

海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金
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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信银行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	海富通富利三个月持有
基金主代码	010850
交易代码	010850
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 7 月 20 日
报告期末基金份额总额	56,835,509.47 份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。
投资策略	<p>本基金通过对宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究，同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素，兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动，结合投资时钟理论，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例。并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，或借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应，以规避或分散市场风险。</p> <p>股票投资方面，本基金将采用量化选股策略、风险估测模型——有效控制预期风险、交易成本模型——控制交</p>

	易成本以保护投资业绩、投资组合的优化及调整、港股通标的股票的投资策略等策略； 债券投资方面，本基金将采用利率策略、信用策略、收益率曲线策略、杠杆策略等策略。	
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
下属两级基金的交易代码	010850	010851
报告期末下属两级基金的份额总额	30,460,724.55 份	26,374,784.92 份

§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)	
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
1.本期已实现收益	-490,617.36	-428,512.32
2.本期利润	-487,871.85	-416,613.73
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157	-0.0159
4.期末基金资产净值	28,889,632.64	24,794,003.08
5.期末基金份额净值	0.9484	0.9401

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。

3.2 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

1、海富通富利三个月持有 A：

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	-1.63%	0.28%	-0.86%	0.18%	-0.77%	0.10%
过去六个月	-2.49%	0.26%	-0.98%	0.18%	-1.51%	0.08%
过去一年	-2.99%	0.24%	0.57%	0.21%	-3.56%	0.03%
自基金合同生效起至今	-5.16%	0.28%	-3.73%	0.23%	-1.43%	0.05%

2、海富通富利三个月持有 C：

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	-1.72%	0.28%	-0.86%	0.18%	-0.86%	0.10%
过去六个月	-2.68%	0.26%	-0.98%	0.18%	-1.70%	0.08%
过去一年	-3.37%	0.24%	0.57%	0.21%	-3.94%	0.03%
自基金合同生效起至今	-5.99%	0.28%	-3.73%	0.23%	-2.26%	0.05%

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

海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1. 海富通富利三个月持有 A

(2021 年 7 月 20 日至 2023 年 9 月 30 日)



2. 海富通富利三个月持有 C

(2021 年 7 月 20 日至 2023 年 9 月 30 日)



注：本基金合同于 2021 年 7 月 20 日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生

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

§4 管理人报告

4.1 基金经理（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		
张靖爽	本基金的基金经理； 债券基金部副总监。	2021-07-20	-	13 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中银基金管理有限公司研究员，交银施罗德基金管理有限公司投资经理、基金经理助理、研究员。2016 年 7 月至 2017 年 10 月任海富通双利债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 11 月兼任海富通纯债债券基金经理。2017 年 8 月起兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）和海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2018 年 2 月至 2021 年 2 月任海富通融丰定开债券基金经理。2018 年 11 月至 2020 年 10 月任海富通鼎丰定开债券基金经理。2019 年 5 月至 2022 年 12 月兼任海富通新内需混合基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 4 月任海富通聚合纯债基金经理。2019 年 12 月起兼任海富通裕通 30 个月定开债券基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通裕昇三年定开债券基金经理。2020 年 5 月至 2021 年 7 月兼任海富通瑞

					弘 6 个月定开债券基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。2022 年 8 月起兼任海富通添鑫收益债券基金经理。
杜晓海	本基金的基金经理；总经理助理兼量化投资部总监。	2021-07-20	-	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。
--	--	--	--	--

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

固定收益方面，三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。投资方面，制造业投资维持韧性，高技术行业维持高增；基建投资由于基数问题增速略有回落；地产投资跌幅略有走扩，但是在保交楼政策的支持下竣工端持续发力。消费方面，暑期带动出行链相关板块走强，但地产销售遇冷拖累地产后周期板块。出口方面仍有下行压力，但由于美国经济韧性较强，下行压力较前期有所缓和。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，三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。三季度 DR001 与 DR007 均值为 1.59% 和 1.88%，较二季度分别回升 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、政策预期偏弱的情况下债市走强，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。城投方面，政治局会议明确提出“制定实施一揽子化债方案”，随着化债政策不断落地，一定程度提升市场机构信心，同时，“遏增化存”仍为基调，供给端收缩加剧城投债资产荒行情。

组合在三季度期间保持一定仓位，并交易流动性较好的资产以捕捉资本利得的机会。

权益方面，本报告期，考虑到策略分散性，本基金基本维持以核心资产标的为主，红利叠加事件驱动为辅的复合策略结构。

因子方面，本基金相对基准更偏小市值和价值，由于报告期内以上两个风格表现相对强势，获得一定超额收益。

回顾本报告期的投资操作，策略在满仓情况下相对基准有一定超额收益，净值损失主要来源于相对高仓位运作叠加市场整体表现不佳带来的净值下跌。接下来我们将通过策略分散性、组合构建和股指期货对冲优化资产配置，平衡向上弹性和回撤风险。

展望后市，随着三季报陆续披露，基本面因子可能重新受到重视。后市操作上，本基金将在控制回撤的基础上，充分挖掘相对收益机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通富利三个月持有 A 净值增长率为-1.63%，同期业绩比较基准收益率为-0.86%，基金净值跑输业绩比较基准 0.77 个百分点。海富通富利三个月持有 C 净值增长率为-1.72%，同期业绩比较基准收益率为-0.86%，基金净值跑输业绩比较基准 0.86 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	20,892,519.97	38.56
	其中：股票	20,892,519.97	38.56
2	固定收益投资	30,179,759.79	55.70
	其中：债券	30,179,759.79	55.70
	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	791,726.88	1.46
	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	1,222,506.63	2.26
7	其他资产	1,096,200.66	2.02
8	合计	54,182,713.93	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

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	56,220.00	0.10
B	采矿业	1,465,579.00	2.73
C	制造业	10,537,232.69	19.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	558,612.00	1.04
E	建筑业	1,080,911.00	2.01
F	批发和零售业	1,173,206.00	2.19
G	交通运输、仓储和邮政业	367,759.00	0.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,155,835.10	2.15
J	金融业	1,819,347.00	3.39
K	房地产业	957,922.00	1.78
L	租赁和商务服务业	379,365.00	0.71
M	科学研究和技术服务业	354,400.18	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	153,328.00	0.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	26,182.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	806,621.00	1.50
S	综合	-	-
	合计	20,892,519.97	38.92

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600325	华发股份	39,300	376,494.00	0.70
2	000651	格力电器	9,400	341,220.00	0.64
3	600048	保利发展	26,700	340,158.00	0.63
4	600104	上汽集团	20,400	301,920.00	0.56
5	000906	浙商中拓	36,900	298,890.00	0.56
6	601668	中国建筑	52,100	288,113.00	0.54
7	600395	盘江股份	46,500	286,905.00	0.53
8	002128	电投能源	18,700	257,312.00	0.48
9	601928	凤凰传媒	24,100	252,568.00	0.47
10	600740	山西焦化	47,400	248,850.00	0.46

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	2,816,668.82	5.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,679,907.10	38.52
	其中：政策性金融债	20,679,907.10	38.52
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）	6,683,183.87	12.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,179,759.79	56.22

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	200205	20 国开 05	200,000	20,679,907.10	38.52

2	019678	22 国债 13	28,000	2,816,668.82	5.25
3	110059	浦发转债	20,450	2,225,281.60	4.15
4	113042	上银转债	19,560	2,133,382.41	3.97
5	113044	大秦转债	1,220	143,640.13	0.27

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

代码	名称	持仓量	合约市值 (元)	公允价值变 动(元)	风险说明
IH2310	IH2310	-1.00	-753,780.00	8,340.00	-
IC2311	IC2311	-1.00	-1,139,560.00	1,680.00	-
IF2311	IF2311	-1.00	-1,112,820.00	2,520.00	-
公允价值变动总额合计(元)					12,540.00
股指期货投资本期收益(元)					-130,084.79
股指期货投资本期公允价值变动(元)					23,610.00

注：股指期货投资本期收益中已扣除本期股指期货差价收入应缴纳增值税额。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

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

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

报告期内，本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险，符合既定投资策略及投资目标。

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	376,118.02
2	应收证券清算款	169,856.66
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	550,225.98
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,096,200.66

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	2,225,281.60	4.15
2	113042	上银转债	2,133,382.41	3.97
3	113044	大秦转债	143,640.13	0.27
4	113056	重银转债	91,351.33	0.17

5	118031	天 23 转债	81,097.35	0.15
6	110081	闻泰转债	80,769.55	0.15
7	127018	本钢转债	75,818.24	0.14
8	127012	招路转债	74,022.22	0.14
9	113052	兴业转债	73,267.55	0.14
10	128129	青农转债	71,426.12	0.13
11	113615	金诚转债	68,127.80	0.13
12	110045	海澜转债	67,736.98	0.13
13	110043	无锡转债	67,246.83	0.13
14	113623	风 21 转债	67,137.88	0.13
15	113616	韦尔转债	65,559.88	0.12
16	113053	隆 22 转债	64,694.06	0.12
17	113033	利群转债	64,380.99	0.12
18	123035	利德转债	63,917.67	0.12
19	128108	蓝帆转债	63,149.63	0.12
20	113631	皖天转债	62,923.34	0.12
21	110064	建工转债	62,864.62	0.12
22	113017	吉视转债	62,750.49	0.12
23	113505	杭电转债	62,211.33	0.12
24	127019	国城转债	62,028.73	0.12
25	123048	应急转债	61,651.03	0.11
26	113532	海环转债	60,811.15	0.11
27	113054	绿动转债	55,284.57	0.10
28	128142	新乳转债	53,887.07	0.10
29	110062	烽火转债	51,885.19	0.10
30	110061	川投转债	48,488.01	0.09
31	128081	海亮转债	47,232.84	0.09
32	113530	大丰转债	43,282.05	0.08
33	127017	万青转债	41,800.57	0.08
34	113516	苏农转债	35,562.56	0.07
35	123104	卫宁转债	35,252.01	0.07

36	127029	中钢转债	27,611.60	0.05
37	113045	环旭转债	15,197.97	0.03
38	113049	长汽转债	1,130.39	0.00
39	127024	盈峰转债	1,076.00	0.00
40	113641	华友转债	1,059.62	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通富利三个月持有A	海富通富利三个月持有C
本报告期期初基金份额总额	31,668,379.50	26,660,039.41
本报告期基金总申购份额	45,509.71	586,657.17
减：本报告期基金总赎回份额	1,253,164.66	871,911.66
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	30,460,724.55	26,374,784.92

§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

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。

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富利三个月持有期混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

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