

海富通欣睿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：恒丰银行股份有限公司

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。

基金托管人恒丰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 | 海富通欣睿混合 |
| 基金主代码 | 010657 |
| 交易代码 | 010657 |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 2 月 9 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 442,791,263.74 份 |
| 投资目标 | 本基金通过积极主动的资产配置与严谨的风险管理，在严格控制风险的前提下，积极把握证券市场的投资机会，追求资产的保值增值。 |
| 投资策略 | 本基金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，确定基金资产在股票、债券、货币市场工具之间的配置比例。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。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×20%+恒生指数收益率（经汇率调 |

| | | |
|-----------------|---|------------------|
| | 整) ×5%+中证全债指数收益率×75% | |
| 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 | 恒丰银行股份有限公司 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 海富通欣睿混合 A | 海富通欣睿混合 C |
| 下属两级基金的交易代码 | 010657 | 010658 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 192,950,913.90 份 | 249,840,349.84 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) | |
|-----------------|---|----------------|
| | 海富通欣睿混合 A | 海富通欣睿混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -929,129.73 | -1,149,344.16 |
| 2. 本期利润 | -3,437,732.78 | -3,218,363.70 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0126 | -0.0117 |
| 4. 期末基金资产净值 | 215,125,963.89 | 276,957,158.21 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.1149 | 1.1085 |

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、海富通欣睿混合 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 | -0.84% | 0.21% | -0.60% | 0.21% | -0.24% | 0.00% |
| 过去六个月 | -1.45% | 0.20% | -1.12% | 0.21% | -0.33% | -0.01% |
| 过去一年 | 2.49% | 0.20% | 0.97% | 0.21% | 1.52% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.49% | 0.25% | -0.60% | 0.28% | 12.09% | -0.03% |

2、海富通欣睿混合 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 | -0.89% | 0.21% | -0.60% | 0.21% | -0.29% | 0.00% |
| 过去六个月 | -1.55% | 0.20% | -1.12% | 0.21% | -0.43% | -0.01% |
| 过去一年 | 2.29% | 0.20% | 0.97% | 0.21% | 1.32% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.85% | 0.25% | -0.60% | 0.28% | 11.45% | -0.03% |

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

海富通欣睿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. 海富通欣睿混合 A

(2021 年 2 月 9 日至 2023 年 12 月 31 日)



2. 海富通欣睿混合 C

(2021 年 2 月 9 日至 2023 年 12 月 31 日)



注：本基金合同于 2021 年 2 月 9 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 | | |
| 江勇 | 本基金的基金经理；混合资产投资部总经理。 | 2021-02-09 | - | 12 年 | 经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师，资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2018 年 7 月至 2023 年 7 月任海富通上证非周期 ETF 联接基金经理。2018 年 7 月至 2022 年 5 月任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF、海富通中证 100 指数 (LOF) 基金经理。2018 年 7 月至 2020 年 3 月任海富通中证内地低碳指数（现海富通中证 500 增强）基金经理。2020 年 8 月至 2022 年 5 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 联接基金经理。2020 年 8 月至 2023 年 3 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通稳固收益债券的基金经理。2021 年 2 月起兼任海富通欣睿混合基金经理。2021 年 6 月起兼任海富通策略收益债券基金经理。2021 年 6 月至 2023 年 10 月兼任海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。2021 年 9 月起兼任海富通欣利混合基金经理。2023 年 1 月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2023 年 11 月起兼任海富 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 通添利收益一年持有期债券基金经理。2023 年 12 月起兼任海富通悦享一年持有期混合基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

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

四季度，A 股市场震荡下跌，万得全 A 指数来看，当季度跌幅 3.84%。分市场看，沪深 300 指数下跌 7.00%、中证 500 指数下跌 4.60%、创业板指下跌 5.62%。分行业看，申万一级行业表现靠前且收益率为正的板块是煤炭、电子、农林牧渔和综合，跌幅较大的板块是美容护理、房地产、建筑材料、商贸零售和电力设备。

10 月中旬美债利率持续上行，10 年期美债收益率逼近 5%，叠加海外巴以冲突爆发影响全球风险偏好下行，对 A 股市场的资金面和估值面产生了较大压力。国内方面，国庆期间消费数据疲弱，同时 3 季报密集披露，企业盈利呈现走弱的趋势，市场信心受

到影响，跌幅较大。后续随着风险的快速释放，叠加中美经济工作组举行会议，中美经贸关系改善预期升温；此外，特别国债发力稳增长，内外需阶段性共振，对经济改善的预期升温，市场出现明显的反弹。TMT、医药、军工等成长板块涨幅居前。但随着业绩数据的陆续披露，基本面改善的预期遇到波折，10月、11月、12月制造业PMI延续回落，连续三个月处于收缩区间。虽然房地产政策持续放松，但销售数据仍然疲弱，市场对经济预期逐渐转弱，风险偏好大幅下行，红利资产超额收益显著，房地产、成长和部分消费行业出现调整。

债券方面，4季度国内经济总体稳定，修复动能略有放缓，债券收益率先震荡后下行。整体来看，地产板块偏弱，工业生产修复放缓，十一长假带动下服务业与消费持续发力。从PMI来看，10-12月PMI逐月走低，12月达到49%的年内低点；但10-11月经济数据由于基数效应总体反应国内经济稳中向好的情况。投资方面，制造业投资维持韧性，高技术行业维持高增；基建投资由于基数效应增速略有回落；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维持较高的增速。消费方面，十一假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，由于美国经济韧性较强，在中美关系略有缓和等有利因素的影响下，压力较前期减弱，11月同比增速小幅回正。通胀方面，CPI总体维持弱势，在10-11月负增，主要受到食品与消费品价格拖累；PPI由于需求偏弱，跌幅略有走扩。货币政策方面，由于汇率方面压力较大，因此在总量方面的操作偏谨慎，但结构上继续推进银行存款利率下调，缓解银行负债端压力，为2024年继续推进降低实体融资成本做好铺垫。财政政策方面主要体现在年内上调中央财政赤字，增发1万亿国债以及集中发行约1.4万亿特殊再融资债化解地方政府隐性债务。此外，政策的调整主要集中在房地产板块，包括针对房企融资端向银行提出“三个不低于”要求，需求端推出一线城市普宅认定标准放松、下调首付比例与房贷利率等利好政策。资金价格与流动性方面，由于利率债发行节奏前置但财政投放后置的影响，即使10月央行MLF净投放约3000亿，资金缺口依然较大，跨月时点甚至出现了“小钱荒”的现象；随后，央行于11月与12月MLF净投放6000亿与8000亿，伴随财政存款的逐步投放，流动性紧张的情况明显缓解。资金价格方面，4季度DR001与DR007均值为1.72%和1.93%，较3季度分别回升13bp与回升6bp。对应债市而言，4季度的关注点在于资金面与政策之间的博弈，收益率曲线平坦化。10月-11月由于财政发力，流动性偏紧，短端资产收益率明显上行，10年期国债收益率区间震荡偏弱，收益率曲线扁平化。12月资金面压力明显缓和，叠加2024年初降息预期的升温，债券收益率明显下行，且短端下行更快，曲线呈现牛陡行情，10年期国债收益率年末收于2.56%的位置。信用债方面，特殊再融资债重启发行，截至12月末发行规模约1.4万亿元，本轮特殊再融资债规模、范围和用途均超预期，同时表内信贷用于地方化债方案持续推进，化债行情下城投债持续走强；但行情演绎下也蕴藏着新的担忧，协会和交易所对于城投发债均有较严格的审批要求，并且针对平台名单采用差异化的审核口径。随着城投债供给持续收缩，二永债成为市场挖掘的重点，高等级二永债主要跟随利率波动，低等级二永债在票息策略下利差持续压降。地产政策再度加码，从融资端的“三个不低于”、“白

名单”等到需求端的一线城市调控松绑，政策效果有待融资和销售数据进一步验证。整体而言，资产荒延续的背景下，信用债期限利差持续压降，目前曲线较为平坦，短端性价比较高。可转债方面，四季度中证转债指数下跌 3.22%，表现出一定抗跌性。走势上，四季度转债市场呈现倒“N”型：十月转债跟随股市下行至历史较低区间，在十月底快速反弹，其后因经济数据不及预期，外资流出导致权益和转债市场下跌。估值方面，四季度转债百元溢价率压缩 3.09%，纯债溢价率压缩 5.82%。纵观四季度，行情波动较大，但 10 月底转债的修复行情有一些特征值得借鉴，一是转债纯债溢价率下行到接近三年最低位后，估值修复明显；二是反弹时的资金风格值得关注，融资资金规模增长的同时，权益市场风格从大盘持续向小盘微盘转向，转债在反弹行情中因正股规模普遍较小而受益较多。从修复行情开始，主要演绎行业周期底部产能去化与主题性投资。

报告期间，本基金权益仓位有所上升，在控制回撤的基础上，积极寻找估值盈利匹配的股票以赚取绝对收益，行业分布上较为均衡，持仓个股较为分散，组合整体风格偏向价值。转债方面，年末转债的调整提供了较好的一个配置时机，转债仓位有所上升，转债的配置主要以绝对价格较低的转债配置为主，希望在不大幅增加组合波动的前提下增厚组合收益。信用债方面配置以绝对收益角度出发，主要配置中短久期、高评级的信用债为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通欣睿混合 A 净值增长率为-0.84%，同期业绩比较基准收益率为-0.60%，基金净值跑输业绩比较基准 0.24 个百分点。海富通欣睿混合 C 净值增长率为-0.89%，同期业绩比较基准收益率为-0.60%，基金净值跑输业绩比较基准 0.29 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 | 129,617,811.41 | 22.80 |
| | 其中：股票 | 129,617,811.41 | 22.80 |
| 2 | 固定收益投资 | 423,653,839.35 | 74.53 |
| | 其中：债券 | 423,653,839.35 | 74.53 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 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 | -182.80 | 0.00 |
| | 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 | 4,390,479.45 | 0.77 |
| 7 | 其他资产 | 10,762,576.75 | 1.89 |
| 8 | 合计 | 568,424,524.16 | 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8,141,502.56元，占资产净值比例为1.65%。

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 | 130,473.00 | 0.03 |
| B | 采矿业 | 5,015,220.00 | 1.02 |
| C | 制造业 | 69,649,995.96 | 14.15 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,224,732.40 | 1.47 |
| E | 建筑业 | 6,545,436.00 | 1.33 |
| F | 批发和零售业 | 2,619,349.00 | 0.53 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,657,731.80 | 1.35 |
| H | 住宿和餐饮业 | 716,958.00 | 0.15 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,649,018.34 | 0.74 |
| J | 金融业 | 10,777,839.35 | 2.19 |
| K | 房地产业 | 4,292,648.00 | 0.87 |
| L | 租赁和商务服务业 | 161,458.00 | 0.03 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,349,673.00 | 0.48 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|----------------|-------|
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 580,964.00 | 0.12 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,104,812.00 | 0.22 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 121,476,308.85 | 24.69 |

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 | 126,621.59 | 0.03 |
| 日常消费品 | 53,013.87 | 0.01 |
| 金融 | 1,386,761.28 | 0.28 |
| 工业 | 5,475,027.23 | 1.11 |
| 通信服务 | 63,181.66 | 0.01 |
| 房地产 | 1,036,896.93 | 0.21 |
| 合计 | 8,141,502.56 | 1.65 |

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 | 000333 | 美的集团 | 43,700 | 2,387,331.00 | 0.49 |
| 2 | 600795 | 国电电力 | 509,600 | 2,119,936.00 | 0.43 |
| 3 | 600970 | 中材国际 | 221,600 | 2,069,744.00 | 0.42 |
| 4 | 601668 | 中国建筑 | 422,200 | 2,030,782.00 | 0.41 |
| 5 | 000400 | 许继电气 | 90,800 | 1,993,968.00 | 0.41 |
| 6 | 600803 | 新奥股份 | 109,100 | 1,835,062.00 | 0.37 |
| 7 | 601211 | 国泰君安 | 123,100 | 1,831,728.00 | 0.37 |
| 8 | 603368 | 柳药集团 | 93,500 | 1,769,020.00 | 0.36 |
| 9 | 002352 | 顺丰控股 | 40,600 | 1,640,240.00 | 0.33 |
| 10 | 688016 | 心脉医疗 | 8,359 | 1,626,912.17 | 0.33 |

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 | 5,336,698.63 | 1.08 |
| 2 | 央行票据 | - | - |

| | | | |
|----|-----------|----------------|-------|
| 3 | 金融债券 | 222,302,425.88 | 45.18 |
| | 其中：政策性金融债 | 20,497,451.24 | 4.17 |
| 4 | 企业债券 | 92,001,512.89 | 18.70 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 104,013,201.95 | 21.14 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 423,653,839.35 | 86.09 |

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 | 2128021 | 21 工商银行永续债 01 | 300,000 | 31,514,380.33 | 6.40 |
| 2 | 2028006 | 20 邮储银行永续债 | 300,000 | 31,200,285.25 | 6.34 |
| 3 | 1928033 | 19 中国银行二级 03 | 300,000 | 30,486,180.33 | 6.20 |
| 4 | 110059 | 浦发转债 | 271,340 | 29,214,062.70 | 5.94 |
| 5 | 113042 | 上银转债 | 190,260 | 20,949,737.10 | 4.26 |

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根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金管理人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，符合既定投资政策及投资目标。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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的规定，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，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国邮政储蓄银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚，中国银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行的处罚，上海银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局上海监管局的处罚，中国建设银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、国家金融监督管理总局的处罚，中国农业银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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 | 89,697.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | 10,614,578.91 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 58,300.15 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 10,762,576.75 |

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 | 29,214,062.70 | 5.94 |
| 2 | 113042 | 上银转债 | 20,949,737.10 | 4.26 |
| 3 | 113052 | 兴业转债 | 11,770,715.75 | 2.39 |
| 4 | 113037 | 紫银转债 | 5,465,746.45 | 1.11 |
| 5 | 113050 | 南银转债 | 4,145,258.81 | 0.84 |
| 6 | 113584 | 家悦转债 | 3,660,869.66 | 0.74 |
| 7 | 128125 | 华阳转债 | 2,053,467.02 | 0.42 |
| 8 | 110079 | 杭银转债 | 1,842,541.83 | 0.37 |
| 9 | 110073 | 国投转债 | 1,750,941.80 | 0.36 |
| 10 | 113056 | 重银转债 | 1,654,174.61 | 0.34 |
| 11 | 127024 | 盈峰转债 | 1,578,842.63 | 0.32 |
| 12 | 113640 | 苏利转债 | 1,406,424.96 | 0.29 |
| 13 | 123113 | 仙乐转债 | 1,356,696.26 | 0.28 |
| 14 | 127034 | 绿茵转债 | 1,315,966.89 | 0.27 |
| 15 | 123104 | 卫宁转债 | 1,145,409.55 | 0.23 |
| 16 | 113606 | 荣泰转债 | 1,007,004.16 | 0.20 |
| 17 | 128116 | 瑞达转债 | 915,756.33 | 0.19 |
| 18 | 113633 | 科沃转债 | 825,048.49 | 0.17 |
| 19 | 128138 | 侨银转债 | 785,549.70 | 0.16 |

| | | | | |
|----|--------|---------|------------|------|
| 20 | 127017 | 万青转债 | 771,498.55 | 0.16 |
| 21 | 127018 | 本钢转债 | 742,835.93 | 0.15 |
| 22 | 113658 | 密卫转债 | 694,791.68 | 0.14 |
| 23 | 128105 | 长集转债 | 652,747.63 | 0.13 |
| 24 | 113650 | 博 22 转债 | 636,711.95 | 0.13 |
| 25 | 110092 | 三房转债 | 635,660.95 | 0.13 |
| 26 | 128117 | 道恩转债 | 625,338.96 | 0.13 |
| 27 | 113046 | 金田转债 | 510,670.68 | 0.10 |
| 28 | 123169 | 正海转债 | 421,926.17 | 0.09 |
| 29 | 127061 | 美锦转债 | 393,737.75 | 0.08 |
| 30 | 113652 | 伟 22 转债 | 339,546.58 | 0.07 |
| 31 | 110064 | 建工转债 | 338,440.70 | 0.07 |
| 32 | 113516 | 苏农转债 | 325,698.90 | 0.07 |
| 33 | 123165 | 回天转债 | 316,739.82 | 0.06 |
| 34 | 123178 | 花园转债 | 295,250.59 | 0.06 |
| 35 | 123106 | 正丹转债 | 291,203.69 | 0.06 |
| 36 | 123146 | 中环转 2 | 280,998.82 | 0.06 |
| 37 | 128109 | 楚江转债 | 246,706.95 | 0.05 |
| 38 | 127086 | 恒邦转债 | 240,637.97 | 0.05 |
| 39 | 113532 | 海环转债 | 226,348.87 | 0.05 |
| 40 | 123144 | 裕兴转债 | 217,660.82 | 0.04 |
| 41 | 127016 | 鲁泰转债 | 186,758.27 | 0.04 |
| 42 | 127070 | 大中转债 | 158,166.18 | 0.03 |
| 43 | 113647 | 禾丰转债 | 138,518.81 | 0.03 |
| 44 | 113653 | 永 22 转债 | 112,070.66 | 0.02 |
| 45 | 113043 | 财通转债 | 111,478.22 | 0.02 |
| 46 | 111009 | 盛泰转债 | 106,660.27 | 0.02 |
| 47 | 118031 | 天 23 转债 | 101,741.73 | 0.02 |
| 48 | 127022 | 恒逸转债 | 101,602.52 | 0.02 |
| 49 | 127041 | 弘亚转债 | 100,592.26 | 0.02 |
| 50 | 113625 | 江山转债 | 88,453.70 | 0.02 |

| | | | | |
|----|--------|---------|-----------|------|
| 51 | 118005 | 天奈转债 | 82,057.21 | 0.02 |
| 52 | 110093 | 神马转债 | 80,778.29 | 0.02 |
| 53 | 113631 | 皖天转债 | 62,570.51 | 0.01 |
| 54 | 113657 | 再 22 转债 | 53,986.51 | 0.01 |
| 55 | 123128 | 首华转债 | 51,401.85 | 0.01 |
| 56 | 127025 | 冀东转债 | 30,677.98 | 0.01 |
| 57 | 127043 | 川恒转债 | 24,426.25 | 0.00 |
| 58 | 127051 | 博杰转债 | 22,271.73 | 0.00 |
| 59 | 123115 | 捷捷转债 | 21,676.74 | 0.00 |
| 60 | 110086 | 精工转债 | 20,601.67 | 0.00 |
| 61 | 127031 | 洋丰转债 | 11,148.81 | 0.00 |
| 62 | 110076 | 华海转债 | 3,244.12 | 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 | 海富通欣睿混合A | 海富通欣睿混合C |
|---------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 284,031,423.34 | 312,640,273.15 |
| 本报告期基金总申购份额 | 18,851,079.71 | 11,897,638.55 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 109,931,589.15 | 74,697,561.86 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 192,950,913.90 | 249,840,349.84 |

§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

单位：份

| 项目 | 海富通欣睿混合A | 海富通欣睿混合C |
|----|----------|----------|
|----|----------|----------|

| | | |
|--------------------------|---------------|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 19,863,495.40 | - |
| 本报告期买入/申购总份额 | - | - |
| 本报告期卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 19,863,495.40 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 10.29 | - |

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欣睿混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通欣睿混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通欣睿混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通欣睿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