

海富通富盈混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

§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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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 2024 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	6
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	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	46
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通富盈混合型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	102,075,167.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
下属分级基金的交易代码	009154	009155
报告期末下属分级基金的份额总额	49,034,305.71 份	53,040,861.33 份

2.2 基金产品说明

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。</p> <p>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。</p>
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。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	龚小武
	联系电话	021-38650788	021-52629999-212056
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95561
传真		021-33830166	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大 道398号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路167号4 楼
邮政编码		200120	200120
法定代表人		杨仓兵	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	海富通基金管理有限公司	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

§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（2024年1月1日至2024年6月30日）	
	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C

本期已实现收益	-938,542.06	-1,171,193.61
本期利润	1,333,633.51	1,253,718.77
加权平均基金份额本期利润	0.0256	0.0221
本期加权平均净值利润率	2.41%	2.11%
本期基金份额净值增长率	2.40%	2.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
期末可供分配利润	3,505,134.01	2,860,680.16
期末可供分配基金份额利润	0.0715	0.0539
期末基金资产净值	52,539,439.72	55,901,541.49
期末基金份额净值	1.0715	1.0539
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
基金份额累计净值增长率	7.15%	5.39%

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）。

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

海富通富盈混合 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	-1.24%	0.28%	-0.06%	0.10%	-1.18%	0.18%
过去三个月	1.09%	0.28%	0.95%	0.14%	0.14%	0.14%
过去六个月	2.40%	0.33%	2.42%	0.18%	-0.02%	0.15%
过去一年	-0.20%	0.32%	0.86%	0.18%	-1.06%	0.14%
过去三年	-1.24%	0.28%	-2.13%	0.22%	0.89%	0.06%
自基金合同生效起至今	7.15%	0.29%	1.55%	0.22%	5.60%	0.07%

海富通富盈混合 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	-1.28%	0.28%	-0.06%	0.10%	-1.22%	0.18%
过去三个月	0.99%	0.28%	0.95%	0.14%	0.04%	0.14%
过去六个月	2.19%	0.33%	2.42%	0.18%	-0.23%	0.15%
过去一年	-0.59%	0.32%	0.86%	0.18%	-1.45%	0.14%
过去三年	-2.43%	0.28%	-2.13%	0.22%	-0.30%	0.06%
自基金合同生效起至今	5.39%	0.29%	1.55%	0.22%	3.84%	0.07%

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历史走势对比图

(2020年5月20日至2024年6月30日)

海富通富盈混合 A



海富通富盈混合 C



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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 97 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、海富通稳固收益债券型证券投资基金、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、

海富通盈丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资基金、海富通瑞鑫 30 天持有期债券型证券投资基金、海富通优势驱动混合型证券投资基金、海富通 ESG 领先股票型证券投资基金、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金、海富通红利优选混合型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通数字经济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		
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。

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

2024 年上半年国内 GDP 增速 5%，达到年初的计划目标。其中，生产端优于需求端，投资端优于消费端，净出口维持高增。CPI 保持正增长，PPI 降幅收敛，通胀总体平稳。海外方面，美国经济呈现边际走弱的迹象，CME 利率期货显示美联储 9 月降息的市场预期不断升温。

财政金融政策方面，超长期特别国债落地，降准 0.5%，5 年期 LPR 降 0.25%。流动性总体宽松，通胀稳定，助力上半年债牛行情。利率债方面，10 年期国债活跃券上半年收益率下降超过 30BP。信用债方面，“利率化”趋势加大，市场对信用风险钝化，等级利差、期限利差多数创历史新低。可转债上半年呈倒 V 字走势，中证转债指数跌 0.07%。

A 股各指数上半年涨跌不一。其中，中证全指下跌 8.64%，沪深 300 指数上涨 0.89%，中证 800 指数下跌 1.76%，创业板指下跌 10.99%，科创 50 下跌 16.42%。风格上，大盘股优于小盘股；红利风格上涨持续性较好。中信一级行业的银行、煤炭、石油石化等涨幅领先，消费者服务、计算机、商品零售等跌幅居前。H 股上半年表现好于 A 股，恒生指数上涨 3.94%。12 个恒生一级行业，上半年有 7 个行业录得正增长。

报告期，本基金基于对于 2023 年底中央经济工作会议的乐观展望，在大类资产配置上侧重于权益类资产的布局，对于债券类资产采取了比较保守的策略。年初 A 股市场调整后，加大了权益资产和可转债的配置力度，组合净值因此在 5 月份创下本期新高。权益类资产的布局围绕股息率、市现

率和预收账款增速三大核心指标展开，在银行、公用事业、公路港口等稳定类权益资产部分赚取了较充分的收益，较好享受了今年 A 股的红利风格带来的回报。但逆向投资策略选择的标的表现不如人意。

本期债券类资产投资在年初既定的“三不”策略(不加杠杆、不下沉信用、不拉长久期)之下，组合的信用债和利率债剩余久期自然下降，未能充分享受到上半年的债牛行情。同时，作为“预备队”的现金类资产上半年占比偏高。

4.4.2 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 2.40%，同期业绩比较基准收益率为 2.42%。海富通富盈混合 C 净值增长率为 2.19%，同期业绩比较基准收益率为 2.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，结合二十届三中全会的路线图和结构性政策来看，国内经济稳定运行的态势不会改变。有利因素至少包括：税收政策调整有利于增加地方收入来源、减轻支出压力；超长债和地方债发行规模和节奏提速；地产行业风险释放进入下半场；硬科技专项扶持性政策陆续出台；国资市值管理加速推进；等等。而外部干扰因素主要来自于美联储的利率政策和美国大选。

具体到国内股市和债市，股市的结构性机会或好于上半年，而债市机会或存在着弱于上半年的可能性。5 月中下旬以来，A 股和可转债市场的连续调整已经反应比较充分的负面预期。在经济处于结构性调整期、权益市场处于区间振荡的情况下，回落至低位意味着更多的机会而非风险。

基于上述认识，本组合下半年将采取如下措施进一步提升组合的回报率。其一，优化大类资产比例结构，即降低现金管理比例，优化债券和权益投资比例。其二，债券投资部分，修正利率债的加权久期，但是不会下沉信用，也不会提升杠杆率。另外，进一步提升债性可转债的配置比例。其三，权益投资部分，在保持三成以上偏积极仓位的情况下，适度提升 H 股持仓比例。其四，做好组合的风险预算管理，优化回撤控制。

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，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：海富通富盈混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,246,805.39	3,830,491.70
结算备付金		1,665,961.51	2,163,447.94
存出保证金		18,228.42	17,814.09
交易性金融资产	6.4.7.2	77,393,051.22	87,981,362.23
其中：股票投资		37,353,259.43	41,217,835.60
基金投资		-	-
债券投资		40,039,791.79	46,763,526.63
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	26,017,621.61	33,033,121.70
应收清算款		2,466,783.61	-
应收股利		110,806.76	9,344.00
应收申购款		497.32	2,745.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		108,919,755.84	127,038,327.19
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		-	-
应付清算款		-	3,315,629.43
应付赎回款		225,284.91	76,869.26
应付管理人报酬		90,158.84	105,546.89
应付托管费		18,031.75	21,109.40
应付销售服务费		18,611.72	22,251.09
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,168.50	4,789.96

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	123,518.91	224,279.33
负债合计		478,774.63	3,770,475.36
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	102,075,167.04	118,714,818.35
未分配利润	6.4.7.8	6,365,814.17	4,553,033.48
净资产合计		108,440,981.21	123,267,851.83
负债和净资产总计		108,919,755.84	127,038,327.19

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0715 元，C 类基金份额净值 1.0539 元。

基金份额总额 102,075,167.04 份，其中 A 类基金份额 49,034,305.71 份，C 类基金份额 53,040,861.33 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通富盈混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,495,243.27	4,216,604.81
1.利息收入		350,878.01	296,917.85
其中：存款利息收入	6.4.7.9	18,141.67	98,732.79
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		332,736.34	198,185.06
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,553,535.76	3,292,300.44
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,852,989.78	555,528.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	421,800.24	2,016,989.26
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	-	-
股利收益	6.4.7.14	877,653.78	719,783.00
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	4,697,087.95	626,950.82
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	813.07	435.70

减：二、营业总支出		907,890.99	1,281,021.64
1. 管理人报酬		570,453.69	801,152.36
2. 托管费		114,090.71	200,288.08
3. 销售服务费		117,945.71	166,418.63
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	3,842.99
其中：卖出回购金融资产支出		-	3,842.99
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		2,730.92	3,153.83
8. 其他费用	6.4.7.17	102,669.96	106,165.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,587,352.28	2,935,583.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,587,352.28	2,935,583.17
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,587,352.28	2,935,583.17

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通富盈混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	118,714,818.35	-	4,553,033.48	123,267,851.83
二、本期期初净资产	118,714,818.35	-	4,553,033.48	123,267,851.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,639,651.31	-	1,812,780.69	-14,826,870.62
（一）、综合收益总额	-	-	2,587,352.28	2,587,352.28
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-16,639,651.31	-	-774,571.59	-17,414,222.90
其中：1.基金申购	240,907.00	-	16,349.13	257,256.13

款				
2.基金赎回款	-16,880,558.31	-	-790,920.72	-17,671,479.03
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	102,075,167.04	-	6,365,814.17	108,440,981.21
项目	上年度可比期间 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	166,144,318.70	-	8,099,571.60	174,243,890.30
二、本期期初净资产	166,144,318.70	-	8,099,571.60	174,243,890.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-25,337,627.16	-	1,280,974.41	-24,056,652.75
(一)、综合收益总额	-	-	2,935,583.17	2,935,583.17
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-25,337,627.16	-	-1,654,608.76	-26,992,235.92
其中：1.基金申购款	2,042,577.13	-	140,541.43	2,183,118.56
2.基金赎回款	-27,380,204.29	-	-1,795,150.19	-29,175,354.48
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	140,806,691.54	-	9,380,546.01	150,187,237.55

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

海富通富盈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[2020]332 号《关于准予海富通富盈混合型证券投资基金注册的批复》注册,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《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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 2,931,336,195.26 元,其中海富通富盈混合 A 为人民币 1,092,228,123.51 元,海富通富盈混合 C 为人民币 1,839,108,071.75 元。经向中国证监会备案,《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 20 日正式生效,基金合同生效日的海富通富盈混合 A 基金份额总额为 1,092,446,802.70 份,其中认购资金利息折合 218,679.19 份基金份额,海富通富盈混合 C 基金份额总额为 1,839,497,101.82 份,其中认购资金利息折合 389,030.07 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》和《海富通富盈混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、港股通标的股票、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、同业存单、股指期货、股票期权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。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产及存托凭证的比例占基金资产的比例为 0%-40%,投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%,投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%;每个交易日日终,扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或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。本基金业绩比较基准为: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%。

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 2024 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况、2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

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 [2014] 81 号文《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税 [2016] 127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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：

(a) 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。

(b) 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。

(c) 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。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(d) 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(e) 本基金城市维护建设税、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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,246,805.39
等于：本金	1,246,499.53
加：应计利息	305.86
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	1,246,805.39

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	35,745,032.92	-	37,353,259.43	1,608,226.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	190,346.76		
	市场	24,322,136.11	24,638,126.56	125,643.69
	银行间	215,665.23		
	市场	15,072,226.26	15,401,665.23	113,773.74
合计	39,394,362.37	406,011.99	40,039,791.79	239,417.43
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	75,139,395.29	406,011.99	77,393,051.22	1,847,643.94

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	26,017,621.61	-
银行间市场	-	-
合计	26,017,621.61	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	41,469.67
其中：交易所市场	41,469.67
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	82,049.24
合计	123,518.91

6.4.7.7 实收基金

海富通富盈混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	55,477,233.38	55,477,233.38
本期申购	35,518.42	35,518.42
本期赎回（以“-”号填列）	-6,478,446.09	-6,478,446.09
本期末	49,034,305.71	49,034,305.71

海富通富盈混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,237,584.97	63,237,584.97
本期申购	205,388.58	205,388.58
本期赎回（以“-”号填列）	-10,402,112.22	-10,402,112.22
本期末	53,040,861.33	53,040,861.33

注：总申购份额含转换入份额。

6.4.7.8 未分配利润

海富通富盈混合 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	8,493,607.46	-5,920,155.62	2,573,451.84
本期期初	8,493,607.46	-5,920,155.62	2,573,451.84
本期利润	-938,542.06	2,272,175.57	1,333,633.51
本期基金份额交易产生的变动数	-871,580.90	469,629.56	-401,951.34
其中：基金申购款	4,753.70	-2,442.76	2,310.94
基金赎回款	-876,334.60	472,072.32	-404,262.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,683,484.50	-3,178,350.49	3,505,134.01

海富通富盈混合 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	8,666,431.46	-6,686,849.82	1,979,581.64
本期期初	8,666,431.46	-6,686,849.82	1,979,581.64
本期利润	-1,171,193.61	2,424,912.38	1,253,718.77
本期基金份额交易产生的变动数	-1,215,070.17	842,449.92	-372,620.25

其中：基金申购款	24,175.12	-10,136.93	14,038.19
基金赎回款	-1,239,245.29	852,586.85	-386,658.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,280,167.68	-3,419,487.52	2,860,680.16

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	3,749.18
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	14,193.51
其他	198.98
合计	18,141.67

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	68,848,404.39
减：卖出股票成本总额	71,524,903.50
减：交易费用	176,490.67
买卖股票差价收入	-2,852,989.78

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	504,906.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-83,106.67
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	421,800.24

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	21,542,545.58
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	21,262,284.12
减：应计利息总额	362,975.35
减：交易费用	392.78
买卖债券差价收入	-83,106.67

6.4.7.12 贵金属投资收益

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	877,653.78
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	877,653.78

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	4,697,087.95
——股票投资	4,421,692.92
——债券投资	275,395.03
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
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	4,697,087.95

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	813.07
合计	813.07

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,624.11
证券组合费	396.61
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	18,000.00
合计	102,669.96

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	132,087,038.80	100.00%	133,315,672.20	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

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 2024年1月1日至2024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	99,862.47	100.00%	41,469.67	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	97,834.38	100.00%	35,659.45	100.00%

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、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用海通证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从海通证券获得研究综合服务。

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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	570,453.69	801,152.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	275,786.94	387,165.99
应支付基金管理人的净管理费	294,666.75	413,986.37

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 × 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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	114,090.71	200,288.08

注：海富通富盈混合型证券投资基金的托管费率由 0.25% 下调至 0.20%，自 2023 年 8 月 26 日起执行新的托管费率。

2023 年 8 月 26 日之前，支付基金托管人的基金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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

2023 年 8 月 26 日（含）之后，支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 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		
	2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C	合计
兴业银行	-	113,046.49	113,046.49
海通证券	-	753.45	753.45
海富通	-	0.00	0.00
合计	-	113,799.94	113,799.94
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	海富通富盈混合A	海富通富盈混合C	合计
兴业银行	-	159,850.83	159,850.83
海通证券	-	801.51	801.51
海富通	-	0.00	0.00
合计	-	160,652.34	160,652.34

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 0.40%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 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 x 0.40% / 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行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自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023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

兴业银行	1,246,805.39	3,749.18	2,056,752.76	7,042.60
------	--------------	----------	--------------	----------

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

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（2024 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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。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争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相

对收益高、风险适中”的风险收益目标。

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 2024 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 30.64%（2023 年 12 月 31 日：30.49%）。

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-

A-1 以下	-	-
未评级	6,005,778.22	14,236,814.92
合计	6,005,778.22	14,236,814.92

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 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	18,980,160.70	22,673,901.31
AAA 以下	9,103,799.34	4,708,457.39
未评级	5,950,053.53	5,144,353.01
合计	34,034,013.57	32,526,711.71

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、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公司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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,246,805.39	-	-	-	1,246,805.39
结算备付金	1,665,961.51	-	-	-	1,665,961.51
存出保证金	18,228.42	-	-	-	18,228.42
交易性金融资产	22,444,520.62	17,460,587.39	134,683.78	37,353,259.43	77,393,051.22
买入返售金融资产	26,017,621.61	-	-	-	26,017,621.61
应收清算款	-	-	-	2,466,783.61	2,466,783.61
应收股利	-	-	-	110,806.76	110,806.76
应收申购款	-	-	-	497.32	497.32
资产总计	51,393,137.55	17,460,587.39	134,683.78	39,931,347.12	108,919,755.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	225,284.91	225,284.91
应付管理人报酬	-	-	-	90,158.84	90,158.84
应付托管费	-	-	-	18,031.75	18,031.75
应付销售服务费	-	-	-	18,611.72	18,611.72
应交税费	-	-	-	3,168.50	3,168.50
其他负债	-	-	-	123,518.91	123,518.91
负债总计	-	-	-	478,774.63	478,774.63
利率敏感度缺口	51,393,137.55	17,460,587.39	134,683.78	39,452,572.49	108,440,981.21
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,830,491.70	-	-	-	3,830,491.70
结算备付金	2,163,447.94	-	-	-	2,163,447.94
存出保证金	17,814.09	-	-	-	17,814.09
交易性金融资产	29,771,097.97	16,573,995.66	418,433.00	41,217,835.60	87,981,362.23
买入返售金融资产	33,033,121.70	-	-	-	33,033,121.70

应收股利	-	-	-	9,344.00	9,344.00
应收申购款	-	-	-	2,745.53	2,745.53
资产总计	68,815,973.40	16,573,995.66	418,433.00	41,229,925.13	127,038,327.19
负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	3,315,629.43	3,315,629.43
应付赎回款	-	-	-	76,869.26	76,869.26
应付管理人报酬	-	-	-	105,546.89	105,546.89
应付托管费	-	-	-	21,109.40	21,109.40
应付销售服务费	-	-	-	22,251.09	22,251.09
应交税费	-	-	-	4,789.96	4,789.96
其他负债	-	-	-	224,279.33	224,279.33
负债总计	-	-	-	3,770,475.36	3,770,475.36
利率敏感度缺口	68,815,973.40	16,573,995.66	418,433.00	37,459,449.77	123,267,851.83

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-154,715.29	-143,251.48
	市场利率下降 25 个基点	156,110.75	144,549.86

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2024年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的 资产			
交易性金融资产	-	7,823,385.53	7,823,385.53
资产合计	-	7,823,385.53	7,823,385.53
以外币计价的 负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	7,823,385.53	7,823,385.53
项目	上年度末 2023年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的 资产			
交易性金融资产	-	14,112,832.32	14,112,832.32
资产合计	-	14,112,832.32	14,112,832.32
以外币计价的 负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	14,112,832.32	14,112,832.32

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	391,169.28	705,641.62
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-391,169.28	-705,641.62	

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，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其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	37,353,259.4 3	34.45	41,217,835.60	33.44
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	37,353,259.4	34.45	41,217,835.60	33.44
	3			

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	1,594,606.96	1,605,976.35
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,594,606.96	-1,605,976.35

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。

三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	50,103,830.13	48,263,075.75
第二层次	27,289,221.09	39,718,286.48
第三层次	-	-

合计	77,393,051.22	87,981,362.23
----	---------------	---------------

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可转换债券等，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，本基金分别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不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 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(2023 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、买入返售金融资产和其他金融负债，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

截止资产负债表日，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	37,353,259.43	34.29
	其中：股票	37,353,259.43	34.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,039,791.79	36.76
	其中：债券	40,039,791.79	36.76
	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	26,017,621.61	23.89
	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	2,912,766.90	2.67
8	其他各项资产	2,596,316.11	2.38
9	合计	108,919,755.84	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 7,823,385.53 元，占资产净值比例为 7.21%。

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	1,033,197.00	0.95
C	制造业	12,889,323.40	11.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,370,455.20	1.26
E	建筑业	1,424,638.00	1.31
F	批发和零售业	981,489.00	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	1,121,507.00	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,386,326.00	1.28
J	金融业	7,801,334.30	7.19
K	房地产业	528,528.00	0.49
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	894,520.00	0.82
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	98,556.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	29,529,873.90	27.23

7.2.2 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（%）
能源	205,353.00	0.19
工业	19,786.90	0.02
非日常生活消费品	448,490.95	0.41
日常消费品	888,457.47	0.82
医疗保健	1,940,585.85	1.79
金融	555,571.14	0.51
信息技术	1,563,668.18	1.44
公用事业	1,649,162.56	1.52
房地产	552,309.48	0.51
合计	7,823,385.53	7.21

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	601998	中信银行	198,100	1,327,270.00	1.22
2	603868	飞科电器	24,800	952,320.00	0.88
3	600323	瀚蓝环境	42,800	894,520.00	0.82
4	01193	华润燃气	33,500	836,220.23	0.77
5	600941	中国移动	7,400	795,500.00	0.73
6	002572	索菲亚	50,200	769,566.00	0.71
7	600502	安徽建工	176,100	757,230.00	0.70
8	01513	丽珠医药	32,200	755,279.21	0.70
9	03969	中国通号	244,000	748,251.57	0.69
10	603886	元祖股份	48,100	724,386.00	0.67
11	002475	立讯精密	18,400	723,304.00	0.67
12	002966	苏州银行	95,200	714,000.00	0.66
13	00763	中兴通讯	45,200	712,854.19	0.66
14	603587	地素时尚	57,600	707,328.00	0.65
15	600150	中国船舶	16,900	687,999.00	0.63
16	601658	邮储银行	134,400	681,408.00	0.63
17	600926	杭州银行	51,900	677,295.00	0.62
18	605368	蓝天燃气	48,180	657,175.20	0.61
19	01816	中广核电力	193,000	605,946.51	0.56
20	300770	新媒股份	17,700	590,826.00	0.54
21	600519	贵州茅台	400	586,956.00	0.54
22	601398	工商银行	102,400	583,680.00	0.54

23	601989	中国重工	118,100	582,233.00	0.54
24	601328	交通银行	77,200	576,684.00	0.53
25	601288	农业银行	129,100	562,876.00	0.52
26	600938	中国海油	16,904	557,832.00	0.51
27	600820	隧道股份	85,400	557,662.00	0.51
28	600346	恒力石化	39,900	556,605.00	0.51
29	600901	江苏金租	107,180	541,259.00	0.50
30	600729	重庆百货	24,000	536,640.00	0.49
31	002244	滨江集团	72,800	528,528.00	0.49
32	601916	浙商银行	191,330	528,070.80	0.49
33	002275	桂林三金	42,500	527,425.00	0.49
34	01530	三生制药	89,000	523,111.67	0.48
35	002142	宁波银行	23,600	520,616.00	0.48
36	603355	莱克电气	23,800	514,080.00	0.47
37	600919	江苏银行	68,000	505,240.00	0.47
38	600062	华润双鹤	24,200	473,836.00	0.44
39	300014	亿纬锂能	11,800	471,056.00	0.43
40	06969	思摩尔国际	54,000	466,726.30	0.43
41	000598	兴蓉环境	60,000	451,200.00	0.42
42	06862	海底捞	35,000	448,490.95	0.41
43	600332	白云山	14,800	434,084.00	0.40
44	000915	华特达因	14,200	428,272.00	0.39
45	06186	中国飞鹤	128,000	421,731.17	0.39
46	601088	中国神华	9,500	421,515.00	0.39
47	000708	中信特钢	30,200	409,814.00	0.38
48	03968	招商银行	12,500	404,431.33	0.37
49	002594	比亚迪	1,600	400,400.00	0.37
50	00960	龙湖集团	39,000	381,573.25	0.35
51	603338	浙江鼎力	6,000	362,520.00	0.33
52	600566	济川药业	11,400	361,494.00	0.33
53	000963	华东医药	12,300	342,063.00	0.32
54	601009	南京银行	32,900	341,831.00	0.32
55	000650	仁和药业	55,900	329,810.00	0.30
56	600897	厦门空港	24,300	306,423.00	0.28
57	03692	翰森制药	20,000	297,898.75	0.27
58	601975	招商南油	76,800	275,712.00	0.25
59	00013	和黄医药	10,500	263,536.35	0.24
60	601158	重庆水务	54,600	262,080.00	0.24
61	601369	陕鼓动力	32,500	260,650.00	0.24
62	600210	紫江企业	47,000	250,040.00	0.23
63	601128	常熟银行	31,850	241,104.50	0.22
64	002353	杰瑞股份	6,600	231,528.00	0.21
65	601000	唐山港	48,600	228,420.00	0.21
66	603279	景津装备	10,200	221,238.00	0.20

67	002043	兔宝宝	20,800	215,696.00	0.20
68	002508	老板电器	9,700	214,370.00	0.20
69	00135	昆仑能源	28,000	206,995.82	0.19
70	02883	中海油田服务	30,000	205,353.00	0.19
71	600079	人福医药	11,400	195,738.00	0.18
72	688187	时代电气	3,530	174,311.40	0.16
73	01109	华润置地	7,046	170,736.23	0.16
74	600428	中远海特	26,500	162,180.00	0.15
75	02628	中国人寿	15,000	151,139.81	0.14
76	605009	豪悦护理	3,100	122,264.00	0.11
77	600970	中材国际	9,100	109,746.00	0.10
78	601872	招商轮船	12,700	107,315.00	0.10
79	002697	红旗连锁	22,200	102,786.00	0.09
80	06869	长飞光纤光缆	14,500	102,562.42	0.09
81	01801	信达生物	3,000	100,759.87	0.09
82	601921	浙版传媒	12,900	98,556.00	0.09
83	601168	西部矿业	3,000	53,850.00	0.05
84	600548	深高速	3,900	41,457.00	0.04
85	09979	绿城管理控股	4,000	19,786.90	0.02

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	300033	同花顺	2,845,928.00	2.31
2	601998	中信银行	1,863,222.00	1.51
3	00960	龙湖集团	1,645,812.43	1.34
4	601989	中国重工	1,385,245.00	1.12
5	603868	飞科电器	1,356,901.00	1.10
6	000661	长春高新	1,218,381.00	0.99
7	002142	宁波银行	1,173,360.00	0.95
8	002244	滨江集团	1,149,758.00	0.93
9	06862	海底捞	1,097,585.18	0.89
10	002304	洋河股份	962,251.00	0.78
11	02601	中国太保	889,303.82	0.72
12	002572	索菲亚	833,894.00	0.68
13	06186	中国飞鹤	816,352.11	0.66
14	600150	中国船舶	806,406.00	0.65
15	603886	元祖股份	787,647.00	0.64
16	601888	中国中免	772,282.00	0.63

17	02628	中国人寿	761,222.94	0.62
18	02318	中国平安	743,159.03	0.60
19	600941	中国移动	742,829.00	0.60
20	00763	中兴通讯	718,030.00	0.58

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	300033	同花顺	2,910,906.00	2.36
2	601998	中信银行	1,703,246.00	1.38
3	00960	龙湖集团	1,574,682.81	1.28
4	002244	滨江集团	1,335,838.00	1.08
5	01109	华润置地	1,317,434.36	1.07
6	01818	招金矿业	1,287,432.05	1.04
7	03900	绿城中国	1,228,392.86	1.00
8	06186	中国飞鹤	1,217,278.31	0.99
9	00390	中国中铁	1,201,718.24	0.97
10	01186	中国铁建	1,194,107.22	0.97
11	600750	江中药业	1,169,558.00	0.95
12	600548	深高速	1,121,669.00	0.91
13	000661	长春高新	1,083,419.00	0.88
14	002458	益生股份	984,420.06	0.80
15	01618	中国中冶	958,508.96	0.78
16	002304	洋河股份	897,160.00	0.73
17	00220	统一企业中国	885,706.55	0.72
18	601989	中国重工	875,206.00	0.71
19	02601	中国太保	870,077.96	0.71
20	001979	招商蛇口	847,779.00	0.69

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	63,238,634.41
卖出股票的收入（成交）总额	68,848,404.39

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	6,818,856.68	6.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	5,068,699.18	4.67
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	15,401,665.23	14.20
7	可转债（可交换债）	12,750,570.70	11.76
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,039,791.79	36.92

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	019727	23 国债 24	53,000	5,396,409.18	4.98
2	102101704	21 中粮 MTN002	50,000	5,139,350.82	4.74
3	102380808	23 广州资管 MTN001	50,000	5,136,975.07	4.74
4	102102306	21 国能资本 MTN001	50,000	5,125,339.34	4.73
5	185459	22 钱江 01	50,000	5,068,699.18	4.67

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。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中信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。

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	18,228.42
2	应收清算款	2,466,783.61
3	应收股利	110,806.76

4	应收利息	-
5	应收申购款	497.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,596,316.11

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	128136	立讯转债	873,622.66	0.81
2	127056	中特转债	692,113.01	0.64
3	113043	财通转债	504,643.39	0.47
4	110076	华海转债	503,914.81	0.46
5	110073	国投转债	453,524.22	0.42
6	113641	华友转债	417,029.43	0.38
7	113049	长汽转债	376,788.99	0.35
8	110081	闻泰转债	368,660.36	0.34
9	113056	重银转债	364,422.84	0.34
10	113605	大参转债	359,650.95	0.33
11	123113	仙乐转债	358,600.00	0.33
12	113024	核建转债	333,281.82	0.31
13	123154	火星转债	329,256.10	0.30
14	127022	恒逸转债	322,979.10	0.30
15	113633	科沃转债	313,835.74	0.29
16	127067	恒逸转 2	305,059.29	0.28
17	110082	宏发转债	288,235.48	0.27
18	113050	南银转债	277,160.70	0.26
19	113627	太平转债	264,622.82	0.24
20	127024	盈峰转债	234,664.66	0.22
21	128095	恩捷转债	207,498.87	0.19
22	127085	韵达转债	201,484.86	0.19
23	113059	福莱转债	198,670.42	0.18
24	113616	韦尔转债	190,855.97	0.18
25	127017	万青转债	182,676.02	0.17
26	127083	山路转债	174,078.78	0.16
27	113046	金田转债	172,859.21	0.16

28	127030	盛虹转债	170,610.27	0.16
29	123179	立高转债	167,610.79	0.15
30	113584	家悦转债	166,738.04	0.15
31	110089	兴发转债	161,825.82	0.15
32	123108	乐普转 2	158,306.17	0.15
33	128116	瑞达转债	158,112.49	0.15
34	127026	超声转债	149,830.72	0.14
35	110067	华安转债	147,516.86	0.14
36	128101	联创转债	145,816.38	0.13
37	113652	伟 22 转债	143,651.72	0.13
38	113042	上银转债	139,818.41	0.13
39	127046	百润转债	137,417.48	0.13
40	123210	信服转债	134,683.78	0.12
41	111010	立昂转债	133,911.86	0.12
42	123117	健帆转债	132,732.17	0.12
43	127066	科利转债	112,365.10	0.10
44	128131	崇达转 2	106,393.38	0.10
45	123091	长海转债	80,708.15	0.07
46	127031	洋丰转债	67,501.32	0.06
47	128129	青农转债	61,726.70	0.06
48	113021	中信转债	61,439.71	0.06
49	113655	欧 22 转债	59,406.40	0.05
50	128144	利民转债	59,014.44	0.05
51	128105	长集转债	55,462.02	0.05
52	113033	利群转债	53,879.28	0.05
53	127073	天赐转债	53,831.01	0.05
54	123064	万孚转债	52,759.76	0.05
55	113659	莱克转债	48,230.92	0.04
56	128134	鸿路转债	42,836.49	0.04
57	110059	浦发转债	38,596.38	0.04
58	123121	帝尔转债	29,510.85	0.03
59	113047	旗滨转债	27,412.98	0.03
60	113618	美诺转债	27,409.81	0.03
61	113542	好客转债	27,156.92	0.03
62	128071	合兴转债	27,064.63	0.02
63	127038	国微转债	26,481.37	0.02
64	113045	环旭转债	23,757.81	0.02
65	123180	浙矿转债	22,948.18	0.02
66	111001	山玻转债	22,725.16	0.02
67	113065	齐鲁转债	21,659.55	0.02
68	127016	鲁泰转债	21,518.92	0.02

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告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
海富通富盈混合 A	979	50,086.11	-	-	49,034,305.71	100.00%
海富通富盈混合 C	1,618	32,781.74	-	-	53,040,861.33	100.00%
合计	2,597	39,305.03	-	-	102,075,167.04	100.00%

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	海富通富盈混合 A	2,188,106.62	4.4624%
	海富通富盈混合 C	30.01	0.0001%
	合计	2,188,136.63	2.1437%

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	海富通富盈混合 A	0
	海富通富盈混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	海富通富盈混合 A	>100

开放式基金	海富通富盈混合 C	0
	合计	>100

§9 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
基金合同生效日（2020 年 5 月 20 日）基金份额总额	1,092,446,802.70	1,839,497,101.82
本报告期期初基金份额总额	55,477,233.38	63,237,584.97
本报告期基金总申购份额	35,518.42	205,388.58
减：本报告期基金总赎回份额	6,478,446.09	10,402,112.22
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	49,034,305.71	53,040,861.33

注：总申购份额含转换入份额。

§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

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)，未有改聘情况发生。

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

报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

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	
海通证券	2	132,087,038.80	100.00%	99,862.47	100.00%	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

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、研究水平和综合服务支持三个部分进行评议，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，经投资部部门内部讨论，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会审议。

<2> 核准。在完成对证券公司的评估和审核后，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
海通证券	16,651,113.71	100.00%	1,151,930,000.00	100.00%	-	-

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贵州省贵文文化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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-12

2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-18
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-07

§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 123 只公募基金。截至 2024 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1613 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《上海证券报》颁发的“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，海富通荣获中国保险资产管理业协会颁发的“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《上海证券报》颁发的“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”。

§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

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

二〇二四年八月三十日