40
第二层次	133,918,806.98	176,167,882.00
第三层次	-	764,401.39
合计	185,323,738.41	233,605,785.79

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金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	50,828,524.34	25.47
	其中：股票	50,828,524.34	25.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	134,495,214.07	67.40
	其中：债券	134,495,214.07	67.40
	资产支持证券	-	-
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	9,659,066.09	4.84
8	其他各项资产	4,568,104.51	2.29
9	合计	199,550,909.01	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	-	-
B	采矿业	1,267,676.00	0.68
C	制造业	32,577,708.02	17.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,168,430.60	0.62
E	建筑业	2,204,905.00	1.18
F	批发和零售业	1,029,943.00	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	884,868.94	0.47
H	住宿和餐饮业	109,910.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,112,133.25	2.73
J	金融业	2,995,043.20	1.60
K	房地产业	1,574,106.00	0.84
L	租赁和商务服务业	521,947.90	0.28

M	科学研究和技术服务业	949,510.43	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	60,507.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	116,840.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	254,995.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	50,828,524.34	27.16

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	000333	美的集团	19,000	1,119,480.00	0.60
2	000063	中兴通讯	22,600	1,029,204.00	0.55
3	600519	贵州茅台	600	1,014,600.00	0.54
4	601668	中国建筑	149,900	860,426.00	0.46
5	300274	阳光电源	7,300	851,399.00	0.45
6	300750	宁德时代	3,440	787,037.60	0.42
7	600919	江苏银行	102,100	750,435.00	0.40
8	300760	迈瑞医疗	2,200	659,560.00	0.35
9	600941	中国移动	6,700	625,110.00	0.33
10	600325	华发股份	56,000	551,600.00	0.29
11	001979	招商蛇口	41,900	545,957.00	0.29
12	601567	三星医疗	42,300	534,249.00	0.29
13	002318	久立特材	30,000	510,900.00	0.27
14	300358	楚天科技	33,200	495,676.00	0.26
15	600426	华鲁恒升	15,980	489,467.40	0.26
16	002555	三七互娱	13,900	484,832.00	0.26
17	600131	国网信通	23,800	480,522.00	0.26
18	000858	五粮液	2,700	441,639.00	0.24
19	600901	江苏金租	104,440	431,337.20	0.23
20	601058	赛轮轮胎	36,400	414,596.00	0.22
21	300316	晶盛机电	5,800	411,220.00	0.22
22	600803	新奥股份	21,300	404,274.00	0.22

23	300887	谱尼测试	10,000	395,800.00	0.21
24	002517	恺英网络	23,900	376,186.00	0.20
25	300146	汤臣倍健	14,700	352,506.00	0.19
26	688257	新锐股份	13,231	350,753.81	0.19
27	603444	吉比特	700	343,777.00	0.18
28	600566	济川药业	11,600	336,864.00	0.18
29	600887	伊利股份	11,800	334,176.00	0.18
30	000400	许继电气	14,300	329,615.00	0.18
31	601689	拓普集团	4,000	322,800.00	0.17
32	601899	紫金矿业	28,300	321,771.00	0.17
33	002126	银轮股份	18,100	320,370.00	0.17
34	000589	贵州轮胎	57,200	320,320.00	0.17
35	603305	旭升集团	11,200	312,144.00	0.17
36	603043	广州酒家	11,000	310,860.00	0.17
37	002463	沪电股份	14,700	307,818.00	0.16
38	002011	盾安环境	22,000	304,260.00	0.16
39	600496	精工钢构	78,500	292,805.00	0.16
40	601377	兴业证券	47,500	290,700.00	0.16
41	603993	洛阳钼业	54,500	290,485.00	0.16
42	688128	中国电研	11,272	287,436.00	0.15
43	601117	中国化学	34,500	285,660.00	0.15
44	002345	潮宏基	35,800	281,388.00	0.15
45	600970	中材国际	21,700	276,675.00	0.15
46	601318	中国平安	5,700	264,480.00	0.14
47	002050	三花智控	8,476	256,483.76	0.14
48	603298	杭叉集团	10,800	254,340.00	0.14
49	603035	常熟汽饰	12,500	242,875.00	0.13
50	688626	翔宇医疗	5,329	242,522.79	0.13
51	002705	新宝股份	13,400	241,602.00	0.13
52	688332	中科蓝讯	2,820	235,977.60	0.13
53	300408	三环集团	7,800	228,930.00	0.12
54	600674	川投能源	15,200	228,760.00	0.12
55	300773	拉卡拉	13,000	226,720.00	0.12
56	000921	海信家电	8,300	223,685.00	0.12
57	600036	招商银行	6,800	222,768.00	0.12
58	002371	北方华创	700	222,355.00	0.12
59	600861	北京人力	9,500	220,400.00	0.12
60	002984	森麒麟	6,800	213,928.00	0.11
61	601857	中国石油	28,400	212,148.00	0.11
62	002154	报喜鸟	37,800	208,656.00	0.11
63	000988	华工科技	5,300	201,453.00	0.11
64	600572	康恩贝	29,200	200,020.00	0.11
65	002384	东山精密	7,700	199,430.00	0.11
66	002867	周大生	11,100	197,358.00	0.11

67	600497	驰宏锌锗	39,100	196,282.00	0.10
68	600079	人福医药	7,100	191,274.00	0.10
69	601390	中国中铁	25,000	189,500.00	0.10
70	601816	京沪高铁	35,900	188,834.00	0.10
71	600415	小商品城	21,900	186,807.00	0.10
72	600820	隧道股份	30,400	182,704.00	0.10
73	600048	保利发展	14,000	182,420.00	0.10
74	002727	一心堂	6,800	179,520.00	0.10
75	600109	国金证券	20,700	179,469.00	0.10
76	000811	冰轮环境	11,300	178,088.00	0.10
77	300476	胜宏科技	7,300	176,003.00	0.09
78	002990	盛视科技	4,700	172,960.00	0.09
79	300130	新国都	6,100	172,813.00	0.09
80	002063	远光软件	19,500	169,260.00	0.09
81	000568	泸州老窖	800	167,656.00	0.09
82	000933	神火股份	12,800	166,400.00	0.09
83	603129	春风动力	1,000	161,900.00	0.09
84	601601	中国太保	6,200	161,076.00	0.09
85	600248	陕建股份	33,600	160,272.00	0.09
86	300223	北京君正	1,800	158,958.00	0.08
87	688589	力合微	3,890	158,478.60	0.08
88	002605	姚记科技	3,400	157,862.00	0.08
89	600835	上海机电	9,100	156,338.00	0.08
90	603187	海容冷链	7,820	156,321.80	0.08
91	600600	青岛啤酒	1,500	155,445.00	0.08
92	300592	华凯易佰	5,700	155,154.00	0.08
93	601211	国泰君安	11,000	153,890.00	0.08
94	601877	正泰电器	5,500	152,075.00	0.08
95	300360	炬华科技	8,500	151,980.00	0.08
96	002541	鸿路钢构	5,240	150,964.40	0.08
97	002987	京北方	6,840	149,932.80	0.08
98	600309	万华化学	1,700	149,328.00	0.08
99	600938	中国海油	8,200	148,584.00	0.08
100	600900	长江电力	6,700	147,802.00	0.08
101	601298	青岛港	20,900	145,673.00	0.08
102	601369	陕鼓动力	15,900	144,849.00	0.08
103	600562	国睿科技	8,800	142,560.00	0.08
104	002851	麦格米特	3,900	142,233.00	0.08
105	600511	国药股份	3,600	139,860.00	0.07
106	002415	海康威视	4,200	139,062.00	0.07
107	300470	中密控股	3,000	138,660.00	0.07
108	002475	立讯精密	4,225	137,101.25	0.07
109	300627	华测导航	4,200	136,374.00	0.07
110	603801	志邦家居	4,100	135,382.00	0.07

111	688621	阳光诺和	2,296	135,050.72	0.07
112	000733	振华科技	1,400	134,190.00	0.07
113	300036	超图软件	5,600	132,776.00	0.07
114	603345	安井食品	900	132,120.00	0.07
115	300416	苏试试验	6,120	131,947.20	0.07
116	002244	滨江集团	14,900	131,418.00	0.07
117	002790	瑞尔特	13,500	129,600.00	0.07
118	002594	比亚迪	500	129,135.00	0.07
119	603920	世运电路	6,500	126,945.00	0.07
120	002158	汉钟精机	5,000	124,800.00	0.07
121	600030	中信证券	6,300	124,614.00	0.07
122	003006	百亚股份	7,200	124,416.00	0.07
123	002179	中航光电	2,678	121,447.30	0.06
124	601766	中国中车	18,600	120,900.00	0.06
125	600487	亨通光电	8,200	120,212.00	0.06
126	000960	锡业股份	7,700	119,735.00	0.06
127	002027	分众传媒	17,300	117,813.00	0.06
128	300533	冰川网络	2,350	117,406.00	0.06
129	002014	永新股份	13,400	116,312.00	0.06
130	600027	华电国际	17,200	115,068.00	0.06
131	301061	匠心家居	3,100	114,545.00	0.06
132	002271	东方雨虹	4,200	114,492.00	0.06
133	605368	蓝天燃气	11,920	114,074.40	0.06
134	601000	唐山港	31,700	111,901.00	0.06
135	600004	白云机场	7,691	110,288.94	0.06
136	600258	首旅酒店	5,800	109,910.00	0.06
137	300982	苏文电能	1,800	109,008.00	0.06
138	300068	南都电源	5,600	108,416.00	0.06
139	002444	巨星科技	4,900	107,212.00	0.06
140	600755	厦门国贸	13,800	106,812.00	0.06
141	600138	中青旅	8,500	106,335.00	0.06
142	688066	航天宏图	1,746	106,331.40	0.06
143	300031	宝通科技	4,300	106,296.00	0.06
144	688425	铁建重工	21,196	101,952.76	0.05
145	603486	科沃斯	1,300	101,101.00	0.05
146	600989	宝丰能源	8,000	100,880.00	0.05
147	002073	软控股份	15,000	99,300.00	0.05
148	688019	安集科技	598	98,568.34	0.05
149	600908	无锡银行	18,300	98,088.00	0.05
150	002410	广联达	3,000	97,470.00	0.05
151	300118	东方日升	3,800	97,394.00	0.05
152	603927	中科软	2,500	96,400.00	0.05
153	002270	华明装备	8,800	96,360.00	0.05
154	603986	兆易创新	900	95,625.00	0.05

155	600765	中航重机	3,600	95,436.00	0.05
156	000922	佳电股份	7,100	93,436.00	0.05
157	002469	三维化学	15,100	92,865.00	0.05
158	002180	纳思达	2,700	92,475.00	0.05
159	002130	沃尔核材	11,200	90,944.00	0.05
160	603300	华铁应急	16,660	90,797.00	0.05
161	603338	浙江鼎力	1,600	89,616.00	0.05
162	603699	纽威股份	6,000	89,280.00	0.05
163	300494	盛天网络	3,600	89,244.00	0.05
164	601717	郑煤机	7,100	88,395.00	0.05
165	601126	四方股份	5,800	88,102.00	0.05
166	300866	安克创新	1,000	87,500.00	0.05
167	600582	天地科技	14,800	86,284.00	0.05
168	601138	工业富联	3,400	85,680.00	0.05
169	688208	道通科技	2,824	85,595.44	0.05
170	603195	公牛集团	888	85,301.28	0.05
171	603118	共进股份	6,300	83,727.00	0.04
172	601186	中国铁建	8,500	83,725.00	0.04
173	600064	南京高科	12,300	81,303.00	0.04
174	000338	潍柴动力	6,500	80,990.00	0.04
175	601838	成都银行	6,600	80,586.00	0.04
176	300687	赛意信息	2,900	80,562.00	0.04
177	600398	海澜之家	11,700	80,496.00	0.04
178	002439	启明星辰	2,700	80,352.00	0.04
179	300122	智飞生物	1,800	79,560.00	0.04
180	000650	仁和药业	12,800	78,592.00	0.04
181	002643	万润股份	4,500	78,345.00	0.04
182	002049	紫光国微	840	78,330.00	0.04
183	600587	新华医疗	2,200	77,726.00	0.04
184	002430	杭氧股份	2,200	75,592.00	0.04
185	603799	华友钴业	1,640	75,292.40	0.04
186	000725	京东方 A	18,300	74,847.00	0.04
187	002832	比音勒芬	2,100	74,361.00	0.04
188	000596	古井贡酒	300	74,214.00	0.04
189	002324	普利特	5,100	72,777.00	0.04
190	002483	润邦股份	12,500	72,500.00	0.04
191	000690	宝新能源	10,300	72,306.00	0.04
192	002352	顺丰控股	1,600	72,144.00	0.04
193	002035	华帝股份	10,100	71,710.00	0.04
194	300124	汇川技术	1,100	70,631.00	0.04
195	000938	紫光股份	2,200	70,070.00	0.04
196	603309	维力医疗	4,400	68,068.00	0.04
197	688599	天合光能	1,593	67,877.73	0.04
198	600580	卧龙电驱	4,600	67,206.00	0.04

199	603076	乐惠国际	1,400	66,934.00	0.04
200	603889	新澳股份	8,900	66,839.00	0.04
201	600066	宇通客车	4,500	66,330.00	0.04
202	603877	太平鸟	2,600	65,728.00	0.04
203	688100	威胜信息	2,159	64,359.79	0.03
204	002311	海大集团	1,369	64,123.96	0.03
205	688556	高测股份	1,206	64,086.84	0.03
206	002044	美年健康	9,000	63,990.00	0.03
207	300059	东方财富	4,480	63,616.00	0.03
208	600028	中国石化	10,000	63,600.00	0.03
209	600458	时代新材	5,300	63,547.00	0.03
210	603596	伯特利	800	63,408.00	0.03
211	600845	宝信软件	1,237	62,851.97	0.03
212	002533	金杯电工	7,700	62,832.00	0.03
213	603279	景津装备	2,000	62,720.00	0.03
214	688596	正帆科技	1,446	62,611.80	0.03
215	605599	莱百股份	4,700	62,087.00	0.03
216	002611	东方精工	10,800	61,992.00	0.03
217	688376	美埃科技	1,568	61,920.32	0.03
218	300532	今天国际	3,000	61,680.00	0.03
219	003029	吉大正元	1,900	61,655.00	0.03
220	002829	星网宇达	1,400	61,502.00	0.03
221	002937	兴瑞科技	2,500	61,500.00	0.03
222	600267	海正药业	5,400	61,452.00	0.03
223	603179	新泉股份	1,400	61,446.00	0.03
224	300019	硅宝科技	3,600	61,380.00	0.03
225	002648	卫星化学	4,100	61,336.00	0.03
226	300938	信测标准	1,400	61,320.00	0.03
227	002752	昇兴股份	12,900	61,275.00	0.03
228	002046	国机精工	4,800	61,248.00	0.03
229	300502	新易盛	900	61,173.00	0.03
230	300384	三联虹普	3,600	61,164.00	0.03
231	605167	利柏特	6,300	60,984.00	0.03
232	300351	永贵电器	3,700	60,791.00	0.03
233	603180	金牌厨柜	1,800	60,336.00	0.03
234	002777	久远银海	1,700	60,299.00	0.03
235	002138	顺络电子	2,500	59,775.00	0.03
236	688680	海优新材	490	59,691.80	0.03
237	688037	芯源微	346	59,148.70	0.03
238	605133	嵘泰股份	1,700	59,092.00	0.03
239	002170	芭田股份	8,600	59,082.00	0.03
240	688239	航宇科技	844	59,037.80	0.03
241	601702	华峰铝业	4,300	58,824.00	0.03
242	603112	华翔股份	5,000	58,800.00	0.03

243	603308	应流股份	3,200	58,560.00	0.03
244	603690	至纯科技	1,680	58,531.20	0.03
245	300993	玉马遮阳	5,100	58,395.00	0.03
246	688516	奥特维	309	58,215.60	0.03
247	002674	兴业科技	4,700	58,045.00	0.03
248	600298	安琪酵母	1,600	57,936.00	0.03
249	000403	派林生物	2,900	57,884.00	0.03
250	688009	中国通号	9,962	57,779.60	0.03
251	300820	英杰电气	700	57,666.00	0.03
252	002236	大华股份	2,900	57,275.00	0.03
253	301363	美好医疗	1,300	57,187.00	0.03
254	002068	黑猫股份	4,800	56,976.00	0.03
255	603239	浙江仙通	3,500	56,945.00	0.03
256	000928	中钢国际	5,900	56,935.00	0.03
257	600060	海信视像	2,300	56,925.00	0.03
258	300041	回天新材	4,810	56,758.00	0.03
259	601872	招商轮船	9,800	56,742.00	0.03
260	601333	广深铁路	14,300	56,628.00	0.03
261	688588	凌志软件	3,632	56,477.60	0.03
262	300628	亿联网络	1,600	56,112.00	0.03
263	002334	英威腾	4,400	56,056.00	0.03
264	300406	九强生物	2,400	55,992.00	0.03
265	002737	葵花药业	2,300	55,982.00	0.03
266	600612	老凤祥	800	55,904.00	0.03
267	600933	爱柯迪	2,400	55,896.00	0.03
268	002266	浙富控股	13,500	55,755.00	0.03
269	600862	中航高科	2,200	55,682.00	0.03
270	002508	老板电器	2,200	55,638.00	0.03
271	600809	山西汾酒	300	55,521.00	0.03
272	601869	长飞光纤	1,500	55,515.00	0.03
273	300634	彩讯股份	2,100	55,440.00	0.03
274	688389	普门科技	2,360	55,436.40	0.03
275	600872	中炬高新	1,500	55,185.00	0.03
276	300109	新开源	2,200	54,714.00	0.03
277	688110	东芯股份	1,515	54,691.50	0.03
278	000002	万科A	3,900	54,678.00	0.03
279	300951	博硕科技	1,000	54,630.00	0.03
280	600285	羚锐制药	3,400	54,604.00	0.03
281	600720	祁连山	4,800	54,576.00	0.03
282	600009	上海机场	1,200	54,504.00	0.03
283	002276	万马股份	4,500	54,495.00	0.03
284	300014	亿纬锂能	900	54,450.00	0.03
285	300908	仲景食品	1,200	54,420.00	0.03
286	603507	振江股份	1,500	54,390.00	0.03

287	600422	昆药集团	2,600	53,872.00	0.03
288	300291	百纳千成	7,600	53,504.00	0.03
289	688099	晶晨股份	634	53,458.88	0.03
290	688390	固德威	320	53,395.20	0.03
291	300144	宋城演艺	4,300	53,320.00	0.03
292	600570	恒生电子	1,200	53,148.00	0.03
293	600710	苏美达	6,200	53,072.00	0.03
294	603966	法兰泰克	4,200	53,046.00	0.03
295	603882	金域医学	700	52,850.00	0.03
296	605009	豪悦护理	1,100	52,800.00	0.03
297	300806	斯迪克	2,800	52,416.00	0.03
298	000028	国药一致	1,200	52,332.00	0.03
299	603806	福斯特	1,400	52,066.00	0.03
300	600977	中国电影	3,700	51,985.00	0.03
301	688012	中微公司	331	51,784.95	0.03
302	003000	劲仔食品	4,100	51,619.00	0.03
303	002028	思源电气	1,100	51,392.00	0.03
304	000997	新大陆	2,700	51,030.00	0.03
305	603018	华设集团	5,800	50,750.00	0.03
306	002698	博实股份	2,900	50,721.00	0.03
307	300770	新媒股份	1,100	50,446.00	0.03
308	002335	科华数据	1,400	50,330.00	0.03
309	002965	祥鑫科技	900	50,112.00	0.03
310	600584	长电科技	1,600	49,872.00	0.03
311	603590	康辰药业	1,500	49,800.00	0.03
312	002429	兆驰股份	9,000	49,500.00	0.03
313	301195	北路智控	1,050	48,888.00	0.03
314	605377	华旺科技	2,700	48,735.00	0.03
315	603369	今世缘	900	47,520.00	0.03
316	601012	隆基绿能	1,656	47,477.52	0.03
317	688385	复旦微电	933	46,743.30	0.02
318	600373	中文传媒	3,500	46,620.00	0.02
319	002916	深南电路	600	45,222.00	0.02
320	601137	博威合金	2,900	45,124.00	0.02
321	688698	伟创电气	1,111	44,417.78	0.02
322	300860	锋尚文化	800	44,352.00	0.02
323	300308	中际旭创	300	44,235.00	0.02
324	601728	中国电信	7,800	43,914.00	0.02
325	002738	中矿资源	840	42,789.60	0.02
326	000708	中信特钢	2,700	42,768.00	0.02
327	600183	生益科技	3,000	42,600.00	0.02
328	002461	珠江啤酒	4,500	39,645.00	0.02
329	300856	科思股份	500	39,385.00	0.02
330	301208	中亦科技	700	38,731.00	0.02

331	300347	泰格医药	600	38,724.00	0.02
332	601328	交通银行	6,600	38,280.00	0.02
333	603556	海兴电力	1,500	37,860.00	0.02
334	603508	思维列控	2,200	37,510.00	0.02
335	000034	神州数码	1,400	37,226.00	0.02
336	603667	五洲新春	2,400	35,712.00	0.02
337	002402	和而泰	2,100	35,658.00	0.02
338	001965	招商公路	3,700	35,520.00	0.02
339	300811	铂科新材	580	34,475.20	0.02
340	601818	光大银行	10,900	33,463.00	0.02
341	300638	广和通	1,440	32,659.20	0.02
342	688800	瑞可达	519	32,255.85	0.02
343	300129	泰胜风能	3,300	31,647.00	0.02
344	002595	豪迈科技	900	31,617.00	0.02
345	300853	申昊科技	900	31,590.00	0.02
346	688080	映翰通	632	30,904.80	0.02
347	301179	泽宇智能	900	30,330.00	0.02
348	002332	仙琚制药	2,286	30,289.50	0.02
349	300314	戴维医疗	1,400	29,596.00	0.02
350	002139	拓邦股份	2,200	28,710.00	0.02
351	002803	吉宏股份	1,400	28,644.00	0.02
352	300369	绿盟科技	2,300	28,451.00	0.02
353	603566	普莱柯	1,200	27,900.00	0.01
354	002487	大金重工	900	27,756.00	0.01
355	600125	铁龙物流	4,500	27,180.00	0.01
356	000543	皖能电力	4,100	27,060.00	0.01
357	000792	盐湖股份	1,400	26,838.00	0.01
358	603899	晨光股份	600	26,784.00	0.01
359	600089	特变电工	1,200	26,748.00	0.01
360	603050	科林电气	1,660	26,742.60	0.01
361	002841	视源股份	400	26,736.00	0.01
362	002314	南山控股	8,100	26,730.00	0.01
363	000821	京山轻机	1,300	26,598.00	0.01
364	300674	宇信科技	1,500	26,520.00	0.01
365	002015	协鑫能科	1,900	25,517.00	0.01
366	601975	招商南油	8,900	25,454.00	0.01
367	002142	宁波银行	1,000	25,300.00	0.01
368	300442	润泽科技	800	24,608.00	0.01
369	601939	建设银行	3,900	24,414.00	0.01
370	688400	凌云光	800	24,384.00	0.01
371	300601	康泰生物	960	24,374.40	0.01
372	600452	涪陵电力	1,040	22,131.20	0.01
373	301129	瑞纳智能	300	22,101.00	0.01
374	300443	金雷股份	600	21,270.00	0.01

375	300232	洲明科技	2,300	21,022.00	0.01
376	603203	快克智能	680	20,930.40	0.01
377	600406	国电南瑞	893	20,628.30	0.01
378	601398	工商银行	4,200	20,244.00	0.01
379	605168	三人行	235	20,195.90	0.01
380	603501	韦尔股份	200	19,608.00	0.01
381	600529	山东药玻	702	19,108.44	0.01
382	002056	横店东磁	1,000	18,210.00	0.01
383	688617	惠泰医疗	45	16,818.75	0.01
384	601208	东材科技	1,300	16,510.00	0.01
385	000975	银泰黄金	1,380	16,146.00	0.01
386	603730	岱美股份	1,013	16,005.40	0.01
387	603277	银都股份	700	15,288.00	0.01
388	000950	重药控股	2,200	14,806.00	0.01
389	002807	江阴银行	4,000	14,760.00	0.01
390	600745	闻泰科技	300	14,670.00	0.01
391	600259	广晟有色	400	14,456.00	0.01
392	300138	晨光生物	800	14,320.00	0.01
393	300740	水羊股份	900	13,950.00	0.01
394	000059	华锦股份	2,200	13,838.00	0.01
395	603259	药明康德	221	13,770.51	0.01
396	601128	常熟银行	2,000	13,640.00	0.01
397	688378	奥来德	251	12,399.40	0.01
398	688078	龙软科技	234	12,062.70	0.01
399	600461	洪城环境	1,400	11,438.00	0.01
400	600419	天润乳业	700	11,354.00	0.01
401	002045	国光电器	700	11,242.00	0.01
402	603639	海利尔	600	10,752.00	0.01
403	000963	华东医药	200	8,674.00	0.00
404	688226	威腾电气	391	8,531.62	0.00
405	603258	电魂网络	200	8,502.00	0.00
406	688550	瑞联新材	192	7,603.20	0.00
407	603324	盛剑环境	200	7,540.00	0.00
408	605068	明新旭腾	300	7,338.00	0.00
409	300196	长海股份	500	6,925.00	0.00
410	603816	顾家家居	180	6,867.00	0.00
411	600031	三一重工	400	6,652.00	0.00
412	688355	明志科技	196	5,962.32	0.00
413	688301	奕瑞科技	19	5,366.17	0.00
414	002078	太阳纸业	500	5,345.00	0.00
415	601921	浙版传媒	600	5,214.00	0.00
416	600475	华光环能	400	4,752.00	0.00
417	002434	万里扬	500	4,475.00	0.00
418	601168	西部矿业	400	4,204.00	0.00

419	601288	农业银行	1,100	3,883.00	0.00
420	600586	金晶科技	500	3,860.00	0.00
421	300738	奥飞数据	360	3,672.00	0.00
422	600062	华润双鹤	200	3,484.00	0.00
423	300925	法本信息	200	2,826.00	0.00
424	688181	八亿时空	92	2,593.48	0.00
425	002001	新和成	156	2,402.40	0.00
426	688268	华特气体	9	726.57	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	1,815,732.00	0.75
2	600519	贵州茅台	1,462,277.00	0.61
3	600941	中国移动	974,633.00	0.40
4	002555	三七互娱	896,381.00	0.37
5	000333	美的集团	764,373.00	0.32
6	000063	中兴通讯	736,655.00	0.31
7	002304	洋河股份	722,257.00	0.30
8	600325	华发股份	689,793.00	0.29
9	600919	江苏银行	645,771.00	0.27
10	601377	兴业证券	632,782.00	0.26
11	300750	宁德时代	616,157.00	0.26
12	601888	中国中免	558,446.00	0.23
13	300274	阳光电源	558,360.00	0.23
14	300118	东方日升	540,543.00	0.22
15	601058	赛轮轮胎	532,383.00	0.22
16	601668	中国建筑	526,946.00	0.22
17	000400	许继电气	521,496.00	0.22
18	603882	金域医学	494,720.00	0.20
19	603444	吉比特	474,339.00	0.20
20	601601	中国太保	465,149.00	0.19

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	600153	建发股份	1,493,220.00	0.62
2	601318	中国平安	1,456,821.00	0.60
3	601888	中国中免	925,847.00	0.38
4	300494	盛天网络	683,195.00	0.28
5	002304	洋河股份	676,888.00	0.28
6	000002	万科A	659,776.00	0.27
7	300682	朗新科技	639,577.00	0.26
8	002142	宁波银行	636,345.48	0.26
9	002555	三七互娱	622,300.00	0.26
10	688041	海光信息	603,435.19	0.25
11	000858	五粮液	554,573.67	0.23
12	002484	江海股份	552,201.00	0.23
13	300750	宁德时代	541,407.00	0.22
14	002929	润建股份	533,961.00	0.22
15	600765	中航重机	517,607.00	0.21
16	002352	顺丰控股	515,740.00	0.21
17	601799	星宇股份	508,274.00	0.21
18	601088	中国神华	501,531.00	0.21
19	300979	华利集团	494,900.70	0.20
20	300014	亿纬锂能	490,932.24	0.20

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	81,320,200.08
卖出股票的收入（成交）总额	90,387,069.44

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	30,698,523.29	16.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	31,830,272.52	17.01

	其中：政策性金融债	10,213,898.63	5.46
4	企业债券	35,835,931.78	19.15
5	企业短期融资券	5,048,895.07	2.70
6	中期票据	20,495,953.97	10.95
7	可转债（可交换债）	737,080.39	0.39
8	同业存单	9,848,557.05	5.26
9	其他	-	-
10	合计	134,495,214.07	71.87

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	210012	21 付息国债 12	200,000	20,518,734.25	10.96
2	2121062	21 北京农商二级	100,000	10,299,392.33	5.50
3	101900051	19 华润 MTN001	100,000	10,254,076.71	5.48
4	230203	23 国开 03	100,000	10,213,898.63	5.46
5	185016	21 电科 01	100,000	10,194,315.07	5.45

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主要用于套期保值。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

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

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

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

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

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

报告期内本基金投资的 21 建设银行二级 01（2128025）的发行人，因公司治理和内部控制制度与监管规定不符，监管发现问题屡查屡犯或未充分整改，向检查组提供企业出具的虚假证明材料，未按规定及时报送案件信息，违规发放房地产贷款等共计 38 项违法行为，于 2023 年 2 月 16 日被中国银行保险监督管理委员会没收违法所得并处罚款合计 19891.5626 万元；其中总行 7341.5626 万元，分支机构 12550 万元。

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

报告期内本基金投资的 21 重庆农商绿色金融债 02（2121025）的发行人，因存在审查审批不尽职，超需求发放流动资金贷款形成风险，掩盖不良贷款，拨备覆盖率指标虚假、贷款减值准备不足，未

按规定对质押资产进行审查即向政府融资平台公司发放贷款，同业授信调查及审查审批不尽职，贷款“三查”不尽职导致形成重大信用风险，同业投资业务不合规，贷后管理不到位、信贷资金被挪用，未执行统一授信管理等事实，于 2022 年 11 月 11 日被中国银行保险监督管理委员会重庆监管局罚款共计 1285 万元。因向投资者销售基金前，未按照《证券期货投资者适当性管理办法》向投资者告知信息，支行个别员工在未取得基金从业资格的情况下进行了基金宣传推介活动等问题，于 2023 年 3 月 10 日被中国证券监督管理委员会重庆监管局出具警示函。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为地方中型银行，综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。其余六名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	444,444.05
2	应收清算款	4,099,396.99
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	24,263.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,568,104.51

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	110053	苏银转债	252,689.49	0.14
2	110079	杭银转债	194,375.05	0.10
3	113050	南银转债	112,584.55	0.06

4	127054	双箭转债	105,807.41	0.06
5	113043	财通转债	56,623.59	0.03

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
海富通安颐收益混合 A	49,030	2,251.86	21,431,383.84	19.41%	88,977,093.39	80.59%
海富通安颐收益混合 C	10,437	3,698.83	13,253,840.84	34.33%	25,350,859.96	65.67%
合计	59,467	2,505.81	34,685,224.68	23.28%	114,327,953.35	76.72%

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	海富通安颐收益混合 A	1,384,138.58	1.2537%
	海富通安颐收益混合 C	559,074.06	1.4482%
	合计	1,943,212.64	1.3041%

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	海富通安颐收益混合 A	>100
	海富通安颐收益混合 C	50~100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开	海富通安颐收益混合 A	>100

开放式基金	海富通安颐收益混合 C	50~100
	合计	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
基金合同生效日（2013 年 5 月 29 日）基金份额总额	850,399,612.86	-
本报告期期初基金份额总额	140,634,947.89	55,533,639.99
本报告期基金总申购份额	2,514,720.13	1,256,911.46
减：本报告期基金总赎回份额	32,741,190.79	18,185,850.65
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	110,408,477.23	38,604,700.80

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
西南证券	2	35,846,308.89	20.90%	26,188.33	22.31%	-
海通证券	2	29,122,913.27	16.98%	21,006.75	17.90%	-
银河证券	1	25,923,919.88	15.11%	13,515.09	11.51%	-
上海证券	1	17,548,742.96	10.23%	12,832.99	10.93%	-
国泰君安	2	17,297,020.22	10.08%	12,650.58	10.78%	-
中信证券	4	13,417,126.69	7.82%	9,793.73	8.34%	-
国盛证券	2	7,288,427.70	4.25%	5,272.67	4.49%	-
国金证券	1	6,885,002.57	4.01%	3,658.73	3.12%	-
长江证券	1	6,813,678.20	3.97%	4,233.13	3.61%	-
开源证券	2	6,543,332.07	3.81%	4,719.97	4.02%	-
野村东方国际证券	1	3,744,074.10	2.18%	2,700.66	2.30%	-
华西证券	1	1,093,326.97	0.64%	799.39	0.68%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-

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
西南证券	2,498,835.06	4.43%	210,100,000.00	22.26%	-	-
海通证券	-	-	12,300,000.00	1.30%	-	-
银河证券	10,473,380.28	18.56%	10,000,000.00	1.06%	-	-
上海证券	9,078,456.40	16.09%	195,200,000.00	20.68%	-	-
国泰君安	10,036,358.51	17.79%	351,450,000.00	37.23%	-	-
中信证券	12,123,269.15	21.49%	75,900,000.00	8.04%	-	-
国盛证券	5,134,432.08	9.10%	28,000,000.00	2.97%	-	-
国金证券	7,043,519.64	12.48%	42,200,000.00	4.47%	-	-
长江证券	27,679.66	0.05%	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	4,500,000.00	0.48%	-	-
华西证券	-	-	14,330,000.00	1.52%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-04
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海长量基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-17
3	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-06
4	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-08
5	海富通基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-22
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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-13
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
8	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增京东肯特瑞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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-13
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	上海证券报、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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-17
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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-19

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 109 只公募基金。截至 2023 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1649 亿元人民币。

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

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

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

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获“IAMAC 推介·2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上

交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通安颐收益混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通安颐收益混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通安颐收益混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通安颐收益混合型证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

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