

海富通富泽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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	17
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	17
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	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通富泽混合型证券投资基金	
基金简称	海富通富泽混合	
基金主代码	009156	
交易代码	009156	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 6 月 22 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	80,997,689.13 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
下属分级基金的交易代码	009156	009157
报告期末下属分级基金的份额总额	64,651,900.87 份	16,345,788.26 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制下跌风险的前提下，通过量化选股和主动债券投资相结合的投资策略，力争实现战胜业绩比较基准的目标，追求资产净值的长期稳健增值。
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。本基金投资策略还包括债券投资组合策略、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。
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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	朱萍
	联系电话	021-38650788	021-31888888
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	Zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95528
传真		021-33830166	021-63602540
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	上海市中山东一路12号
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	上海市博成路1388号浦银中心 A栋
邮政编码		200120	200126
法定代表人		杨仓兵	张为忠

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）
---------------	--------------------------------------

	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
本期已实现收益	1,393,558.29	340,938.08
本期利润	2,676,725.02	646,471.45
加权平均基金份额本期利润	0.0366	0.0366
本期加权平均净值利润率	3.43%	3.49%
本期基金份额净值增长率	3.77%	3.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
期末可供分配利润	5,647,094.08	1,143,060.89
期末可供分配基金份额利润	0.0873	0.0699
期末基金资产净值	70,298,994.95	17,488,849.15
期末基金份额净值	1.0873	1.0699
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
基金份额累计净值增长率	8.73%	6.99%

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

海富通富泽混合 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	0.39%	0.26%	-0.08%	0.10%	0.47%	0.16%
过去三个月	1.73%	0.26%	0.91%	0.14%	0.82%	0.12%
过去六个月	3.77%	0.34%	2.39%	0.18%	1.38%	0.16%
过去一年	1.14%	0.27%	0.92%	0.18%	0.22%	0.09%
过去三年	1.47%	0.26%	-2.57%	0.22%	4.04%	0.04%
自基金合同生效起至今	8.73%	0.26%	2.10%	0.22%	6.63%	0.04%

海富通富泽混合 C

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	0.36%	0.26%	-0.08%	0.10%	0.44%	0.16%
过去三个月	1.63%	0.26%	0.91%	0.14%	0.72%	0.12%
过去六个月	3.56%	0.34%	2.39%	0.18%	1.17%	0.16%
过去一年	0.74%	0.27%	0.92%	0.18%	-0.18%	0.09%
过去三年	0.25%	0.26%	-2.57%	0.22%	2.82%	0.04%
自基金合同生 效起至今	6.99%	0.26%	2.10%	0.22%	4.89%	0.04%

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

海富通富泽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6月22日至2024年6月30日)

海富通富泽混合 A



海富通富泽混合 C



注：本基金合同于 2020 年 6 月 22 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		
陈林海	本基金的基金经理	2023-07-13	-	12 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任上海从容投资管理有限公司研究员，华泰柏瑞基金管理有限公司研究员、高级研究员。2015 年 9 月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师、高级股票分析师、基金经理助理。2021 年 4 月至 2022 年 08 月任海富通添鑫收益债券基金基金经理。2022 年 5 月至 2023 年 8 月兼任海富通中证 100 指数（LOF）基金经理。2022 年 5 月至 2023 年 7 月兼任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF 基金基金经理。2022 年 5 月至 2023 年 3 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 基金经理。2022 年 5 月至 2023 年 5 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 联接基金经理。2022 年 8 月至 2023 年 8 月兼任海富通新内需混合基金经理。2023 年 7 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2023 年 8 月起兼任海富通先进制造股票基金经理。
张靖爽	本基金的基金经理；债券基金部副总监。	2020-06-22	-	14 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。2024年3月起兼任海富通瑞兴3个月定开债券基金经理。
杜晓海	本基金的基金经理；公司总经理助理。	2020-06-22	-	24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、量化投资部总监，现任海富通基金管理有限公司总经理助理。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

				<p>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。2024 年 3 月起兼任海富通 ESG 领先股票基金经理。2024 年 6 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 发起联接基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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

国内方面，2024 年上半年国内经济整体维持弱修复状态，实现了实际 GDP 增速 5%，基本完成了目标。从经济运行节奏看，第一季度开局良好，进入第二季度，社融和 M1 增速开始回落，经济增速边际放缓，实际 GDP 同比增长 4.7%。从经济增长动力上看，海外经济向好，国内生产和出口保持强势，有力提振经济增长，而国内地产未显著回暖，居民和企业融资意愿不足，内需消费疲弱，全社会风险偏好较低。从政策思路看，目前国内政策主要集中在供给侧，坚持高质量发展，因地制宜发展新质生产力，这也是我国跨越中等收入陷阱的必由之路。

海外方面，2024 年上半年美国经济在高利率和紧财政下开始走弱，但是经济仍有韧性，降息预期不断延后。6 月美国失业率走高，叠加 CPI 同比也回落，CME 利率期货显示预计美联储 9 月将启动降息。但是，失业率上升更多是源于新增劳动力进入市场，非农就业数据依然超预期，且实际薪资增速依然保持较高增长，最新零售数据也超预期，美国消费依然具有韧性。

从 A 股市场看，本报告期内，价值板块跑赢成长板块，大盘股跑赢小盘，市场情绪较弱。因子方面，上半年基本面类因子表现较好，包括估值、成长、盈利质量、分析师预期等。反转类因子表现较差，大市值显著占优。在宏观经济缓慢复苏、市场风格偏向红利价值的前提下，本基金在控制回撤的基础上，力图兼顾估值、盈利质量、景气度的匹配，寻找低估值的优质股票投资机会，以赚取绝对收益。本报告期内，本基金在股票策略上增配了良好现金流的港股通公司，进一步提升整体

组合的红利暴露。本基金的投资思路为在控制风险的基础上，优选低估值股票，同时积极地捕捉市场的结构性机会，力争跑赢市场。

固定收益方面，上半年国内经济企稳回升，实际 GDP 增速达到 5%。整体来看，生产端修复节奏好于需求端，PMI 在 3 月重回扩张区间，但持续性略有不足。投资端方面，制造业与基建投资实现高增，地产投资跌幅走扩。消费增速回落，可选消费与地产后周期消费偏弱。出口方面，出口同比与贸易顺差双双回升。通胀方面，CPI 总体弹性有限，维持在 0-1% 的区间窄幅震荡；PPI 在基数效应下跌幅收窄但仍未转正。货币政策方面，上半年调降 5 年期 LPR25bp，全面降准 0.5 个百分点，体现了货币政策引导降低实体融资成本的目的。财政政策方面，超长期特别国债落地，2024 年将率先发行 1 万亿；同时地方债稳步发行。流动性方面，总体维持合理充裕的状态，但分层的现象较为突出。资金价格方面，上半年 R001 与 R007 均值为 1.84% 和 2.03%。对应债市而言，上半年走出牛市行情。

信用债方面，供求矛盾持续，收益率进一步走低，2.3% 以上合意资产难觅，不过结构特征较去年有所变化。需求端，大行存款流失而理财规模快速增长，市场定价权一定程度向非银倾斜，非银主导的中短端信用债表现较强；供给端，信用债供给总量并不少，主要是收益率低位，超长信用债供给放量，以高等级央国企产业债为主，城投债净融资额持续低位徘徊。整体而言，随着资产荒持续演绎，今年信用债“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。

报告期内，本基金主要投资于利率债，根据市场情况灵活调整组合久期和杠杆。鉴于上半年的基本面、资金面和政策面，组合维持较高的债券仓位，并依据利率曲线的变化，针对不同期限的利率债和不同品种的信用债进行积极的交易以增厚收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通富泽混合 A 净值增长率为 3.77%，同期业绩比较基准收益率为 2.39%。海富通富泽混合 C 净值增长率为 3.56%，同期业绩比较基准收益率为 2.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从全球经济看，由于美国财政高杠杆、货币高利率的制约，2024 年美国财政刺激力度将边际走弱，美国经济、通胀也将逐步下行。6 月 18 日美国 CBO 在最新财政和经济展望中上调了 2024 年财年预算赤字，受到边际趋松的财政提振，通胀或存在抬升的压力。7 月就业数据超预期走弱，市场降息预期升温，但受飓风等因素影响 7 月就业数据有一定特殊性，未来美联储降息节奏和幅度还需要进一步跟踪。一旦美联储启动降息，这对全球金融市场、各类资产都将产生较为显著的影响，我

们面临的外部金融环境有望缓解。

中国经济暂时仍面临着总需求不足、结构调整阵痛的冲击，在这过程中市场信心较为脆弱和不足。目前政策的重心仍主要在供给端，短期而言，在破立并举、先立后破的政策基调下，若未来内需进一步下滑，不排除阶段性向需求端倾斜的可能，这需要进一步跟踪。此外，监管层也在积极呵护市场，下行空间可能有限，这时候更重要的是行业配置。

投资策略上，我们将通过多因子选股模型寻找各板块内低估值的优质股票投资机会，并通过组合优化，构建兼顾风险收益、估值、盈利质量、景气度匹配的组合，力争超越基准的表现。市场风格方面，从增量资金偏好、估值等角度看，需要提高对盈利质量的重视，小微盘风格的暴露需要谨慎对待。三季度将重点依据公司基本面，在盈利质量、景气度和估值匹配的公司中寻找投资机会。我们也将继续通过港股红利，转债等手段来提升组合的价值和绝对收益特征。本基金也将利用动态的仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。

固定收益方面，展望下半年，经济或维持修复状态。投资方面，基建在超长期特别国债与地方债发力的情况下有望保持较高的景气度；制造业投资在高技术领域或将继续发力；地产投资在政策端可能仍有调整的空间。通胀方面，CPI 有望维持在正增区间；PPI 在需求端弹性有限，基数效应下跌幅有望继续收窄。货币政策方面，流动性的合理充裕或维持，总量层面仍有降准降息的可能性。财政方面，超长期特别国债持续发力，地方债发行有望提速。下半年对债券市场中性偏乐观。资金面与流动性方面，央行重建利率走廊，资金价格的波动或被熨平。基本面方面，当前经济环比动能不足，关注下半年增量政策的出台。目前可预期的风险或来自于政府债券供给，如果地方债集中发行，债券市场可能面临一定的调整风险。综合来看，基本面因素对债市利好；信贷需求偏弱，债券收益率中枢仍然处于下行通道。

信用债方面，实体融资需求修复仍是核心，预计资产荒仍会持续。需求端，需谨防理财规模持续膨胀与净值平滑监管趋严的扰动；供给方面，除利率债外，金融债或有放量，但扰动有限，重点关注城投政策动向。

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，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配后份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对海富通富泽混合型证券投资基金的托管过程中，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、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对海富通富泽混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由海富通基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、

收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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：海富通富泽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	1,357,494.42	1,534,407.87
结算备付金		2,725,296.52	6,458,497.74
存出保证金		353,203.68	12,965.10
交易性金融资产	6.4.7.2	88,022,697.27	109,998,942.69
其中：股票投资		27,494,532.19	31,053,376.05
基金投资		-	-
债券投资		60,528,165.08	78,945,566.64
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	-	-
应收清算款		424,033.28	-
应收股利		214,620.65	-
应收申购款		-	9,994.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		93,097,345.82	118,014,807.40
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		4,700,000.00	1,799,740.83
应付清算款		294,854.56	1,053,606.27
应付赎回款		97,564.56	168,652.13
应付管理人报酬		57,944.94	78,518.52
应付托管费		14,486.22	19,629.64

应付销售服务费		5,773.18	6,847.37
应付投资顾问费		-	-
应交税费		550.06	557.23
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	138,328.20	232,975.07
负债合计		5,309,501.72	3,360,527.06
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	80,997,689.13	109,692,079.93
未分配利润	6.4.7.8	6,790,154.97	4,962,200.41
净资产合计		87,787,844.10	114,654,280.34
负债和净资产总计		93,097,345.82	118,014,807.40

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0873 元，C 类基金份额净值 1.0699 元。基金份额总额 80,997,689.13 份，其中 A 类基金份额 64,651,900.87 份，C 类基金份额 16,345,788.26 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通富泽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		3,974,494.56	4,493,023.90
1.利息收入		70,967.77	201,507.99
其中：存款利息收入	6.4.7.9	55,713.04	120,697.74
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		15,254.73	80,810.25
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,314,826.69	1,802,108.82
其中：股票投资收益	6.4.7.10	395,900.23	-875,857.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,209,645.12	1,572,349.72
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	188,441.90	490,400.34
股利收益	6.4.7.14	520,839.44	615,216.47
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.15	1,588,700.10	2,489,370.82

填列)			
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	-	36.27
减：二、营业总支出		651,298.09	1,083,203.29
1. 管理人报酬		384,987.75	718,512.45
2. 托管费		96,246.90	179,628.13
3. 销售服务费		36,883.07	56,570.16
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		39,525.02	16,513.52
其中：卖出回购金融资产支出		39,525.02	16,513.52
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		1,249.14	3,677.26
8. 其他费用	6.4.7.17	92,406.21	108,301.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,323,196.47	3,409,820.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,323,196.47	3,409,820.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,323,196.47	3,409,820.61

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通富泽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	109,692,079.93	-	4,962,200.41	114,654,280.34
二、本期期初净资产	109,692,079.93	-	4,962,200.41	114,654,280.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-28,694,390.80	-	1,827,954.56	-26,866,436.24
（一）、综合收益总额	-	-	3,323,196.47	3,323,196.47
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净	-28,694,390.80	-	-1,495,241.91	-30,189,632.71

资产减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	117,259.04	-	6,157.37	123,416.41
2.基金赎回款	-28,811,649.84	-	-1,501,399.28	-30,313,049.12
(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	80,997,689.13	-	6,790,154.97	87,787,844.10
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	192,470,315.78	-	10,382,771.19	202,853,086.97
二、本期期初净资产	192,470,315.78	-	10,382,771.19	202,853,086.97
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-51,458,106.09	-	-104,852.74	-51,562,958.83
(一)、综合收益总额	-	-	3,409,820.61	3,409,820.61
(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)	-51,458,106.09	-	-3,514,673.35	-54,972,779.44
其中：1.基金申购款	144,349.20	-	9,851.49	154,200.69
2.基金赎回款	-51,602,455.29	-	-3,524,524.84	-55,126,980.13
(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	141,012,209.69	-	10,277,918.45	151,290,128.14

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

海富通富泽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]126 号《关于准予海富通富泽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《海富通富泽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 903,252,947.38 元，其中海富通富泽混合 A 为人民币 570,320,022.61 元，海富通富泽混合 C 为人民币 332,932,924.77 元。经向中国证监会备案，《海富通富泽混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 6 月 22 日正式生效，基金合同生效日的海富通富泽混合 A 基金份额总额为 570,462,800.39 份，其中认购资金利息折合 142,777.78 份基金份额，海富通富泽混合 C 基金份额总额为 332,998,748.80 份，其中认购资金利息折合 65,824.03 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《海富通富泽混合型证券投资基金基金合同》及《海富通富泽混合型证券投资基金基金招募说明书》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《海富通富泽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》（以下合称“企业会计准则”）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<年度报告和中期报告>》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	1,357,494.42
等于：本金	1,357,327.62
加：应计利息	166.80
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	1,357,494.42

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	26,689,279.15	-	27,494,532.19	805,253.04	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所	165,084.62			
	市场	23,313,305.72	23,762,920.82	284,530.48	
	银行间	473,244.26			
	市场	35,645,193.33	36,765,244.26	646,806.67	
	合计	58,958,499.05	638,328.88	60,528,165.08	931,337.15
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	85,647,778.20	638,328.88	88,022,697.27	1,736,590.19	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-2,857,454.40	-	-	-
——股指期货	-2,857,454.40	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-2,857,454.40	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2412	IM2412	-3.00	-2,813,400.00	44,054.40
合计	-	-	-	44,054.40
减：可抵销期货暂 收款	-	-	-	44,054.40
净额	-	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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无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	66,278.96
其中：交易所市场	66,278.96
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	72,049.24
合计	138,328.20

6.4.7.7 实收基金

海富通富泽混合 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	90,332,196.23	90,332,196.23
本期申购	115,534.57	115,534.57
本期赎回（以“-”号填列）	-25,795,829.93	-25,795,829.93
本期末	64,651,900.87	64,651,900.87

海富通富泽混合 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	19,359,883.70	19,359,883.70
本期申购	1,724.47	1,724.47
本期赎回（以“-”号填列）	-3,015,819.91	-3,015,819.91
本期末	16,345,788.26	16,345,788.26

6.4.7.8 未分配利润

海富通富泽混合 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	8,201,990.52	-3,880,783.48	4,321,207.04
本期期初	8,201,990.52	-3,880,783.48	4,321,207.04
本期利润	1,393,558.29	1,283,166.73	2,676,725.02
本期基金份额交易产生的变动数	-2,231,977.98	881,140.00	-1,350,837.98
其中：基金申购款	9,402.45	-3,331.61	6,070.84
基金赎回款	-2,241,380.43	884,471.61	-1,356,908.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,363,570.83	-1,716,476.75	5,647,094.08

海富通富泽混合 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	1,464,339.86	-823,346.49	640,993.37
本期期初	1,464,339.86	-823,346.49	640,993.37
本期利润	340,938.08	305,533.37	646,471.45
本期基金份额交易产生的变动数	-231,502.37	87,098.44	-144,403.93
其中：基金申购款	135.59	-49.06	86.53
基金赎回款	-231,637.96	87,147.50	-144,490.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,573,775.57	-430,714.68	1,143,060.89

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	2,263.24
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	53,312.96
其他	136.84
合计	55,713.04

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	102,124,577.04

减：卖出股票成本总额	101,502,049.86
减：交易费用	226,626.95
买卖股票差价收入	395,900.23

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	982,989.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	226,655.90
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	1,209,645.12

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	43,548,076.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	42,444,901.70
减：应计利息总额	875,766.91
减：交易费用	752.04
买卖债券差价收入	226,655.90

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

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益（税前）	204,365.60
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	7,084.66
减：交易费用	8,839.04

合计	188,441.90
----	------------

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	520,839.44
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	520,839.44

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	1,544,645.70
——股票投资	738,886.80
——债券投资	805,758.90
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	44,054.40
——权证投资	-
——股指期货	44,054.40
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	1,588,700.10

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

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	49,672.34
证券出借违约金	-
证券组合费	148.67

银行划款手续费	1,608.30
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	18,000.00
合计	92,406.21

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、登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	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	199,328,896.24	100.00%	150,576,947.14	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	147,526.95	100.00%	66,278.96	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	110,161.04	100.00%	46,361.73	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 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
当期发生的基金应支付的管理费	384,987.75	718,512.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	184,628.85	334,572.82
应支付基金管理人的净管理费	200,358.90	383,939.63

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 0.80% 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 × 0.80% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	96,246.90	179,628.13

注：支付基金托管人浦发银行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 x0.20%/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		
	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C	合计
浦发银行	-	33,028.99	33,028.99
海通证券	-	35.27	35.27
海富通基金	-	-	-
合计	-	33,064.26	33,064.26
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		
	海富通富泽混合A	海富通富泽混合C	合计
浦发银行	-	50,397.08	50,397.08
海通证券	-	32.58	32.58
海富通基金	-	-	-
合计	-	50,429.66	50,429.66

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 x0.40%/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固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固有资金投资本基金。

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
浦发银行	1,357,494.42	2,263.24	3,083,106.13	8,102.63

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**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 4,700,000.00 元，于 2024 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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 26.35%（2023 年 12 月 31 日：15.05%）。

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	4,916,751.29	-
合计	4,916,751.29	-

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。

6.4.13.2.2 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	17,925,356.50	13,066,510.20
AAA 以下	5,204,409.75	4,193,734.43
未评级	32,481,647.54	61,685,322.01
合计	55,611,413.79	78,945,566.64

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、政策性金融债。

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发行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)。

本基金所持的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	1,357,494.42	-	-	-	1,357,494.42
结算备付金	2,725,296.52	-	-	-	2,725,296.52
存出保证金	15,595.68	-	-	337,608.00	353,203.68
交易性金融资产	4,916,751.29	38,598,380.50	17,013,033.29	27,494,532.19	88,022,697.27
应收清算款	-	-	-	424,033.28	424,033.28
应收股利	-	-	-	214,620.65	214,620.65
资产总计	9,015,137.91	38,598,380.50	17,013,033.29	28,470,794.12	93,097,345.82
负债					
卖出回购金融资产款	4,700,000.00	-	-	-	4,700,000.00
应付清算款	-	-	-	294,854.56	294,854.56
应付赎回款	-	-	-	97,564.56	97,564.56
应付管理人报酬	-	-	-	57,944.94	57,944.94
应付托管费	-	-	-	14,486.22	14,486.22
应付销售服务费	-	-	-	5,773.18	5,773.18
应交税费	-	-	-	550.06	550.06

其他负债	-	-	-	138,328.20	138,328.20
负债总计	4,700,000.00	-	-	609,501.72	5,309,501.72
利率敏感度缺口	4,315,137.91	38,598,380.50	17,013,033.29	27,861,292.40	87,787,844.10
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	1,534,407.87	-	-	-	1,534,407.87
结算备付金	6,458,497.74	-	-	-	6,458,497.74
存出保证金	12,965.10	-	-	-	12,965.10
交易性金融资产	8,599,857.53	27,510,463.21	42,835,245.90	31,053,376.05	109,998,942.69
应收申购款	-	-	-	9,994.00	9,994.00
资产总计	16,605,728.24	27,510,463.21	42,835,245.90	31,063,370.05	118,014,807.40
负债					
卖出回购金融资产款	1,799,740.83	-	-	-	1,799,740.83
应付清算款	-	-	-	1,053,606.27	1,053,606.27
应付赎回款	-	-	-	168,652.13	168,652.13
应付管理人报酬	-	-	-	78,518.52	78,518.52
应付托管费	-	-	-	19,629.64	19,629.64
应付销售服务费	-	-	-	6,847.37	6,847.37
应交税费	-	-	-	557.23	557.23
其他负债	-	-	-	232,975.07	232,975.07
负债总计	1,799,740.83	-	-	1,560,786.23	3,360,527.06
利率敏感度缺口	14,805,987.41	27,510,463.21	42,835,245.90	29,502,583.82	114,654,280.34

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	-627,095.91	-746,491.13
	市场利率下降 25 个基点	637,196.20	758,204.90

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	-	9,433,292.51	9,433,292.51
资产合计	-	9,433,292.51	9,433,292.51
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	-	9,433,292.51	9,433,292.51
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	-	2,837,293.25	2,837,293.25
资产合计	-	2,837,293.25	2,837,293.25
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	-	2,837,293.25	2,837,293.25

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	上年度末
		2024年6月30日	2023年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	471,664.63	141,864.66
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-471,664.63	-141,864.66

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	27,494,532.19	31.32	31,053,376.05	27.08
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	27,494,532.19	31.32	31,053,376.05	27.08

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%	1,129,260.65	1,304,936.38
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,129,260.65	-1,304,936.38

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	31,547,663.23	33,822,296.09
第二层次	56,475,034.04	76,176,646.60
第三层次	-	-
合计	88,022,697.27	109,998,942.69

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、卖出回购金融资产款和其他金融负债，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

截至资产负债表日，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	27,494,532.19	29.53
	其中：股票	27,494,532.19	29.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	60,528,165.08	65.02
	其中：债券	60,528,165.08	65.02
	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	-	-
	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	4,082,790.94	4.39
8	其他各项资产	991,857.61	1.07
9	合计	93,097,345.82	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 9,433,292.51 元，占资产净值比例为 10.75%。

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	1,729,597.00	1.97
C	制造业	11,415,416.12	13.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,745,416.00	1.99
E	建筑业	570,605.00	0.65
F	批发和零售业	265,680.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	396,231.40	0.45

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	590,072.96	0.67
J	金融业	415,166.20	0.47
K	房地产业	115,062.00	0.13
L	租赁和商务服务业	229,335.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	35,841.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	552,817.00	0.63
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	18,061,239.68	20.57

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	1,428,380.71	1.63
原材料	355,205.92	0.40
工业	2,608,600.97	2.97
非日常生活消费品	583,330.29	0.66
日常消费品	13,014.82	0.01
医疗保健	134,273.48	0.15
金融	2,450,663.52	2.79
信息技术	603,295.18	0.69
通信服务	350,231.82	0.40
公用事业	715,865.12	0.82
房地产	190,430.68	0.22
合计	9,433,292.51	10.75

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	00883	中国海洋石油	34,000	695,097.09	0.79
2	01398	工商银行	164,000	694,512.97	0.79

3	00386	中国石油化工股份	104,000	480,288.72	0.55
3	600028	中国石化	12,200	77,104.00	0.09
4	300308	中际旭创	3,780	521,186.40	0.59
5	01288	农业银行	157,000	478,591.14	0.55
6	00995	安徽皖通高速公路	50,000	426,677.90	0.49
6	600012	皖通高速	3,000	41,910.00	0.05
7	300750	宁德时代	2,400	432,072.00	0.49
8	002126	银轮股份	24,200	421,322.00	0.48
9	300502	新易盛	3,900	411,645.00	0.47
10	600150	中国船舶	9,900	403,029.00	0.46
11	600487	亨通光电	24,500	386,365.00	0.44
12	01800	中国交通建设	91,000	386,200.54	0.44
13	01070	T C L 电子	63,000	363,392.67	0.41
14	601138	工业富联	12,800	350,720.00	0.40
15	01658	邮储银行	82,000	342,766.10	0.39
16	300433	蓝思科技	18,200	332,150.00	0.38
17	03899	中集安瑞科	46,000	330,408.41	0.38
18	03618	重庆农村商业银行	94,000	328,583.05	0.37
19	02601	中国太保	16,000	278,330.89	0.32
19	601601	中国太保	1,400	39,004.00	0.04
20	00941	中国移动	4,500	316,243.62	0.36
21	002463	沪电股份	8,400	306,600.00	0.35
22	00998	中信银行	62,000	283,496.66	0.32
23	002322	理工能科	17,000	272,340.00	0.31
24	600795	国电电力	44,700	267,753.00	0.31
25	601001	晋控煤业	16,100	265,972.00	0.30
26	000333	美的集团	4,100	264,450.00	0.30
27	603129	春风动力	1,800	256,212.00	0.29
28	601899	紫金矿业	13,900	244,223.00	0.28
29	600803	新奥股份	11,700	243,360.00	0.28
30	01919	中远海控	17,500	218,176.15	0.25
30	601919	中远海控	1,500	23,235.00	0.03
31	600483	福能股份	20,700	241,362.00	0.27
32	000552	甘肃能化	69,200	240,124.00	0.27
33	01186	中国铁建	46,500	236,388.68	0.27
34	300573	兴齐眼药	1,400	229,600.00	0.26
35	601033	永兴股份	14,100	228,279.00	0.26
36	03969	中国通号	72,000	220,795.55	0.25
37	600323	瀚蓝环境	10,500	219,450.00	0.25
38	00564	郑煤机	18,200	177,735.30	0.20
38	601717	郑煤机	2,800	41,440.00	0.05

39	01071	华电国际电力股份	50,000	215,848.82	0.25
40	00038	第一拖拉机股份	32,000	215,830.57	0.25
41	01816	中广核电力	68,000	213,494.11	0.24
42	000400	许继电气	6,200	213,342.00	0.24
43	00598	中国外运	61,000	211,559.22	0.24
44	600522	中天科技	13,100	207,635.00	0.24
45	01378	中国宏桥	19,000	204,969.67	0.23
46	603283	赛腾股份	2,600	198,640.00	0.23
47	601668	中国建筑	36,300	192,753.00	0.22
48	300476	胜宏科技	5,900	190,334.00	0.22
49	000543	皖能电力	21,200	187,620.00	0.21
50	02039	中集集团	27,800	178,622.43	0.20
51	00135	昆仑能源	24,000	177,424.99	0.20
52	002027	分众传媒	29,100	176,346.00	0.20
53	002353	杰瑞股份	5,000	175,400.00	0.20
54	00921	海信家电	4,000	93,823.50	0.11
54	000921	海信家电	2,400	77,376.00	0.09
55	600575	淮河能源	42,700	166,103.00	0.19
56	601702	华峰铝业	8,800	160,688.00	0.18
57	002588	史丹利	21,200	159,636.00	0.18
58	600900	长江电力	5,500	159,060.00	0.18
59	002429	兆驰股份	32,500	156,325.00	0.18
60	06869	长飞光纤光缆	21,500	152,075.31	0.17
61	00546	阜丰集团	31,000	150,236.25	0.17
62	600098	广州发展	23,400	149,760.00	0.17
63	300628	亿联网络	3,900	143,403.00	0.16
64	601918	新集能源	14,300	139,425.00	0.16
65	002273	水晶光电	8,200	139,236.00	0.16
66	301004	嘉益股份	1,500	136,500.00	0.16
67	603871	嘉友国际	7,660	135,505.40	0.15
68	01052	越秀交通基建	36,000	133,397.31	0.15
69	00857	中国石油股份	18,000	129,783.10	0.15
70	603993	洛阳钼业	15,100	128,350.00	0.15
71	002452	长高电新	15,500	128,340.00	0.15
72	000090	天健集团	31,600	127,032.00	0.14
73	601117	中国化学	15,400	126,896.00	0.14
74	000338	潍柴动力	7,800	126,672.00	0.14
75	01585	雅迪控股	14,000	126,114.12	0.14
76	00148	建滔集团	7,500	125,812.94	0.14
77	002252	上海莱士	16,000	125,120.00	0.14
78	01093	石药集团	22,000	124,891.13	0.14
79	001286	陕西能源	10,800	124,524.00	0.14
80	02883	中海油田服务	18,000	123,211.80	0.14

81	300181	佐力药业	8,000	120,960.00	0.14
82	603067	振华股份	10,200	118,932.00	0.14
83	688093	世华科技	6,367	115,688.39	0.13
84	000902	新洋丰	9,600	113,952.00	0.13
85	002001	新和成	5,900	113,280.00	0.13
86	300360	炬华科技	6,400	108,800.00	0.12
87	002851	麦格米特	4,200	108,528.00	0.12
88	603556	海兴电力	2,300	107,709.00	0.12
89	600546	山煤国际	7,300	106,726.00	0.12
90	002922	伊戈尔	4,800	104,928.00	0.12
91	00123	越秀地产	21,000	97,748.03	0.11
92	01193	华润燃气	3,900	97,351.01	0.11
93	300274	阳光电源	1,560	96,766.80	0.11
94	000682	东方电子	8,500	93,840.00	0.11
95	00688	中国海外发展	7,500	92,682.65	0.11
96	601028	玉龙股份	7,400	92,500.00	0.11
97	00285	比亚迪电子	2,500	88,986.30	0.10
98	002540	亚太科技	16,600	87,814.00	0.10
99	300760	迈瑞医疗	300	87,273.00	0.10
100	00144	招商局港口	8,000	84,842.73	0.10
101	300679	电连技术	2,100	84,483.00	0.10
102	601168	西部矿业	4,700	84,365.00	0.10
103	002130	沃尔核材	5,900	83,308.00	0.09
104	601577	长沙银行	9,800	80,164.00	0.09
105	688169	石头科技	200	78,520.00	0.09
106	300627	华测导航	2,600	77,610.00	0.09
107	000598	兴蓉环境	10,200	76,704.00	0.09
108	603986	兆易创新	800	76,496.00	0.09
109	000630	铜陵有色	21,000	75,810.00	0.09
110	688401	路维光电	2,874	75,298.80	0.09
111	600710	苏美达	9,200	74,980.00	0.09
112	600497	驰宏锌锗	13,300	71,022.00	0.08
113	300910	瑞丰新材	1,600	69,952.00	0.08
114	603279	景津装备	3,100	67,239.00	0.08
115	300979	华利集团	1,100	66,935.00	0.08
116	002422	科伦药业	2,200	66,726.00	0.08
117	600048	保利发展	6,800	59,568.00	0.07
118	002332	仙琚制药	5,100	58,191.00	0.07
119	002790	瑞尔特	6,400	57,792.00	0.07
120	600114	东睦股份	4,000	57,560.00	0.07
121	603699	纽威股份	3,200	54,784.00	0.06
122	000807	云铝股份	4,000	54,040.00	0.06
123	002532	天山铝业	6,400	51,904.00	0.06
124	300926	博俊科技	2,590	51,851.80	0.06

125	300482	万孚生物	2,100	51,240.00	0.06
126	002833	弘亚数控	2,700	49,248.00	0.06
127	002600	领益智造	6,900	49,128.00	0.06
128	002142	宁波银行	2,200	48,532.00	0.06
129	688332	中科蓝讯	818	48,253.82	0.05
130	002938	鹏鼎控股	1,200	47,712.00	0.05
131	600584	长电科技	1,500	47,565.00	0.05
132	002475	立讯精密	1,200	47,172.00	0.05
133	002128	电投能源	2,200	46,420.00	0.05
134	600285	羚锐制药	1,900	45,999.00	0.05
135	300791	仙乐健康	1,820	45,864.00	0.05
136	600886	国投电力	2,400	43,776.00	0.05
137	600970	中材国际	3,600	43,416.00	0.05
138	600660	福耀玻璃	900	43,110.00	0.05
139	000923	河钢资源	2,500	43,050.00	0.05
140	601128	常熟银行	5,660	42,846.20	0.05
141	600426	华鲁恒升	1,600	42,624.00	0.05
142	600406	国电南瑞	1,700	42,432.00	0.05
143	601898	中煤能源	3,400	42,432.00	0.05
144	600008	首创环保	15,300	41,004.00	0.05
145	600312	平高电气	2,100	40,845.00	0.05
146	600023	浙能电力	5,700	40,527.00	0.05
147	002078	太阳纸业	2,900	40,455.00	0.05
148	600968	海油发展	9,700	39,964.00	0.05
149	601939	建设银行	5,400	39,960.00	0.05
150	601088	中国神华	900	39,933.00	0.05
151	002533	金杯电工	4,000	39,800.00	0.05
152	002318	久立特材	1,700	39,661.00	0.05
153	600219	南山铝业	10,300	39,243.00	0.04
154	000885	城发环境	3,200	38,944.00	0.04
155	601600	中国铝业	5,100	38,913.00	0.04
156	002003	伟星股份	3,100	38,905.00	0.04
157	002039	黔源电力	2,200	38,720.00	0.04
158	601225	陕西煤业	1,500	38,655.00	0.04
159	600820	隧道股份	5,900	38,527.00	0.04
160	603393	新天然气	1,100	38,214.00	0.04
161	002096	易普力	3,200	38,080.00	0.04
162	601997	贵阳银行	7,200	37,944.00	0.04
163	601058	赛轮轮胎	2,700	37,800.00	0.04
164	605090	九丰能源	1,300	37,700.00	0.04
165	603508	思维列控	2,000	37,500.00	0.04
166	600007	中国国贸	1,700	37,332.00	0.04
167	002064	华峰化学	5,200	37,284.00	0.04
168	300017	网宿科技	4,700	37,130.00	0.04

169	600750	江中药业	1,600	36,976.00	0.04
170	600901	江苏金租	7,300	36,865.00	0.04
171	300795	米奥会展	2,100	36,813.00	0.04
172	000887	中鼎股份	3,000	36,720.00	0.04
173	601127	赛力斯	400	36,448.00	0.04
174	600298	安琪酵母	1,300	36,309.00	0.04
175	600887	伊利股份	1,400	36,176.00	0.04
176	301109	军信股份	2,400	35,880.00	0.04
177	603357	设计总院	3,900	35,841.00	0.04
178	601666	平煤股份	3,200	35,840.00	0.04
179	601677	明泰铝业	3,100	35,836.00	0.04
180	002911	佛燃能源	3,900	35,646.00	0.04
181	300092	科新机电	3,300	35,508.00	0.04
182	605319	无锡振华	2,000	35,400.00	0.04
183	600566	济川药业	1,100	34,881.00	0.04
184	000848	承德露露	4,400	34,584.00	0.04
185	603055	台华新材	3,400	34,442.00	0.04
186	603611	诺力股份	2,000	34,080.00	0.04
187	600123	兰花科创	3,800	34,010.00	0.04
188	000498	山东路桥	6,500	33,995.00	0.04
189	00700	腾讯控股	100	33,988.20	0.04
190	600422	昆药集团	1,900	33,877.00	0.04
191	300349	金卡智能	2,800	33,376.00	0.04
192	002091	江苏国泰	4,900	33,369.00	0.04
193	002264	新华都	6,500	33,215.00	0.04
194	002311	海大集团	700	32,935.00	0.04
195	600479	千金药业	3,200	32,544.00	0.04
196	603369	今世缘	700	32,340.00	0.04
197	601689	拓普集团	600	32,166.00	0.04
198	002697	红旗连锁	6,900	31,947.00	0.04
199	002687	乔治白	7,300	30,660.00	0.03
200	688789	宏华数科	283	30,507.40	0.03
201	300815	玉禾田	2,600	30,264.00	0.03
202	002757	南兴股份	2,500	30,125.00	0.03
203	300770	新媒股份	900	30,042.00	0.03
204	603040	新坐标	1,500	29,895.00	0.03
205	600398	海澜之家	3,200	29,568.00	0.03
206	600018	上港集团	5,100	29,478.00	0.03
207	002327	富安娜	2,800	28,140.00	0.03
208	002461	珠江啤酒	3,700	27,454.00	0.03
209	300415	伊之密	1,200	24,936.00	0.03
210	688099	晶晨股份	403	23,905.96	0.03
211	301195	北路智控	800	23,792.00	0.03
212	601009	南京银行	2,100	21,819.00	0.02

213	300130	新国都	1,300	21,632.00	0.02
214	06818	中国光大银行	9,000	19,960.31	0.02
215	601838	成都银行	1,300	19,747.00	0.02
216	600461	洪城环境	1,700	19,686.00	0.02
217	603529	爱玛科技	720	19,677.60	0.02
218	601126	四方股份	1,000	19,220.00	0.02
219	603228	景旺电子	600	19,080.00	0.02
220	603236	移远通信	400	18,692.00	0.02
221	300457	赢合科技	1,000	17,830.00	0.02
222	000786	北新建材	600	17,796.00	0.02
223	02328	中国财险	2,000	17,705.99	0.02
224	600036	招商银行	500	17,095.00	0.02
225	600971	恒源煤电	1,400	16,716.00	0.02
226	001323	慕思股份	573	16,485.21	0.02
227	000906	浙商中拓	2,400	16,176.00	0.02
228	601166	兴业银行	900	15,858.00	0.02
229	00981	中芯国际	1,000	15,625.08	0.02
230	600985	淮北矿业	900	15,066.00	0.02
231	603298	杭叉集团	760	14,926.40	0.02
232	688408	中信博	158	14,548.64	0.02
233	000012	南玻 A	2,800	14,112.00	0.02
234	301198	喜悦智行	1,700	13,617.00	0.02
235	300470	中密控股	400	13,524.00	0.02
236	002043	兔宝宝	1,300	13,481.00	0.02
237	301009	可靠股份	1,800	13,446.00	0.02
238	301088	戎美股份	1,200	13,440.00	0.02
239	600237	铜峰电子	2,500	13,050.00	0.01
240	00220	统一企业中国	2,000	13,014.82	0.01
241	600348	华阳股份	1,300	12,948.00	0.01
242	603010	万盛股份	1,400	12,614.00	0.01
243	002762	金发拉比	2,500	12,550.00	0.01
244	301101	明月镜片	556	12,421.04	0.01
245	601318	中国平安	300	12,408.00	0.01
246	002222	福晶科技	550	12,391.50	0.01
247	300453	三鑫医疗	1,900	12,141.00	0.01
248	603917	合力科技	1,100	11,902.00	0.01
249	02688	新奥能源	200	11,746.19	0.01
250	002695	煌上煌	1,800	11,682.00	0.01
251	600089	特变电工	800	11,096.00	0.01
252	603368	柳药集团	600	10,500.00	0.01
253	300073	当升科技	300	10,293.00	0.01
254	002032	苏泊尔	200	10,020.00	0.01
255	600064	南京高科	1,600	9,712.00	0.01
256	603816	顾家家居	300	9,687.00	0.01

257	000895	双汇发展	400	9,508.00	0.01
258	01513	丽珠医药	400	9,382.35	0.01
259	002737	葵花药业	400	9,352.00	0.01
260	600729	重庆百货	400	8,944.00	0.01
261	01618	中国中冶	6,000	8,761.73	0.01
262	603355	莱克电气	400	8,640.00	0.01
263	600325	华发股份	1,300	8,450.00	0.01
264	600248	陕建股份	2,200	7,986.00	0.01
265	000932	华菱钢铁	1,700	7,531.00	0.01
266	601699	潞安环能	400	7,252.00	0.01
267	603995	甬金股份	400	7,008.00	0.01
268	603301	振德医疗	300	6,258.00	0.01
269	603757	大元泵业	300	5,730.00	0.01
270	06881	中国银河	1,500	5,599.29	0.01
271	601231	环旭电子	300	4,815.00	0.01
272	002847	盐津铺子	100	4,277.00	0.00
273	300121	阳谷华泰	400	3,120.00	0.00
274	601788	光大证券	200	2,924.00	0.00
275	002674	兴业科技	200	2,044.00	0.00
276	603876	鼎胜新材	180	1,668.60	0.00
277	03958	东方证券	400	1,117.12	0.00
278	688026	洁特生物	7	69.72	0.00

注：中国石化、皖通高速、中国太保、中远海控、郑煤机、海信家电同时在 A+H 股上市，合并计算其公允价值参与排序。

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	300750	宁德时代	895,533.00	0.78
2	300274	阳光电源	827,849.00	0.72
3	01658	邮储银行	768,073.12	0.67
4	600023	浙能电力	756,829.00	0.66
5	01398	工商银行	683,489.25	0.60
6	601138	工业富联	659,742.00	0.58
7	00883	中国海洋石油	646,039.29	0.56
8	000858	五粮液	627,156.00	0.55
9	601077	渝农商行	626,958.00	0.55
10	02601	中国太保	623,086.59	0.54
11	603129	春风动力	608,533.00	0.53

12	000338	潍柴动力	599,963.00	0.52
13	002452	长高电新	596,916.00	0.52
14	600919	江苏银行	580,835.00	0.51
15	03899	中集安瑞科	562,707.28	0.49
16	601028	玉龙股份	555,589.73	0.48
17	000034	神州数码	542,590.94	0.47
18	000333	美的集团	530,232.00	0.46
19	300857	协创数据	525,913.00	0.46
20	600900	长江电力	514,947.00	0.45

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	000034	神州数码	1,013,959.00	0.88
2	600519	贵州茅台	996,777.00	0.87
3	300130	新国都	945,937.00	0.83
4	600919	江苏银行	902,049.00	0.79
5	000921	海信家电	874,184.00	0.76
6	601138	工业富联	845,684.00	0.74
7	300274	阳光电源	831,515.00	0.73
8	600900	长江电力	776,693.00	0.68
9	600023	浙能电力	743,822.00	0.65
10	000338	潍柴动力	683,435.71	0.60
11	300592	华凯易佰	661,901.00	0.58
12	000858	五粮液	628,271.00	0.55
13	600941	中国移动	627,731.00	0.55
14	601077	渝农商行	616,362.00	0.54
15	002452	长高电新	605,190.00	0.53
16	000700	模塑科技	596,581.00	0.52
17	600422	昆药集团	589,678.00	0.51
18	601601	中国太保	577,182.00	0.50
19	300857	协创数据	561,197.00	0.49
20	000100	TCL 科技	557,630.00	0.49

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	97,204,319.20
---------------	---------------

卖出股票的收入（成交）总额	102,124,577.04
---------------	----------------

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	4,916,751.29	5.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	32,481,647.54	37.00
	其中：政策性金融债	32,481,647.54	37.00
4	企业债券	4,283,596.72	4.88
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,053,131.04	4.62
8	同业存单	-	-
9	其他	14,793,038.49	16.85
10	合计	60,528,165.08	68.95

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	190210	19 国开 10	200,000	21,548,000.00	24.55
2	190215	19 国开 15	100,000	10,933,647.54	12.45
3	231601	24 湖南 01	85,000	8,713,652.74	9.93
4	198952	24 安徽 13	60,000	6,079,385.75	6.93
5	019740	24 国债 09	49,000	4,916,751.29	5.60

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。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。符合既定投资政策及投资目标。

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，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。

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	353,203.68
2	应收清算款	424,033.28
3	应收股利	214,620.65

4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	991,857.61

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	113042	上银转债	1,327,706.56	1.51
2	113052	兴业转债	999,931.28	1.14
3	113050	南银转债	724,881.84	0.83
4	128125	华阳转债	399,386.49	0.45
5	127024	盈峰转债	243,731.25	0.28
6	123113	仙乐转债	195,800.00	0.22
7	111003	聚合转债	81,895.29	0.09
8	113065	齐鲁转债	79,798.33	0.09

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
海富通富泽混合	690	93,698.41	2,345,216.25	3.63%	62,306,684.62	96.37%

A						
海富通富泽混合 C	222	73,629.68	-	-	16,345,788.26	100.00 %
合计	912	88,813.26	2,345,216.25	2.90%	78,652,472.88	97.10%

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	海富通富泽混合 A	414,192.32	0.6406%
	海富通富泽混合 C	111.01	0.0007%
	合计	414,303.33	0.5115%

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	海富通富泽混合 A	10~50
	海富通富泽混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通富泽混合 A	10~50
	海富通富泽混合 C	0
	合计	10~50

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
基金合同生效日(2020年6月22日)基金份额总额	570,462,800.39	332,998,748.80
本报告期期初基金份额总额	90,332,196.23	19,359,883.70
本报告期基金总申购份额	115,534.57	1,724.47
减：本报告期基金总赎回份额	25,795,829.93	3,015,819.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	64,651,900.87	16,345,788.26

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

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	199,328,896.24	100.00%	147,526.95	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	29,105,641.62	100.00%	481,625,000.00	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泽混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通富泽混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通富泽混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通富泽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它文件

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