

海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金  
2024 年中期报告  
2024 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	50
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 本报告期投资基金情况	51
7.13 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	54

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	56
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	56
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.9 其他重大事件 .....	57
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>58</b>
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	海富通欣盈 6 个月持有期混合	
基金主代码	019134	
交易代码	019134	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 3 月 19 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	205,584,723.25 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通欣盈 6 个月持有期混合 A	海富通欣盈 6 个月持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	019134	019135
报告期末下属分级基金的份额总额	108,462,090.23 份	97,122,633.02 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极主动的管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。
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。
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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露	姓名	岳冲	龚小武
	联系电话	021-38650788	021-52629999-212056

负责人	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95561
传真		021-33830166	021-62159217
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	上海市浦东新区银城路167号4楼
邮政编码		200120	200120
法定代表人		杨仓兵	吕家进

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
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3月19日(基金合同生效日)至2024年6月30日)	
	海富通欣盈6个月持有期混合A	海富通欣盈6个月持有期混合C
本期已实现收益	590,328.72	418,232.45
本期利润	653,751.04	474,595.59
加权平均基金份额本期利润	0.0060	0.0049
本期加权平均净值利润率	0.60%	0.49%

本期基金份额净值增长率	0.60%	0.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	海富通欣盈 6 个月持有期混合 A	海富通欣盈 6 个月持有期混合 C
期末可供分配利润	590,346.37	418,562.14
期末可供分配基金份额利润	0.0054	0.0043
期末基金资产净值	109,115,875.66	97,598,145.91
期末基金份额净值	1.0060	1.0049
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	海富通欣盈 6 个月持有期混合 A	海富通欣盈 6 个月持有期混合 C
基金份额累计净值增长率	0.60%	0.49%

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）。

4、本基金合同生效日为 2024 年 3 月 19 日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

### 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

海富通欣盈 6 个月持有期混合 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	-0.19%	0.13%	-0.06%	0.10%	-0.13%	0.03%
过去三个月	0.61%	0.08%	0.95%	0.14%	-0.34%	-0.06%
自基金合同生效起至今	0.60%	0.07%	0.69%	0.14%	-0.09%	-0.07%

海富通欣盈 6 个月持有期混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.22%	0.12%	-0.06%	0.10%	-0.16%	0.02%
过去三个月	0.51%	0.08%	0.95%	0.14%	-0.44%	-0.06%
自基金合同生效起至今	0.49%	0.07%	0.69%	0.14%	-0.20%	-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

海富通欣盈 6 个月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

(2024 年 3 月 19 日至 2024 年 6 月 30 日)

海富通欣盈 6 个月持有期混合 A



海富通欣盈 6 个月持有期混合 C



注：1、本基金合同于 2024 年 3 月 19 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	2024-03-19	-	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

	产投资部总经理。			<p>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>
--	----------	--	--	--

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

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

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，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。预计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。债券方面，以绝对收益角度出发，主要以配置高等级的信用债为主。此外，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，部分个券被错杀，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，海富通欣盈 6 个月持有期混合 A 净值增长率为 0.60%，同期业绩比较基准收益率为 0.69%。海富通欣盈 6 个月持有期混合 C 净值增长率为 0.49%，同期业绩比较基准收益率为 0.69%。

#### 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可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。固定收益部分，仍以持有高等级信用债为主，同时将视市场状况配置一定比例的具备绝对收益的可转债，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

基金收益分配后基金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

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

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格

遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：海富通欣盈 6 个月持有期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
<b>资 产：</b>		
货币资金	6.4.7.1	557,602.91
结算备付金		32,718,942.46
存出保证金		4,003.72
交易性金融资产	6.4.7.2	170,143,464.41
其中：股票投资		1,285,648.37
基金投资		1,793,995.20
债券投资		167,063,820.84
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	3,800,253.16
应收清算款		351,313.02
应收股利		-
应收申购款		200.00
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		207,575,779.68
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>
<b>负 债：</b>		
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		632,795.91
应付赎回款		-
应付管理人报酬		118,645.07
应付托管费		16,949.29
应付销售服务费		32,010.12
应付投资顾问费		-
应交税费		5,145.13
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	56,212.59
负债合计		861,758.11
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.7	205,584,723.25
未分配利润	6.4.7.8	1,129,298.32
净资产合计		206,714,021.57
负债和净资产总计		207,575,779.68

注：1、报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0060 元，C 类基金份额净值 1.0049 元。基金份额总额 205,584,723.25 份，其中 A 类基金份额 108,462,090.23 份，C 类基金份额 97,122,633.02 份。

2、基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		1,759,847.27
1.利息收入		489,077.95
其中：存款利息收入	6.4.7.9	287,951.60
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		201,126.35
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,150,983.86
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,933.87
基金投资收益	6.4.7.11	-72.00
债券投资收益	6.4.7.12	1,145,319.99

资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	1,802.00
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	119,785.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>631,500.64</b>
1. 管理人报酬		406,379.46
2. 托管费		58,054.16
3. 销售服务费		109,616.46
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		1,804.39
8. 其他费用	6.4.7.19	55,646.17
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,128,346.63</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,128,346.63</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>1,128,346.63</b>

注：本财务报表的实际编制期间为 2024 年 03 月 19 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日，上年度可比期间无比较数据。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	205,428,572.38	-	-	205,428,572.3

产				8
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	156,150.87	-	1,129,298.32	1,285,449.19
（一）、综合收益总额	-	-	1,128,346.63	1,128,346.63
（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）	156,150.87	-	951.69	157,102.56
其中：1.基金申购款	156,150.87	-	951.69	157,102.56
2.基金赎回款	-	-	-	-
（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	205,584,723.25	-	1,129,298.32	206,714,021.57

注：本财务报表的实际编制期间为 2024 年 03 月 19 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日，上年度可比期间无比较数据。

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

海富通欣盈 6 个月持有期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[2023] 1738 号《关于准予海富通欣盈 6 个月持有期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《海富通欣盈 6 个月持有期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 205,367,115.02 元。经向中国证监会备案，《海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2024 年 3 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 205,428,572.38 份，A 类基金份额 108,457,240.53 份，C 类基金份

额 96,971,331.85 份，其中认购资金利息折合 A 基金份额 14,400.88 份，认购资金利息折合 C 基金份额 47,056.48 份。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和《海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用及销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用，而不从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，而是从本类别基金财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《海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、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（含可分离交易可转换债券的纯债部分）及其他经中国证监会允许投资的债券）、经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（仅限本基金管理人管理的权益类证券投资基金及全市场的股票型交易型开放式指数证券投资基金，不含香港互认基金、QDII 基金、FOF 基金、可投资基金的非 FOF 基金和货币市场基金）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、股指期货、股票期权、国债期货、信用衍生品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。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金对权益类资产及可转换债券、可交换债券的投资合计占基金资产的 10%-30%（其中，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%）；本基金投资的权益类资产包括股票、存托凭证及权益类证券投资基金。本基金投资的权益类证券投资基金包括股票型基金以及至少满足以下一条标准的混合型基金：（1）基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于 60%；（2）基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 60%。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金投资比例不超过基金资产的 10%；本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：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》、《海富通欣盈 6 个月持有期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 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日止期间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 日的财务状况以及本基金 2024 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2024 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其

他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持

证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为

投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金各类份额默认的收益分配方式是现金分红;本基金不同份额类别基金份额,其分红相互独立、互不影响;投资者不同基金交易账户设置的基金分红相互独立、互不影响;因红利再投所得的份额与原份额适用相同的最短持有期,即红利再投资的基金份额在对应认购/申购份额锁定持有期到期后即可进行赎回或转换转出;若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配;基金收益分配后基金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;同一类别的每一基金份额享有同等分配权;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。在符合法律法规及基金合同约定,并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整,不需召开基金份额持有人大会。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、基金投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

(4)对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布<基金中基金估值业务指引(试行)>的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》，采用如下方法估值：

(a)对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日

的收盘价估值；

(b)对于境内上市开放式基金(LOF)及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

(a)以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与本基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值；

(b)以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(c)如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 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[2014]81号《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[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]127号《财政部国

家税务总局证监会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]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，以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	557,602.91
等于：本金	557,160.95

加：应计利息	441.96
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	557,602.91

#### 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	1,277,391.53	-	1,285,648.37	8,256.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	1,006,957.92		
	市场	103,809,009.36	104,873,945.22	57,977.94
	银行间	603,875.62		
	市场	61,527,074.72	62,189,875.62	58,925.28
合计	165,336,084.08	1,610,833.54	167,063,820.84	116,903.22
资产支持证券	-	-	-	-
基金	1,799,369.80	-	1,793,995.20	-5,374.60
其他	-	-	-	-
合计	168,412,845.41	1,610,833.54	170,143,464.41	119,785.46

#### 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	3,800,253.16	-
银行间市场	-	-
合计	3,800,253.16	-

**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从买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 其他资产**

本基金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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,046.27
其中：交易所市场	846.27
银行间市场	1,200.00
应付利息	-
预提费用	54,166.32
合计	56,212.59

**6.4.7.7 实收基金**

海富通欣盈 6 个月持有期混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	108,457,240.53	108,457,240.53
本期申购	4,849.70	4,849.70

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	108,462,090.23	108,462,090.23

海富通欣盈 6 个月持有期混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	96,971,331.85	96,971,331.85
本期申购	151,301.17	151,301.17
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	97,122,633.02	97,122,633.02

注：1、本基金自 2024 年 2 月 26 日至 2024 年 3 月 15 日期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 205,367,115.02 元，折合为 205,367,115.02 份基金份额（其中 A 类基金份额 108,442,839.65 份，C 类基金份额 96,924,275.37 份）。根据《海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 61,457.36 元在本基金成立后，折合为 61,457.36 份基金份额（其中 A 类基金份额 14,400.88 份，C 类基金份额 47,056.48 份），划入基金份额持有人账户。

2、根据《海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》、《海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》和《海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告》的相关规定，本基金于 2024 年 4 月 30 日开始办理申购业务。

3、本基金对每份基金份额设置 6 个月的最短持有期，即自基金合同生效日（对认购份额而言，下同）、基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）或基金份额转换转入确认日（对转换转入份额而言，下同）起至基金合同生效日、基金份额申购确认日或基金份额转换转入确认日 6 个月后的月度对日止的期间，在每份基金份额的最短持有期到期日前（不含当日），投资者不能申请办理该基金份额的赎回，自每份基金份额的最短持有期到期日起（含当日），投资者可在开放日申请办理该基金份额的赎回。

#### 6.4.7.8 未分配利润

海富通欣盈 6 个月持有期混合 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	590,328.72	63,422.32	653,751.04
本期基金份额交易产生的变动数	17.65	16.74	34.39
其中：基金申购款	17.65	16.74	34.39
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	590,346.37	63,439.06	653,785.43

## 海富通欣盈 6 个月持有期混合 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	418,232.45	56,363.14	474,595.59
本期基金份额交易产生的变动数	329.69	587.61	917.30
其中：基金申购款	329.69	587.61	917.30
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	418,562.14	56,950.75	475,512.89

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,238.99
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	274,698.49
其他	14.12
合计	287,951.60

## 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	54,342.00
减：卖出股票成本总额	49,403.00
减：交易费用	1,005.13

买卖股票差价收入	3,933.87
----------	----------

#### 6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	-
减：卖出/赎回基金成本总额	-
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	72.00
基金投资收益	-72.00

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	874,703.97
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	270,616.02
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	1,145,319.99

##### 6.4.7.12.2 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3月19日（基金合同生效日）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	4,674,555.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,382,438.76
减：应计利息总额	17,841.29
减：交易费用	3,659.19
买卖债券差价收入	270,616.02

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,802.00
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	1,802.00

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日
1.交易性金融资产	119,785.46
——股票投资	8,256.84
——债券投资	116,903.22
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-5,374.60
——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	119,785.46

**6.4.7.17 其他收入**

本基金本报告期无其他收入。

**6.4.7.18 持有基金产生的费用**

项目	本期 2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30 日
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）	216.65
当期持有基金产生的应支付托管费 （元）	43.33

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。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日
审计费用	18,055.44
信息披露费	36,110.88
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,079.85
开户费	400.00
合计	55,646.17

#### 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

截至财务报表报出日，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、登记机构、基金销售机构

兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	1,381,136.53	100.00%

注：基金合同成立于 2024 年 3 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易，基金合同成立于 2024 年 3 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

###### 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3月19日（基金合同生效日）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	890.02	100.00%	846.27	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. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

3. 基金合同成立于 2024 年 3 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

##### 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3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	406,379.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	141,756.49
应支付基金管理人的净管理费	264,622.97

注：1、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扣除所持有的本基金管理人自身管理的基金份额所对应的资产净值后的余额的 0.70% 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=前一日的基金资产净值扣除所持有的本基金管理人自身管理的基金份额所对应的资产净值后的余额 x0.70%/当年天数。

2、基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	58,054.16

注：1、支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有的本基金基金托管人自身托管的基金份额所对应的资产净值后的余额的 0.10% 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=前一日的基金资产净值扣除所持有的本基金基金托管人自身托管的基金份额所对应的资产净值后的余额 x0.10%/当年天数。

2、基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通欣盈 6 个月持有期混合 A	海富通欣盈 6 个月持有期混合 C	合计
兴业银行	-	106,788.18	106,788.18
海通证券	-	1.03	1.03
海富通	-	12.23	12.23
合计	-	106,801.44	106,801.44

注：1、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。

2、基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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

本基金本报告期末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。基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

##### 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

本基金本报告期末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。基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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

份额单位：份

项目	本期 2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	海富通欣盈6个月持有期混合A	海富通欣盈6个月持有期混合C
基金合同生效日（2024年3月19日）持有的基金份额	30,005,400.18	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	30,005,400.18	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	27.66%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定，基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

##### 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金，基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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	
	2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	557,602.91	13,238.99

注：基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券，基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项，基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

##### 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

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

本基金本报告期末无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、债券型基金，低于股票型基金。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 75.39%。基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

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
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	10,208,379.92
合计	10,208,379.92

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债。

3、基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	9,820,028.79
合计	9,820,028.79

注：基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 6.4.13.2.3 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
AAA	84,980,398.55
AAA 以下	45,701,611.67
未评级	16,353,401.91
合计	147,035,412.13

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

- 2、未评级部分为国债及无第三方评级机构评级的债券。
- 3、基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在满足基金合同规定的持有期后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，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%，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流通受限证券。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。

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	557,602.91	-	-	-	557,602.91
结算备付金	32,718,942.46	-	-	-	32,718,942.46
存出保证金	4,003.72	-	-	-	4,003.72
交易性金融资产	31,717,005.24	133,416,233.89	1,930,581.71	3,079,643.57	170,143,464.41
买入返售金融资产	3,800,253.16	-	-	-	3,800,253.16
应收清算款	-	-	-	351,313.02	351,313.02
应收申购款	-	-	-	200.00	200.00

资产总计	68,797,807.49	133,416,233.89	1,930,581.71	3,431,156.59	207,575,779.68
负债					
应付清算款	-	-	-	632,795.91	632,795.91
应付管理人报酬	-	-	-	118,645.07	118,645.07
应付托管费	-	-	-	16,949.29	16,949.29
应付销售服务费	-	-	-	32,010.12	32,010.12
应交税费	-	-	-	5,145.13	5,145.13
其他负债	-	-	-	56,212.59	56,212.59
负债总计	-	-	-	861,758.11	861,758.11
利率敏感度缺口	68,797,807.49	133,416,233.89	1,930,581.71	2,569,398.48	206,714,021.57

注：1. 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。

2. 基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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
	市场利率上升 25 个基点	-854,465.41
	市场利率下降 25 个基点	862,824.57

注：基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,285,648.37	0.62
交易性金融资产—基金投资	1,793,995.20	0.87
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	3,079,643.57	1.49

注：基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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
	1.业绩比较基准上升 5%	100,748.19
	2.业绩比较基准下降 5%	-100,748.19

注：基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

### 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
第一层次	55,660,328.60
第二层次	114,483,135.81
第三层次	-
合计	170,143,464.41

注：基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

##### 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，确定相关股票和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，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。基金合同成立于 2024 年 03 月 19 日，上年度可比期间无比较数据。

##### 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资产和负债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相差很小。

##### 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	1,285,648.37	0.62
	其中：股票	1,285,648.37	0.62
2	基金投资	1,793,995.20	0.86
3	固定收益投资	167,063,820.84	80.48
	其中：债券	167,063,820.84	80.48
	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	3,800,253.16	1.83
	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	33,276,545.37	16.03
8	其他各项资产	355,516.74	0.17
9	合计	207,575,779.68	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	8,736.00	0.00
C	制造业	644,531.37	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	123,353.00	0.06
E	建筑业	189,088.00	0.09

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	167,370.00	0.08
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	152,570.00	0.07
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	1,285,648.37	0.62

### 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	000333	美的集团	5,100	328,950.00	0.16
2	600323	瀚蓝环境	7,300	152,570.00	0.07
3	600941	中国移动	1,400	150,500.00	0.07
4	600970	中材国际	9,900	119,394.00	0.06
5	000543	皖能电力	8,500	75,225.00	0.04
6	688106	金宏气体	3,179	55,696.08	0.03
7	603067	振华股份	4,500	52,470.00	0.03
8	002001	新和成	2,600	49,920.00	0.02
9	601668	中国建筑	9,400	49,914.00	0.02
10	000598	兴蓉环境	6,400	48,128.00	0.02
11	688093	世华科技	2,237	40,646.29	0.02
12	600987	航民股份	5,400	38,124.00	0.02
13	600502	安徽建工	4,600	19,780.00	0.01
14	603508	思维列控	1,000	18,750.00	0.01

15	600131	国网信通	1,000	16,870.00	0.01
16	000063	中兴通讯	600	16,782.00	0.01
17	600961	株冶集团	1,000	9,440.00	0.00
18	600862	中航高科	500	9,390.00	0.00
19	601898	中煤能源	700	8,736.00	0.00
20	300638	广和通	500	8,550.00	0.00
21	600866	星湖科技	1,500	8,280.00	0.00
22	300371	汇中股份	900	7,533.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	330,284.00	0.16
2	600323	瀚蓝环境	148,278.00	0.07
3	600941	中国移动	139,898.00	0.07
4	600970	中材国际	118,270.00	0.06
5	000543	皖能电力	72,714.00	0.04
6	688106	金宏气体	59,937.63	0.03
7	000598	兴蓉环境	49,792.00	0.02
8	603067	振华股份	49,642.00	0.02
9	601668	中国建筑	49,632.00	0.02
10	002001	新和成	49,504.00	0.02
11	601872	招商轮船	49,403.00	0.02
12	688093	世华科技	39,871.90	0.02
13	600987	航民股份	38,626.00	0.02
14	600502	安徽建工	19,846.00	0.01
15	600131	国网信通	19,520.00	0.01
16	603508	思维列控	18,925.00	0.01
17	000063	中兴通讯	16,745.00	0.01
18	600866	星湖科技	9,779.00	0.00
19	600961	株冶集团	9,513.00	0.00
20	600862	中航高科	9,407.00	0.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	601872	招商轮船	54,342.00	0.03

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	1,326,794.53
卖出股票的收入（成交）总额	54,342.00

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	11,220,633.34	5.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	52,369,846.83	25.33
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	41,072,626.85	19.87
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	52,580,685.03	25.44
8	同业存单	9,820,028.79	4.75
9	其他	-	-
10	合计	167,063,820.84	80.82

#### 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	2228011	22 农业银	150,000	15,702,254.10	7.60

		行永续债 01			
2	2028044	20 广发银 行二级 01	100,000	10,570,406.56	5.11
3	2128019	21 中国银 行永续债 01	100,000	10,412,452.60	5.04
4	2128022	21 交通银 行永续债	100,000	10,394,687.12	5.03
5	138618	22 国联 G3	100,000	10,292,244.38	4.98

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金投资于本基金管理人管理的权益类证券投资基金及全市场的股票型交易型开放式指数证券投资基金。本基金投资的权益类证券投资基金包括股票型基金以及至少满足以下一条标准的混合型基金：（1）基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于 60%；（2）基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 60%。根据对当前宏观经济形势的判断，自上而下的选择相对价值较高的基金品种进行投资。基金选择上以长期可持续的超额收益能力作为核心目标，采用定量分析和定性分析相结合的方式，一方面通过量化规则筛选出投资价值相对突出的标的，另一方面通过定性的方式对基金进行二次研判，多维度共同筛选出匹配组合投资策略，适合组合参与的投资标的。

本基金可投资于其他符合基金合同要求的证券投资基金。本基金所投资的其他证券投资基金面临流动性风险时，如资产变现难度大、出现大额赎回、暂停赎回或延缓支付赎回款项、赎回款项支付效率较低的情形，将为本基金带来流动性风险。本基金可通过二级市场进行 ETF 的买卖交易，由此可能面临交易量不足所引起的流动性风险、交易价格与基金份额净值之间的折溢价风险以及被投资基金暂停交易或退市的风险。本基金可投资于定期开放基金，投资后将在一定期限内无法赎回，在本基金面临大规模赎回时有可能因为无法变现造成流动性风险。本基金可投资于封闭式基金，可能会面临在一定价格下无法卖出而需降价卖出的风险。

### 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

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	1,350,900. 00	1,793,995. 20	0.87	否

## 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，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，中国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，广发银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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

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

7.13.2 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。

### 7.13.3 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	4,003.72
2	应收清算款	351,313.02
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	200.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	355,516.74

### 7.13.4 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	110059	浦发转债	5,930,609.39	2.87
2	113633	科沃转债	2,993,181.65	1.45
3	113644	艾迪转债	2,285,595.63	1.11
4	127024	盈峰转债	2,174,914.71	1.05
5	128134	鸿路转债	2,171,810.20	1.05
6	113584	家悦转债	2,014,662.85	0.97
7	113605	大参转债	1,999,015.14	0.97
8	128071	合兴转债	1,831,734.17	0.89
9	128131	崇达转 2	1,817,553.59	0.88
10	113606	荣泰转债	1,734,843.53	0.84

11	123071	天能转债	1,684,638.08	0.81
12	110076	华海转债	1,567,131.60	0.76
13	113657	再 22 转债	1,425,589.52	0.69
14	128142	新乳转债	1,336,733.59	0.65
15	110081	闻泰转债	1,139,675.84	0.55
16	123115	捷捷转债	1,101,819.38	0.53
17	123121	帝尔转债	1,032,879.92	0.50
18	123120	隆华转债	1,013,070.59	0.49
19	111014	李子转债	997,641.32	0.48
20	128121	宏川转债	987,790.56	0.48
21	128117	道恩转债	966,868.46	0.47
22	127088	赫达转债	934,408.64	0.45
23	113625	江山转债	885,488.55	0.43
24	123113	仙乐转债	847,000.00	0.41
25	128125	华阳转债	729,125.21	0.35
26	123126	瑞丰转债	694,259.31	0.34
27	123154	火星转债	669,133.36	0.32
28	128066	亚泰转债	590,831.01	0.29
29	127062	垒知转债	525,028.08	0.25
30	127051	博杰转债	491,424.04	0.24
31	118032	建龙转债	468,559.27	0.23
32	123063	大禹转债	459,706.27	0.22
33	127052	西子转债	414,762.28	0.20
34	123109	昌红转债	391,542.12	0.19
35	123124	晶瑞转 2	378,693.78	0.18
36	123165	回天转债	340,232.26	0.16
37	113053	隆 22 转债	325,601.14	0.16
38	123213	天源转债	311,755.62	0.15
39	127059	永东转 2	289,446.38	0.14
40	113676	荣 23 转债	270,486.38	0.13
41	127077	华宏转债	258,608.54	0.13
42	110079	杭银转债	241,534.47	0.12
43	128109	楚江转债	221,653.04	0.11
44	127025	冀东转债	217,320.54	0.11
45	111004	明新转债	212,527.67	0.10
46	123100	朗科转债	199,994.93	0.10
47	118005	天奈转债	189,790.48	0.09
48	113542	好客转债	184,667.09	0.09
49	123104	卫宁转债	183,650.85	0.09
50	127017	万青转债	177,140.38	0.09
51	123178	花园转债	173,317.51	0.08
52	127056	中特转债	164,007.82	0.08
53	118038	金宏转债	156,141.27	0.08
54	128105	长集转债	154,061.18	0.07

55	127076	中宠转 2	135,957.96	0.07
56	127041	弘亚转债	126,726.48	0.06
57	127090	兴瑞转债	123,389.92	0.06
58	113636	甬金转债	113,900.68	0.06
59	113650	博 22 转债	102,850.00	0.05
60	113048	晶科转债	94,506.85	0.05
61	123180	浙矿转债	93,878.93	0.05
62	118009	华锐转债	86,212.27	0.04
63	113643	风语转债	75,078.36	0.04
64	127099	盛航转债	68,403.67	0.03
65	127016	鲁泰转债	63,424.17	0.03
66	123149	通裕转债	60,590.47	0.03
67	128081	海亮转债	54,252.92	0.03
68	127046	百润转债	54,101.37	0.03
69	128087	孚日转债	46,577.30	0.02
70	113632	鹤 21 转债	38,941.76	0.02
71	118033	华特转债	33,531.53	0.02
72	123211	阳谷转债	33,225.87	0.02
73	118035	国力转债	31,749.25	0.02
74	111009	盛泰转债	28,637.59	0.01
75	128138	侨银转债	25,126.35	0.01
76	127026	超声转债	22,362.79	0.01
77	123214	东宝转债	21,020.05	0.01
78	123212	立中转债	11,750.29	0.01
79	123119	康泰转 2	11,550.93	0.01
80	118028	会通转债	11,527.68	0.01
81	123158	宙邦转债	11,371.47	0.01
82	113064	东材转债	11,244.88	0.01
83	113647	禾丰转债	10,424.34	0.01
84	127044	蒙娜转债	9,810.92	0.00
85	118018	瑞科转债	8,898.79	0.00

#### 7.13.5 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
海富通欣盈 6 个月持有期混合 A	107	1,013,664.39	84,894,949.16	78.27%	23,567,141.07	21.73%
海富通欣盈 6 个月持有期混合 C	1,939	50,089.03	4,000,720.00	4.12%	93,121,913.02	95.88%
合计	2,046	100,481.29	88,895,669.16	43.24%	116,689,054.09	56.76%

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	海富通欣盈 6 个月持有期混合 A	465,385.62	0.4291%
	海富通欣盈 6 个月持有期混合 C	715,434.06	0.7366%
	合计	1,180,819.68	0.5744%

## 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	海富通欣盈 6 个月持有期混合 A	10~50
	海富通欣盈 6 个月持有期混合 C	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通欣盈 6 个月持有期混合 A	0
	海富通欣盈 6 个月持有期混合 C	50~100
	合计	50~100

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通欣盈 6 个月持有期混合	海富通欣盈 6 个月持有期混合
----	-----------------	-----------------

	A	C
基金合同生效日（2024 年 3 月 19 日）基金份额总额	108,457,240.53	96,971,331.85
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,849.70	151,301.17
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	108,462,090.23	97,122,633.02

## §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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期持有的基金未发生重大影响事件。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.7.1 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。

#### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	单元数量	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	1,381,136.53	100.00%	890.02	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。

### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
海通证券	113,183,837.30	100.00%	1,128,011,000.00	100.00%	-	-	1,799,369.80	100.00%

### 10.9 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	海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-30
2	海富通基金管理有限公司关于海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金新增长江证券股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-02-27
3	海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金延长募集期的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-07
4	海富通基金管理有限公司关于海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金新增北京汇成基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-13

5	海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-20
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-15
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增京东肯特瑞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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-17
8	海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-27
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增南京证券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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-10
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海好买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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-15
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-22
12	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-12

## §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欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通欣盈 6 个月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

### 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