

# 海富通安颐收益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：中国银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| § 1 重要提示及目录                             | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| § 2 基金简介                                | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 6  |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现                       | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现                              | 7  |
| § 4 管理人报告                               | 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              | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 14 |
| 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             | 14 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 15 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 16 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 17 |
| 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       | 17 |
| § 5 托管人报告                               | 17 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 17 |
| 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 | 17 |
| 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       | 17 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计）                     | 17 |
| 6.1 资产负债表                               | 17 |
| 6.2 利润表                                 | 19 |
| 6.3 净资产变动表                              | 20 |
| 6.4 报表附注                                | 21 |
| § 7 投资组合报告                              | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 43 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 43 |
| 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       | 44 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 50 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 52 |
| 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      | 52 |
| 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   | 53 |
| 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   | 53 |
| 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      | 53 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 53 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 53 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 53 |
| § 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 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 56        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....     | 56        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 56        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 58        |
| <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 .....                         | 60        |
| 12.3 查阅方式 .....                         | 60        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金名称            | 海富通安颐收益混合型证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 海富通安颐收益混合        |                 |
| 基金主代码           | 519050           |                 |
| 交易代码            | 519050           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2013 年 5 月 29 日  |                 |
| 基金管理人           | 海富通基金管理有限公司      |                 |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司       |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 100,310,041.11 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 海富通安颐收益混合 A      | 海富通安颐收益混合 C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 519050           | 002339          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 82,283,370.80 份  | 18,026,670.31 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金坚持灵活的资产配置，在严格控制下跌风险的基础上，积极把握股票市场的投资机会，确保资产的保值增值，实现战胜绝对收益基准的目标，为投资者提供稳健的养老理财工具。  |
| 投资策略   | 本基金的资产配置策略以基金的投资目标为中心，在实现既定的投资目标同时将可能的损失最小化。首先按照投资时钟理论，根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段，作出权益类资产的初步配置，并根据投资时钟判断大致的行业配置；其次结合证券市场趋势指标，判断证券市场指数的大致风险收益比，从而做出权益类资产的具体仓位选择。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款利率(税后)+2%   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。   |

### 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          | 中国银行股份有限公司                |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 岳冲                   | 许俊                        |
|             | 联系电话 | 021-38650788         | 010-66596688              |
|             | 电子邮箱 | chongyue@hftfund.com | fxjd_hq@bank-of-china.com |
| 客户服务电话      |      | 40088-40099          | 95566                     |
| 传真          |      | 021-33830166         | 010-66594942              |

|       |  |               |
|-------|--|---------------|
| 注册地址  | 中国（上海）自由贸易试验区<br>陆家嘴环路479号18层<br>1802-1803室以及19层<br>1901-1908室 | 北京西城区复兴门内大街1号 |
| 办公地址  | 中国（上海）自由贸易试验区<br>陆家嘴环路479号18层<br>1802-1803室以及19层<br>1901-1908室 | 北京西城区复兴门内大街1号 |
| 邮政编码  | 200120   | 100818        |
| 法定代表人 | 杨仓兵  | 葛海蛟           |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》   |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <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 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日） |               |
|---------------|--------------------------------------|---------------|
|               | 海富通安颐收益混合 A                          | 海富通安颐收益混合 C   |
| 本期已实现收益       | 871,475.91                           | 177,571.67    |
| 本期利润          | 2,632,161.75                         | 568,387.94    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0300                               | 0.0288        |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.43%                                | 2.30%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.52%                                | 2.47%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日)                |               |
|               | 海富通安颐收益混合 A                          | 海富通安颐收益混合 C   |
| 期末可供分配利润      | 12,640,570.45                        | 3,134,040.48  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1536                               | 0.1739        |
| 期末基金资产净值      | 102,834,991.82                       | 22,924,053.97 |

|              |                       |             |
|--------------|-----------------------|-------------|
| 期末基金份额净值     | 1.2498                | 1.2717      |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) |             |
|              | 海富通安颐收益混合 A           | 海富通安颐收益混合 C |
| 基金份额累计净值增长率  | 93.19%                | 45.90%      |

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、海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）于 2016 年 1 月 6 日刊登公告，自 2016 年 1 月 8 日起增加收取销售服务费的 C 类份额。

### 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

海富通安颐收益混合 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      | 0.18%    | 0.21%       | 0.38%      | 0.01%         | -0.20%  | 0.20% |
| 过去三个月      | 1.04%    | 0.22%       | 1.16%      | 0.01%         | -0.12%  | 0.21% |
| 过去六个月      | 2.52%    | 0.33%       | 2.34%      | 0.02%         | 0.18%   | 0.31% |
| 过去一年       | 0.00%    | 0.26%       | 4.76%      | 0.01%         | -4.76%  | 0.25% |
| 过去三年       | -2.30%   | 0.25%       | 14.95%     | 0.01%         | -17.25% | 0.24% |
| 自基金合同生效起至今 | 93.19%   | 0.36%       | 72.17%     | 0.02%         | 21.02%  | 0.34% |

海富通安颐收益混合 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      | 0.18%    | 0.21%       | 0.38%      | 0.01%         | -0.20%  | 0.20% |
| 过去三个月      | 1.02%    | 0.22%       | 1.16%      | 0.01%         | -0.14%  | 0.21% |
| 过去六个月      | 2.47%    | 0.33%       | 2.34%      | 0.02%         | 0.13%   | 0.31% |
| 过去一年       | -0.10%   | 0.26%       | 4.76%      | 0.01%         | -4.86%  | 0.25% |
| 过去三年       | -2.62%   | 0.25%       | 14.95%     | 0.01%         | -17.57% | 0.24% |
| 自基金合同生效起至今 | 45.90%   | 0.25%       | 48.25%     | 0.01%         | -2.35%  | 0.24% |

### 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

海富通安颐收益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

(2013 年 5 月 29 日至 2024 年 6 月 30 日)

海富通安颐收益混合 A



海富通安颐收益混合 C



注：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 |        |  |
| 谈云飞 | 本基金的基金经理 | 2024-03-21      | -    | 19 年   | 硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 4 月至 2014 年 6 月就职于华宝兴业基金管理有限公司， |

|     |                   |            |   |      |   |
|-----|-------------------|------------|---|------|---|
|     |                   |            |   |      | <p>曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2014 年 7 月至 2015 年 10 月任海富通现金管理货币基金经理。2014 年 9 月至 2020 年 9 月任海富通季季增利理财债券基金经理。2015 年 1 月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015 年 4 月至 2020 年 1 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 2 月起兼任海富通货币基金经理。2016 年 4 月至 2017 年 6 月兼任海富通纯债债券、海富通双福债券(原海富通双福分级债券)、海富通双利债券基金经理。2016 年 4 月至 2020 年 1 月兼任海富通安颐收益混合(原海富通养老收益混合)基金经理。2016 年 9 月至 2023 年 7 月兼任海富通聚利债券基金经理。2016 年 9 月至 2020 年 1 月兼任海富通欣荣混合基金经理。2016 年 9 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合基金经理。2017 年 2 月至 2021 年 10 月兼任海富通强化回报混合基金经理。2017 年 3 月起兼任海富通欣享混合基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 7 月至 2020 年 9 月任海富通季季通利理财债券基金经理。2019 年 9 月至 2023 年 1 月兼任海富通中短债债券基金经理。2021 年 2 月起兼任海富通惠睿精选混合基金经理。2022 年 3 月至 2023 年 9 月兼任海富通欣润混合基金经理。2022 年 3 月至 2023 年 5 月兼任海富通惠鑫混合基金经理。2022 年 5 月起兼任海富通恒益一年定开债券发起式基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通安颐收益混合基金经理。</p> |
| 杜晓海 | 本基金的基金经理；公司总经理助理。 | 2016-06-22 | - | 24 年 | <p>硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富</p>   |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监、量化投资部总监,现任海富通基金管理有限公司总经理助理。2016 年 6 月起任海富通安颐收益混合(原海富通养老收益混合)基金经理。2016 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 10 月兼任海富通富睿混合(现海富通沪深 300 增强)基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至 2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月至 2021 年 7 月兼任海富通中证 500 增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月至 2023 年 10 月兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。2023 年 10 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通 ESG 领先股票基金经理。2024 年 6 月起兼任海富通中</p> |
|--|--|--|--|--|

|     |          |            |            |     |   |
|-----|----------|------------|------------|-----|---|
|     |          |            |            |     | 证港股通科技 ETF 发起联接基金经理。  |
| 夏妍妍 | 本基金的基金经理 | 2019-05-22 | 2024-03-22 | 9 年 | 上海交通大学经济学硕士,持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生,西门子财务租赁有限公司上海分公司高级财务分析师,2014 年加入海富通基金管理有限公司,历任固定收益投资部固定收益分析师、基金经理助理。2018 年 1 月至 2023 年 1 月任海富通欣益混合基金经理。2018 年 4 月至 2024 年 3 月兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2018 年 4 月至 2021 年 5 月任海富通融丰定开债券基金经理。2019 年 5 月至 2024 年 3 月兼任海富通安颐收益混合基金经理。2019 年 10 月至 2020 年 11 月兼任海富通瑞丰债券基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 9 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2019 年 10 月至 2023 年 4 月兼任海富通富祥混合基金经理。2019 年 10 月至 2024 年 3 月兼任海富通聚合纯债基金经理。2020 年 5 月至 2023 年 10 月兼任海富通富盈混合基金经理。2021 年 5 月至 2024 年 3 月兼任海富通美元债 (QDII) 基金经理。2021 年 8 月至 2024 年 3 月兼任海富通瑞兴 3 个月定开债券基金经理。2022 年 7 月至 2024 年 3 月兼任海富通策略收益债券基金经理。 |

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 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

国内方面，2024 年上半年国内经济整体维持弱修复状态，实现了实际 GDP 增速 5%，基本完成了目标。从经济运行节奏看，第一季度开局良好，进入第二季度，社融和 M1 增速开始回落，经济增速边际放缓，实际 GDP 同比增长 4.7%。从经济增长动力上看，海外经济向好，国内生产和出口保持强势，有力提振经济增长，而国内地产未显著回暖，居民和企业融资意愿不足，内需消费疲弱，全社会风险偏好较低。从政策思路看，目前国内政策主要集中在供给侧，坚持高质量发展，因地制宜发展新质生产力，这也是我国跨越中等收入陷阱的必由之路。

海外方面，2024 年上半年美国经济在高利率和紧财政下开始走弱，但是经济仍有韧性，降息预期不断延后。6 月美国失业率走高，叠加 CPI 同比也回落，CME 利率期货显示预计美联储 9 月将启动降息。但是，失业率上升更多是源于新增劳动力进入市场，非农就业数据依然超预期，且实际薪资增速依然保持较高增长，最新零售数据也超预期，美国消费依然具有韧性。

从 A 股市场看，本报告期内，价值板块跑赢成长板块，大盘股跑赢小盘。在避险情绪和红利表现强势的背景下，银行、公用事业、煤炭、石化、交运总体上涨。受益于科技创新和出口等原因，电子、通信、家电表现相对靠前。医药、地产链、消费板块由于基本面不佳，整体延续下跌趋势；TMT 板块亦大幅回调。在宏观经济缓慢复苏、市场风格偏向红利价值的前提下，本基金积极配置拥挤度较低、盈利有预期改善的高性价比资产，组合风格向均衡结构靠拢，重视个股的盈利质量，同

时在因子配置上尽可能兼顾估值与成长。本基金在控制风险的基础上，积极地捕捉市场的结构性机会，力争跑赢市场。

固收方面，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。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。CPI 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，上半年调降 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，上半年资金面保持宽松。财政政策方面，在化债背景下，城投平台再融资收缩，地方债发行慢于往年，一方面使得财政对信用扩张作用有限，另一方面使得债市出现资产荒。一季度债市收益率单边大幅下行，二季度央行多次提示长期限债券利率风险，长端利率债收益率区间震荡。但 4 月份中旬后，大量资金从存款流入理财，使得非银金融机构流动性较为宽松，债市资产荒加剧，中短端债券收益率再次大幅下行，信用债“利率化”趋势加大，市场对信用风险钝化，等级利差、期限利差多数创历史新低。

本基金债券部分在上半年以信用债为主要配置，信用债品种上，选择中高等级、中等期限的信用债，在收益率大幅下行、信用利差被大幅压缩后，提高利率债配置比例，并积极进行利率债交易，提高组合久期，获得较好的投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通安颐收益混合 A 净值增长率为 2.52%，同期业绩比较基准收益率为 2.34%。海富通安颐收益混合 C 净值增长率为 2.47%，同期业绩比较基准收益率为 2.34%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从全球经济看，由于美国财政高杠杆、货币高利率的制约，2024 年美国财政刺激力度将边际走弱，美国经济、通胀也将逐步下行。6 月 18 日美国 CBO 在最新财政和经济展望中上调了 2024 年财年预算赤字，受到边际趋松的财政提振，通胀或存在抬升的压力。7 月就业数据超预期走弱，市场降息预期升温，但受飓风等因素影响 7 月就业数据有一定特殊性，未来美联储降息节奏和幅度还需要进一步跟踪。一旦美联储启动降息，这对全球金融市场、各类资产都将产生较为显著的影响，我们面临的外部金融环境有望缓解。

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，我们将通过多因子的选股模型寻找各板块内低估值的优质股票投资机会，并通过组合优化，构建兼顾风险收益、估值、盈利质量、景气度匹配的组合，力争实现超越基准的表现。市场风格方面，从增量资金偏好、估值等角度看，需要提高对盈利质量的重视，小微盘风格的暴露需要谨慎对待。另外，三季度将重点关注前期跌幅较大、基本面有积极变化的个股，同时密切跟踪前期超额较高的个股，适时做出止盈。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。

固收方面，展望下半年，经济或维持修复状态。投资方面，基建在超长期特别国债与地方债发力的情况下有望保持较高的景气度；制造业投资在高技术领域或将继续发力；地产投资在政策端可能仍有调整的空间。通胀方面，CPI 有望维持在正增区间；PPI 在需求端弹性有限，基数效应下跌幅有望继续收窄。货币政策方面，流动性的合理充裕或维持，总量层面仍有降准降息的可能性。财政方面，超长期特别国债持续发力，地方债发行有望提速。下半年对债券市场中性偏乐观。资金面与流动性方面，央行重建利率走廊，资金价格的波动或被熨平。基本面方面，当前经济环比动能不足，关注下半年增量政策的出台。目前可预期的风险或来自于政府债券供给，如果地方债集中发行，债券市场可能面临一定的调整风险。综合来看，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。

本基金债券部分在下半年将继续保持一定的信用债配置，但在信用利差被大幅压缩的情况下，将提高利率债的配置比例，并积极进行利率债交易，保持一定组合久期，争取获得较好的绝对回报。

#### 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

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### §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：海富通安颐收益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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b>   |         |                        |                          |
| 货币资金          | 6.4.7.1 | 3,967,663.51           | 3,432,439.45             |
| 结算备付金         |         | 3,533,392.20           | 7,355,366.93             |
| 存出保证金         |         | 353,218.53             | 11,151.92                |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2 | 125,753,185.25         | 152,129,482.21           |
| 其中：股票投资       |         | 31,170,546.95          | 37,318,153.73            |
| 基金投资          |         | -                      | -                        |
| 债券投资          |         | 94,582,638.30          | 114,811,328.48           |
| 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 | -                      | -                        |
| 应收清算款         |         | -                      | 31,442.08                |
| 应收股利          |         | -                      | -                        |
| 应收申购款         |         | 8,996.86               | 44,183.98                |
| 递延所得税资产       |         | -                      | -                        |
| 其他资产          | 6.4.7.5 | -                      | -                        |
| 资产总计          |         | 133,616,456.35         | 163,004,066.57           |
| <b>负债和净资产</b> |         |                        |                          |
|               | 附注号     | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
| <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     |         | 7,100,000.00           | 19,597,677.37            |
| 应付清算款         |         | 46,361.40              | 783,821.50               |
| 应付赎回款         |         | 415,673.69             | 441,184.79               |
| 应付管理人报酬       |         | 104,109.16             | 121,812.85               |
| 应付托管费         |         | 20,821.85              | 24,362.57                |
| 应付销售服务费       |         | 1,910.08               | 2,303.28                 |
| 应付投资顾问费       |         | -                      | -                        |
| 应交税费          |         | 2,955.85               | 3,117.86                 |
| 应付利润          |         | -                      | -                        |
| 递延所得税负债       |         | -                      | -                        |
| 其他负债          | 6.4.7.6 | 165,578.53             | 245,009.78               |
| 负债合计          |         | 7,857,410.56           | 21,219,290.00            |
| <b>净资产：</b>   |         |                        |                          |

|          |         |                |                |
|----------|---------|----------------|----------------|
| 实收基金     | 6.4.7.7 | 100,310,041.11 | 115,909,840.53 |
| 未分配利润    | 6.4.7.8 | 25,449,004.68  | 25,874,936.04  |
| 净资产合计    |         | 125,759,045.79 | 141,784,776.57 |
| 负债和净资产总计 |         | 133,616,456.35 | 163,004,066.57 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.2498 元，C 类基金份额净值 1.2717 元。

基金份额总额 100,310,041.11 份，其中 A 类基金份额 82,283,370.80 份，C 类基金份额 18,026,670.31 份。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通安颐收益混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至<br>2023 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>        |          | 4,236,808.18                             | 6,284,773.91                                  |
| 1.利息收入                |          | 61,361.19                                | 165,073.03                                    |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.9  | 61,361.19                                | 103,543.38                                    |
| 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            |          | -  | 61,529.65                                     |
| 其他利息收入                |          | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 2,021,268.90                             | 2,426,249.83                                  |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.10 | 211,820.25                               | -517,179.00                                   |
| 基金投资收益                |          | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.11 | 1,369,643.92                             | 1,922,173.29                                  |
| 资产支持证券投资收益            |          | -  | -   |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.12 | -  | -   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.13 | -88,047.34                               | 353,781.55                                    |
| 股利收益                  | 6.4.7.14 | 527,852.07                               | 667,473.99                                    |
| 其他投资收益                |          | -  | -   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | 2,151,502.11                             | 3,676,762.74                                  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.16 | 2,675.98                                 | 16,688.31                                     |
| <b>减：二、营业总支出</b>      |          | 1,036,258.49                             | 1,503,730.55                                  |
| 1. 管理人报酬              |          | 660,715.60                               | 1,044,185.23                                  |
| 2. 托管费                |          | 132,143.07                               | 261,046.34                                    |
| 3. 销售服务费              |          | 12,295.46                                | 27,835.17                                     |
| 4. 投资顾问费              |          | -  | -   |

|                            |          |                     |                     |
|----------------------------|----------|---------------------|---------------------|
| 5. 利息支出                    |          | 122,967.11          | 52,751.38           |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 122,967.11          | 52,751.38           |
| 6. 信用减值损失                  |          | -                   | -                   |
| 7. 税金及附加                   |          | 2,871.69            | 4,159.02            |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.17 | 105,265.56          | 113,753.41          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>3,200,549.69</b> | <b>4,781,043.36</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                   | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>3,200,549.69</b> | <b>4,781,043.36</b> |
| 五、其他综合收益的税后净额              |          | -                   | -                   |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | <b>3,200,549.69</b> | <b>4,781,043.36</b> |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：海富通安颐收益混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                |               |                |
|-------------------------------------|---------------------------------------|----------------|---------------|----------------|
|                                     | 实收基金                                  | 其他综合<br>收益（若有） | 未分配利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                           | 115,909,840.53                        | -              | 25,874,936.04 | 141,784,776.57 |
| 二、本期期初净资产                           | 115,909,840.53                        | -              | 25,874,936.04 | 141,784,776.57 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | -15,599,799.42                        | -              | -425,931.36   | -16,025,730.78 |
| （一）、综合收益总额                          | -                                     | -              | 3,200,549.69  | 3,200,549.69   |
| （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） | -15,599,799.42                        | -              | -3,626,481.05 | -19,226,280.47 |
| 其中：1.基金申购款                          | 1,307,431.89                          | -              | 311,691.85    | 1,619,123.74   |
| 2.基金赎回款                             | -16,907,231.31                        | -              | -3,938,172.90 | -20,845,404.21 |
| （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                                | 100,310,041.11                             | -          | 25,449,004.68  | 125,759,045.79 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |            |                |                |
|  | 实收基金                                       | 其他综合收益（若有） | 未分配利润          | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                                | 196,168,587.88                             | -          | 45,351,484.93  | 241,520,072.81 |
| 二、本期期初净资产                                | 196,168,587.88                             | -          | 45,351,484.93  | 241,520,072.81 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -47,155,409.85                             | -          | -7,231,928.44  | -54,387,338.29 |
| （一）、综合收益总额                               | -  | -          | 4,781,043.36   | 4,781,043.36   |
| （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）      | -47,155,409.85                             | -          | -12,012,971.80 | -59,168,381.65 |
| 其中：1.基金申购款                               | 3,771,631.59                               | -          | 952,982.82     | 4,724,614.41   |
| 2.基金赎回款                                  | -50,927,041.44                             | -          | -12,965,954.62 | -63,892,996.06 |
| （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                                | 149,013,178.03                             | -          | 38,119,556.49  | 187,132,734.52 |

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

海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益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[2013] 299 号文核准,由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通养老收益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 850,131,326.99 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 328 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通养老收益混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 5 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 850,399,612.86 份基金份额,其中认购资金利息折合 268,285.87 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据本基金管理人海富通基金管理有限公司 2016 年 1 月 6 日《关于海富通养老收益混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》的规定,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,自 2016 年 1 月 8 日起对本基金增加 C 类份额并相应修改基金合同。本基金原有的基金份额类别更名为 A 类基金份额,新增的基金份额类别命名为 C 类基金份额,并对 C 级份额收取销售服务费。

根据本基金管理人海富通基金管理有限公司 2018 年 6 月 1 日《海富通基金管理有限公司关于海富通养老收益混合型证券投资基金更名的公告》,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,自 2018 年 6 月 1 日起,海富通养老收益混合型证券投资基金更名为海富通安颐收益混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通安颐收益混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转换债券、分离交易可转换债券、次级债券、中小企业私募债券、债券回购、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以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)。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:本基金股票投资及存托凭证占基金资产的比例为 0%~95%,权证投资占基金资产净值的比例为 0%~3%,债券、银行存款、货币市场工具、现金及其它资产合计占基金资产的比例为 5%~100%,其中每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:三年期银行定期存款利率(税后)+ 2%。

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》、《海富通安颐收益混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品

管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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<br>2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 3,967,663.51           |
| 等于：本金          | 3,967,331.22           |
| 加：应计利息         | 332.29                 |
| 定期存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |

|        |              |
|--------|--------------|
| 等于：本金  | -            |
| 加：应计利息 | -            |
| 合计     | 3,967,663.51 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |           | 本期末<br>2024年6月30日 |              |                |              |
|---------------|-----------|-------------------|--------------|----------------|--------------|
|               |           | 成本                | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动       |
| 股票            |           | 30,003,436.13     | -            | 31,170,546.95  | 1,167,110.82 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |           | -                 | -            | -              | -            |
| 债券            | 交易所<br>市场 | 40,555,049.50     | 546,271.36   | 41,090,834.36  | -10,486.50   |
|               | 银行间<br>市场 | 51,785,967.77     | 626,153.94   | 53,491,803.94  | 1,079,682.23 |
|               | 合计        | 92,341,017.27     | 1,172,425.30 | 94,582,638.30  | 1,069,195.73 |
|               | 资产支持证券    | -                 | -            | -              | -            |
| 基金            |           | -                 | -            | -              | -            |
| 其他            |           | -                 | -            | -              | -            |
| 合计            |           | 122,344,453.40    | 1,172,425.30 | 125,753,185.25 | 2,236,306.55 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2024年6月30日 |      |    |    |
|--------|-------------------|------|----|----|
|        | 合同/名义<br>金额       | 公允价值 |    | 备注 |
|        |                   | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具 | -                 | -    | -  | -  |
| 货币衍生工具 | -                 | -    | -  | -  |
| 权益衍生工具 | -2,862,740.00     | -    | -  | -  |
| ——股指期货 | -2,862,740.00     | -    | -  | -  |
| 其他衍生工具 | -                 | -    | -  | -  |
| 合计     | -2,862,740.00     | -    | -  | -  |

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

| 代码         | 名称     | 持仓量(买/卖) | 合约市值          | 公允价值变动    |
|------------|--------|----------|---------------|-----------|
| IM2412     | IM2412 | -3.00    | -2,813,400.00 | 49,340.00 |
| 合计         | -      | -        | -             | 49,340.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 | -      | -        | -             | 49,340.00 |
| 净额         | -      | -        | -             | -         |

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

## 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 70.88             |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 83,458.41         |
| 其中：交易所市场    | 83,108.41         |
| 银行间市场       | 350.00            |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 82,049.24         |
| 合计          | 165,578.53        |

## 6.4.7.7 实收基金

## 海富通安颐收益混合 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 94,224,250.59              | 94,224,250.59  |
| 本期申购          | 851,618.04                 | 851,618.04     |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -12,792,497.83             | -12,792,497.83 |
| 本期末           | 82,283,370.80              | 82,283,370.80  |

## 海富通安颐收益混合 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |               |
|---------------|----------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额          |
| 上年度末          | 21,685,589.94              | 21,685,589.94 |
| 本期申购          | 455,813.85                 | 455,813.85    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -4,114,733.48              | -4,114,733.48 |
| 本期末           | 18,026,670.31              | 18,026,670.31 |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.8 未分配利润

## 海富通安颐收益混合 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           | 13,462,748.91 | 7,183,630.10  | 20,646,379.01 |
| 本期期初           | 13,462,748.91 | 7,183,630.10  | 20,646,379.01 |
| 本期利润           | 871,475.91    | 1,760,685.84  | 2,632,161.75  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,693,654.37 | -1,033,265.37 | -2,726,919.74 |
| 其中：基金申购款       | 121,132.49    | 75,858.42     | 196,990.91    |
| 基金赎回款          | -1,814,786.86 | -1,109,123.79 | -2,923,910.65 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 12,640,570.45 | 7,911,050.57  | 20,551,621.02 |

## 海富通安颐收益混合 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           | 3,546,650.19 | 1,681,906.84 | 5,228,557.03  |
| 本期期初           | 3,546,650.19 | 1,681,906.84 | 5,228,557.03  |
| 本期利润           | 177,571.67   | 390,816.27   | 568,387.94    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -590,181.38  | -309,379.93  | -899,561.31   |
| 其中：基金申购款       | 74,001.07    | 40,699.87    | 114,700.94    |
| 基金赎回款          | -664,182.45  | -350,079.80  | -1,014,262.25 |
| 本期已分配利润        | -            | -            | -             |
| 本期末            | 3,134,040.48 | 1,763,343.18 | 4,897,383.66  |

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 7,697.36                   |
| 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 | 53,551.51                  |
| 其他        | 112.32                     |
| 合计        | 61,361.19                  |

## 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 129,124,792.73             |
| 减：卖出股票成本总额 | 128,648,246.77             |
| 减：交易费用     | 264,725.71                 |
| 买卖股票差价收入   | 211,820.25                 |

## 6.4.7.11 债券投资收益

## 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|-------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入      | 1,342,112.76               |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及 | 27,531.16                  |

|                |              |
|----------------|--------------|
| 债券到期兑付) 差价收入   |              |
| 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             | 1,369,643.92 |

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期                   |
|-------------------------|----------------------|
|                         | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额    | 54,769,453.31        |
| 减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额 | 53,823,292.06        |
| 减: 应计利息总额               | 917,520.50           |
| 减: 交易费用                 | 1,109.59             |
| 买卖债券差价收入                | 27,531.16            |

#### 6.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

| 项目                 | 本期                   |
|--------------------|----------------------|
|                    | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股指期货投资收益(税前)       | -74,100.00           |
| 减: 股指期货差价收入应缴纳增值税额 | 4,596.70             |
| 减: 交易费用            | 9,350.64             |
| 合计                 | -88,047.34           |

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   |
|----------------|----------------------|
|                | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益    | 527,852.07           |
| 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             | 527,852.07           |

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产                  | 2,102,162.11               |
| ——股票投资                     | 1,060,872.44               |
| ——债券投资                     | 1,041,289.67               |
| ——资产支持证券投资                 | -                          |
| ——基金投资                     | -                          |
| ——贵金属投资                    | -                          |
| ——其他                       | -                          |
| 2.衍生工具                     | 49,340.00                  |
| ——权证投资                     | -                          |
| ——股指期货                     | 49,340.00                  |
| 3.其他                       | -                          |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的<br>预估增值税 | -                          |
| 合计                         | 2,151,502.11               |

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 2,473.35                   |
| 基金转换费收入 | 202.63                     |
| 合计      | 2,675.98                   |

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 审计费用      | 22,376.90                  |
| 信息披露费     | 59,672.34                  |
| 证券出借违约金   | -                          |
| 银行划款手续费   | 4,616.32                   |
| 其他费用      | 600.00                     |
| 债券托管账户维护费 | 18,000.00                  |
| 合计        | 105,265.56                 |

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称              | 与本基金的关系         |
|--------------------|-----------------|
| 海富通基金管理有限公司(“海富通”) | 基金管理人、基金销售机构    |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”) | 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |              |
|-------|----------------------------|--------------|---------------------------------|--------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期股票成交总额的比例 |
| 海通证券  | 21,567,613.11              | 8.61%        | 29,122,913.27                   | 8.24%        |

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024年1月1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  | 14,454.14                  | 7.85%      | 14,454.14 | 17.39%       |

| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                |          |                  |
|-------|---------------------------------|----------------|----------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 海通证券  | 21,006.75                       | 17.90%         | -        | -                |

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。

#### 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<br>2024年1月1日至2024年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6<br>月30日 |
|------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 660,715.60                     | 1,044,185.23                        |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 221,086.58                     | 347,927.55                          |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 439,629.02                     | 696,257.68                          |

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 x 1.00%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6<br>月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 132,143.07                     | 261,046.34                          |

注：海富通安颐收益混合型证券投资基金的托管费率由 0.25% 下调至 0.20%，自 2023 年 8 月 26 日起执行新的托管费率。

2023 年 8 月 26 日之前支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 x 0.25%/当年天数。

2023 年 8 月 26 日之后（含）支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 x 0.20%/当年天数。

**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<br>2024年1月1日至2024年6月30日      |             |          |
|----------------|---------------------------------|-------------|----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |             |          |
|                | 海富通安颐收益混合 A                     | 海富通安颐收益混合 C | 合计       |
| 海通证券           | -                               | 12.74       | 12.74    |
| 海富通基金          | -                               | 11.52       | 11.52    |
| 合计             | -                               | 24.26       | 24.26    |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |             |          |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |             |          |
|                | 海富通安颐收益混合 A                     | 海富通安颐收益混合 C | 合计       |
| 海通证券           | -                               | 3,849.81    | 3,849.81 |
| 海富通基金          | -                               | 4,087.61    | 4,087.61 |
| 合计             | -                               | 7,937.42    | 7,937.42 |

注：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 0.10%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.10% 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 × 0.10% / 当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

| 项目                | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |            | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |            |
|-------------------|----------------------------|------------|---------------------------------|------------|
|                   | 海富通安颐收益混合A                 | 海富通安颐收益混合C | 海富通安颐收益混合A                      | 海富通安颐收益混合C |
| 期初持有的基金份额         | 14,780,873.55              | -          | 14,780,873.55                   | -          |
| 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         | 14,780,873.55              | -          | 14,780,873.55                   | -          |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 17.96%                     | -          | 13.39%                          | -          |

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。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |          | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |           |
|-------|----------------------------|----------|---------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                       | 当期利息收入   | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 中国银行  | 3,967,663.51               | 7,697.36 | 3,716,610.13                    | 11,058.79 |

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

##### 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

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制下跌风险的基础上，积极把握股票市场的投资机会，确保资产的保值增值，实现战胜绝对收益基准的目标，为投资者提供稳健的养老理财工具。

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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 53.44%（2023 年 12 月 31 日：54.45%）。

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<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 6,722,904.82      | 7,539,066.30        |
| 合计     | 6,722,904.82      | 7,539,066.30        |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债。

##### 6.4.13.2.2 按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<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
|--------|-------------------|---------------------|

|        |   |              |
|--------|---|--------------|
| A-1    | - | -            |
| A-1 以下 | - | -            |
| 未评级    | - | 9,962,108.31 |
| 合计     | - | 9,962,108.31 |

#### 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<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 60,781,040.09     | 62,102,238.74       |
| AAA 以下 | 1,287,443.55      | -                   |
| 未评级    | 25,791,249.84     | 35,207,915.13       |
| 合计     | 87,859,733.48     | 97,310,153.87       |

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、政策性金融债、中期票据及无第三方评级机构评级的债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均能及时变现。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金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<br>2024年6月30日   | 1年以内          | 1-5年          | 5年以上          | 不计息           | 合计             |
|---------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|
| 资产                  |               |               |               |               |                |
| 货币资金                | 3,967,663.51  | -             | -             | -             | 3,967,663.51   |
| 结算备付金               | 3,533,392.20  | -             | -             | -             | 3,533,392.20   |
| 存出保证金               | 15,610.53     | -             | -             | 337,608.00    | 353,218.53     |
| 交易性金融资产             | 37,367,422.76 | 25,338,199.72 | 31,877,015.82 | 31,170,546.95 | 125,753,185.25 |
| 应收申购款               | -             | -             | -             | 8,996.86      | 8,996.86       |
| 资产总计                | 44,884,089.00 | 25,338,199.72 | 31,877,015.82 | 31,517,151.81 | 133,616,456.35 |
| 负债                  |               |               |               |               |                |
| 卖出回购金融资产款           | 7,100,000.00  | -             | -             | -             | 7,100,000.00   |
| 应付清算款               | -             | -             | -             | 46,361.40     | 46,361.40      |
| 应付赎回款               | -             | -             | -             | 415,673.69    | 415,673.69     |
| 应付管理人报酬             | -             | -             | -             | 104,109.16    | 104,109.16     |
| 应付托管费               | -             | -             | -             | 20,821.85     | 20,821.85      |
| 应付销售服务费             | -             | -             | -             | 1,910.08      | 1,910.08       |
| 应交税费                | -             | -             | -             | 2,955.85      | 2,955.85       |
| 其他负债                | -             | -             | -             | 165,578.53    | 165,578.53     |
| 负债总计                | 7,100,000.00  | -             | -             | 757,410.56    | 7,857,410.56   |
| 利率敏感度缺口             | 37,784,089.00 | 25,338,199.72 | 31,877,015.82 | 30,759,741.25 | 125,759,045.79 |
| 上年度末<br>2023年12月31日 | 1年以内          | 1-5年          | 5年以上          | 不计息           | 合计             |
| 资产                  |               |               |               |               |                |
| 货币资金                | 3,432,439.45  | -             | -             | -             | 3,432,439.45   |
| 结算备付金               | 7,355,366.93  | -             | -             | -             | 7,355,366.93   |
| 存出保证金               | 11,151.92     | -             | -             | -             | 11,151.92      |
| 交易性金融资产             | 68,129,032.04 | 37,091,913.34 | 9,590,383.10  | 37,318,153.73 | 152,129,482.21 |
| 应收清算款               | -             | -             | -             | 31,442.08     | 31,442.08      |
| 应收申购款               | -             | -             | -             | 44,183.98     | 44,183.98      |

|           |               |               |              |               |                |
|-----------|---------------|---------------|--------------|---------------|----------------|
| 资产总计      | 78,927,990.34 | 37,091,913.34 | 9,590,383.10 | 37,393,779.79 | 163,004,066.57 |
| 负债        |               |               |              |               |                |
| 卖出回购金融资产款 | 19,597,677.37 | -             | -            | -             | 19,597,677.37  |
| 应付清算款     | -             | -             | -            | 783,821.50    | 783,821.50     |
| 应付赎回款     | -             | -             | -            | 441,184.79    | 441,184.79     |
| 应付管理人报酬   | -             | -             | -            | 121,812.85    | 121,812.85     |
| 应付托管费     | -             | -             | -            | 24,362.57     | 24,362.57      |
| 应付销售服务费   | -             | -             | -            | 2,303.28      | 2,303.28       |
| 应交税费      | -             | -             | -            | 3,117.86      | 3,117.86       |
| 其他负债      | -             | -             | -            | 245,009.78    | 245,009.78     |
| 负债总计      | 19,597,677.37 | -             | -            | 1,621,612.63  | 21,219,290.00  |
| 利率敏感度缺口   | 59,330,312.97 | 37,091,913.34 | 9,590,383.10 | 35,772,167.16 | 141,784,776.57 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设            | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                     |
|---------------|--------------------|---------------------------------|---------------------|
| 分析            | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                     |
|               |                    | 本期末<br>2024年6月30日               | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|               | 市场利率上升 25 个基点      | -864,669.71                     | -732,895.04         |
| 市场利率下降 25 个基点 | 880,804.44         | 745,634.22                      |                     |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，

也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资及存托凭证 0%~95%，权证投资 0%~3%，债券、银行存款、货币市场工具、现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)及其它资产 5%~100%。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<br>2024 年 6 月 30 日 |                      | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |                      |
|---------------|------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 31,170,546.95          | 24.79                | 37,318,153.73            | 26.32                |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 其他            | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 合计            | 31,170,546.95          | 24.79                | 37,318,153.73            | 26.32                |

#### 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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 1.业绩比较基准上升 5% | 1,365,795.28           | 1,527,886.43             |
| 2.业绩比较基准下降 5% | -1,365,795.28          | -1,527,886.43            |

#### 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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 34,481,687.45          | 37,424,170.58            |
| 第二层次          | 91,271,497.80          | 114,705,311.63           |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 125,753,185.25         | 152,129,482.21           |

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日,本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2023 年 12 月 31 日:无)。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 31,170,546.95  | 23.33         |
|    | 其中：股票             | 31,170,546.95  | 23.33         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 94,582,638.30  | 70.79         |
|    | 其中：债券             | 94,582,638.30  | 70.79         |
|    | 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          | -              | -             |
|    | 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      | 7,501,055.71   | 5.61          |
| 8  | 其他各项资产            | 362,215.39     | 0.27          |
| 9  | 合计                | 133,616,456.35 | 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      | 3,164,097.00 | 2.52          |

|   |                  |               |       |
|---|------------------|---------------|-------|
| C | 制造业              | 17,904,791.59 | 14.24 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,133,283.00  | 2.49  |
| E | 建筑业              | 991,664.00    | 0.79  |
| F | 批发和零售业           | 364,703.00    | 0.29  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 715,140.40    | 0.57  |
| H | 住宿和餐饮业           | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,280,570.36  | 1.02  |
| J | 金融业              | 2,224,147.60  | 1.77  |
| K | 房地产业             | 176,697.00    | 0.14  |
| L | 租赁和商务服务业         | 344,328.00    | 0.27  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 52,383.00     | 0.04  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 818,742.00    | 0.65  |
| 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               | 31,170,546.95 | 24.79 |

### 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  | 300308 | 中际旭创 | 5,460  | 752,824.80 | 0.60         |
| 2  | 600487 | 亨通光电 | 46,200 | 728,574.00 | 0.58         |
| 3  | 300502 | 新易盛  | 6,900  | 728,295.00 | 0.58         |
| 4  | 300750 | 宁德时代 | 3,800  | 684,114.00 | 0.54         |
| 5  | 600522 | 中天科技 | 35,800 | 567,430.00 | 0.45         |
| 6  | 600150 | 中国船舶 | 13,100 | 533,301.00 | 0.42         |
| 7  | 601001 | 晋控煤业 | 30,300 | 500,556.00 | 0.40         |
| 8  | 601138 | 工业富联 | 17,800 | 487,720.00 | 0.39         |
| 9  | 300433 | 蓝思科技 | 26,500 | 483,625.00 | 0.38         |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 10 | 002126 | 银轮股份 | 26,700 | 464,847.00 | 0.37 |
| 11 | 002322 | 理工能科 | 26,800 | 429,336.00 | 0.34 |
| 12 | 002463 | 沪电股份 | 11,700 | 427,050.00 | 0.34 |
| 13 | 603129 | 春风动力 | 3,000  | 427,020.00 | 0.34 |
| 14 | 601668 | 中国建筑 | 78,300 | 415,773.00 | 0.33 |
| 15 | 600642 | 申能股份 | 45,000 | 397,350.00 | 0.32 |
| 16 | 601033 | 永兴股份 | 24,100 | 390,179.00 | 0.31 |
| 17 | 000333 | 美的集团 | 6,000  | 387,000.00 | 0.31 |
| 18 | 600795 | 国电电力 | 62,800 | 376,172.00 | 0.30 |
| 19 | 600483 | 福能股份 | 30,000 | 349,800.00 | 0.28 |
| 20 | 300573 | 兴齐眼药 | 2,100  | 344,400.00 | 0.27 |
| 21 | 000552 | 甘肃能化 | 99,100 | 343,877.00 | 0.27 |
| 22 | 601717 | 郑煤机  | 23,200 | 343,360.00 | 0.27 |
| 23 | 600803 | 新奥股份 | 16,500 | 343,200.00 | 0.27 |
| 24 | 601899 | 紫金矿业 | 19,500 | 342,615.00 | 0.27 |
| 25 | 600938 | 中国海油 | 10,300 | 339,900.00 | 0.27 |
| 26 | 600323 | 瀚蓝环境 | 15,200 | 317,680.00 | 0.25 |
| 27 | 000400 | 许继电气 | 9,200  | 316,572.00 | 0.25 |
| 28 | 601077 | 渝农商行 | 61,400 | 308,228.00 | 0.25 |
| 29 | 603283 | 赛腾股份 | 4,000  | 305,600.00 | 0.24 |
| 30 | 600919 | 江苏银行 | 36,300 | 269,709.00 | 0.21 |
| 31 | 002142 | 宁波银行 | 12,200 | 269,132.00 | 0.21 |
| 32 | 600941 | 中国移动 | 2,400  | 258,000.00 | 0.21 |
| 33 | 601658 | 邮储银行 | 50,500 | 256,035.00 | 0.20 |
| 34 | 300476 | 胜宏科技 | 7,900  | 254,854.00 | 0.20 |
| 35 | 603871 | 嘉友国际 | 14,160 | 250,490.40 | 0.20 |
| 36 | 002353 | 杰瑞股份 | 7,100  | 249,068.00 | 0.20 |
| 37 | 600023 | 浙能电力 | 34,900 | 248,139.00 | 0.20 |
| 38 | 002027 | 分众传媒 | 39,800 | 241,188.00 | 0.19 |
| 39 | 600575 | 淮河能源 | 61,600 | 239,624.00 | 0.19 |
| 40 | 601702 | 华峰铝业 | 12,700 | 231,902.00 | 0.18 |
| 41 | 601601 | 中国太保 | 8,200  | 228,452.00 | 0.18 |
| 42 | 600028 | 中国石化 | 36,100 | 228,152.00 | 0.18 |
| 43 | 600900 | 长江电力 | 7,800  | 225,576.00 | 0.18 |
| 44 | 002429 | 兆驰股份 | 46,200 | 222,222.00 | 0.18 |
| 45 | 000543 | 皖能电力 | 24,900 | 220,365.00 | 0.18 |
| 46 | 603993 | 洛阳钼业 | 25,700 | 218,450.00 | 0.17 |
| 47 | 600098 | 广州发展 | 33,900 | 216,960.00 | 0.17 |
| 48 | 603556 | 海兴电力 | 4,600  | 215,418.00 | 0.17 |
| 49 | 301004 | 嘉益股份 | 2,300  | 209,300.00 | 0.17 |
| 50 | 300628 | 亿联网络 | 5,600  | 205,912.00 | 0.16 |
| 51 | 601918 | 新集能源 | 20,900 | 203,775.00 | 0.16 |
| 52 | 002273 | 水晶光电 | 11,900 | 202,062.00 | 0.16 |
| 53 | 600036 | 招商银行 | 5,400  | 184,626.00 | 0.15 |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 54 | 002452 | 长高电新 | 22,100 | 182,988.00 | 0.15 |
| 55 | 000090 | 天健集团 | 45,500 | 182,910.00 | 0.15 |
| 56 | 001286 | 陕西能源 | 15,700 | 181,021.00 | 0.14 |
| 57 | 000338 | 潍柴动力 | 11,100 | 180,264.00 | 0.14 |
| 58 | 000921 | 海信家电 | 5,500  | 177,320.00 | 0.14 |
| 59 | 688093 | 世华科技 | 9,608  | 174,577.36 | 0.14 |
| 60 | 002588 | 史丹利  | 23,100 | 173,943.00 | 0.14 |
| 61 | 300181 | 佐力药业 | 11,400 | 172,368.00 | 0.14 |
| 62 | 000039 | 中集集团 | 18,300 | 169,458.00 | 0.13 |
| 63 | 002001 | 新和成  | 8,656  | 166,195.20 | 0.13 |
| 64 | 000902 | 新洋丰  | 13,900 | 164,993.00 | 0.13 |
| 65 | 300274 | 阳光电源 | 2,580  | 160,037.40 | 0.13 |
| 66 | 002851 | 麦格米特 | 6,100  | 157,624.00 | 0.13 |
| 67 | 300360 | 炬华科技 | 9,200  | 156,400.00 | 0.12 |
| 68 | 600546 | 山煤国际 | 10,600 | 154,972.00 | 0.12 |
| 69 | 601117 | 中国化学 | 18,600 | 153,264.00 | 0.12 |
| 70 | 600497 | 驰宏锌锗 | 28,700 | 153,258.00 | 0.12 |
| 71 | 002922 | 伊戈尔  | 6,900  | 150,834.00 | 0.12 |
| 72 | 000682 | 东方电子 | 12,200 | 134,688.00 | 0.11 |
| 73 | 601028 | 玉龙股份 | 10,700 | 133,750.00 | 0.11 |
| 74 | 002540 | 亚太科技 | 23,900 | 126,431.00 | 0.10 |
| 75 | 300926 | 博俊科技 | 6,315  | 126,426.30 | 0.10 |
| 76 | 002252 | 上海莱士 | 15,900 | 124,338.00 | 0.10 |
| 77 | 601168 | 西部矿业 | 6,900  | 123,855.00 | 0.10 |
| 78 | 002130 | 沃尔核材 | 8,600  | 121,432.00 | 0.10 |
| 79 | 002422 | 科伦药业 | 4,000  | 121,320.00 | 0.10 |
| 80 | 300679 | 电连技术 | 3,000  | 120,690.00 | 0.10 |
| 81 | 002966 | 苏州银行 | 15,900 | 119,250.00 | 0.09 |
| 82 | 603067 | 振华股份 | 10,000 | 116,600.00 | 0.09 |
| 83 | 601998 | 中信银行 | 17,400 | 116,580.00 | 0.09 |
| 84 | 300760 | 迈瑞医疗 | 400    | 116,364.00 | 0.09 |
| 85 | 603986 | 兆易创新 | 1,200  | 114,744.00 | 0.09 |
| 86 | 600820 | 隧道股份 | 17,100 | 111,663.00 | 0.09 |
| 87 | 300627 | 华测导航 | 3,700  | 110,445.00 | 0.09 |
| 88 | 000598 | 兴蓉环境 | 14,600 | 109,792.00 | 0.09 |
| 89 | 600710 | 苏美达  | 13,400 | 109,210.00 | 0.09 |
| 90 | 000630 | 铜陵有色 | 30,100 | 108,661.00 | 0.09 |
| 91 | 688401 | 路维光电 | 4,111  | 107,708.20 | 0.09 |
| 92 | 601225 | 陕西煤业 | 4,100  | 105,657.00 | 0.08 |
| 93 | 300910 | 瑞丰新材 | 2,400  | 104,928.00 | 0.08 |
| 94 | 600750 | 江中药业 | 4,500  | 103,995.00 | 0.08 |
| 95 | 601919 | 中远海控 | 6,700  | 103,783.00 | 0.08 |
| 96 | 300482 | 万孚生物 | 4,200  | 102,480.00 | 0.08 |
| 97 | 601677 | 明泰铝业 | 8,800  | 101,728.00 | 0.08 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 98  | 002687 | 乔治白  | 23,900 | 100,380.00 | 0.08 |
| 99  | 300979 | 华利集团 | 1,600  | 97,360.00  | 0.08 |
| 100 | 300349 | 金卡智能 | 8,100  | 96,552.00  | 0.08 |
| 101 | 603279 | 景津装备 | 4,300  | 93,267.00  | 0.07 |
| 102 | 600048 | 保利发展 | 10,300 | 90,228.00  | 0.07 |
| 103 | 605090 | 九丰能源 | 3,100  | 89,900.00  | 0.07 |
| 104 | 600114 | 东睦股份 | 5,800  | 83,462.00  | 0.07 |
| 105 | 002332 | 仙琚制药 | 7,186  | 81,992.26  | 0.07 |
| 106 | 601577 | 长沙银行 | 9,700  | 79,346.00  | 0.06 |
| 107 | 000807 | 云铝股份 | 5,600  | 75,656.00  | 0.06 |
| 108 | 002532 | 天山铝业 | 9,200  | 74,612.00  | 0.06 |
| 109 | 002600 | 领益智造 | 9,900  | 70,488.00  | 0.06 |
| 110 | 002833 | 弘亚数控 | 3,800  | 69,312.00  | 0.06 |
| 111 | 603699 | 纽威股份 | 4,000  | 68,480.00  | 0.05 |
| 112 | 600285 | 羚锐制药 | 2,800  | 67,788.00  | 0.05 |
| 113 | 002128 | 电投能源 | 3,200  | 67,520.00  | 0.05 |
| 114 | 600886 | 国投电力 | 3,600  | 65,664.00  | 0.05 |
| 115 | 002752 | 昇兴股份 | 12,900 | 65,274.00  | 0.05 |
| 116 | 000933 | 神火股份 | 3,200  | 64,736.00  | 0.05 |
| 117 | 002371 | 北方华创 | 200    | 63,978.00  | 0.05 |
| 118 | 600012 | 皖通高速 | 4,500  | 62,865.00  | 0.05 |
| 119 | 601898 | 中煤能源 | 5,000  | 62,400.00  | 0.05 |
| 120 | 600406 | 国电南瑞 | 2,500  | 62,400.00  | 0.05 |
| 121 | 600660 | 福耀玻璃 | 1,300  | 62,270.00  | 0.05 |
| 122 | 601128 | 常熟银行 | 8,180  | 61,922.60  | 0.05 |
| 123 | 600426 | 华鲁恒升 | 2,300  | 61,272.00  | 0.05 |
| 124 | 601328 | 交通银行 | 8,200  | 61,254.00  | 0.05 |
| 125 | 002327 | 富安娜  | 5,900  | 59,295.00  | 0.05 |
| 126 | 601939 | 建设银行 | 8,000  | 59,200.00  | 0.05 |
| 127 | 603393 | 新天然气 | 1,700  | 59,058.00  | 0.05 |
| 128 | 002078 | 太阳纸业 | 4,200  | 58,590.00  | 0.05 |
| 129 | 600018 | 上港集团 | 10,100 | 58,378.00  | 0.05 |
| 130 | 600312 | 平高电气 | 3,000  | 58,350.00  | 0.05 |
| 131 | 601088 | 中国神华 | 1,300  | 57,681.00  | 0.05 |
| 132 | 605368 | 蓝天燃气 | 4,200  | 57,288.00  | 0.05 |
| 133 | 600968 | 海油发展 | 13,900 | 57,268.00  | 0.05 |
| 134 | 600584 | 长电科技 | 1,800  | 57,078.00  | 0.05 |
| 135 | 002533 | 金杯电工 | 5,700  | 56,715.00  | 0.05 |
| 136 | 300130 | 新国都  | 3,400  | 56,576.00  | 0.04 |
| 137 | 601600 | 中国铝业 | 7,400  | 56,462.00  | 0.04 |
| 138 | 600219 | 南山铝业 | 14,800 | 56,388.00  | 0.04 |
| 139 | 002064 | 华峰化学 | 7,800  | 55,926.00  | 0.04 |
| 140 | 601997 | 贵阳银行 | 10,600 | 55,862.00  | 0.04 |
| 141 | 002993 | 奥海科技 | 1,500  | 55,800.00  | 0.04 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 142 | 300791 | 仙乐健康 | 2,210  | 55,692.00 | 0.04 |
| 143 | 600901 | 江苏金租 | 11,000 | 55,550.00 | 0.04 |
| 144 | 002003 | 伟星股份 | 4,400  | 55,220.00 | 0.04 |
| 145 | 002475 | 立讯精密 | 1,400  | 55,034.00 | 0.04 |
| 146 | 301301 | 川宁生物 | 4,300  | 54,954.00 | 0.04 |
| 147 | 002380 | 科远智慧 | 3,000  | 54,900.00 | 0.04 |
| 148 | 002096 | 易普力  | 4,600  | 54,740.00 | 0.04 |
| 149 | 601058 | 赛轮轮胎 | 3,900  | 54,600.00 | 0.04 |
| 150 | 002039 | 黔源电力 | 3,100  | 54,560.00 | 0.04 |
| 151 | 600008 | 首创环保 | 20,300 | 54,404.00 | 0.04 |
| 152 | 603508 | 思维列控 | 2,900  | 54,375.00 | 0.04 |
| 153 | 002911 | 佛燃能源 | 5,900  | 53,926.00 | 0.04 |
| 154 | 600566 | 济川药业 | 1,700  | 53,907.00 | 0.04 |
| 155 | 688332 | 中科蓝讯 | 911    | 53,739.89 | 0.04 |
| 156 | 000923 | 河钢资源 | 3,100  | 53,382.00 | 0.04 |
| 157 | 300017 | 网宿科技 | 6,700  | 52,930.00 | 0.04 |
| 158 | 600064 | 南京高科 | 8,700  | 52,809.00 | 0.04 |
| 159 | 601666 | 平煤股份 | 4,700  | 52,640.00 | 0.04 |
| 160 | 000887 | 中鼎股份 | 4,300  | 52,632.00 | 0.04 |
| 161 | 300795 | 米奥会展 | 3,000  | 52,590.00 | 0.04 |
| 162 | 603357 | 设计总院 | 5,700  | 52,383.00 | 0.04 |
| 163 | 002311 | 海大集团 | 1,100  | 51,755.00 | 0.04 |
| 164 | 002938 | 鹏鼎控股 | 1,300  | 51,688.00 | 0.04 |
| 165 | 600887 | 伊利股份 | 2,000  | 51,680.00 | 0.04 |
| 166 | 300092 | 科新机电 | 4,800  | 51,648.00 | 0.04 |
| 167 | 605319 | 无锡振华 | 2,900  | 51,330.00 | 0.04 |
| 168 | 002847 | 盐津铺子 | 1,200  | 51,324.00 | 0.04 |
| 169 | 000848 | 承德露露 | 6,500  | 51,090.00 | 0.04 |
| 170 | 301109 | 军信股份 | 3,400  | 50,830.00 | 0.04 |
| 171 | 600398 | 海澜之家 | 5,500  | 50,820.00 | 0.04 |
| 172 | 300470 | 中密控股 | 1,500  | 50,715.00 | 0.04 |
| 173 | 301195 | 北路智控 | 1,700  | 50,558.00 | 0.04 |
| 174 | 000906 | 浙商中拓 | 7,500  | 50,550.00 | 0.04 |
| 175 | 600422 | 昆药集团 | 2,800  | 49,924.00 | 0.04 |
| 176 | 000498 | 山东路桥 | 9,500  | 49,685.00 | 0.04 |
| 177 | 000012 | 南玻 A | 9,700  | 48,888.00 | 0.04 |
| 178 | 603055 | 台华新材 | 4,800  | 48,624.00 | 0.04 |
| 179 | 601689 | 拓普集团 | 900    | 48,249.00 | 0.04 |
| 180 | 600970 | 中材国际 | 4,000  | 48,240.00 | 0.04 |
| 181 | 002697 | 红旗连锁 | 10,400 | 48,152.00 | 0.04 |
| 182 | 002264 | 新华都  | 9,400  | 48,034.00 | 0.04 |
| 183 | 600479 | 千金药业 | 4,700  | 47,799.00 | 0.04 |
| 184 | 000932 | 华菱钢铁 | 10,700 | 47,401.00 | 0.04 |
| 185 | 300770 | 新媒股份 | 1,400  | 46,732.00 | 0.04 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 186 | 603369 | 今世缘  | 1,000 | 46,200.00 | 0.04 |
| 187 | 603040 | 新坐标  | 2,300 | 45,839.00 | 0.04 |
| 188 | 601127 | 赛力斯  | 500   | 45,560.00 | 0.04 |
| 189 | 600298 | 安琪酵母 | 1,600 | 44,688.00 | 0.04 |
| 190 | 300457 | 赢合科技 | 2,500 | 44,575.00 | 0.04 |
| 191 | 300815 | 玉禾田  | 3,800 | 44,232.00 | 0.04 |
| 192 | 688789 | 宏华数科 | 404   | 43,551.20 | 0.03 |
| 193 | 002757 | 南兴股份 | 3,600 | 43,380.00 | 0.03 |
| 194 | 300415 | 伊之密  | 1,800 | 37,404.00 | 0.03 |
| 195 | 002461 | 珠江啤酒 | 4,500 | 33,390.00 | 0.03 |
| 196 | 601009 | 南京银行 | 3,100 | 32,209.00 | 0.03 |
| 197 | 300514 | 友讯达  | 2,100 | 31,773.00 | 0.03 |
| 198 | 688169 | 石头科技 | 79    | 31,015.40 | 0.02 |
| 199 | 603298 | 杭叉集团 | 1,540 | 30,245.60 | 0.02 |
| 200 | 600248 | 陕建股份 | 8,300 | 30,129.00 | 0.02 |
| 201 | 600461 | 洪城环境 | 2,600 | 30,108.00 | 0.02 |
| 202 | 603086 | 先达股份 | 7,900 | 30,020.00 | 0.02 |
| 203 | 000786 | 北新建材 | 1,000 | 29,660.00 | 0.02 |
| 204 | 688099 | 晶晨股份 | 498   | 29,541.36 | 0.02 |
| 205 | 601126 | 四方股份 | 1,500 | 28,830.00 | 0.02 |
| 206 | 603228 | 景旺电子 | 900   | 28,620.00 | 0.02 |
| 207 | 603236 | 移远通信 | 600   | 28,038.00 | 0.02 |
| 208 | 601838 | 成都银行 | 1,800 | 27,342.00 | 0.02 |
| 209 | 002032 | 苏泊尔  | 500   | 25,050.00 | 0.02 |
| 210 | 002318 | 久立特材 | 1,000 | 23,330.00 | 0.02 |
| 211 | 600123 | 兰花科创 | 2,600 | 23,270.00 | 0.02 |
| 212 | 601166 | 兴业银行 | 1,300 | 22,906.00 | 0.02 |
| 213 | 301088 | 戎美股份 | 2,000 | 22,400.00 | 0.02 |
| 214 | 600007 | 中国国贸 | 1,000 | 21,960.00 | 0.02 |
| 215 | 600985 | 淮北矿业 | 1,300 | 21,762.00 | 0.02 |
| 216 | 600971 | 恒源煤电 | 1,800 | 21,492.00 | 0.02 |
| 217 | 002241 | 歌尔股份 | 1,100 | 21,461.00 | 0.02 |
| 218 | 002043 | 兔宝宝  | 2,000 | 20,740.00 | 0.02 |
| 219 | 301198 | 喜悦智行 | 2,400 | 19,224.00 | 0.02 |
| 220 | 600348 | 华阳股份 | 1,900 | 18,924.00 | 0.02 |
| 221 | 600237 | 铜峰电子 | 3,600 | 18,792.00 | 0.01 |
| 222 | 002762 | 金发拉比 | 3,600 | 18,072.00 | 0.01 |
| 223 | 300453 | 三鑫医疗 | 2,800 | 17,892.00 | 0.01 |
| 224 | 002695 | 煌上煌  | 2,700 | 17,523.00 | 0.01 |
| 225 | 002440 | 闰土股份 | 3,200 | 17,376.00 | 0.01 |
| 226 | 002222 | 福晶科技 | 770   | 17,348.10 | 0.01 |
| 227 | 688408 | 中信博  | 186   | 17,126.88 | 0.01 |
| 228 | 300264 | 佳创视讯 | 4,300 | 16,899.00 | 0.01 |
| 229 | 600089 | 特变电工 | 1,200 | 16,644.00 | 0.01 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 230 | 601318 | 中国平安 | 400   | 16,544.00 | 0.01 |
| 231 | 603811 | 诚意药业 | 2,600 | 16,250.00 | 0.01 |
| 232 | 000885 | 城发环境 | 1,300 | 15,821.00 | 0.01 |
| 233 | 603368 | 柳药集团 | 900   | 15,750.00 | 0.01 |
| 234 | 603611 | 诺力股份 | 900   | 15,336.00 | 0.01 |
| 235 | 002737 | 葵花药业 | 600   | 14,028.00 | 0.01 |
| 236 | 300073 | 当升科技 | 400   | 13,724.00 | 0.01 |
| 237 | 600729 | 重庆百货 | 600   | 13,416.00 | 0.01 |
| 238 | 603355 | 莱克电气 | 600   | 12,960.00 | 0.01 |
| 239 | 603816 | 顾家家居 | 400   | 12,916.00 | 0.01 |
| 240 | 601699 | 潞安环能 | 700   | 12,691.00 | 0.01 |
| 241 | 000895 | 双汇发展 | 500   | 11,885.00 | 0.01 |
| 242 | 600325 | 华发股份 | 1,800 | 11,700.00 | 0.01 |
| 243 | 300303 | 聚飞光电 | 2,400 | 11,664.00 | 0.01 |
| 244 | 600612 | 老凤祥  | 200   | 11,638.00 | 0.01 |
| 245 | 002091 | 江苏国泰 | 1,700 | 11,577.00 | 0.01 |
| 246 | 603995 | 甬金股份 | 600   | 10,512.00 | 0.01 |
| 247 | 002867 | 周大生  | 800   | 10,448.00 | 0.01 |
| 248 | 603757 | 大元泵业 | 500   | 9,550.00  | 0.01 |
| 249 | 603301 | 振德医疗 | 400   | 8,344.00  | 0.01 |
| 250 | 603010 | 万盛股份 | 900   | 8,109.00  | 0.01 |
| 251 | 603818 | 曲美家居 | 2,900 | 8,091.00  | 0.01 |
| 252 | 002674 | 兴业科技 | 300   | 3,066.00  | 0.00 |
| 253 | 002434 | 万里扬  | 500   | 2,450.00  | 0.00 |
| 254 | 603839 | 安正时尚 | 500   | 2,185.00  | 0.00 |
| 255 | 002293 | 罗莱生活 | 200   | 1,616.00  | 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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 300274 | 阳光电源 | 1,245,367.00 | 0.88            |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 1,017,641.00 | 0.72            |
| 3  | 601077 | 渝农商行 | 1,005,437.00 | 0.71            |
| 4  | 600522 | 中天科技 | 980,816.00   | 0.69            |
| 5  | 600919 | 江苏银行 | 937,834.00   | 0.66            |
| 6  | 000858 | 五粮液  | 925,989.00   | 0.65            |
| 7  | 603129 | 春风动力 | 918,707.00   | 0.65            |
| 8  | 000333 | 美的集团 | 900,023.00   | 0.63            |
| 9  | 002322 | 理工能科 | 899,677.00   | 0.63            |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 10 | 600023 | 浙能电力 | 898,757.00 | 0.63 |
| 11 | 601138 | 工业富联 | 835,877.00 | 0.59 |
| 12 | 000338 | 潍柴动力 | 825,927.00 | 0.58 |
| 13 | 002452 | 长高电新 | 819,925.00 | 0.58 |
| 14 | 600642 | 申能股份 | 798,760.00 | 0.56 |
| 15 | 601601 | 中国太保 | 795,897.00 | 0.56 |
| 16 | 000034 | 神州数码 | 791,909.00 | 0.56 |
| 17 | 600941 | 中国移动 | 787,008.00 | 0.56 |
| 18 | 601028 | 玉龙股份 | 779,072.00 | 0.55 |
| 19 | 601001 | 晋控煤业 | 758,329.00 | 0.53 |
| 20 | 300857 | 协创数据 | 738,098.00 | 0.52 |

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 000034 | 神州数码 | 1,373,561.00 | 0.97            |
| 2  | 300274 | 阳光电源 | 1,218,248.00 | 0.86            |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 1,164,690.00 | 0.82            |
| 4  | 300130 | 新国都  | 1,161,977.00 | 0.82            |
| 5  | 000921 | 海信家电 | 1,104,438.00 | 0.78            |
| 6  | 601138 | 工业富联 | 1,100,339.00 | 0.78            |
| 7  | 600941 | 中国移动 | 989,416.50   | 0.70            |
| 8  | 601601 | 中国太保 | 987,447.00   | 0.70            |
| 9  | 600919 | 江苏银行 | 985,035.00   | 0.69            |
| 10 | 600900 | 长江电力 | 976,382.00   | 0.69            |
| 11 | 000858 | 五粮液  | 927,335.00   | 0.65            |
| 12 | 300592 | 华凯易佰 | 854,034.00   | 0.60            |
| 13 | 000338 | 潍柴动力 | 850,514.00   | 0.60            |
| 14 | 002452 | 长高电新 | 818,806.00   | 0.58            |
| 15 | 000700 | 模塑科技 | 801,904.00   | 0.57            |
| 16 | 300857 | 协创数据 | 782,603.00   | 0.55            |
| 17 | 600422 | 昆药集团 | 778,871.00   | 0.55            |
| 18 | 000568 | 泸州老窖 | 725,256.00   | 0.51            |
| 19 | 600023 | 浙能电力 | 724,833.00   | 0.51            |
| 20 | 603035 | 常熟汽饰 | 721,156.84   | 0.51            |

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 | 121,439,767.55 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 129,124,792.73 |

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      | 16,583,757.67 | 13.19        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 33,354,625.20 | 26.52        |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,793,421.92 | 8.58         |
| 4  | 企业债券      | 31,056,789.04 | 24.70        |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | 10,276,325.89 | 8.17         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 3,311,140.50  | 2.63         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 94,582,638.30 | 75.21        |

### 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  | 210210  | 21 国开 10   | 100,000 | 10,793,421.92 | 8.58         |
| 2  | 2121062 | 21 北京农商二级  | 100,000 | 10,536,782.51 | 8.38         |
| 3  | 230012  | 23 付息国债 12 | 95,000  | 9,860,852.85  | 7.84         |
| 4  | 019740  | 24 国债 09   | 67,000  | 6,722,904.82  | 5.35         |
| 5  | 2128025 | 21 建设银     | 60,000  | 6,353,301.64  | 5.05         |

|  |  |        |  |  |  |
|--|--|--------|--|--|--|
|  |  | 行二级 01 |  |  |  |
|--|--|--------|--|--|--|

### 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

本基金的股指期货投资将主要用于套期保值。在预期市场上涨时，可以通过买入股指期货作为股票替代，增加股票仓位，同时提高资金的利用效率；在预期市场下跌时，可以通过卖出股指期货对冲股市整体下跌的系统性风险，对投资组合的价值进行保护。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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，中国东方资产管理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。

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

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额         |
|----|-------|------------|
| 1  | 存出保证金 | 353,218.53 |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 8,996.86   |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 362,215.39 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 113052 | 兴业转债 | 1,194,723.09 | 0.95         |
| 2  | 113050 | 南银转债 | 828,973.86   | 0.66         |
| 3  | 128125 | 华阳转债 | 498,416.93   | 0.40         |
| 4  | 127024 | 盈峰转债 | 354,130.30   | 0.28         |
| 5  | 123113 | 仙乐转债 | 195,800.00   | 0.16         |
| 6  | 111003 | 聚合转债 | 120,434.25   | 0.10         |
| 7  | 127041 | 弘亚转债 | 118,662.07   | 0.09         |

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
|-----------------|--------|----------|---------------|------------|---------------|------------|
| 海富通安颐收益<br>混合 A | 39,745 | 2,070.28 | 21,439,395.73 | 26.06%     | 60,843,975.07 | 73.94%     |
| 海富通安颐收益<br>混合 C | 8,045  | 2,240.73 | 668,733.90    | 3.71%      | 17,357,936.41 | 96.29%     |
| 合计              | 47,790 | 2,098.98 | 22,108,129.63 | 22.04%     | 78,201,911.48 | 77.96%     |

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<br>员持有本基金 | 海富通安颐收益混合 A | 1,417,387.55 | 1.7226%  |
|                      | 海富通安颐收益混合 C | 557,508.42   | 3.0927%  |
|                      | 合计          | 1,974,895.97 | 1.9688%  |

## 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<br>金投资和部门负责人<br>持有本开放式基金 | 海富通安颐收益混合 A | >100              |
|                                      | 海富通安颐收益混合 C | 50~100            |
|                                      | 合计          | >100              |
| 本基金基金经理持有本开<br>放式基金                  | 海富通安颐收益混合 A | >100              |
|                                      | 海富通安颐收益混合 C | 50~100            |
|                                      | 合计          | >100              |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 海富通安颐收益混合 A    | 海富通安颐收益混合 C   |
|--------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日（2013 年 5 月 29 日）基金份额总额 | 850,399,612.86 | -             |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 94,224,250.59  | 21,685,589.94 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 851,618.04     | 455,813.85    |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 12,792,497.83  | 4,114,733.48  |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -              | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 82,283,370.80  | 18,026,670.31 |

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 天风证券 | 2      | 108,067,285.03 | 43.13%       | 80,610.03 | 43.79%     | -  |
| 招商证券 | 2      | 99,369,481.27  | 39.66%       | 73,127.07 | 39.72%     | -  |
| 海通证券 | 2      | 21,567,613.11  | 8.61%        | 14,454.14 | 7.85%      | -  |
| 中信证券 | 4      | 20,844,478.87  | 8.32%        | 15,449.94 | 8.39%      | -  |
| 国金证券 | 1      | 435,154.00     | 0.17%        | 237.67    | 0.13%      | -  |
| 国盛证券 | 2      | 280,548.00     | 0.11%        | 206.42    | 0.11%      | -  |
| 华西证券 | 1      | -              | -            | -         | -          | -  |
| 民生证券 | 2      | -              | -            | -         | -          | -  |

|              |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 申万宏源         | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安         | 2 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投         | 2 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券        | 2 | - | - | - | - | - |
| 西南证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 开源证券         | 2 | - | - | - | - | - |
| 上海证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司         | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券         | 1 | - | - | - | - | - |
| 野村东方国际<br>证券 | 1 | - | - | - | - | - |

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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易          |              | 回购交易           |              | 权证交易 |              |
|------|---------------|--------------|----------------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 天风证券 | 8,529,741.52  | 30.17%       | 821,550,000.00 | 68.43%       | -    | -            |
| 招商证券 | 5,736,338.22  | 20.29%       | 2,000,000.00   | 0.17%        | -    | -            |
| 海通证券 | 12,623,932.84 | 44.65%       | 98,600,000.00  | 8.21%        | -    | -            |
| 中信证券 | 1,385,578.28  | 4.90%        | 237,150,000.00 | 19.75%       | -    | -            |

|              |   |   |               |       |   |   |
|--------------|---|---|---------------|-------|---|---|
|              |   |   | 00.00         |       |   |   |
| 国金证券         | - | - | 38,600,000.00 | 3.22% | - | - |
| 国盛证券         | - | - | 2,600,000.00  | 0.22% | - | - |
| 华西证券         | - | - | -             | -     | - | - |
| 民生证券         | - | - | -             | -     | - | - |
| 申万宏源         | - | - | -             | -     | - | - |
| 国泰君安         | - | - | -             | -     | - | - |
| 渤海证券         | - | - | -             | -     | - | - |
| 中信建投         | - | - | -             | -     | - | - |
| 太平洋证券        | - | - | -             | -     | - | - |
| 西南证券         | - | - | -             | -     | - | - |
| 开源证券         | - | - | -             | -     | - | - |
| 上海证券         | - | - | -             | -     | - | - |
| 华创证券         | - | - | -             | -     | - | - |
| 长江证券         | - | - | -             | -     | - | - |
| 中金公司         | - | - | -             | -     | - | - |
| 银河证券         | - | - | -             | -     | - | - |
| 野村东方国际<br>证券 | - | - | -             | -     | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式                      | 法定披露日期     |
|----|---|-----------------------------|------------|
| 1  | 海富通安颐收益混合型证券投资基金基金经理变更公告                                | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-03-23 |
| 2  | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-04-18 |

## §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安颐收益混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通安颐收益混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通安颐收益混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通安颐收益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