

**海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金**  
**2024 年第 1 季度报告**  
**2024 年 3 月 31 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：二〇二四年四月二十二日

## §1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 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
交易代码	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	245,839,589.62 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	115,664,247.73 份	130,175,341.89 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 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 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	877,511.08	856,634.84
2.本期利润	1,063,677.78	1,065,876.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0092	0.0082
4.期末基金资产净值	117,130,216.29	131,666,788.18
5.期末基金份额净值	1.0127	1.0115

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	0.92%	0.14%	1.46%	0.21%	-0.54%	-0.07%
自基金合同生效起至今	1.27%	0.13%	2.42%	0.20%	-1.15%	-0.07%

#### 2、海富通悦享一年持有期混合 C：

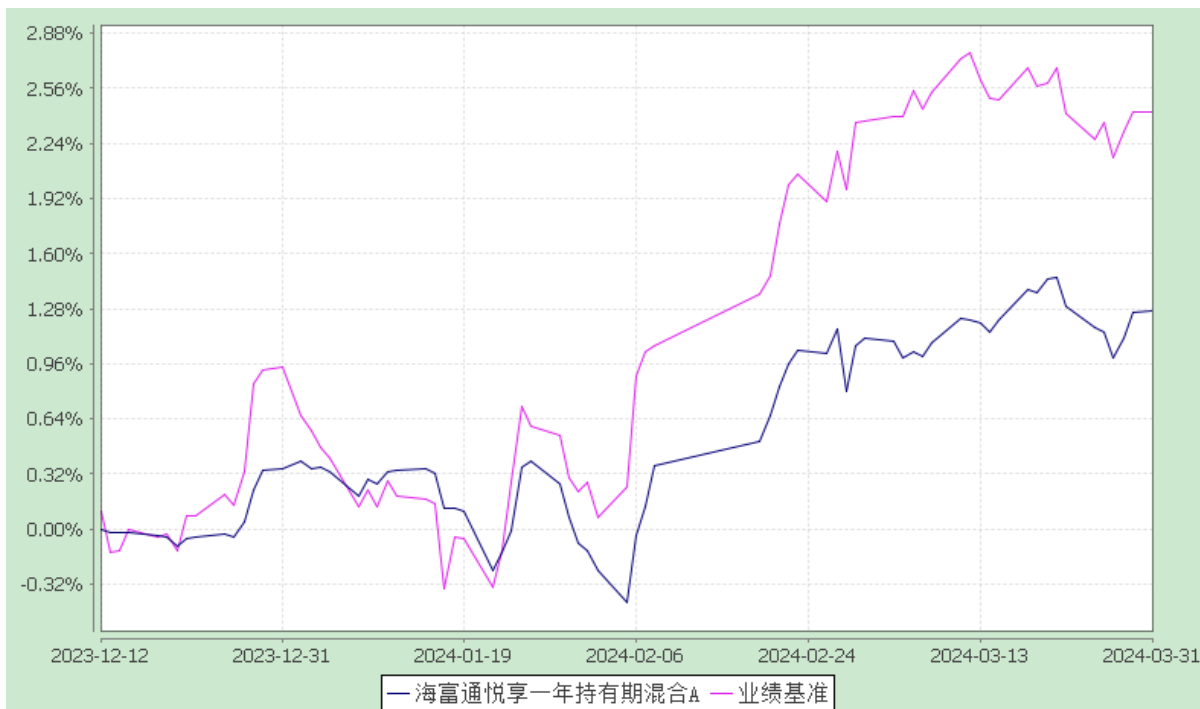
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.82%	0.14%	1.46%	0.21%	-0.64%	-0.07%
自基金合同生效起至今	1.15%	0.13%	2.42%	0.20%	-1.27%	-0.07%

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

海富通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的历史走势对比图

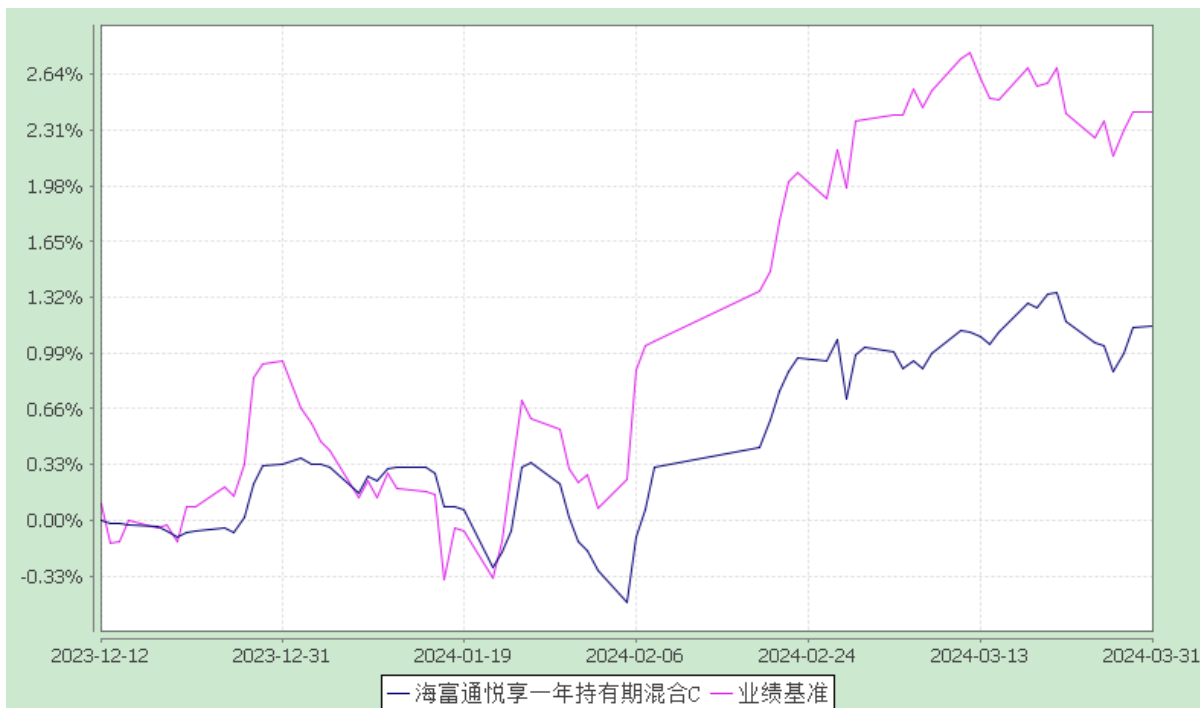
#### 1. 海富通悦享一年持有期混合 A

(2023 年 12 月 12 日至 2024 年 3 月 31 日)



## 2. 海富通悦享一年持有期混合 C

(2023 年 12 月 12 日至 2024 年 3 月 31 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。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

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

					海富通强化回报混合基金经理。2023 年 11 月起兼任海富通添利收益一年持有期债券基金经理。2023 年 12 月起兼任海富通悦享一年持有期混合基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通欣盈 6 个月持有期混合基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度 A 股市场先跌后涨。以万得全 A 指数来看，一季度跌幅 2.85%。分指数看，一季度沪深 300 指数上涨 3.10%，中证 500 指数下跌 2.64%，科创 50 指数下跌 10.48%，创业板综下跌 7.79%，中小综指下跌 5.95%。分行业看，申万一级行业表现靠前的板块是银行、石油石化、煤炭、家用电器、有色金属，跌幅较大的板块是医药生物、计算机、

电子、房地产和社会服务。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，1 季度国内经济企稳回升，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；1-2 月经济数据超预期，制造业与基建投资维持高增，地产投资维持惯性下行。消费增速回落，可选消费与地产后周期消费偏弱。出口方面，由于美国经济韧性较强，出口同比与贸易顺差双双回升。通胀方面，CPI 由于基数效应波动较大；PPI 由于需求偏弱，跌幅略有走扩。货币政策方面，由于汇率方面压力较大，因此在政策利率方面的操作偏谨慎，但 2 月调降 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。流动性方面，由于央行对于“资金空转”问题的关注，流动性总体维持合理充裕的状态，但流动性分层的现象较为突出。资金价格方面，1 季度 R001 与 R007 均值为 1.85% 和 2.13%，较 2023 年 4 季度分别下行 4bp 与 27bp。对应债市而言，1 季度走出牛市行情。1-2 月，受到货币政策宽松、股债跷跷板效应的影响，同时配合城农商行在年初配置超长期品种利率债，债券收益率明显且快速下行。但 3 月往后基本面利空因素增加，债券收益率下行过程中遇到一定阻力，但总体继续维持牛市行情，10 年期国债收益率季末收于 2.29% 的位置。

可转债方面，一季度中证转债指数下跌 0.81%。由于标的成份不同，转债指数走势不及大盘股指，但与小盘股指相比体现出了较强的抗跌性。

报告期间，本基金秉承绝对收益的投资思路。权益仓位保持相对低位；配置上整体偏价值风格，行业分布较为均衡，医药、建筑、公用事业等稳定类行业相对靠前，持仓个股较为分散。风格上，组合偏红利、价值的风格在一季度有所获益，但组合全市场选股偏小市值的风格在一季度有所受损；但因整体相对偏低的权益配置在一季度的较大波动中回撤相对有限。本组合权益部分的投资未来仍将偏向于价值风格，在权益市场低位下，从波动和潜在收益来看价值仍是较优选择。债券方面，从绝对收益角度出发，主要配置高等级的信用债；此外，因看好转债市场未来的表现，在转债年初的调整阶段同时增配了部分低价可转债。年初转债市场的调整，部分信用风险较低的转债自身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。

#### 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 0.92%，同期业绩比较基准收益率为 1.46%，基金净值跑输业绩比较基准 0.54 个百分点。海富通悦享一年持有期混合 C 净值增长率为 0.82%，同期业绩比较基准收益率为 1.46%，基金净值跑输业绩比较基准 0.64 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	16,609,670.92	6.66
	其中：股票	16,609,670.92	6.66
2	基金投资	2,458,511.43	0.99
3	固定收益投资	212,532,690.17	85.17
	其中：债券	212,532,690.17	85.17
	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	1,300,000.00	0.52
	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	16,333,970.81	6.55
8	其他资产	293,199.80	0.12
9	合计	249,528,043.13	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1,734,823.05元，占资产净值比例为0.70%。

### 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	1,025,800.00	0.41
C	制造业	7,685,572.97	3.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,321,998.00	0.53
E	建筑业	1,089,876.00	0.44
F	批发和零售业	574,915.00	0.23

G	交通运输、仓储和邮政业	1,339,562.00	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	416,530.90	0.17
J	金融业	565,619.00	0.23
K	房地产业	143,150.00	0.06
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	315,223.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	114,299.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	117,116.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	165,186.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	14,874,847.87	5.98

### 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	223,232.50	0.09
能源	32,635.80	0.01
金融	638,048.02	0.26
医疗保健	42,607.85	0.02
工业	579,312.65	0.23
信息技术	121,568.36	0.05
房地产	97,417.87	0.04
合计	1,734,823.05	0.70

注：以上分类采用国际通用的具有权威性的行业分类标准。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600548	深高速	46,900	453,523.00	0.18
2	601872	招商轮船	52,900	421,084.00	0.17
3	600803	新奥股份	21,600	418,176.00	0.17
4	00390	中国中铁	73,000	256,109.44	0.10

4	601390	中国中铁	22,000	154,220.00	0.06
5	002353	杰瑞股份	13,300	402,724.00	0.16
6	01336	新华保险	16,600	208,575.40	0.08
6	601336	新华保险	6,500	193,830.00	0.08
7	600027	华电国际	53,300	366,171.00	0.15
8	600970	中材国际	32,400	364,176.00	0.15
9	000333	美的集团	4,600	295,412.00	0.12
10	600522	中天科技	20,900	293,227.00	0.12

#### 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	12,337,421.67	4.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	95,734,226.47	38.48
	其中：政策性金融债	1,224,984.00	0.49
4	企业债券	55,740,964.39	22.40
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	48,720,077.64	19.58
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	212,532,690.17	85.42

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	2128021	21 工商银行 永续债 01	200,000	21,302,303.83	8.56
2	2028037	20 光大银行 永续债	100,000	10,548,049.18	4.24
3	2128038	21 农业银行 永续债 01	100,000	10,444,594.54	4.20
4	2028017	20 农业银行 永续债 01	100,000	10,425,213.11	4.19

5	188406	21 张江 02	100,000	10,391,822.47	4.18
---	--------	----------	---------	---------------	------

## 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，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、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

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

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

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

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	11,787.84
2	应收证券清算款	281,411.96
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	293,199.80

#### 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	113056	重银转债	2,824,226.21	1.14
2	128125	华阳转债	1,954,180.92	0.79
3	113584	家悦转债	1,852,126.31	0.74
4	113633	科沃转债	1,509,650.36	0.61
5	110079	杭银转债	1,451,552.58	0.58
6	113625	江山转债	1,403,405.67	0.56

7	113052	兴业转债	1,374,110.71	0.55
8	113644	艾迪转债	1,305,071.12	0.52
9	113653	永 22 转债	1,297,771.23	0.52
10	123115	捷捷转债	1,250,693.90	0.50
11	110059	浦发转债	1,248,017.06	0.50
12	128134	鸿路转债	1,182,044.07	0.48
13	128116	瑞达转债	1,159,893.98	0.47
14	113606	荣泰转债	1,150,161.05	0.46
15	110076	华海转债	1,081,742.14	0.43
16	128117	道恩转债	1,037,721.62	0.42
17	123121	帝尔转债	1,024,370.61	0.41
18	123113	仙乐转债	1,023,915.21	0.41
19	113658	密卫转债	1,018,067.04	0.41
20	123071	天能转债	991,354.18	0.40
21	127024	盈峰转债	979,676.49	0.39
22	128138	侨银转债	957,558.01	0.38
23	127017	万青转债	890,068.30	0.36
24	113650	博 22 转债	854,855.73	0.34
25	127088	赫达转债	832,954.17	0.33
26	123104	卫宁转债	794,728.22	0.32
27	123106	正丹转债	749,456.75	0.30
28	127041	弘亚转债	736,620.64	0.30
29	123169	正海转债	683,611.38	0.27
30	127025	冀东转债	672,154.56	0.27
31	113636	甬金转债	634,630.65	0.26
32	113050	南银转债	569,824.66	0.23
33	123109	昌红转债	561,612.00	0.23
34	127070	大中转债	534,714.08	0.21
35	127018	本钢转债	518,258.07	0.21
36	113640	苏利转债	498,245.60	0.20
37	123213	天源转债	472,258.13	0.19

38	110081	闻泰转债	453,254.61	0.18
39	113046	金田转债	401,569.39	0.16
40	127086	恒邦转债	385,915.00	0.16
41	128071	合兴转债	376,983.27	0.15
42	123126	瑞丰转债	374,443.65	0.15
43	123146	中环转 2	357,888.90	0.14
44	127034	绿茵转债	355,434.91	0.14
45	123165	回天转债	355,303.26	0.14
46	110064	建工转债	319,707.40	0.13
47	113054	绿动转债	313,008.08	0.13
48	113647	禾丰转债	295,167.56	0.12
49	113624	正川转债	276,349.49	0.11
50	123103	震安转债	276,273.15	0.11
51	113657	再 22 转债	275,323.44	0.11
52	127016	鲁泰转债	255,536.65	0.10
53	127052	西子转债	242,531.27	0.10
54	127062	垒知转债	231,536.14	0.09
55	118005	天奈转债	225,923.12	0.09
56	113652	伟 22 转债	218,403.80	0.09
57	113048	晶科转债	210,003.56	0.08
58	123091	长海转债	206,920.41	0.08
59	123180	浙矿转债	186,498.44	0.07
60	118028	会通转债	181,499.40	0.07
61	113632	鹤 21 转债	137,983.07	0.06
62	123093	金陵转债	137,848.11	0.06
63	127031	洋丰转债	132,991.31	0.05
64	111009	盛泰转债	132,494.58	0.05
65	110093	神马转债	131,068.83	0.05
66	128109	楚江转债	130,949.94	0.05
67	113605	大参转债	127,559.18	0.05
68	128063	未来转债	121,844.66	0.05

69	128066	亚泰转债	121,659.85	0.05
70	118031	天 23 转债	121,441.81	0.05
71	123133	佩蒂转债	117,548.09	0.05
72	113655	欧 22 转债	115,392.11	0.05
73	113542	好客转债	108,318.68	0.04
74	111010	立昂转债	106,751.23	0.04
75	118010	洁特转债	97,373.56	0.04
76	110086	精工转债	93,726.99	0.04
77	127043	川恒转债	85,817.70	0.03
78	113037	紫银转债	79,419.90	0.03
79	127051	博杰转债	65,391.53	0.03
80	128142	新乳转债	63,643.15	0.03
81	123145	药石转债	62,699.51	0.03
82	123119	康泰转 2	58,074.93	0.02
83	118032	建龙转债	50,938.15	0.02
84	127022	恒逸转债	49,979.62	0.02
85	123211	阳谷转债	44,665.23	0.02
86	128135	洽洽转债	22,629.18	0.01
87	111001	山玻转债	21,469.12	0.01
88	128131	崇达转 2	21,415.45	0.01
89	113053	隆 22 转债	20,216.16	0.01
90	123179	立高转债	20,168.38	0.01
91	127061	美锦转债	18,528.67	0.01
92	123154	火星转债	18,513.35	0.01
93	110094	众和转债	12,700.27	0.01
94	127020	中金转债	12,230.89	0.00
95	113042	上银转债	11,091.50	0.00
96	127030	盛虹转债	11,043.29	0.00
97	110082	宏发转债	10,793.97	0.00
98	113638	台 21 转债	10,629.38	0.00
99	128105	长集转债	10,511.37	0.00



100	113641	华友转债	10,280.73	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 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	-	-
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	115,664,247.73	130,175,341.89

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

#### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 119 只公募基金。截至 2024 年 3 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1643 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”。

## 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通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

## 9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

## 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司  
二〇二四年四月二十二日