

**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  
2023 年第 3 季度报告  
2023 年 9 月 30 日**

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

## §1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	海富通上证投资级可转债 ETF
场内简称	上证转债
基金主代码	511180
交易代码	511180
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 13 日
报告期末基金份额总额	35,959,729.00 份
投资目标	本基金将紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.25%，年化跟踪误差不超过 3%。
投资策略	本基金为指数基金，将采用分层抽样复制法对业绩比较基准进行跟踪。当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券及备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券及备选成份券外寻找其他债券构建替代组合，对指数进行跟踪复制。对于非成份券的债券，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进

	行日常管理。另外，本基金债券投资将适当运用杠杆策略，通过债券回购融入资金，然后买入收益率更高的债券以获得收益。对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳定收益。
业绩比较基准	上证投资级可转债及可交换债券指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金属于指数基金，采用分层抽样策略，跟踪上证投资级可转债及可交换债券指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	1,194,864.37
2.本期利润	47,251.17
3.加权平均基金份额本期利润	0.0018
4.期末基金资产净值	382,520,408.74
5.期末基金份额净值	10.6375

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

（3）本基金已于2020年07月31日进行了基金份额折算，折算比例为0.1。

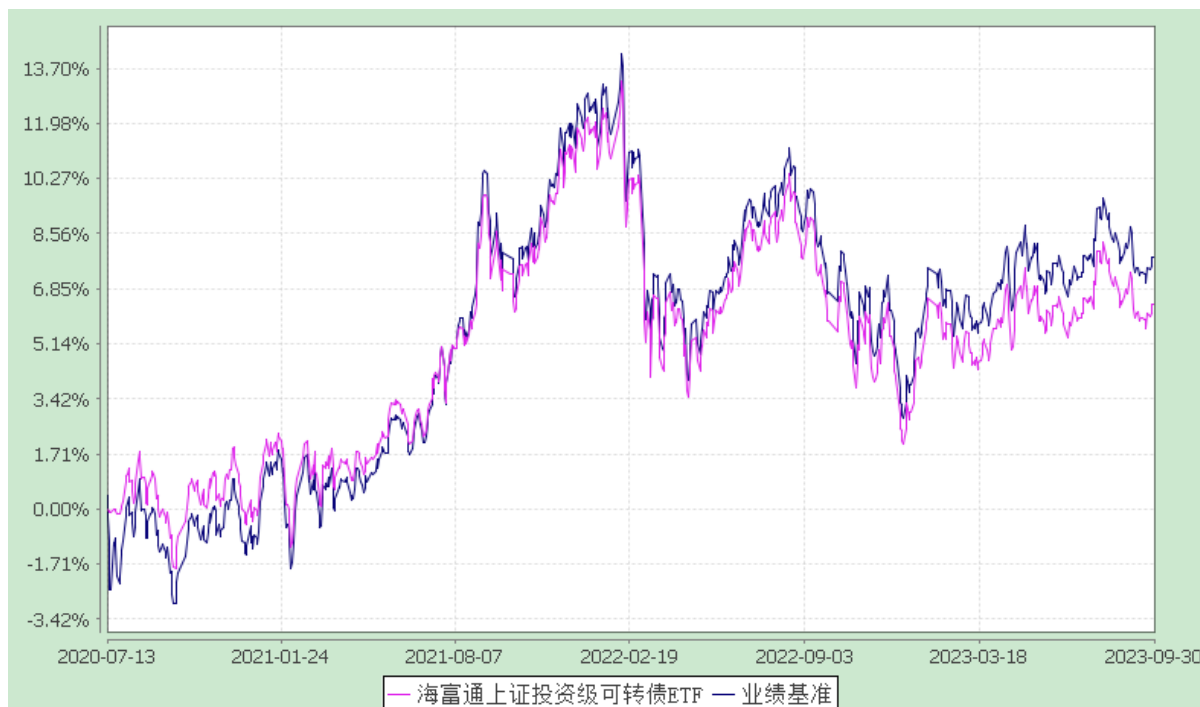
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.42%	0.26%	0.57%	0.26%	-0.15%	0.00%
过去六个月	1.18%	0.30%	1.50%	0.30%	-0.32%	0.00%
过去一年	0.49%	0.35%	1.00%	0.35%	-0.51%	0.00%
过去三年	7.30%	0.39%	10.00%	0.40%	-2.70%	-0.01%
自基金合同生效起至今	6.37%	0.39%	7.83%	0.41%	-1.46%	-0.02%

### 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  
 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  
 (2020年7月13日至2023年9月30日)



注：本基金合同于2020年7月13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十四部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

## §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈轶平	本基金的基金经理；固定收益投资总监兼债券基金部总监。	2020-07-13	-	14 年	博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011 年 10 月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固定收益投资总监兼债券基金部总监。2013 年 8 月至 2020 年 7 月任海富通货币基金经理。2014 年 8 月至 2019 年 9 月兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014 年 11 月起兼任海富通上证可质押城投债 ETF（现为海富通上证城投债 ETF）基金经理。2015 年 12 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 7 月兼任海富通稳进增利债券（LOF）基金经理。2016 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定开债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通富

				<p>祥混合基金经理。2016 年 8 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞丰一年定开债券（现为海富通瑞丰债券）基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 11 月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 10 月兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2017 年 1 月至 2021 年 3 月兼任海富通上证周期产业债 ETF 基金经理。2017 年 2 月至 2023 年 7 月兼任海富通瑞利债券基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 6 月兼任海富通富源债券基金经理。2017 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 9 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 指数增强）基金经理。2017 年 7 月至 2019 年 9 月兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2017 年 7 月至 2018 年 12 月兼任海富通欣悦混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018 年 10 月起兼任海富通上证 10 年期地方政府债 ETF 基金经理。2018 年 11 月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。2019 年 1 月起兼任海富通上清所短融债券基金经理。2019 年 11 月起兼任海富通上证 5</p>
--	--	--	--	---

					年期地方政府债 ETF 基金经理。2020 年 4 月至 2022 年 08 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 7 月起兼任海富通上证投资级可转债 ETF 基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通利率债债券基金经理。2022 年 3 月起兼任海富通恒益一年定开债券发起式基金经理。2022 年 7 月起兼任海富通中证短融 ETF 基金经理。2023 年 8 月起兼任海富通盈丰一年定开债券发起式基金经理。
唐灵儿	本基金的基金经理	2022-07-18	-	5 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2017 年 7 月加入海富通基金管理有限公司，历任固定收益研究部助理固定收益分析师、债券基金部基金经理助理。2022 年 7 月起任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF、海富通上证 10 年期地方政府债 ETF、海富通上证投资级可转债 ETF、海富通上证城投债 ETF、海富通中证短融 ETF 基金经理。
陶斐然	本基金的基金经理	2023-06-02	-	8 年	金融学硕士，持有基金从业人员资格证书。2014 年 12 月加入海富通基金管理有限公司，历任助理交易员、交易员、高级交易员。2020 年 6 月至 2023 年 6 月任债券基金部基金经理助理。2023 年 6 月起任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF、海富通上证投资级可转债 ETF、海

					富通中证短融 ETF、海富通上证 10 年期地方政府债 ETF、海富通上证城投债 ETF 基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

3 季度国内经济企稳回升，债券收益率先下后上。整体来看，地产板块偏弱，工业生产企稳回暖，服务业与消费持续发力。从 PMI 来看，7-9 月 PMI 逐月走高，最终在 9 月升至 50% 以上；7-8 月经济数据也反映当前基本面见底的情况。通胀方面，CPI 总体维持弱势，并在 7 月短暂转负，主要受到非食品类消费品价格拖累；PPI 受到基数影响同比跌幅逐月收窄。在此经济环境下，3 季度货币政策维持宽松，8 月调降 7 天 OMO 利率 10bp，调降 MLF 利率 15bp，9 月降准 25bp，释放中长期流动性约 5000 亿。财政



政策方面主要体现在 8 月与 9 月地方政府专项债的集中发行与一揽子地方政府债务化解方案的推出。此外政策的调整主要集中在房地产板块，在因城施策的大背景下，调降贷款利率与首付比例、调降存量房贷利率、一线城市落实“认房不认贷”、放松限购等政策陆续出台。资金价格与流动性方面，3 季度由于信贷投放与专项债集中发行等因素，流动性存在一定缺口，资金面总体偏紧，资金价格中枢由于降息的影响变化幅度不大。具体来看，7 月信贷需求不佳，流动性合理充裕，8 月与 9 月信贷投放压力增大，同时由于专项债集中发行等因素，流动性出现偏紧的情况。3 季度 DR001 与 DR007 均值为 1.59% 和 1.88%，较 2 季度分别回升 13bp 与回落 6bp。对应债市而言，收益率先下后上。在 7-8 月经济基本面没有起色、政策预期偏弱的环境下债市走强，10 年期国债收益率一度下行至 2.56% 附近的水平。但随着 PMI 连续两个月回暖、信贷需求回升、政治局会议后政策在房地产领域集中落地，债市出现了明显调整，10 年期国债收益率在 9 月末再次回到 2.70% 附近的水平。

信用债方面，收益率走势一波三折。7 月跨季以来，理财规模回升、中小银行委外增加等带来配债增量，但政策博弈仍有扰动，债市表现纠结，24 日，政治局会议召开，政策转向需求端+地产政策更积极+活跃资本市场带来的风险偏好提升等对债市偏不利，债市情绪快速反转，信用债收益率跟随利率债快速上行；8 月，受政策落地不及预期、资金面宽松、机构欠配压力以及央行 15 日超预期降息等因素影响，信用债收益率跟随利率债大幅下行；进入 9 月后，受资金面偏紧、支持地产政策密集出台、机构赎回等因素影响，信用债市场出现明显调整，机构止盈、谨慎心态增加。

可转债方面，7 月市场受益于政治局会议超预期的政策定调，非银金融、房地产大涨，顺周期板块也有所表现；8 月市场普跌，原因包括政策实施不及预期、北向资金持续流出、宏观经济数据不及预期等；9 月由于赎回预期超前，转债估值大幅压缩，但压缩时间较短且幅度小于前几次。行业上分化明显，商品市场价格波动带动能源股上涨，交易行为上市场向红利指数靠近。整体来看，三季度转债走出独立行情，表现优于权益，百元平价溢价率基本持平。区间内中证转债指数下跌 0.52%。

作为指数基金，本基金应用指数复制策略构建组合，以跟踪指数并控制跟踪偏离度及跟踪误差。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 0.42%，同期业绩比较基准收益率为 0.57%，基金净值跑输业绩比较基准 0.15 个百分点。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	379,992,504.03	99.27
	其中：债券	379,992,504.03	99.27
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	999,058.63	0.26
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,718,482.65	0.45
7	其他资产	79,099.95	0.02
8	合计	382,789,145.26	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	379,992,504.03	99.34
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	379,992,504.03	99.34

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	300,390	32,686,834.98	8.55
2	113052	兴业转债	300,460	31,005,866.80	8.11
3	113021	中信转债	239,160	27,859,715.64	7.28
4	113044	大秦转债	180,230	21,219,786.42	5.55
5	132018	G 三峡 EB1	119,760	17,646,603.19	4.61

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金暂不投资股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	77,805.57
2	应收证券清算款	1,294.38
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	79,099.95

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	32,686,834.98	8.55
2	113052	兴业转债	31,005,866.80	8.11

3	113021	中信转债	27,859,715.64	7.28
4	113044	大秦转债	21,219,786.42	5.55
5	132018	G 三峡 EB1	17,646,603.19	4.61
6	113042	上银转债	13,108,316.55	3.43
7	113050	南银转债	11,354,654.76	2.97
8	110079	杭银转债	10,493,250.06	2.74
9	110085	通 22 转债	8,533,185.00	2.23
10	113056	重银转债	8,110,707.41	2.12
11	132026	G 三峡 EB2	6,651,424.42	1.74
12	118031	天 23 转债	5,611,398.51	1.47
13	110081	闻泰转债	5,565,596.19	1.45
14	110073	国投转债	5,386,302.76	1.41
15	113060	浙 22 转债	5,258,340.16	1.37
16	113065	齐鲁转债	4,943,887.56	1.29
17	113641	华友转债	4,837,074.00	1.26
18	113057	中银转债	4,584,366.48	1.20
19	110075	南航转债	4,474,702.22	1.17
20	113053	隆 22 转债	4,457,903.31	1.17
21	113062	常银转债	4,241,819.13	1.11
22	110083	苏租转债	4,210,225.16	1.10
23	113055	成银转债	3,891,955.33	1.02
24	110061	川投转债	3,755,049.31	0.98
25	113037	紫银转债	2,860,207.65	0.75
26	113059	福莱转债	2,710,262.15	0.71
27	113043	财通转债	2,577,364.19	0.67
28	132020	19 蓝星 EB	2,559,978.77	0.67
29	113045	环旭转债	2,423,478.99	0.63
30	113049	长汽转债	2,373,750.82	0.62
31	111010	立昂转债	2,371,610.89	0.62
32	110062	烽火转债	2,294,048.77	0.60
33	110045	海澜转债	2,267,252.19	0.59

34	110088	淮 22 转债	2,229,468.78	0.58
35	118024	冠宇转债	2,223,322.74	0.58
36	113066	平煤转债	2,209,660.51	0.58
37	113051	节能转债	2,190,783.31	0.57
38	110093	神马转债	2,118,413.92	0.55
39	113024	核建转债	2,065,890.09	0.54
40	113661	福 22 转债	2,056,846.94	0.54
41	118022	锂科转债	2,038,447.60	0.53
42	110091	合力转债	2,016,784.00	0.53
43	110087	天业转债	1,993,184.79	0.52
44	113061	拓普转债	1,990,041.29	0.52
45	110067	华安转债	1,950,193.75	0.51
46	110043	无锡转债	1,903,530.70	0.50
47	110089	兴发转债	1,877,161.10	0.49
48	113063	赛轮转债	1,816,821.04	0.47
49	110068	龙净转债	1,784,547.38	0.47
50	113623	凤 21 转债	1,770,266.34	0.46
51	110092	三房转债	1,728,454.12	0.45
52	110077	洪城转债	1,653,620.61	0.43
53	113616	韦尔转债	1,653,560.76	0.43
54	113048	晶科转债	1,550,540.70	0.41
55	113054	绿动转债	1,536,012.47	0.40
56	113632	鹤 21 转债	1,520,110.79	0.40
57	113058	友发转债	1,502,420.96	0.39
58	113615	金诚转债	1,489,099.75	0.39
59	113655	欧 22 转债	1,441,411.53	0.38
60	113666	爱玛转债	1,399,535.17	0.37
61	110082	宏发转债	1,368,455.59	0.36
62	110086	精工转债	1,356,525.87	0.35
63	118030	睿创转债	1,349,399.60	0.35
64	110090	爱迪转债	1,348,293.63	0.35

65	110048	福能转债	1,306,595.24	0.34
66	113602	景 20 转债	1,304,994.20	0.34
67	110076	华海转债	1,226,581.78	0.32
68	113033	利群转债	1,160,043.31	0.30
69	113064	东材转债	1,114,548.78	0.29
70	113047	旗滨转债	1,075,783.09	0.28
71	113647	禾丰转债	1,057,497.73	0.28
72	118025	奕瑞转债	1,017,596.71	0.27
73	113046	金田转债	977,071.55	0.26
74	113626	伯特转债	971,240.54	0.25
75	113025	明泰转债	961,209.27	0.25
76	113605	大参转债	952,955.26	0.25
77	118013	道通转债	951,678.25	0.25
78	113652	伟 22 转债	941,087.56	0.25
79	110064	建工转债	869,835.51	0.23
80	113516	苏农转债	860,214.06	0.22
81	113659	莱克转债	845,323.38	0.22
82	110080	东湖转债	834,942.35	0.22
83	118019	金盘转债	776,431.20	0.20
84	113619	世运转债	747,766.98	0.20
85	113017	吉视转债	724,318.13	0.19
86	113545	金能转债	710,929.79	0.19
87	110084	贵燃转债	707,610.61	0.18
88	113631	皖天转债	702,233.83	0.18
89	113633	科沃转债	680,486.30	0.18
90	118003	华兴转债	639,465.44	0.17
91	113634	珀莱转债	619,208.79	0.16
92	113563	柳药转债	602,357.62	0.16
93	113549	白电转债	596,380.58	0.16
94	110060	天路转债	588,557.52	0.15
95	113519	长久转债	576,537.09	0.15

96	113627	太平转债	563,489.75	0.15
97	113505	杭电转债	519,575.48	0.14
98	111002	特纸转债	503,895.26	0.13
99	113530	大丰转债	483,731.15	0.13
100	111009	盛泰转债	463,729.77	0.12
101	113588	润达转债	460,962.53	0.12
102	113621	彤程转债	447,739.24	0.12
103	113651	松霖转债	437,452.50	0.11
104	110074	精达转债	419,517.47	0.11
105	113638	台 21 转债	414,700.26	0.11
106	113584	家悦转债	411,206.58	0.11
107	113542	好客转债	408,330.07	0.11
108	113582	火炬转债	384,485.68	0.10
109	113504	艾华转债	351,161.60	0.09
110	113579	健友转债	339,864.05	0.09
111	113532	海环转债	316,675.59	0.08
112	110055	伊力转债	274,284.80	0.07
113	110052	贵广转债	255,988.17	0.07
114	113039	嘉泽转债	238,777.84	0.06
115	113030	东风转债	207,886.14	0.05
116	110070	凌钢转债	157,312.47	0.04

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	19,459,729.00
本报告期基金总申购份额	37,900,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	21,400,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-



本报告期末基金份额总额	35,959,729.00
-------------	---------------

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	2023/7/1-2023/8/13	5,000,000.00	-	-	5,000,000.00	13.90%

#### 产品特有风险

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：

- 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；
- 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 110 只公募基金。截至 2023 年 9 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1505 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”。2023 年 8 月，海富通荣获《上海证券报》颁发的“上证·中国基金投教创新案例奖”。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通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的文件

(二)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基金合同

(三)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招募说明书

(四)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

### 9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

### 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司  
二〇二三年十月二十五日