

海富通强化回报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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	5
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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	11
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）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
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	45
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	45
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通强化回报混合型证券投资基金
基金简称	海富通强化回报混合
基金主代码	519007
交易代码	519007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年5月25日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	238,692,588.35 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	每年超越三年期定期存款（税前）加权平均收益率。
投资策略	本基金认为，灵活而有纪律的资产配置策略和精选证券是获得回报的主要来源，而收益管理和风险管理是保证回报的重要手段。因此，本基金将运用资产配置、精选证券和收益管理三个层次的投资策略，实现基金的投资目标。
业绩比较基准	三年期银行定期存款(税前)加权平均收益率
风险收益特征	追求每年高于一定正回报的投资品种。属于适度风险、适中收益的混合型基金，其长期的预期收益和风险高于债券基金，低于股票基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	张姗
	联系电话	021-38650788	400-61-95555
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		40088-40099	400-61-95555
传真		021-33830166	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区	深圳市深南大道7088号招商银

	陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	杨仓兵	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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）
本期已实现收益	-3,473,155.95
本期利润	6,243,834.83
加权平均基金份额本期利润	0.0260
本期加权平均净值利润率	2.78%
本期基金份额净值增长率	2.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-13,033,829.85
期末可供分配基金份额利润	-0.0546
期末基金资产净值	225,658,758.50
期末基金份额净值	0.9454
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	166.49%

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

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	-3.57%	0.81%	0.23%	0.01%	-3.80%	0.80%
过去三个月	1.06%	0.85%	0.69%	0.01%	0.37%	0.84%
过去六个月	2.83%	1.07%	1.38%	0.01%	1.45%	1.06%
过去一年	-5.38%	0.88%	2.80%	0.01%	-8.18%	0.87%
过去三年	-2.64%	0.60%	8.55%	0.01%	-11.19%	0.59%
自基金合同生效起至今	166.49%	1.15%	86.05%	0.01%	80.44%	1.14%

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

海富通强化回报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

（2006年5月25日至2024年6月30日）



注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期满至今，本基

金投资组合均达到本基金合同第十二条（二）、（七）规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

§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		
江勇	本基金的基金经理；混合资产投资部总经	2023-01-19	-	13 年	经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师，资产管理部

	理。				<p>研究员、交易员、投资经理。2017年6月加入海富通基金管理有限公司，现任混合资产投资部总经理。2018年7月至2023年7月任海富通上证非周期ETF联接基金经理。2018年7月至2022年5月任海富通上证周期ETF、海富通上证周期ETF联接、海富通上证非周期ETF、海富通中证100指数(LOF)基金经理。2018年7月至2020年3月任海富通中证内地低碳指数（现海富通中证500增强）基金经理。2020年8月至2022年5月兼任海富通中证长三角领先ETF联接基金经理。2020年8月至2023年3月兼任海富通中证长三角领先ETF基金经理。2020年10月起兼任海富通稳固收益债券的基金经理。2021年2月起兼任海富通欣睿混合基金经理。2021年6月起兼任海富通策略收益债券基金经理。2021年6月至2023年10月兼任海富通中证港股通科技ETF基金经理。2021年9月起兼任海富通欣利混合基金经理。2023年1月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2023年11月起兼任海富通添利收益一年持有期债券基金经理。2023年12月起兼任海富通悦享一年持有期混合基金经理。2024年3月起兼任海富通欣盈6个月持有期混合基金经理。2024年6月起兼任海富通红利优选混合基金经理。</p>
陶敏	本基金的基金经理	2018-04-18	-	18年	<p>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。</p>

					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。
赵莹洲	本基金的基金经理助理	2023-08-15	-	6 年	东北财经大学工商管理硕士,持有基金从业人员资格证书。历任中钢集团辽宁有限公司大宗原材料进出口市场分析师、上海钢联电子商务股份有限公司分析师、天风证券股份有限公司研究所钢铁行业研究员。2020 年 11 月加入海富通基金管理有限公司,任固定收益分析师。2022 年 5 月起兼任海富通稳健添利债券和海富通纯债债券基金经理助理。2023 年 8 月起兼任海富通强化回报混合、海富通欣利混合、海富通策略收益债券、海富通欣睿混合、海富通稳固收益债券的基金经理助理。

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间交易的样本，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

宏观上来看，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。

从 A 股市场看，上半年主要指数多以下跌为主，上证指数为-0.25%，沪深 300 为 0.89%，中证 800 为-1.76%，创业板指为-10.99%。行业板块方面，根据中信一级行业分类，表现靠前的板块是银行、煤炭、石油石化、家电、电力及公用事业，跌幅较大的板块是消费者服务、计算机、商品零售、传媒、医药。风格上看，大市值高股息策略表现较佳。

从债券市场来看，上半年走出牛市行情。一季度虽然基本面利空债券市场，但由于货币政策宽松，债券维持牛市行情。二季度央行多次提示利率风险，但基本面有所走弱，收益率呈现震荡下行的趋势。截止 2024 年 6 月 28 日，10 年期国债到期收益率为 2.21%。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；随着资产荒持续演绎，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。可转债方面，2024 年上半年中证转债指数下跌 0.07%。市场分化明显，转债指数表现介于 A 股大盘指数与小盘指数之间。

报告期间，本组合权益仓位保持相对稳定；权益配置上，组合整体偏价值风格，行业分布较为均衡，持仓个股较为分散。风格上，组合偏红利、价值的风格在上半年有所获益，但组合全市场选股偏小市值的风格在上半年有所受损。在权益市场风险偏好较低背景下，从波动和潜在收益来看价值仍是较优选择，预计组合权益部分的投资未来仍将偏向于价值风格。债券方面，以绝对收益角度出发，配置了一部分低价且信用风险较低的可转债；转债在今年 2 月、6 月经历了两轮冲击，都带来了阶段性较好的配置机会；6 月，在正股退市以及信用的共同担忧下，整体市场显著下跌，在这轮调整中，组合增配了部分低价且信用风险较低的可转债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 2.83%，同期业绩比较基准收益率为 1.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观上看，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，随着经济增长在全球范围内均相对乏力，我们将更加关注上市公司的分红回报和长期竞争力。

债券市场，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。可转债市场，中小盘股票偏弱叠加信用冲击，转债市场的估值跌至历史低位，目前来看，整体转债市场的纯债溢价率水平跌到了历史低位，部分信用风险较低的转债自身未来的票息收入已经提供了充分的安全垫，在下行风险有限的背景下又提供了一定的权益市场潜在弹性，属于确定性较强的一类资产。

未来，本基金将继续在控制风险的基础上，积极寻找市场的结构性机会，力争跑赢市场。个股层面，在注重安全边际的前提下着力挖掘具备收益弹性的标的；行业上，将继续维持相对均衡的配置。同时，本基金也将利用动态的仓位调整来控制回撤风险。固定收益部分，将视市场状况配置一定比例的具备绝对收益的转债，以增厚组合收益。

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及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

- 一、本基金本报告期内无应分配的收益。
- 二、已实施的利润分配：无。
- 三、不存在应分配但尚未实施的利润。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：海富通强化回报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	3,573,696.92	2,031,823.48
结算备付金		482,521.52	286,258.17
存出保证金		33,935.73	25,123.16
交易性金融资产	6.4.7.2	223,082,322.50	219,915,089.91
其中：股票投资		170,047,504.91	174,393,108.27
基金投资		-	-
债券投资		53,034,817.59	45,521,981.64
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	1,400,000.00	1,199,865.55
应收清算款		-	1,263,960.03
应收股利		-	-
应收申购款		30,078.59	494.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		228,602,555.26	224,722,614.36
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		2,407,625.03	1,221,155.15
应付赎回款		40,353.61	97,855.10
应付管理人报酬		226,035.68	226,665.23
应付托管费		37,672.62	37,777.55
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,038.40	787.36
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	231,071.42	276,666.40
负债合计		2,943,796.76	1,860,906.79
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	238,692,588.35	242,389,896.63
未分配利润	6.4.7.8	-13,033,829.85	-19,528,189.06
净资产合计		225,658,758.50	222,861,707.57
负债和净资产总计		228,602,555.26	224,722,614.36

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9454 元，基金份额总额 238,692,588.35 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通强化回报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		7,920,383.19	9,272,597.00
1.利息收入		24,634.10	312,817.89
其中：存款利息收入	6.4.7.9	7,802.56	39,681.02
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		16,831.54	273,136.87
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,823,922.87	9,783,619.39
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,331,858.79	5,369,057.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	460,811.80	1,767,195.00
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	3,047,124.12	2,647,367.14
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	9,716,990.78	-843,096.58
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	2,681.18	19,256.30
减：二、营业总支出		1,676,548.36	2,337,786.41
1. 管理人报酬		1,340,661.47	1,908,947.31
2. 托管费		223,443.58	318,157.91
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		7,842.40	824.20
其中：卖出回购金融资产支出		7,842.40	824.20
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		650.55	2,537.57
8. 其他费用	6.4.7.17	103,950.36	107,319.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,243,834.83	6,934,810.59

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,243,834.83	6,934,810.59
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,243,834.83	6,934,810.59

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通强化回报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	242,389,896.63	-	-19,528,189.06	222,861,707.57
二、本期期初净资产	242,389,896.63	-	-19,528,189.06	222,861,707.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,697,308.28	-	6,494,359.21	2,797,050.93
（一）、综合收益总额	-	-	6,243,834.83	6,243,834.83
（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）	-3,697,308.28	-	250,524.38	-3,446,783.90
其中：1.基金申购款	2,529,495.50	-	-85,074.73	2,444,420.77
2.基金赎回款	-6,226,803.78	-	335,599.11	-5,891,204.67
（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	238,692,588.35	-	-13,033,829.85	225,658,758.50
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	284,570,691.26	-	-7,891,439.49	276,679,251.77
二、本期期初净资产	284,570,691.26	-	-7,891,439.49	276,679,251.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-37,383,827.88	-	7,705,902.13	-29,677,925.75
（一）、综合收益总额	-	-	6,934,810.59	6,934,810.59
（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）	-37,383,827.88	-	771,091.54	-36,612,736.34
其中：1.基金申购款	10,756,044.49	-	109,068.49	10,865,112.98
2.基金赎回款	-48,139,872.37	-	662,023.05	-47,477,849.32
（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	247,186,863.38	-	-185,537.36	247,001,326.02

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

海富通强化回报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”)证监基金字[2006]第 58 号《关于同意海富通强化回报混合型证券投资基金募集的批复》核准，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《海富通强化回报混合型证券投资基金基金合同》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 2,563,360,601.57 元，已经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 63 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通强化回报混合型证券投资基金基金合同》于 2006 年 5 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为

2,564,312,627.02 份基金份额，其中认购资金利息折合 952,025.45 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通强化回报混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行上市的股票、存托凭证、债券、货币市场金融工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的资产配置：股票资产及存托凭证 0%-95%，权证投资 0%-3%，债券 5%-95%；并保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款(税前)加权平均收益率。

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

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通强化回报混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[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：

(1)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，产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)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。

(3)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。

(4)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。

(5)本基金的城市维护建设税、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	3,573,696.92
等于：本金	3,573,445.09
加：应计利息	251.83
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	3,573,696.92

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	174,958,883.43	-	170,047,504.91	-4,911,378.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	319,676.39	53,034,817.59	373,894.97
	银行间市场	-	-	-
	合计	319,676.39	53,034,817.59	373,894.97
		52,341,246.23		
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	227,300,129.66	319,676.39	223,082,322.50	-4,537,483.55

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	1,400,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,400,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

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	72.53
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	146,463.53
其中：交易所市场	146,463.53
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	231,071.42

6.4.7.7 实收基金

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	242,389,896.63	242,389,896.63
本期申购	2,529,495.50	2,529,495.50
本期赎回（以“-”号填列）	-6,226,803.78	-6,226,803.78

本期末	238,692,588.35	238,692,588.35
-----	----------------	----------------

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

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	34,166,564.21	-53,694,753.27	-19,528,189.06
本期期初	34,166,564.21	-53,694,753.27	-19,528,189.06
本期利润	-3,473,155.95	9,716,990.78	6,243,834.83
本期基金份额交易产生的变动数	-428,268.68	678,793.06	250,524.38
其中：基金申购款	289,229.14	-374,303.87	-85,074.73
基金赎回款	-717,497.82	1,053,096.93	335,599.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,265,139.58	-43,298,969.43	-13,033,829.85

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	3,222.45
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	4,367.72
其他	212.39
合计	7,802.56

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	226,432,302.81
减：卖出股票成本总额	231,294,313.52
减：交易费用	469,848.08
买卖股票差价收入	-5,331,858.79

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	300,535.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	160,276.58
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	460,811.80

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	23,661,676.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	23,255,286.86
减：应计利息总额	244,382.35
减：交易费用	1,730.27
买卖债券差价收入	160,276.58

6.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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	3,047,124.12
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	3,047,124.12

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	9,716,990.78
——股票投资	8,862,592.77
——债券投资	854,398.01
——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	9,716,990.78

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	2,669.94
基金转换费收入	11.24
合计	2,681.18

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	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	815.00
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	18,000.00
合计	103,950.36

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露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、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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	1,340,661.47	1,908,947.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	573,013.05	821,334.32
应支付基金管理人的净管理费	767,648.42	1,087,612.99

注：海富通强化回报混合型证券投资基金的管理费率由 1.50% 下调至 1.20%，自 2023 年 8 月 26 日起执行新的管理费率。

2023 年 8 月 26 日之前,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 1.50% 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 x1.50%/当年天数。

2023 年 8 月 26 日(含)之后,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 1.20% 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:日管理人报酬=前一日基金资产净值 x1.20%/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	223,443.58	318,157.91

注:海富通强化回报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 x0.25%/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 x0.20%/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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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
招商银行	3,573,696.92	3,222.45	5,848,808.47	18,688.80

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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月	新股锁定	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月	新股锁定	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
30156	达利	2023-1	6个月	新股	8.90	16.97	576	5,126.	9,774.	-

6	凯普	2-22		锁定				40	72	
60334	龙旗	2024-0	6 个月	新股	26.00	37.49	118	3,068.	4,423.	-
1	科技	2-23		锁定				00	82	

注：[301538]骏鼎达于 2024 年 3 月 13 日中签新股锁定流通受限数量 107 股，成本 5,972.74 元；于 2024 年 5 月 22 日送股，数量 43 股。因此总数量 150 股，总成本 5,972.74 元。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

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

本基金是一只混合型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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以上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“风险和收益相匹配”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系统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，将风险控制可在可承受的范围内。

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 18.42%（2023 年 12 月 31 日：15.50%）。

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	11,458,203.06	8,645,002.74
合计	11,458,203.06	8,645,002.74

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	9,721,420.33	17,329,681.87
AAA 以下	31,855,194.20	17,217,409.90
未评级	-	2,329,887.13
合计	41,576,614.53	36,876,978.90

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。

6.4.13.3 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时间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该比例限制)。

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。

本基金的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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

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	3,573,696.92	-	-	-	3,573,696.92
结算备付金	482,521.52	-	-	-	482,521.52
存出保证金	33,935.73	-	-	-	33,935.73
交易性金融资产	11,652,059.49	39,218,233.86	2,164,524.24	170,047,504.91	223,082,322.5

					0
买入返售金融资产	1,400,000.00	-	-	-	1,400,000.00
应收申购款	-	-	-	30,078.59	30,078.59
资产总计	17,142,213.66	39,218,233.86	2,164,524.24	170,077,583.50	228,602,555.26
负债					
应付清算款	-	-	-	2,407,625.03	2,407,625.03
应付赎回款	-	-	-	40,353.61	40,353.61
应付管理人报酬	-	-	-	226,035.68	226,035.68
应付托管费	-	-	-	37,672.62	37,672.62
应交税费	-	-	-	1,038.40	1,038.40
其他负债	-	-	-	231,071.42	231,071.42
负债总计	-	-	-	2,943,796.76	2,943,796.76
利率敏感度缺口	17,142,213.66	39,218,233.86	2,164,524.24	167,133,786.74	225,658,758.50
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	2,031,823.48	-	-	-	2,031,823.48
结算备付金	286,258.17	-	-	-	286,258.17
存出保证金	25,123.16	-	-	-	25,123.16
交易性金融资产	16,619,629.50	27,070,364.65	1,831,987.49	174,393,108.27	219,915,089.91
买入返售金融资产	1,199,865.55	-	-	-	1,199,865.55
应收清算款	-	-	-	1,263,960.03	1,263,960.03
应收申购款	-	-	-	494.06	494.06
资产总计	20,162,699.86	27,070,364.65	1,831,987.49	175,657,562.36	224,722,614.36
负债					
应付清算款	-	-	-	1,221,155.15	1,221,155.15
应付赎回款	-	-	-	97,855.10	97,855.10
应付管理人报酬	-	-	-	226,665.23	226,665.23
应付托管费	-	-	-	37,777.55	37,777.55

应交税费	-	-	-	787.36	787.36
其他负债	-	-	-	276,666.40	276,666.40
负债总计	-	-	-	1,860,906.79	1,860,906.79
利率敏感度缺口	20,162,699.86	27,070,364.65	1,831,987.49	173,796,655.57	222,861,707.57

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	-305,454.61	-248,374.22
	市场利率下降 25 个基点	308,653.75	251,019.11

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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或银行间同业市场交易的股票和债券，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，采用“自上而下”的策略，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。本基金投资组合中股票资产及存托凭证 0%-95%、债券资产 5%-95%、权证投资 0%-3%；并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日

在一年以内的政府债券。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	170,047,504.91	75.36	174,393,108.27	78.25
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	170,047,504.91	75.36	174,393,108.27	78.25

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%	8,820,464.23	7,460,016.52
2.业绩比较基准下降 5%	-8,820,464.23	-7,460,016.52	

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的层次，由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决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：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	211,587,111.36	203,411,178.60
第二层次	11,458,203.06	16,316,027.25
第三层次	37,008.08	187,884.06
合计	223,082,322.50	219,915,089.91

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债券，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，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

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买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，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	170,047,504.91	74.39
	其中：股票	170,047,504.91	74.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	53,034,817.59	23.20
	其中：债券	53,034,817.59	23.20
	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	1,400,000.00	0.61
	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	4,056,218.44	1.77
8	其他各项资产	64,014.32	0.03
9	合计	228,602,555.26	100.00

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	4,010,746.00	1.78
C	制造业	104,607,447.29	46.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,291,324.00	5.45
E	建筑业	12,089,029.00	5.36
F	批发和零售业	3,961,393.80	1.76
G	交通运输、仓储和邮政业	5,066,199.00	2.25

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,533,905.30	5.11
J	金融业	8,443,479.00	3.74
K	房地产业	1,137,924.00	0.50
L	租赁和商务服务业	2,419.12	0.00
M	科学研究和技术服务业	2,032,102.40	0.90
N	水利、环境和公共设施管理业	4,871,536.00	2.16
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	170,047,504.91	75.36

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	600522	中天科技	239,600	3,797,660.00	1.68
2	600795	国电电力	552,400	3,308,876.00	1.47
3	600803	新奥股份	151,600	3,153,280.00	1.40
4	002353	杰瑞股份	89,300	3,132,644.00	1.39
5	600323	瀚蓝环境	149,600	3,126,640.00	1.39
6	600970	中材国际	253,500	3,057,210.00	1.35
7	000333	美的集团	42,800	2,760,600.00	1.22
8	000090	天健集团	681,100	2,738,022.00	1.21
9	600487	亨通光电	170,560	2,689,731.20	1.19
10	600941	中国移动	24,300	2,612,250.00	1.16
11	601577	长沙银行	299,300	2,448,274.00	1.08
12	600497	驰宏锌锗	405,900	2,167,506.00	0.96
13	002322	理工能科	133,500	2,138,670.00	0.95
14	002236	大华股份	137,600	2,127,296.00	0.94
15	601717	郑煤机	141,100	2,088,280.00	0.93
16	603368	柳药集团	117,900	2,063,250.00	0.91

17	605090	九丰能源	66,800	1,937,200.00	0.86
18	605183	确成股份	124,500	1,924,770.00	0.85
19	601668	中国建筑	360,500	1,914,255.00	0.85
20	300396	迪瑞医疗	92,700	1,882,737.00	0.83
21	605507	国邦医药	109,200	1,818,180.00	0.81
22	603816	顾家家居	56,100	1,811,469.00	0.80
23	002984	森麒麟	75,140	1,810,122.60	0.80
24	600079	人福医药	103,400	1,775,378.00	0.79
25	688332	中科蓝讯	29,368	1,732,418.32	0.77
26	002483	润邦股份	380,400	1,715,604.00	0.76
27	002035	华帝股份	273,800	1,705,774.00	0.76
28	000902	新洋丰	141,400	1,678,418.00	0.74
29	688106	金宏气体	95,628	1,675,402.56	0.74
30	002139	拓邦股份	156,600	1,663,092.00	0.74
31	603279	景津装备	75,900	1,646,271.00	0.73
32	002025	航天电器	35,200	1,632,576.00	0.72
33	000682	东方电子	146,400	1,616,256.00	0.72
34	601658	邮储银行	312,100	1,582,347.00	0.70
35	300996	普联软件	106,800	1,566,756.00	0.69
36	002452	长高电新	187,400	1,551,672.00	0.69
37	002831	裕同科技	58,800	1,504,692.00	0.67
38	688093	世华科技	82,501	1,499,043.17	0.66
39	002478	常宝股份	297,200	1,480,056.00	0.66
40	601669	中国电建	262,300	1,466,257.00	0.65
41	002705	新宝股份	102,600	1,443,582.00	0.64
42	600987	航民股份	199,900	1,411,294.00	0.63
43	002011	盾安环境	143,500	1,410,605.00	0.63
44	603055	台华新材	135,800	1,375,654.00	0.61
45	000063	中兴通讯	49,100	1,373,327.00	0.61
46	000933	神火股份	66,800	1,351,364.00	0.60
47	002142	宁波银行	60,700	1,339,042.00	0.59
48	002226	江南化工	297,800	1,334,144.00	0.59
49	300682	朗新集团	155,600	1,324,156.00	0.59
50	002540	亚太科技	242,800	1,284,412.00	0.57
51	600820	隧道股份	194,900	1,272,697.00	0.56
52	601688	华泰证券	102,000	1,263,780.00	0.56
53	601233	桐昆股份	78,700	1,256,052.00	0.56
54	600035	楚天高速	291,200	1,249,248.00	0.55
55	002532	天山铝业	151,700	1,230,287.00	0.55
56	603889	新澳股份	156,600	1,212,084.00	0.54
57	600027	华电国际	174,500	1,211,030.00	0.54
58	000923	河钢资源	69,000	1,188,180.00	0.53
59	688257	新锐股份	76,811	1,177,512.63	0.52
60	000543	皖能电力	131,400	1,162,890.00	0.52

61	000885	城发环境	95,000	1,156,150.00	0.51
62	301096	百诚医药	19,900	1,155,792.00	0.51
63	600048	保利发展	129,900	1,137,924.00	0.50
64	300130	新国都	68,300	1,136,512.00	0.50
65	000661	长春高新	12,200	1,119,594.00	0.50
66	000960	锡业股份	71,400	1,105,986.00	0.49
67	600548	深高速	103,800	1,103,394.00	0.49
68	600426	华鲁恒升	40,300	1,073,592.00	0.48
69	600861	北京人力	62,900	1,026,528.00	0.45
70	300274	阳光电源	16,240	1,007,367.20	0.45
71	601126	四方股份	50,300	966,766.00	0.43
72	601872	招商轮船	113,100	955,695.00	0.42
73	601390	中国中铁	145,900	951,268.00	0.42
74	603227	雪峰科技	149,100	924,420.00	0.41
75	002851	麦格米特	35,200	909,568.00	0.40
76	002947	恒铭达	25,800	908,160.00	0.40
77	600961	株冶集团	94,800	894,912.00	0.40
78	600309	万华化学	11,000	889,460.00	0.39
79	300938	信测标准	44,080	876,310.40	0.39
80	603599	广信股份	71,300	864,869.00	0.38
81	002541	鸿路钢构	49,800	845,106.00	0.37
82	688016	心脉医疗	8,197	803,715.85	0.36
83	600131	国网信通	47,400	799,638.00	0.35
84	300638	广和通	46,600	796,860.00	0.35
85	000708	中信特钢	57,500	780,275.00	0.35
86	688401	路维光电	29,477	772,297.40	0.34
87	600887	伊利股份	29,800	770,032.00	0.34
88	002126	银轮股份	44,000	766,040.00	0.34
89	601222	林洋能源	122,000	764,940.00	0.34
90	601336	新华保险	25,100	753,753.00	0.33
91	601208	东材科技	100,400	728,904.00	0.32
92	300443	金雷股份	47,500	728,175.00	0.32
93	300820	英杰电气	18,300	719,922.00	0.32
94	300514	友讯达	47,200	714,136.00	0.32
95	300092	科新机电	61,900	666,044.00	0.30
96	000700	模塑科技	124,500	653,625.00	0.29
97	603658	安图生物	14,100	649,587.00	0.29
98	688408	中信博	7,031	647,414.48	0.29
99	002138	顺络电子	23,500	645,310.00	0.29
100	603209	兴通股份	44,500	615,880.00	0.27
101	600486	扬农化工	10,900	615,305.00	0.27
102	000811	冰轮环境	63,400	611,810.00	0.27
103	688777	中控技术	16,179	609,948.30	0.27
104	601298	青岛港	62,700	599,412.00	0.27

105	600885	宏发股份	21,600	597,888.00	0.26
106	002539	云图控股	82,600	588,938.00	0.26
107	300003	乐普医疗	39,600	587,664.00	0.26
108	688789	宏华数科	5,448	587,294.40	0.26
109	000598	兴蓉环境	77,700	584,304.00	0.26
110	002088	鲁阳节能	47,200	570,648.00	0.25
111	600098	广州发展	88,600	567,040.00	0.25
112	600256	广汇能源	83,800	561,460.00	0.25
113	603087	甘李药业	12,100	560,472.00	0.25
114	300592	华凯易佰	47,060	537,895.80	0.24
115	300811	铂科新材	12,180	534,702.00	0.24
116	300628	亿联网络	14,500	533,165.00	0.24
117	605319	无锡振华	29,600	523,920.00	0.23
118	600502	安徽建工	121,400	522,020.00	0.23
119	300371	汇中股份	61,400	513,918.00	0.23
120	601058	赛轮轮胎	36,500	511,000.00	0.23
121	002001	新和成	26,200	503,040.00	0.22
122	002790	瑞尔特	54,900	495,747.00	0.22
123	000807	云铝股份	34,800	470,148.00	0.21
124	002352	顺丰控股	13,000	463,970.00	0.21
125	603886	元祖股份	30,600	460,836.00	0.20
126	002533	金杯电工	46,300	460,685.00	0.20
127	600114	东睦股份	31,700	456,163.00	0.20
128	301367	怡和嘉业	7,280	452,816.00	0.20
129	601838	成都银行	28,900	438,991.00	0.19
130	601601	中国太保	15,200	423,472.00	0.19
131	600141	兴发集团	21,600	412,128.00	0.18
132	000739	普洛药业	30,300	411,171.00	0.18
133	002517	恺英网络	41,500	396,325.00	0.18
134	001308	康冠科技	17,500	393,750.00	0.17
135	003012	东鹏控股	60,600	370,266.00	0.16
136	600874	创业环保	65,600	366,704.00	0.16
137	300910	瑞丰新材	8,300	362,876.00	0.16
138	000963	华东医药	12,000	333,720.00	0.15
139	002993	奥海科技	8,900	331,080.00	0.15
140	300791	仙乐健康	13,130	330,876.00	0.15
141	002078	太阳纸业	21,900	305,505.00	0.14
142	603508	思维列控	15,800	296,250.00	0.13
143	002380	科远智慧	16,000	292,800.00	0.13
144	002273	水晶光电	17,100	290,358.00	0.13
145	300286	安科瑞	11,600	251,024.00	0.11
146	002275	桂林三金	19,100	237,031.00	0.11
147	300408	三环集团	7,300	213,087.00	0.09
148	600150	中国船舶	5,200	211,692.00	0.09

149	603067	振华股份	18,100	211,046.00	0.09
150	601166	兴业银行	11,000	193,820.00	0.09
151	688128	中国电研	10,843	186,608.03	0.08
152	603416	信捷电气	6,500	185,770.00	0.08
153	603596	伯特利	4,760	185,164.00	0.08
154	000887	中鼎股份	15,000	183,600.00	0.08
155	002096	易普力	15,400	183,260.00	0.08
156	688301	奕瑞科技	1,590	183,215.70	0.08
157	600054	黄山旅游	16,000	179,520.00	0.08
158	603588	高能环境	28,500	178,980.00	0.08
159	300815	玉禾田	14,900	173,436.00	0.08
160	600866	星湖科技	30,600	168,912.00	0.07
161	603027	千禾味业	12,700	168,910.00	0.07
162	603929	亚翔集成	7,000	167,300.00	0.07
163	603551	奥普科技	16,700	163,660.00	0.07
164	600587	新华医疗	9,810	154,409.40	0.07
165	600862	中航高科	5,300	99,534.00	0.04
166	600584	长电科技	3,000	95,130.00	0.04
167	601898	中煤能源	7,500	93,600.00	0.04
168	301195	北路智控	3,100	92,194.00	0.04
169	300687	赛意信息	6,100	84,912.00	0.04
170	603056	德邦股份	6,000	78,600.00	0.03
171	000568	泸州老窖	500	71,745.00	0.03
172	301109	军信股份	3,800	56,810.00	0.03
173	600760	中航沈飞	1,200	48,120.00	0.02
174	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.01
175	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
176	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
177	002475	立讯精密	200	7,862.00	0.00
178	603341	龙旗科技	118	4,423.82	0.00
179	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00
180	603004	鼎龙科技	137	2,322.15	0.00
181	001358	兴欣新材	6	123.12	0.00

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	000090	天健集团	4,293,939.00	1.93
2	600256	广汇能源	3,145,625.00	1.41

3	600548	深高速	2,932,909.06	1.32
4	000543	皖能电力	2,902,077.00	1.30
5	600323	瀚蓝环境	2,742,315.00	1.23
6	002236	大华股份	2,591,586.00	1.16
7	601577	长沙银行	2,495,422.00	1.12
8	601921	浙版传媒	2,494,292.00	1.12
9	600941	中国移动	2,439,042.00	1.09
10	600487	亨通光电	2,393,368.20	1.07
11	002483	润邦股份	2,246,348.00	1.01
12	600027	华电国际	2,195,918.00	0.99
13	300360	炬华科技	2,169,797.00	0.97
14	600998	九州通	2,114,742.42	0.95
15	600502	安徽建工	2,098,891.00	0.94
16	002452	长高电新	2,095,684.00	0.94
17	600522	中天科技	2,091,260.00	0.94
18	603279	景津装备	1,957,885.00	0.88
19	688106	金宏气体	1,897,497.48	0.85
20	002154	报喜鸟	1,896,963.00	0.85

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	000400	许继电气	3,306,964.00	1.48
2	603508	思维列控	3,230,188.00	1.45
3	601921	浙版传媒	2,787,234.00	1.25
4	000543	皖能电力	2,709,144.80	1.22
5	600373	中文传媒	2,545,631.00	1.14
6	600256	广汇能源	2,484,977.00	1.12
7	002043	兔宝宝	2,466,835.00	1.11
8	600064	南京高科	2,463,531.60	1.11
9	603357	设计总院	2,449,696.00	1.10
10	600998	九州通	2,418,798.87	1.09
11	603885	吉祥航空	2,400,391.00	1.08
12	601601	中国太保	2,337,967.00	1.05
13	002352	顺丰控股	2,290,369.00	1.03
14	600548	深高速	2,185,479.00	0.98
15	002557	洽洽食品	2,128,081.00	0.95
16	601211	国泰君安	2,109,896.00	0.95
17	601872	招商轮船	2,095,000.00	0.94

18	600027	华电国际	2,048,467.00	0.92
19	603507	振江股份	2,008,480.00	0.90
20	002154	报喜鸟	2,007,082.00	0.90

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	218,086,117.39
卖出股票的收入（成交）总额	226,432,302.81

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	11,458,203.06	5.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	41,576,614.53	18.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	53,034,817.59	23.50

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	019709	23 国债 16	86,000	8,734,289.59	3.87
2	113050	南银转债	31,640	3,968,038.28	1.76
3	110079	杭银转债	21,380	2,582,003.44	1.14
4	113584	家悦转债	19,340	2,053,957.81	0.91
5	128134	鸿路转债	15,300	1,638,495.86	0.73

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

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

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 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	33,935.73
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	30,078.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,014.32

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	113050	南银转债	3,968,038.28	1.76
2	110079	杭银转债	2,582,003.44	1.14
3	113584	家悦转债	2,053,957.81	0.91
4	128134	鸿路转债	1,638,495.86	0.73
5	113052	兴业转债	1,547,512.70	0.69
6	113640	苏利转债	1,170,529.23	0.52
7	127088	赫达转债	1,101,267.32	0.49
8	123071	天能转债	1,100,852.61	0.49
9	113644	艾迪转债	1,036,753.93	0.46
10	128071	合兴转债	988,400.29	0.44
11	127024	盈峰转债	936,525.32	0.42
12	123178	花园转债	928,486.64	0.41
13	110073	国投转债	904,883.65	0.40
14	123113	仙乐转债	861,300.00	0.38
15	123126	瑞丰转债	768,093.24	0.34
16	128131	崇达转 2	702,639.62	0.31
17	128116	瑞达转债	680,937.80	0.30
18	113606	荣泰转债	676,332.70	0.30
19	128121	宏川转债	657,808.12	0.29
20	123120	隆华转债	656,825.99	0.29
21	110076	华海转债	624,463.39	0.28
22	113653	永 22 转债	587,353.61	0.26
23	128117	道恩转债	577,234.90	0.26
24	113605	大参转债	549,675.48	0.24
25	113633	科沃转债	544,408.93	0.24
26	128142	新乳转债	528,225.37	0.23
27	123109	昌红转债	525,785.14	0.23

28	123213	天源转债	465,139.38	0.21
29	113657	再 22 转债	460,190.30	0.20
30	123063	大禹转债	459,706.27	0.20
31	110081	闻泰转债	445,960.11	0.20
32	113652	伟 22 转债	441,135.20	0.20
33	123121	帝尔转债	439,257.72	0.19
34	127041	弘亚转债	426,261.79	0.19
35	123165	回天转债	404,154.68	0.18
36	123115	捷捷转债	387,574.66	0.17
37	127070	大中转债	379,633.15	0.17
38	113043	财通转债	367,922.82	0.16
39	113636	甬金转债	351,953.12	0.16
40	123154	火星转债	329,256.10	0.15
41	113650	博 22 转债	300,322.00	0.13
42	127034	绿茵转债	283,051.12	0.13
43	118032	建龙转债	275,740.64	0.12
44	123104	卫宁转债	275,476.27	0.12
45	127052	西子转债	263,323.19	0.12
46	123146	中环转 2	261,639.67	0.12
47	113676	荣 23 转债	256,495.71	0.11
48	123124	晶瑞转 2	225,169.28	0.10
49	110067	华安转债	221,829.86	0.10
50	111014	李子转债	212,264.11	0.09
51	128125	华阳转债	208,943.34	0.09
52	123100	朗科转债	207,645.01	0.09
53	127059	永东转 2	193,673.68	0.09
54	128109	楚江转债	188,405.08	0.08
55	123144	裕兴转债	184,815.07	0.08
56	128066	亚泰转债	175,061.04	0.08
57	127051	博杰转债	174,728.55	0.08
58	113625	江山转债	173,625.21	0.08
59	123180	浙矿转债	166,895.87	0.07
60	123169	正海转债	162,154.32	0.07
61	118038	金宏转债	156,141.27	0.07
62	127017	万青转债	154,997.84	0.07
63	113046	金田转债	152,032.80	0.07
64	123076	强力转债	151,922.05	0.07
65	113632	鹤 21 转债	145,146.57	0.06
66	118028	会通转债	138,332.22	0.06
67	127077	华宏转债	138,109.94	0.06
68	127076	中宠转 2	135,957.96	0.06
69	113624	正川转债	114,996.74	0.05
70	113647	禾丰转债	114,667.77	0.05
71	123093	金陵转债	103,690.60	0.05

72	118009	华锐转债	86,212.27	0.04
73	113048	晶科转债	85,056.16	0.04
74	128105	长集转债	82,165.96	0.04
75	113643	风语转债	75,078.36	0.03
76	127099	盛航转债	68,403.67	0.03
77	113623	凤 21 转债	66,876.93	0.03
78	123211	阳谷转债	66,451.74	0.03
79	127022	恒逸转债	61,325.15	0.03
80	123149	通裕转债	60,590.47	0.03
81	127018	本钢转债	59,038.33	0.03
82	128081	海亮转债	54,252.92	0.02
83	113054	绿动转债	50,705.14	0.02
84	118005	天奈转债	49,944.86	0.02
85	128087	孚日转债	46,577.30	0.02
86	123103	震安转债	42,175.17	0.02
87	118033	华特转债	33,531.53	0.01
88	127062	垒知转债	31,501.68	0.01
89	127025	冀东转债	31,045.79	0.01
90	128138	侨银转债	30,836.88	0.01
91	111009	盛泰转债	28,637.59	0.01
92	123091	长海转债	22,418.93	0.01
93	127026	超声转债	22,362.79	0.01
94	111010	立昂转债	22,134.19	0.01
95	113655	欧 22 转债	21,602.33	0.01
96	118035	国力转债	21,166.16	0.01
97	123214	东宝转债	21,020.05	0.01
98	123179	立高转债	20,440.34	0.01
99	113053	隆 22 转债	20,350.07	0.01
100	132020	19 蓝星 EB	18,795.39	0.01
101	127016	鲁泰转债	18,121.19	0.01
102	127091	科数转债	17,854.81	0.01
103	123212	立中转债	11,750.29	0.01
104	123119	康泰转 2	11,550.93	0.01
105	123158	宙邦转债	11,371.47	0.01
106	113064	东材转债	11,244.88	0.00
107	127044	蒙娜转债	9,810.92	0.00
108	118018	瑞科转债	8,898.79	0.00
109	113659	莱克转债	1,121.65	0.00

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不存在流通受限情况。

§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

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
15,106	15,801.18	13,163,226.89	5.51%	225,529,361.46	94.49%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	700,057.43	0.2933%

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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年5月25日）基金份额总额	2,564,312,627.02
本报告期期初基金份额总额	242,389,896.63
本报告期基金总申购份额	2,529,495.50
减：本报告期基金总赎回份额	6,226,803.78
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	238,692,588.35

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§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

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

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	
中信建投	2	245,178,543.81	55.17%	181,973.66	55.46%	-
华创证券	1	199,223,168.47	44.83%	146,149.63	44.54%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信华南	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

英大证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内基金租用券商交易单元未发生变化。

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
中信建投	19,101,838.88	41.52%	261,295,000.00	93.52%	-	-
华创证券	26,901,870.32	58.48%	18,100,000.00	6.48%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信华南	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

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上海陆享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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-06
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳前海微众银行股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-14

§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强化回报混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通强化回报混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通强化回报混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通强化回报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