

海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

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：二〇二四年七月十九日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通悦享一年持有期混合
基金主代码	019752
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2023 年 12 月 12 日
报告期末基金份额总额	458,671,995.10 份
投资目标	本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现组合资产长期稳健的增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略（定性分析、定量分析、港股通标的股票的投资策略）；3、债券投资组合策略（利率策略、信用策略、收益率曲线策略、杠杆策略）；4、可转换债券及可交换债券投资策略；5、股指期货投资策略；6、国债期货投资策略；7、流通受限证券投资策略；8、股票期权投资策略；9、存托凭证投资策略；10、基金投资策略；11、信用衍生品投资策略；12、资产支持证券投资策略；13、参与融资业务策略。
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。本基金如果投资港股通标的股票，还将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通悦享一年持有期混合 A	海富通悦享一年持有期混合 C
下属两级基金的交易代码	019752	019753
报告期末下属两级基金的份额总额	275,681,837.65 份	182,990,157.45 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	海富通悦享一年持有期混合 A	海富通悦享一年持有期混合 C
1.本期已实现收益	1,423,385.23	1,395,064.09
2.本期利润	1,625,476.61	1,683,112.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.0119	0.0120
4.期末基金资产净值	280,428,601.25	185,731,997.56
5.期末基金份额净值	1.0172	1.0150

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、海富通悦享一年持有期混合 A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.43%	0.13%	0.95%	0.14%	0.48%	-0.01%
过去六个月	2.36%	0.14%	2.42%	0.18%	-0.06%	-0.04%
自基金合同生效起至今	2.72%	0.13%	3.38%	0.17%	-0.66%	-0.04%

2、海富通悦享一年持有期混合 C：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.33%	0.13%	0.95%	0.14%	0.38%	-0.01%
过去六个月	2.16%	0.14%	2.42%	0.18%	-0.26%	-0.04%
自基金合同生效起至今	2.50%	0.13%	3.38%	0.17%	-0.88%	-0.04%

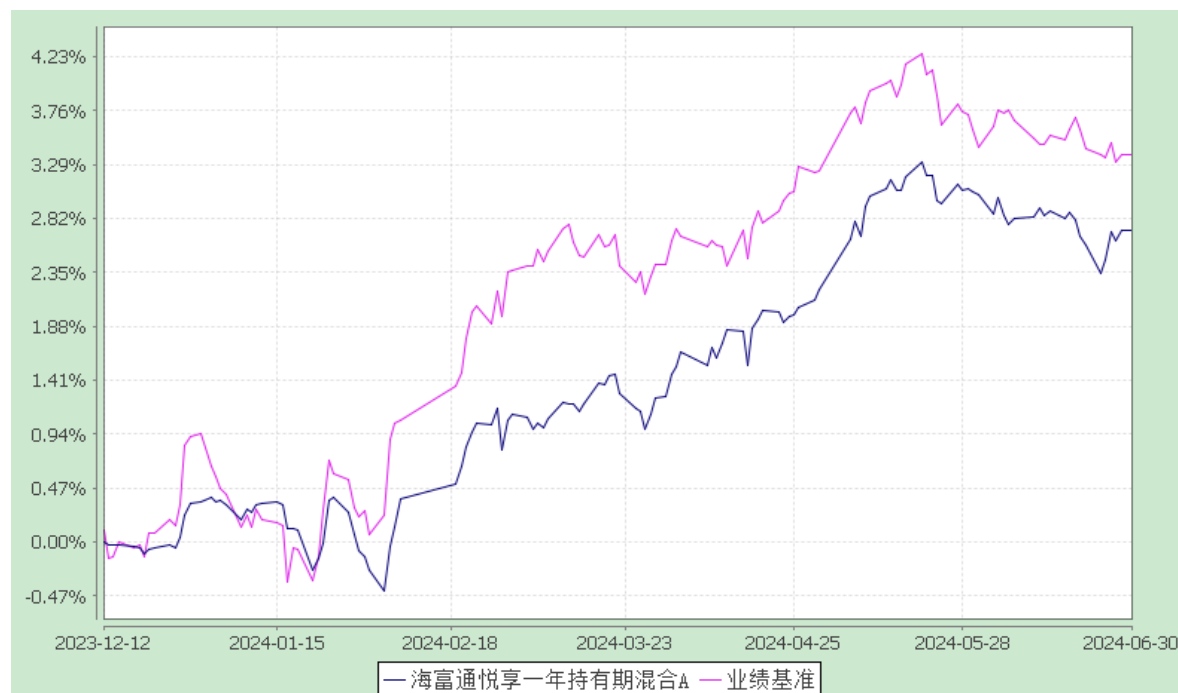
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通悦享一年持有期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

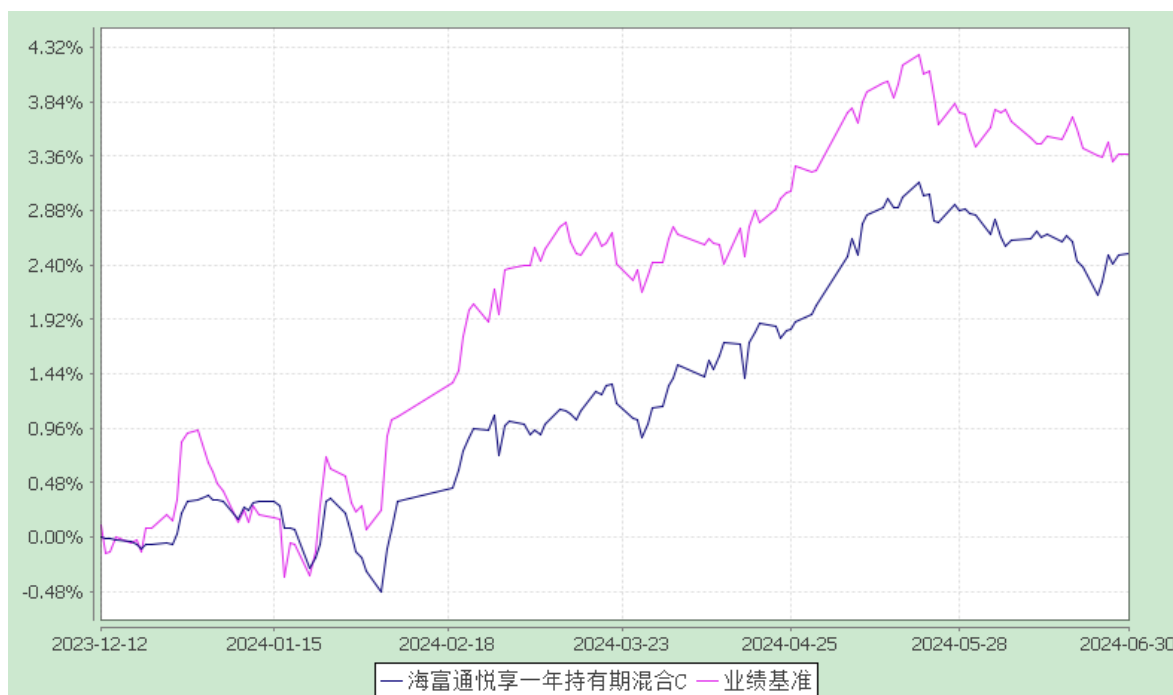
1. 海富通悦享一年持有期混合 A:

(2023 年 12 月 12 日至 2024 年 6 月 30 日)



2. 海富通悦享一年持有期混合 C:

(2023 年 12 月 12 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于2023年12月12日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
江勇	本基金的基金经理；混合资产投资部总经理。	2023-12-12	-	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

				<p>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</p>
--	--	--	--	--

					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。
--	--	--	--	--	---

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遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

权益方面，二季度 A 股市场高位震荡后下跌。沪深 300 指数下跌了 2.14%、中证 500 指数下跌 6.50%、科创 50 指数下跌 6.64%、创业板综指下跌 8.50%、中小综指下跌 6.45%。分行业看，中信一级行业表现靠前的板块是银行、电力及公用事业、交通运输、煤炭、电子，跌幅较大的板块是消费者服务、传媒、商贸零售、计算机、轻工

制造。当前全市场风险偏好降低，类债策略依然是市场的主流预期，高股息率国企密集的行业更受到市场偏爱。

债券方面，二季度国内经济企稳。PMI 重回扩张区间但持续性略有不足。经济数据方面，生产端表现好于需求端；投资方面，制造业与基建维持高增，地产投资跌幅走扩。消费需求偏弱，可选消费与地产后周期消费拖累。出口方面，海外需求旺盛，出口同比增速与贸易顺差回升。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，由于汇率方面压力较大，“资金空转”的问题依然存在，因此总量型货币政策的出台较为谨慎，但月末央行大额投放，呵护关键时点的流动性。财政政策方面，地方债发行略有提速，特别国债稳步发行。流动性方面，除跨月跨季关键节点外，流动性总体维持相对宽松的状态。资金价格方面，二季度 R001 均值为 1.84%，与一季度基本持平；R007 均值为 1.94%，较一季度下行 19bp。对应债市而言，二季度维持牛市行情。4 月，财政部表示支持央行增加国债买卖，提振了市场做多的情绪，各期限收益率均持续下行。但随着央行提示长端利率风险及地产政策陆续出台，10 年期国债收益率有所调整。5-6 月基本面与金融数据偏弱，同时特别国债发行节奏平滑，地方债发行压力不大。在各方利好下债券市场走出牛市行情。全季度来看，10 年期国债到期收益率累计下行 8bp。

可转债方面，二季度中证转债指数上涨 0.75%。二季度行情大概分为三个阶段：4-5 月中旬，在正股行情修复、流动性宽松、纯债资金回归的支撑下，转债平稳上涨。5 月中旬-6 月中旬，权益市场迎来调整，转债跟随权益市场回调逐渐走弱。6 月中旬-6 月底，小微盘风格担忧、信用评级下调、到期券兑付、资金踩踏的担忧等问题叠加引发中低价转债巨震，转债的债底保护暂时失效；后来随着转债信用评级报告的陆续披露，转债市场逐渐企稳。

报告期间，本基金秉承绝对收益的投资思路。权益仓位上，保持相对低位；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，与一季度类似，组合偏红利、价值的风格在二季度有所获益，但组合全市场选股偏小市值的风格在二季度有所受损。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风格仍是较优选择，预计组合权益部分的投资未来仍偏向于价值风格。债券方面，以绝对收益角度出发，主要配置高等级的信用债。同时，转债在 6 月份受到了比较大的冲击，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。目前来看，整体转债市场的纯债溢价率水平跌到了相对历史低位，部分信用风险较低的转债自身未来的票息收入提供了较为充分的安全垫，在下行风险有限的背景下提供了一定的权益市场潜在弹性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通悦享一年持有期混合 A 净值增长率为 1.43%，同期业绩比较基准收益率为 0.95%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.48 个百分点。海富通悦享一年持有期混合 C 净值增长率为 1.33%，同期业绩比较基准收益率为 0.95%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.38 个百分点。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,457,541.10	3.95
	其中：股票	18,457,541.10	3.95
2	基金投资	4,938,674.00	1.06
3	固定收益投资	341,889,619.06	73.18
	其中：债券	341,889,619.06	73.18
	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	83,020,362.80	17.77
	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	8,233,843.98	1.76
8	其他资产	10,665,312.76	2.28
9	合计	467,205,353.70	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2,089,938.64元，占资产净值比例为0.45%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净
----	------	---------	--------

			值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	224,400.00	0.05
C	制造业	9,499,294.16	2.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,347,624.00	0.29
E	建筑业	1,607,133.00	0.34
F	批发和零售业	265,011.40	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	337,411.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,326,659.70	0.28
J	金融业	902,429.00	0.19
K	房地产业	43,800.00	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	263,044.20	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	550,796.00	0.12
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	16,367,602.46	3.51

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值 (人民币)	占基金资产净值比例 (%)
原材料	198,453.14	0.04
非日常生活消费品	149,971.58	0.03
能源	68,998.61	0.01
金融	673,386.26	0.14
工业	672,763.81	0.14
通信服务	105,414.54	0.02
公用事业	43,169.76	0.01
房地产	177,780.94	0.04
合计	2,089,938.64	0.45

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	000333	美的集团	8,300	535,350.00	0.11
2	600323	瀚蓝环境	23,300	486,970.00	0.10
3	002353	杰瑞股份	13,300	466,564.00	0.10
4	600941	中国移动	3,200	344,000.00	0.07
4	00941	中国移动	1,500	105,414.54	0.02
5	00390	中国中铁	73,000	287,156.51	0.06
5	601390	中国中铁	22,000	143,440.00	0.03
6	01336	新华保险	16,600	225,742.27	0.05
6	601336	新华保险	6,500	195,195.00	0.04
7	600522	中天科技	26,200	415,270.00	0.09
8	000090	天健集团	91,500	367,830.00	0.08
9	600803	新奥股份	17,300	359,840.00	0.08
10	600970	中材国际	29,600	356,976.00	0.08

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	24,248,857.76	5.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	157,406,618.38	33.77
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	66,522,455.54	14.27
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	74,075,765.30	15.89
8	同业存单	19,635,922.08	4.21
9	其他	-	-
10	合计	341,889,619.06	73.34

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	242380021	23 建行永续债 02	200,000	21,411,029.51	4.59
2	2128038	21 农业银行永续债 01	200,000	21,218,767.21	4.55
3	2028024	20 中信银行二级	200,000	21,084,760.66	4.52
4	2128021	21 工商银行永续债	200,000	20,782,732.05	4.46

		01			
5	2028037	20 光大银行永续债	100,000	10,663,546.45	2.29

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。国债期货相关投资严格遵循法律法规及中国证监会的规定。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，中国农业银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，中信银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，平安银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚，中国邮政储蓄银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	15,733.96
2	应收证券清算款	8,589,881.58
3	应收股利	32,799.39
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,026,897.83
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10,665,312.76

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113633	科沃转债	7,332,441.08	1.57
2	128134	鸿路转债	2,952,291.11	0.63
3	113605	大参转债	2,927,666.11	0.63
4	113056	重银转债	2,927,313.22	0.63
5	113584	家悦转债	2,677,366.92	0.57
6	113644	艾迪转债	2,596,729.46	0.56
7	127024	盈峰转债	2,573,844.63	0.55
8	128131	崇达转 2	2,549,008.08	0.55

9	113052	兴业转债	2,217,380.08	0.48
10	128071	合兴转债	2,204,143.48	0.47
11	113657	再 22 转债	2,163,894.83	0.46
12	128121	宏川转债	2,081,261.77	0.45
13	128142	新乳转债	2,078,405.13	0.45
14	123071	天能转债	1,856,993.79	0.40
15	128125	华阳转债	1,696,576.41	0.36
16	110076	华海转债	1,557,357.39	0.33
17	113606	荣泰转债	1,537,626.25	0.33
18	113625	江山转债	1,410,704.79	0.30
19	110079	杭银转债	1,328,439.56	0.28
20	113653	永 22 转债	1,287,025.72	0.28
21	110059	浦发转债	1,262,652.98	0.27
22	123113	仙乐转债	1,232,000.00	0.26
23	128117	道恩转债	1,203,312.76	0.26
24	123115	捷捷转债	1,171,582.82	0.25
25	128116	瑞达转债	1,151,058.95	0.25
26	127088	赫达转债	912,160.81	0.20
27	113650	博 22 转债	838,227.50	0.18
28	123120	隆华转债	834,948.29	0.18
29	123104	卫宁转债	814,950.64	0.17
30	123121	帝尔转债	753,661.83	0.16
31	110081	闻泰转债	683,805.50	0.15
32	123169	正海转债	676,724.01	0.15
33	123126	瑞丰转债	656,791.35	0.14
34	127041	弘亚转债	655,060.69	0.14
35	127025	冀东转债	617,811.26	0.13
36	113636	甬金转债	537,611.23	0.12
37	127052	西子转债	514,214.82	0.11
38	123213	天源转债	498,808.99	0.11
39	128066	亚泰转债	492,359.18	0.11
40	123165	回天转债	474,263.15	0.10
41	123063	大禹转债	459,706.27	0.10
42	111014	李子转债	456,367.84	0.10
43	123154	火星转债	412,101.18	0.09
44	113640	苏利转债	409,269.49	0.09
45	123109	昌红转债	402,729.04	0.09
46	127070	大中转债	377,275.18	0.08
47	113050	南银转债	376,236.25	0.08
48	118038	金宏转债	331,242.55	0.07
49	123146	中环转 2	317,705.32	0.07
50	118032	建龙转债	304,713.38	0.07
51	113647	禾丰转债	302,305.93	0.06

52	123124	晶瑞转 2	276,344.11	0.06
53	123103	震安转债	274,138.59	0.06
54	127062	垒知转债	273,014.60	0.06
55	113624	正川转债	268,674.21	0.06
56	113676	荣 23 转债	247,168.59	0.05
57	118005	天奈转债	234,740.86	0.05
58	123100	朗科转债	207,645.01	0.04
59	127059	永东转 2	204,315.09	0.04
60	123180	浙矿转债	198,188.84	0.04
61	127051	博杰转债	196,569.62	0.04
62	113048	晶科转债	189,013.70	0.04
63	127017	万青转债	178,247.51	0.04
64	127099	盛航转债	171,009.16	0.04
65	128105	长集转债	164,331.92	0.04
66	111009	盛泰转债	152,733.81	0.03
67	123178	花园转债	148,557.86	0.03
68	127034	绿茵转债	148,357.83	0.03
69	128109	楚江转债	146,291.01	0.03
70	127077	华宏转债	138,109.94	0.03
71	127076	中宠转 2	135,957.96	0.03
72	123093	金陵转债	126,732.96	0.03
73	128063	未来转债	116,020.27	0.02
74	111010	立昂转债	110,670.96	0.02
75	110093	神马转债	110,503.81	0.02
76	113046	金田转债	110,379.98	0.02
77	123091	长海转债	100,885.19	0.02
78	113632	鹤 21 转债	97,944.43	0.02
79	118010	洁特转债	86,468.92	0.02
80	118009	华锐转债	86,212.27	0.02
81	113054	绿动转债	79,226.77	0.02
82	113542	好客转债	76,039.39	0.02
83	113643	风语转债	75,078.36	0.02
84	118028	会通转债	69,166.11	0.01
85	127016	鲁泰转债	66,821.90	0.01
86	123211	阳谷转债	66,451.74	0.01
87	123149	通裕转债	60,590.47	0.01
88	113655	欧 22 转债	59,406.40	0.01
89	128138	侨银转债	59,389.56	0.01
90	113652	伟 22 转债	56,555.79	0.01
91	128081	海亮转债	54,252.92	0.01
92	127046	百润转债	54,101.37	0.01
93	127022	恒逸转债	51,104.29	0.01
94	128087	孚日转债	46,577.30	0.01

95	118033	华特转债	33,531.53	0.01
96	127026	超声转债	22,362.79	0.00
97	118035	国力转债	21,166.16	0.00
98	123214	东宝转债	21,020.05	0.00
99	123179	立高转债	20,440.34	0.00
100	113053	隆 22 转债	20,350.07	0.00
101	123212	立中转债	11,750.29	0.00
102	123119	康泰转 2	11,550.93	0.00
103	123158	宙邦转债	11,371.47	0.00
104	113064	东材转债	11,244.88	0.00
105	113641	华友转债	10,146.70	0.00
106	127044	蒙娜转债	9,810.92	0.00
107	118018	瑞科转债	8,898.79	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金期末前十名股票未存在流通受限情况。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	515100	景顺长城中证红利低波动100ETF	交易型开放式	3,374,075.00	4,480,771.60	0.96%	否
2	512120	华安中证细分医药ETF	交易型开放式	1,244,300.00	457,902.40	0.10%	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购	-	-

费（元）		
当期交易基金产生的赎回费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,892.68	-
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	378.40	-
当期交易基金产生的交易费（元）	296.94	-
当期交易基金产生的转换费（元）	-	-

注：当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况，根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通悦享一年持有期混合A	海富通悦享一年持有期混合C
本报告期期初基金份额总额	115,664,247.73	130,175,341.89
本报告期基金总申购份额	160,017,589.92	52,814,815.56
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	275,681,837.65	182,990,157.45

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 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”。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

10.2 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

10.3 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

二〇二四年七月十九日