

**海富通欣利混合型证券投资基金**  
**2023 年第 3 季度报告**  
**2023 年 9 月 30 日**

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

## §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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 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 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	海富通欣利混合
基金主代码	011554
交易代码	011554
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 14 日
报告期末基金份额总额	251,783,028.28 份
投资目标	本基金通过积极主动的资产配置与严谨的风险管理，在严格控制风险的前提下，积极把握证券市场的投资机会，追求资产的保值增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究，同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素，兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动，结合投资时钟理论，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例。并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，或借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应，以规避或分散市场风险。 在大类资产配置的框架下，本基金投资策略还包括股票

	投资策略、债券投资组合策略、资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略、流通受限证券投资策略、股票期权投资策略、存托凭证投资策略等。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中证综合债指数收益率×75%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通欣利混合 A	海富通欣利混合 C
下属两级基金的交易代码	011554	011555
报告期末下属两级基金的份额总额	121,117,859.75 份	130,665,168.53 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 (2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)	
	海富通欣利混合 A	海富通欣利混合 C
1.本期已实现收益	-111,189.24	40,639.48
2.本期利润	-2,028,569.39	-1,384,447.77
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0198	-0.0111
4.期末基金资产净值	129,861,216.25	139,524,137.56
5.期末基金份额净值	1.0722	1.0678

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、海富通欣利混合 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	-1.33%	0.36%	-0.55%	0.22%	-0.78%	0.14%
过去六个月	0.35%	0.33%	-0.35%	0.21%	0.70%	0.12%
过去一年	6.37%	0.36%	2.48%	0.25%	3.89%	0.11%
自基金合同生效起至今	7.22%	0.37%	-0.69%	0.28%	7.91%	0.09%

##### 2、海富通欣利混合 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	-1.39%	0.35%	-0.55%	0.22%	-0.84%	0.13%
过去六个月	0.24%	0.33%	-0.35%	0.21%	0.59%	0.12%
过去一年	6.15%	0.36%	2.48%	0.25%	3.67%	0.11%
自基金合同生效起至今	6.78%	0.37%	-0.69%	0.28%	7.47%	0.09%

#### 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

海富通欣利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. 海富通欣利混合 A

(2021 年 9 月 14 日至 2023 年 9 月 30 日)



## 2. 海富通欣利混合 C

(2021 年 9 月 14 日至 2023 年 9 月 30 日)



注：本基金合同于 2021 年 9 月 14 日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部

分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（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。	2021-09-14	-	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 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 和海富通策略收益债券基金经理。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。
--	--	--	--	--	------------------------

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

三季度，A 股市场经历了一轮调整。以万得全 A 指数来看，当季度跌幅 4.33%。分市场看，沪深 300 指数下跌 3.98%、中证 500 指数下跌 5.13%、科创 50 指数下跌 11.67%、创业板综下跌 8.25%、中小综指下跌 7.42%。分行业看，申万一级行业表现靠前的板块是非银金融、煤炭、石油石化、钢铁、银行，跌幅较大的板块是电力设备、传媒、计算机、通信。

三季度美国经济、通胀仍然超越市场预期。美非农就业数据持续表现强劲，呈现出较强的韧性，其他诸如制造业 PMI、失业率数据也都好于预期。在此背景下，美联储停止加息甚至降息的预期不断落空。美债利率持续上行，人民币贬值压力加大，都对 A 股市场的资金面和估值面产生了较大压力，也影响了市场风险偏好。因此，三季度风险

偏好较高且前期涨幅较大的 TMT 板块有较大幅度的调整。

国内因素方面，三季度最大的变化是经济逐步探底回升，政策端逐步发力。政策端，七月政治局会议政策转向稳增长，在房地产、地方债务化解、活跃资本市场等方面的表述超出市场预期。八月下旬以来，在房地产、化债、活跃资本市场三个领域的政策推进速度明显加快。九月央行宣布下调存款准备金率。此外，房地产方面，更多的二线城市宣布全面放开限购。明年城中村改造纳入专项债支持范围。总体来看，三季度财政发力和货币政策配合的组合逐步出现。经济端，6 月以来制造业 PMI 持续回升，9 月重回扩张区域至 50.2%。PPI 在 6 月触底后连续两个月的同比抬升也正式确认了降价去库行为的结束。经济内生增长动能企稳回升，逆周期政策持续发力的情形下，三季度传统工业、基建投资需求表现较优。在此背景下，受益于活跃资本市场政策的非银行金融以及经济周期相关的顺周期品种如煤炭、石油石化、钢铁、银行表现较优，取得正收益。

债券方面，3 季度国内经济企稳回升，债券收益率先下后上。整体来看，地产板块偏弱，工业生产企稳回暖，服务业与消费持续发力。从 PMI 来看，7-9 月 PMI 逐月走高，最终在 9 月升至 50% 以上；7-8 月经济数据也反映当前基本面见底回升的情况。投资方面，制造业投资维持韧性，高技术行业维持高增；基建投资由于基数问题增速略有回落；地产投资跌幅略有走扩，但是在保交楼政策的支持下竣工端持续发力。消费方面，暑期带动出行链相关板块走强，但地产销售遇冷拖累地产后周期板块。出口方面仍有下行压力，但由于美国经济韧性较强，下行压力较前期有所缓和。通胀方面，CPI 总体维持弱势，并在 7 月短暂转负，主要受到非食品类消费品价格拖累；PPI 受到基数影响同比跌幅逐月收窄。在此经济环境下，3 季度货币政策维持宽松，8 月调降 7 天 OMO 利率 10bp，调降 MLF 利率 15bp，9 月降准 25bp，释放中长期流动性约 5000 亿。财政政策方面主要体现在 8 月与 9 月地方政府专项债的集中发行与一揽子地方政府债务化解方案的推出。此外政策的调整主要集中在房地产板块，在因城施策的大背景下，调降贷款利率与首付比例、调降存量房贷利率、一线城市落实“认房不认贷”、放松限购等政策陆续出台。资金价格与流动性方面，3 季度由于信贷投放与专项债集中发行等因素，流动性存在一定缺口，资金面总体偏紧，资金价格中枢由于降息的影响变化幅度不大。具体来看，7 月信贷需求不佳，流动性合理充裕，8 月与 9 月信贷投放压力增大，同时由于专项债集中发行等因素，流动性出现偏紧的情况。3 季度 DR001 与 DR007 均值为 1.59% 和 1.88%，较 2 季度分别回升 13bp 与回落 6bp。对应债市而言，收益率先下后上。在 7-8 月经济基本面没有起色、政策预期偏弱的情况下债市走强，10 年期国债收益率一度下行至 2.56% 附近的水平。但随着 PMI 连续两个月回暖、信贷需求回升、政治局会议后政策在房地产领域集中落地，债市出现了明显调整，10 年期国债收益率在 9 月末再次回到 2.70% 附近的水平。

信用债方面，收益率走势一波三折。7 月跨季以来，理财规模回升、中小银行委外增加等带来配债增量，但政策博弈仍有扰动，债市表现纠结，24 日，政治局会议召开，政策转向需求端+地产政策更积极+活跃资本市场带来的风险偏好提升等对债市偏不利，债市情绪快速反转，信用债收益率跟随利率债快速上行；8 月，受政策落地不及预期、



资金面宽松、机构欠配压力以及央行 15 日超预期降息等因素影响，信用债收益率跟随利率债大幅下行；进入 9 月后，受资金面偏紧、支持地产政策密集出台、机构赎回等因素影响，信用债市场出现明显调整，机构止盈、谨慎心态增加。城投方面，政治局会议明确提出“制定实施一揽子化债方案”，随着化债政策不断落地，一定程度提升市场机构信心，同时，“遏增化存”仍为基调，供给端收缩加剧城投债资产荒行情；地产多空舆情交织，需求端政策再出组合拳，一二线城市迎来限贷限购放松潮，但成交数据反映尚需时间，政策效果有待观察，叠加龙头房企出险对市场信心造成冲击，地产债整体延续调整。

可转债方面，7 月市场受益于政治局会议超预期的政策定调，非银金融、房地产大涨，顺周期板块也有所表现；8 月市场普跌，原因包括政策实施不及预期、北向资金持续流出、宏观经济数据不及预期等；9 月由于赎回预期超前，转债估值大幅压缩，但压缩时间较短且幅度小于前几次。行业上分化明显，商品市场价格波动带动能源股上涨，交易行为上市场向红利指数靠近。整体来看，三季度转债走出独立行情，表现优于权益，百元平价溢价率基本持平。区间内中证转债指数下跌 0.52%。

报告期间，本基金权益仓位保持相对高位，在控制回撤的基础上，积极寻找估值盈利匹配的股票以赚取绝对收益，行业分布上较为均衡，持仓个股较为分散，组合整体风格偏向价值。转债方面，继续保持了较高的仓位，转债的配置主要以绝对价格较低的转债配置为主，希望在不大幅增加组合波动的前提下增厚组合收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通欣利混合 A 净值增长率为-1.33%，同期业绩比较基准收益率为-0.55%，基金净值跑输业绩比较基准 0.78 个百分点。海富通欣利混合 C 净值增长率为-1.39%，同期业绩比较基准收益率为-0.55%，基金净值跑输业绩比较基准 0.84 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	108,825,728.28	40.29
	其中：股票	108,825,728.28	40.29

2	固定收益投资	109,141,468.19	40.40
	其中：债券	109,141,468.19	40.40
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	30,497,232.58	11.29
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	19,774,480.73	7.32
7	其他资产	1,894,233.99	0.70
8	合计	270,133,143.77	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6,410,767.22元，占资产净值比例为2.38%。

## 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	74,588.00	0.03
B	采矿业	2,139,992.00	0.79
C	制造业	58,309,076.49	21.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,359,743.60	1.25
E	建筑业	6,553,048.00	2.43
F	批发和零售业	5,489,799.90	2.04
G	交通运输、仓储和邮政业	4,590,619.00	1.70
H	住宿和餐饮业	585,820.00	0.22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,102,210.05	1.89
J	金融业	10,311,214.12	3.83
K	房地产业	4,520,959.00	1.68
L	租赁和商务服务业	176,264.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	648,058.90	0.24

N	水利、环境和公共设施管理业	241,332.00	0.09
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	312,236.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	102,414,961.06	38.02

### 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	152,529.38	0.06
非日常生活消费品	147,224.56	0.05
金融	729,277.27	0.27
工业	4,238,295.61	1.57
房地产	1,143,440.40	0.42
合计	6,410,767.22	2.38

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	601567	三星医疗	153,300	2,777,796.00	1.03
2	000333	美的集团	40,000	2,219,200.00	0.82
3	601668	中国建筑	377,200	2,085,916.00	0.77
4	603368	柳药集团	86,100	1,858,038.00	0.69
5	600064	南京高科	279,000	1,777,230.00	0.66
6	600919	江苏银行	245,284	1,761,139.12	0.65
7	600030	中信证券	80,700	1,747,962.00	0.65
8	002352	顺丰控股	39,400	1,607,520.00	0.60
9	000400	许继电气	81,300	1,576,407.00	0.59
10	002353	杰瑞股份	48,600	1,549,854.00	0.58

### 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	19,368,112.88	7.19

2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,487,096.99	3.89
	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）	79,286,258.32	29.43
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	109,141,468.19	40.51

### 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	110059	浦发转债	200,720	21,841,492.53	8.11
2	113042	上银转债	145,960	15,919,657.26	5.91
3	019694	23 国债 01	125,000	12,672,034.25	4.70
4	1928033	19 中国银行二级 03	100,000	10,487,096.99	3.89
5	113052	兴业转债	66,000	6,810,785.92	2.53

### 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

代码	名称	持仓量	合约市值 (元)	公允价值变 动(元)	风险说明
IF2310	IF2310	-3.00	-3,331,440.00	12,120.00	-
IF2311	IF2311	-1.00	-1,112,820.00	2,100.00	-
公允价值变动总额合计(元)					14,220.00
股指期货投资本期收益(元)					153,699.96
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-24,660.00

注：股指期货投资本期收益中已扣除本期股指期货差价收入应缴纳增值税额。

## 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

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

### 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，中国银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

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	573,181.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	19,288.43
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,301,763.93
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,894,233.99

## 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	110059	浦发转债	21,841,492.53	8.11
2	113042	上银转债	15,919,657.26	5.91
3	113052	兴业转债	6,810,785.92	2.53
4	113056	重银转债	6,168,290.90	2.29
5	113050	南银转债	4,821,545.62	1.79
6	113037	紫银转债	3,126,991.10	1.16
7	110079	杭银转债	2,579,338.40	0.96
8	113584	家悦转债	2,523,626.20	0.94
9	110073	国投转债	1,451,060.27	0.54
10	123113	仙乐转债	1,399,637.19	0.52
11	127034	绿茵转债	1,286,369.73	0.48
12	113640	苏利转债	1,272,451.13	0.47
13	113043	财通转债	1,240,777.40	0.46
14	113606	荣泰转债	969,782.46	0.36
15	123178	花园转债	801,481.97	0.30
16	123104	卫宁转债	744,840.88	0.28
17	110092	三房转债	701,537.94	0.26
18	127061	美锦转债	627,773.44	0.23
19	113652	伟 22 转债	615,335.03	0.23
20	118005	天奈转债	515,603.42	0.19

21	127024	盈峰转债	505,721.80	0.19
22	113046	金田转债	444,597.48	0.17
23	128108	蓝帆转债	310,655.45	0.12
24	123165	回天转债	281,507.26	0.10
25	113057	中银转债	266,994.90	0.10
26	123144	裕兴转债	228,859.18	0.08
27	113650	博 22 转债	161,506.23	0.06
28	127033	中装转 2	159,762.33	0.06
29	128116	瑞达转债	159,631.38	0.06
30	113641	华友转债	158,943.00	0.06
31	128109	楚江转债	153,180.60	0.06
32	113532	海环转债	137,685.63	0.05
33	128125	华阳转债	112,814.09	0.04
34	113657	再 22 转债	112,162.19	0.04
35	127049	希望转 2	109,301.95	0.04
36	113033	利群转债	107,301.64	0.04
37	118031	天 23 转债	105,321.23	0.04
38	113631	皖天转债	62,923.34	0.02
39	123146	中环转 2	57,477.32	0.02
40	123128	首华转债	53,428.01	0.02
41	110076	华海转债	44,319.95	0.02

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通欣利混合A	海富通欣利混合C
本报告期期初基金份额总额	76,046,974.01	166,250,086.95
本报告期基金总申购份额	62,596,206.27	81,904,789.03
减：本报告期基金总赎回份额	17,525,320.53	117,489,707.45

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	121,117,859.75	130,665,168.53

## §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

单位：份

项目	海富通欣利混合A	海富通欣利混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	13,877,324.45	-
本报告期买入/申购总份额	-	-
本报告期卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	13,877,324.45	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	11.46	-

### 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 110 只公募基金。截至 2023 年 9 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1505 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。

2020 年 3 月，由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，海富通荣获“金牛进取奖”，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖项。2020 年 7 月，由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓，海富通荣获“金基金·股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联“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“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“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欣利混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通欣利混合型证券投资基金基金合同

- (三)海富通欣利混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通欣利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  
二〇二三年十月二十五日