

**海富通富盈混合型证券投资基金**  
**2023 年第 4 季度报告**  
**2023 年 12 月 31 日**

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年一月二十二日

## §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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 月 19 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	海富通富盈混合
基金主代码	009154
交易代码	009154
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 20 日
报告期末基金份额总额	118,714,818.35 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	本基金以在风险可控下寻求稳定的超额收益作为投资理念，采用稳健的大类资产配置和股票投资策略。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。股票投资方面，本基

	金将采用量化选股方法构建股票组合，以价值投资作为核心理念，通过量化模型构建多因子 alpha 模型。 债券投资主要采取利率策略、信用策略、收益率曲线策略以及杠杆策略，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。另外，本基金投资策略还包括资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略、流通受限证券投资策略、股票期权投资策略。	
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	兴业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
下属两级基金的交易代码	009154	009155
报告期末下属两级基金的份额总额	55,477,233.38 份	63,237,584.97 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 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日)	
	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
1.本期已实现收益	-1,076,274.03	-1,266,251.78
2.本期利润	-1,307,413.91	-1,523,521.56
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0227	-0.0236
4.期末基金资产净值	58,050,685.22	65,217,166.61

5.期末基金份额净值	1.0464	1.0313
------------	--------	--------

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、海富通富盈混合 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	-2.08%	0.33%	-0.66%	0.17%	-1.42%	0.16%
过去六个月	-2.53%	0.32%	-1.52%	0.18%	-1.01%	0.14%
过去一年	-0.78%	0.25%	-0.64%	0.18%	-0.14%	0.07%
过去三年	-0.84%	0.30%	-3.53%	0.23%	2.69%	0.07%
自基金合同生效起至今	4.64%	0.28%	-0.85%	0.22%	5.49%	0.06%

##### 2、海富通富盈混合 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	-2.18%	0.33%	-0.66%	0.17%	-1.52%	0.16%
过去六个月	-2.73%	0.32%	-1.52%	0.18%	-1.21%	0.14%
过去一年	-1.18%	0.25%	-0.64%	0.18%	-0.54%	0.07%
过去三年	-2.03%	0.30%	-3.53%	0.23%	1.50%	0.07%
自基金合	3.13%	0.28%	-0.85%	0.22%	3.98%	0.06%

同生效起 至今						
------------	--	--	--	--	--	--

### 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

海富通富盈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. 海富通富盈混合 A

(2020 年 5 月 20 日至 2023 年 12 月 31 日)



#### 2. 海富通富盈混合 C

(2020 年 5 月 20 日至 2023 年 12 月 31 日)



注：本基金合同于 2020 年 5 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		
陶敏	本基金的基金经理	2023-01-19	-	18 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2004 年 7 月至 2008 年 8 月任华泰柏瑞基金管理有限公司基金清算与注册登记经理，2010 年 7 月至 2015 年 7 月任光大保德信基金管理有限公司行业研究员和策略研究员。2015 年 7 月加入海富通基金管理有限公司，历任权益投资部行业研究员、周期组

					组长、基金经理助理。2018 年 4 月起任海富通强化回报混合的基金经理。2022 年 5 月至 2023 年 5 月兼任海富通惠鑫混合基金经理。2023 年 1 月起兼任海富通富盈混合基金经理。
杜晓海	本基金的基金经理；总经理助理兼量化投资部总监。	2020-05-20	2023-10-10	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

				<p>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 月至 2023 年 10 月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。2023 年 10 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。</p>	
夏妍妍	本基金的基金经理	2020-05-20	2023-10-13	9 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 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</p>



				月至 2023 年 10 月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。
--	--	--	--	---

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

4 季度国内经济修复动能平稳。10-12 月 PMI 指数小幅回落，符合季节性特征。投资方面，制造业投资好于基建投资，地产投资中的竣工端增速较好。消费方面，十一假期强劲回升，修复到疫情前九成以上。进出口方面增速回正。价格方面，PPI 和 CPI 均维持同比下降的状态，通胀状况良好。货币政策着力于化债，有效降低了偿债成本。财

政政策着眼于明年和化债工作，既上调了赤字率上限，又增发 1 万亿国债和 1.4 万亿左右特殊再融资债。12 月月底的中央经济工作会议进一步明确了明年经济工作的方向和发力结构，比如在房地产领域确立“三大工程”。具体政策包括房企信贷融资的“三个不低于”、一线城市放宽普通住宅认定标准、下调首付比例与房贷利率等鼓励性政策。

A 股市场总体表现稳定，结构上仍然维持了红利和主题两条并行投资线。而 H 股市场相对平淡。

利率债方面，受到四季度呈现流动性前紧后松的特征，主要受到利率债发行节奏前置而财政存款投放后置的影响，导致国庆前后跨月时点出现局部的资金紧张。央行 11-12 月 MLF 净投放 6000 亿与 8000 亿以及财政存款投放之后，12 月底的跨年非常平稳。国债收益率曲线先平坦化，12 月前后长端和短端收益率先后大降，呈现牛陡的赚钱效应，最终十年期国债收益率回落到 2.56% 左右。

信用债方面，特殊再融资债 12 月末发行约 1.4 万亿，且规模、范围和用途均超预期。化债带来城投债赚钱行情，并且扩散到二永债。信用溢价收敛明显。

可转债方面，中证转债指数小幅回落 3.22%，表现强于正股。其中，低绝对价格和低纯债溢价率的可转债表现更好。

本基金四季度基于对于经济修复的乐观预期，总体上增加权益头寸，降低了债券头寸。具体操作如下：一是三季度减仓利率债之后未及时回调，导致错过了 12 月份的利率债行情；二是减仓信用债，用债性可转债代替，导致错过了四季度化债进展带来的城投债行情，而加仓的可转债部分跟随正股回落而下跌；三是权益投资部分维持地产和金融的超配，并且维持了较高的 H 股消费行业龙头公司的配置，导致较大的负贡献。

展望 2024 年上半年，基于经济持续修复是确定性事件的假设，结合债券市场和股票市场的风险定价水平，组合在债券方面拟采取守势，不拉久期、不加杠杆、不下沉信用，通过加大“双低”转债(低绝对价格、低纯债溢价率)投资仓位的方式追求回报。而权益投资部分，则通过完善之前的“三高”策略(高市现率、高股息率和高预收账款增速)来挖掘具有良好风险收益比投资回报的品种。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通富盈混合 A 净值增长率为-2.08%，同期业绩比较基准收益率为-0.66%，基金净值跑输业绩比较基准 1.42 个百分点。海富通富盈混合 C 净值增长率为-2.18%，同期业绩比较基准收益率为-0.66%，基金净值跑输业绩比较基准 1.52 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	41,217,835.60	32.45
	其中：股票	41,217,835.60	32.45
2	固定收益投资	46,763,526.63	36.81
	其中：债券	46,763,526.63	36.81
	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	33,033,121.70	26.00
	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	5,993,939.64	4.72
7	其他资产	29,903.62	0.02
8	合计	127,038,327.19	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为14,112,832.32元，占资产净值比例为11.45%。

## 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	426,096.00	0.35
B	采矿业	652,301.88	0.53
C	制造业	8,771,719.00	7.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,896,383.60	1.54
E	建筑业	3,228,092.00	2.62
F	批发和零售业	542,322.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	1,003,284.00	0.81
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	394,536.00	0.32
J	金融业	7,532,477.80	6.11
K	房地产业	2,089,166.00	1.69
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	313,673.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	254,952.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	27,105,003.28	21.99

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	1,353,240.20	1.10
日常消费品	2,633,828.75	2.14
金融	412,801.33	0.33
医疗保健	1,377,030.30	1.12
工业	2,862,785.23	2.32
信息技术	1,163,368.99	0.94
公用事业	914,412.23	0.74
房地产	3,395,365.29	2.75
合计	14,112,832.32	11.45

注：以上分类采用国际通用的具有权威性的行业分类标准。

### 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	01109	华润置地	40,000	1,014,966.40	0.82
2	600750	江中药业	48,400	1,010,592.00	0.82
3	600548	深高速	111,600	1,003,284.00	0.81
4	601369	陕鼓动力	121,700	971,166.00	0.79
5	01818	招金矿业	108,000	950,334.79	0.77

6	06186	中国飞鹤	242,000	936,433.37	0.76
7	601998	中信银行	171,000	904,590.00	0.73
8	600820	隧道股份	156,900	903,744.00	0.73
9	03969	中国通号	378,000	890,633.02	0.72
10	03900	绿城中国	123,000	886,147.23	0.72

#### 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	9,174,861.37	7.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	5,112,490.69	4.15
5	企业短期融资券	5,061,953.55	4.11
6	中期票据	20,368,980.87	16.52
7	可转债（可交换债）	7,045,240.15	5.72
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	46,763,526.63	37.94

#### 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	019694	23 国债 01	90,000	9,174,861.37	7.44
2	102380808	23 广州资管 MTN001	50,000	5,144,353.01	4.17
3	185459	22 钱江 01	50,000	5,112,490.69	4.15
4	102280788	22 中电投 MTN006	50,000	5,102,442.62	4.14
5	102101704	21 中粮 MTN002	50,000	5,072,388.52	4.11

#### 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

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

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

#### 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，本基金不参与国债期货交易。

### 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	17,814.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	9,344.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,745.53
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	29,903.62

## 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	113043	财通转债	484,930.25	0.39
2	110076	华海转债	364,422.57	0.30
3	127056	中特转债	308,872.32	0.25
4	110073	国投转债	305,511.42	0.25
5	128136	立讯转债	279,156.09	0.23
6	127022	恒逸转债	270,262.70	0.22
7	123113	仙乐转债	268,096.15	0.22
8	113050	南银转债	234,297.24	0.19
9	110081	闻泰转债	230,999.85	0.19
10	128035	大族转债	176,811.50	0.14
11	113584	家悦转债	167,959.25	0.14
12	128116	瑞达转债	160,097.26	0.13
13	118000	嘉元转债	159,882.72	0.13
14	128108	蓝帆转债	155,506.20	0.13
15	113024	核建转债	145,434.75	0.12
16	113046	金田转债	140,434.44	0.11
17	113605	大参转债	139,057.92	0.11
18	123117	健帆转债	131,040.96	0.11
19	113633	科沃转债	127,009.97	0.10
20	110082	宏发转债	124,633.26	0.10

21	110089	兴发转债	124,208.00	0.10
22	113658	密卫转债	121,110.48	0.10
23	113053	隆 22 转债	119,336.73	0.10
24	113021	中信转债	115,622.81	0.09
25	123179	立高转债	109,137.21	0.09
26	132020	19 蓝星 EB	108,694.38	0.09
27	113056	重银转债	108,436.93	0.09
28	113652	伟 22 转债	108,037.55	0.09
29	113641	华友转债	97,696.70	0.08
30	110092	三房转债	83,365.37	0.07
31	113042	上银转债	82,583.32	0.07
32	127017	万青转债	79,925.03	0.06
33	127024	盈峰转债	74,725.48	0.06
34	123145	药石转债	72,326.87	0.06
35	127083	山路转债	69,870.32	0.06
36	113060	浙 22 转债	61,302.05	0.05
37	110067	华安转债	60,270.15	0.05
38	127075	百川转 2	58,968.61	0.05
39	113655	欧 22 转债	57,905.81	0.05
40	113033	利群转债	56,881.78	0.05
41	113627	太平转债	55,721.30	0.05
42	118031	天 23 转债	54,940.53	0.04
43	113616	韦尔转债	54,217.51	0.04
44	127068	顺博转债	50,644.80	0.04
45	123190	道氏转 02	50,615.47	0.04
46	123154	火星转债	48,376.48	0.04
47	113044	大秦转债	39,552.54	0.03
48	123128	首华转债	38,037.37	0.03
49	127031	洋丰转债	37,905.95	0.03
50	110059	浦发转债	37,683.06	0.03
51	111009	盛泰转债	36,264.49	0.03



52	113659	莱克转债	35,546.47	0.03
53	128129	青农转债	31,765.48	0.03
54	113532	海环转债	30,974.06	0.03
55	123178	花园转债	26,118.32	0.02
56	127046	百润转债	25,271.49	0.02
57	128119	龙大转债	24,953.61	0.02
58	111010	立昂转债	24,514.00	0.02
59	123064	万孚转债	24,402.64	0.02
60	113666	爱玛转债	24,385.78	0.02
61	110047	山鹰转债	24,149.31	0.02
62	127067	恒逸转 2	23,703.30	0.02
63	127061	美锦转债	23,624.27	0.02
64	113059	福莱转债	23,381.09	0.02
65	123108	乐普转 2	23,101.50	0.02
66	113049	长汽转债	22,619.01	0.02
67	113579	健友转债	7,947.92	0.01

#### 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	海富通富盈混合A	海富通富盈混合C
本报告期期初基金份额总额	59,111,485.56	66,815,512.70
本报告期基金总申购份额	65,212.23	97,795.38
减：本报告期基金总赎回份额	3,699,464.41	3,675,723.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	55,477,233.38	63,237,584.97

## §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 113 只公募基金。截至 2023 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1510 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。

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盈混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通富盈混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通富盈混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通富盈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  
二〇二四年一月二十二日