

海富通欣利混合型证券投资基金
2026 年中期报告
2026 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：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

§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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 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 2026 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合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	57
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	57
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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59

8.2 盈利投资者数量占比	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.4 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	60
§9 开放式基金份额变动	60
§10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	61
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	62
10.8 其他重大事件	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息	64
§12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通欣利混合型证券投资基金	
基金简称	海富通欣利混合	
基金主代码	011554	
交易代码	011554	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 14 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,039,385,551.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通欣利混合 A	海富通欣利混合 C
下属分级基金的交易代码	011554	011555
报告期末下属分级基金的份额总额	444,927,026.25 份	594,458,525.67 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极主动的资产配置与严谨的风险管理，在严格控制风险的前提下，积极把握证券市场的投资机会，追求资产的保值增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究，同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素，兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动，结合投资时钟理论，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例。并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，或借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应，以规避或分散市场风险。 在大类资产配置的框架下，本基金投资策略还包括股票投资策略、债券投资组合策略、资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略、流通受限证券投资策略、股票期权投资策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中证综合债指数收益率×75%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	华夏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	赵伟婧
	联系电话	021-38650788	(010) 85237681
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	zhaoweijing@hxb.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95577
传真		021-33830166	(010) 85238680
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京市东城区建国门内大街22 号（100005）
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京市东城区建国门内大街22 号（100005）
邮政编码		200120	100005
法定代表人		谢乐斌	杨书剑

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	海富通基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	海富通欣利混合 A	海富通欣利混合 C
本期已实现收益	21,068,794.18	17,083,314.48

本期利润	-2,872,061.36	-3,920,419.35
加权平均基金份额本期利润	-0.0068	-0.0111
本期加权平均净值利润率	-0.47%	-0.77%
本期基金份额净值增长率	1.43%	1.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	海富通欣利混合 A	海富通欣利混合 C
期末可供分配利润	152,806,263.41	196,478,228.41
期末可供分配基金份额利润	0.3434	0.3305
期末基金资产净值	637,463,977.45	844,398,412.32
期末基金份额净值	1.4327	1.4204
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	海富通欣利混合 A	海富通欣利混合 C
基金份额累计净值增长率	43.27%	42.04%

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）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通欣利混合 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
过去三个月	-0.03%	0.41%	2.78%	0.29%	-2.81%	0.12%
过去六个月	1.43%	0.45%	2.37%	0.27%	-0.94%	0.18%
过去一年	12.63%	0.43%	5.85%	0.24%	6.78%	0.19%
过去三年	31.84%	0.63%	17.47%	0.26%	14.37%	0.37%
自基金合同生效起至今	43.27%	0.55%	17.30%	0.27%	25.97%	0.28%

海富通欣利混合 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
过去三个月	-0.08%	0.41%	2.78%	0.29%	-2.86%	0.12%
过去六个月	1.33%	0.45%	2.37%	0.27%	-1.04%	0.18%

过去一年	12.41%	0.43%	5.85%	0.24%	6.56%	0.19%
过去三年	31.18%	0.63%	17.47%	0.26%	13.71%	0.37%
自基金合同生效起至今	42.04%	0.55%	17.30%	0.27%	24.74%	0.28%

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

海富通欣利混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 9 月 14 日至 2026 年 6 月 30 日)

海富通欣利混合 A



海富通欣利混合 C



注：本基金合同于 2021 年 9 月 14 日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金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，于 2003 年 4 月 1 日发起设立。目前，公司的股东为国泰海通证券股份有限公司、法国巴黎资产管理 BE 控股公司，注册资本为 3 亿元人民币。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下运作的公募基金共有 100 只，分别是：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 A100 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、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、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、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、海富通量化选股混合型证券投资基金、海富通上证基准做市公司债交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、海富通远见回报混合型证券投资基金、海富通配置优选三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、海富通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、海富通致远量化选股股票型发起式证券投资基金、海富通添合收益债券型证券投资基金、海富通聚益优选三个月持有期债券型基金中基金 (FOF)、海富通瑞颐 30 天滚动持有债券型证券投资基金、海富通瑞泽 90 天持有期债券型发起式证券投资基金、海富通沪港深医疗创新混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
江勇	本基金的基金经理；多资产投资部副总监（主持工作）。	2021-09-14	-	15 年	经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师，资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017 年 6 月加入海富通基金管理有限公司，曾任混合资产投资部总经理，现任多资产投资部副总监（主持工作）。2018 年 7 月至 2023 年 7 月任海富通上证非周期 ETF 联接基金经理。2018 年 7 月至 2022 年 5 月任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF、海富通中证 100 指数(LOF)基金经理。2018 年 7 月至 2020 年 3 月任海富通中证内地低碳指数（现海富通中证 500 增强）基金经理。2020 年 8 月至 2022 年 5 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 联接基金经理。2020 年 8 月至 2023 年 3 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通稳固收益债券的基金经理。2021 年 2 月

					起兼任海富通欣睿混合基金经理。2021 年 6 月至 2024 年 11 月兼任海富通策略收益债券基金经理。2021 年 6 月至 2023 年 10 月兼任海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。2021 年 9 月起兼任海富通欣利混合基金经理。2023 年 1 月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2023 年 11 月起兼任海富通添利收益一年持有期债券基金经理。2023 年 12 月起兼任海富通悦享一年持有期混合基金经理。2024 年 3 月至 2025 年 6 月兼任海富通欣盈 6 个月持有期混合基金经理。2024 年 6 月起兼任海富通红利优选混合基金经理。2025 年 7 月起兼任海富通添合收益债券基金经理。
赵莹洲	本基金的基金 经理助理	2023-08-1 5	-	8 年	东北财经大学工商管理硕士,持有基金从业人员资格证书。历任中钢集团辽宁有限公司大宗原材料进出口市场分析师、上海钢联电子商务股份有限公司分析师、天风证券股份有限公司研究所钢铁行业研究员。2020 年 11 月加入海富通基金管理有限公司,任固定收益分析师。2022 年 5 月起兼任海富通稳健添利债券和海富通纯债债券基金经理助理。2023 年 8 月起兼任海富通强化回报混合、海富通欣利混合、海富通策略收益债券、海富通欣睿混合、海富通稳固收益债券的基金经理助理。

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。

3、本公司于 2026 年 7 月 8 日发布公告，自 2026 年 7 月 7 日起赵莹洲先生不再担任本基金的基金经理助理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
江勇	公募基金	8	13,843,539,918.03	2018/07/10

	私募资产管理计划	1	12,056,491.94	2026/02/06
	其他组合	2	4,036,784,490.82	2023/08/22
	合计	11	17,892,380,900.79	

注：表内任职日期为基金经理加入公司以来首次开始管理各类产品的时间。

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。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

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

回顾 2026 年上半年，国内经济一季度实现“开门红”、二季度温和增长。投资端，基建、制造业投资结构分化，通信电子、信息传输等高成长领域投资加快；地产投资处于筑底阶段。消费方面，高基数效用压制社零增速，服务消费表现较强。出口依托国内产业链优势、AI 产业高景气，保持强劲韧性。通胀方面，受外部输入性因素影响，PPI 回升相对比较明显，CPI 涨幅比较温和。政策层面，

财政维持积极基调，全年赤字率拟按 4% 左右安排。货币政策保持适度宽松，上半年未实施降准降息，主要通过公开市场操作引导资金利率围绕政策利率运行。流动性方面，一季度债市资金面整体中性偏松，二季度，资金面在季初偏宽松，央行通过公开市场操作工具连续净回笼，资金面从宽松状态逐步向中性状态回归。

从债券市场来看，2026 年上半年债市整体震荡偏强。年初配置资金入场带动利率从高位下行。3 月国际油价上涨推升通胀预期，债市震荡运行。随后流动性宽松成为主线，债市表现偏强。6 月央行收紧宽松预期、防范资金空转，收益率区间震荡。截至 2026 年 6 月 30 日，10 年期国债到期收益率为 1.73%。

从权益市场来看，上半年上证指数涨幅为 3.16%，沪深 300 为 7.55%，中证 500 为 20.97%，创业板指为 35.58%，科创 50 为 64.25%。行业板块方面，根据申万一级行业分类，表现靠前的板块是电子、通信、建筑材料、机械设备，表现靠后的板块是商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料。从行情节奏看，在年初美联储宽松预期和美国财政脉冲背景下，市场交易流动性宽松和经济复苏受益品种。但是，2 月底美伊战争爆发，油价高位震荡运行，美联储宽松预期消退，加息预期升温，此外战争影响了各国年内经济增长预期，此前的交易逻辑逆转。与此同时，美国科技巨头上修 2026 年资本开支，AI 投资拉动全球经济，AI 产业链成为市场的主线行情。整体而言，上半年 A 股以科技成长风格为主，AI 相关行业涨幅居前，市场结构较为分化。

报告期间，本基金股票仓位保持稳定，权益配置上延续价值风格，行业分布上较为均衡，持仓个股较为分散；上半年市场风格分化较大，成长板块表现突出、价值板块则相对承压，受此影响，组合权益部分均衡偏价值的风格阶段性表现偏弱。从上半年贡献来看，电子、电力设备、基础化工对组合提供了较多正贡献，汽车、交通运输、非银金融对组合有较多拖累。转债方面，持仓比例整体保持在低位，上半年仓位先降后升，目前主要以配置一定具备绝对收益特征的低价转债为主。债券方面，主要以配置高等级信用债为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通欣利混合 A 净值增长率为 1.43%，同期业绩比较基准收益率为 2.37%。海富通欣利混合 C 净值增长率为 1.33%，同期业绩比较基准收益率为 2.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济增长有支撑。超长期特别国债、地方政府专项债和新型政策性金融工具等资金将继续加快落地，“六张网”与新质生产力仍是投资亮点，基建与制造业投资有望获得支撑。以旧换新等政策延续托底消费，消费修复斜率偏缓，服务消费相对更强。AI 资本开支与供应链重塑下，

中国出口或延续较快增长。通胀方面，油价中枢下降，物价或有所回落。财政政策方面，坚持积极的政策基调，关注特别国债与专项债下半年的发行节奏。货币政策方面，将继续实施好适度宽松的货币政策，加大逆周期和跨周期调节力度。

从权益市场来看，市场有望震荡上行。从基本面看，国内经济向新向优，AI 产业链保持高景气度，宏观经济步入补库周期。从流动性看，国内宏观流动性保持宽松，海外宏观流动性短期趋紧但未来有望缓解，此外监管层引导中长线资金入市，整体流动性环境保持稳态。展望未来，我们对 A 股充满信心，将继续跟踪国内政策和经济的变化，以把握市场节奏和投资机会。

从债券市场来看，下半年对债券市场偏中性判断。经济总量平稳增长、结构分化的格局大概率延续，基本面弹性空间有限，对债市形成一定支撑。供需方面，政府债集中发行窗口期或阶段性压制债市情绪，但供给难以扭转中长期行情主线，信贷增速放缓背景下银行、保险配置需求仍有支撑。流动性方面，央行完善利率走廊框架，强化短端流动性调控，引导资金价格平稳运行，资金利率波动幅度或收窄。总体来看，在经济新旧动能转换、资金面相对稳定的背景下，下半年债市或以震荡为主。

未来，本基金将继续在控制风险的基础上，积极寻找市场的结构性机会，力争跑赢市场。从国内各大类资产（房地产、债券、股票）目前性价比来看，依然是股票具备性价比，且目前国内整体的政策、流动性等依然利好权益市场，企业盈利依然保持改善，权益市场依然可能保持震荡偏强走势。后续将密切关注海外地缘政治局势和国内政策变化对市场的影响，择机调整仓位和组合配置来提升收益。个股配置上，将继续从绝对收益目标出发，结合安全边际和潜在收益弹性，继续选取有性价比的个股和个券来进行配置，为组合提升收益。债券方面，以绝对收益角度出发，主要配置高等级的信用债为主。

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，基金收益分配后份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有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真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2026 年中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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：海富通欣利混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	62,988,795.95	13,484,359.99
结算备付金		159,332,536.87	36,297,885.05
存出保证金		7,964,395.20	4,036,452.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,123,111,188.90	396,231,055.56
其中：股票投资		533,393,693.06	227,432,137.12
基金投资		-	-
债券投资		589,717,495.84	168,798,918.44
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	122,000,000.00	178,967,940.22
应收清算款		241,898.13	-
应收股利		249,404.69	24,309.12
应收申购款		17,813,993.04	4,132,559.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,493,702,212.78	633,174,561.84
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		10,678,268.99	3,499,867.53
应付管理人报酬		722,164.97	281,713.53
应付托管费		120,360.84	46,952.24
应付销售服务费		132,699.82	47,643.31
应付投资顾问费		-	-
应交税费		77,723.21	9,906.50
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	108,605.18	143,882.81
负债合计		11,839,823.01	4,029,965.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,039,385,551.92	447,016,857.30

未分配利润	6.4.7.8	442,476,837.85	182,127,738.62
净资产合计		1,481,862,389.77	629,144,595.92
负债和净资产总计		1,493,702,212.78	633,174,561.84

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.4327 元，C 类基金份额净值 1.4204 元。
基金份额总额 1,039,385,551.92 份，其中 A 类基金份额 444,927,026.25 份，C 类基金份额 594,458,525.67 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通欣利混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,259,320.37	8,995,488.10
1.利息收入		1,729,661.63	199,738.57
其中：存款利息收入	6.4.7.9	468,909.34	38,628.29
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		1,260,752.29	161,110.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		39,828,745.84	5,735,228.54
其中：股票投资收益	6.4.7.10	16,963,600.68	2,452,990.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	9,388,580.42	2,101,775.88
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	7,425,890.13	93,236.50
股利收益	6.4.7.14	6,050,674.61	1,087,225.60
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	-44,944,589.37	2,901,851.05
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	1,126,861.53	158,669.94
减：二、营业总支出		4,533,160.34	546,438.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,338,760.02	362,879.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	556,459.99	60,479.91
3. 销售服务费		504,838.94	51,342.87
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		33,972.24	1,524.28
8. 其他费用	6.4.7.17	99,129.15	70,211.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,792,480.71	8,449,049.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,792,480.71	8,449,049.85
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-6,792,480.71	8,449,049.85

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通欣利混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	447,016,857.30	-	182,127,738.62	629,144,595.92
二、本期期初净资产	447,016,857.30	-	182,127,738.62	629,144,595.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	592,368,694.62	-	260,349,099.23	852,717,793.85
（一）、综合收益总额	-	-	-6,792,480.71	-6,792,480.71
（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）	592,368,694.62	-	267,141,579.94	859,510,274.56
其中：1.基金申购款	1,073,207,054.53	-	481,220,863.65	1,554,427,918.18
2.基金赎回款	-480,838,359.91	-	-214,079,283.71	-694,917,643.62
（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	1,039,385,551.92	-	442,476,837.85	1,481,862,389.77
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	67,648,646.23	-	11,968,798.58	79,617,444.81
二、本期期初净资产	67,648,646.23	-	11,968,798.58	79,617,444.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	85,346,958.00	-	29,115,971.51	114,462,929.51
（一）、综合收益总额	-	-	8,449,049.85	8,449,049.85
（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）	85,346,958.00	-	20,666,921.66	106,013,879.66
其中：1.基金申购款	145,797,210.69	-	33,722,807.95	179,520,018.64
2.基金赎回款	-60,450,252.69	-	-13,055,886.29	-73,506,138.98
（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	152,995,604.23	-	41,084,770.09	194,080,374.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：胡光涛，会计机构负责人：胡正万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通欣利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[2021]229 号《关于准予海富通欣利混合型证券投资基金注册的批复》注册,由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通欣利混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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 221,610,845.56 元,其中海富通欣利混合 A 为人民币 120,391,548.49 元,海富通欣利混合 C 为人民币 101,219,297.07 元。经向中国证监会备案,《海富通欣利混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 9 月 14 日正式生效,基金合同生效日的海富通欣利混合 A 基金份额总额为 120,410,992.42 份,其中认购资金利息折合 19,443.93 份基金份额,海富通欣利混合 C 基金份额总额为 101,223,867.70 份,其中认购资金利息折合 4,570.63 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,基金托管人为华夏银行股份有限公司。

根据《海富通欣利混合型证券投资基金基金合同》及《海富通欣利混合型证券投资基金基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通欣利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、同业存单、股指期货、股票期权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。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产及存托凭证的比例占基金资产的比例为 0%-50%,投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0%-50%,投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%;每个交易日日终,扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或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。本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×20%+中证综合债指数收益率×75%+恒生指数收益率(经汇率调整)×5%。

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 2026 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）发布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、2026 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《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[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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 号文《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 号文《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》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，截至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地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。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内

地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d)本基金卖出股票按 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e)对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	12,620,653.54
等于：本金	12,619,498.99
加：应计利息	1,154.55
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	50,368,142.41
等于：本金	50,366,538.51
加：应计利息	1,603.90
合计	62,988,795.95

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		569,534,506.49	-	533,393,693.06	-36,140,813.43
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所		609,405.51		
	市场	75,623,740.68		76,112,327.61	-120,818.58
	银行间		4,767,168.23		
	市场	509,885,338.21		513,605,168.23	-1,047,338.21
合计		585,509,078.89	5,376,573.74	589,717,495.84	-1,168,156.79
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,155,043,585.38	5,376,573.74	1,123,111,188.90	-37,308,970.22

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 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 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	66,091,136.16	-	-	-
——股指期货	66,091,136.16	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	66,091,136.16	-	-	-

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
IF2607	IF2607	39.00	57,587,400.00	251,823.84
IF2608	IF2608	6.00	8,782,560.00	27,000.00
合计	-	-	-	278,823.84

减：可抵销期货暂收款	-	-	-	278,823.84
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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	122,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	122,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10,274.32
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,350.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	1,350.00
应付利息	-
预提费用	81,822.86
其他	15,158.00
合计	108,605.18

6.4.7.7 实收基金

海富通欣利混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	236,601,189.26	236,601,189.26
本期申购	404,118,099.15	404,118,099.15
本期赎回（以“-”号填列）	-195,792,262.16	-195,792,262.16
本期末	444,927,026.25	444,927,026.25

海富通欣利混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	210,415,668.04	210,415,668.04
本期申购	669,088,955.38	669,088,955.38
本期赎回（以“-”号填列）	-285,046,097.75	-285,046,097.75
本期末	594,458,525.67	594,458,525.67

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

海富通欣利混合 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	68,168,598.31	29,421,430.77	97,590,029.08
本期期初	68,168,598.31	29,421,430.77	97,590,029.08
本期利润	21,068,794.18	-23,940,855.54	-2,872,061.36
本期基金份额交易产生的变动数	63,568,870.92	34,250,112.56	97,818,983.48
其中：基金申购款	128,106,112.08	58,233,186.41	186,339,298.49
基金赎回款	-64,537,241.16	-23,983,073.85	-88,520,315.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	152,806,263.41	39,730,687.79	192,536,951.20

海富通欣利混合 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	58,302,542.84	26,235,166.70	84,537,709.54
本期期初	58,302,542.84	26,235,166.70	84,537,709.54
本期利润	17,083,314.48	-21,003,733.83	-3,920,419.35
本期基金份额交易产生的变动数	121,092,371.09	48,230,225.37	169,322,596.46
其中：基金申购款	210,658,076.59	84,223,488.57	294,881,565.16
基金赎回款	-89,565,705.50	-35,993,263.20	-125,558,968.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	196,478,228.41	53,461,658.24	249,939,886.65

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	32,336.87
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	31,500.19
结算备付金利息收入	373,263.32
其他	31,808.96
合计	468,909.34

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	652,969,747.79
减：卖出股票成本总额	634,825,600.66
减：交易费用	1,180,546.45
买卖股票差价收入	16,963,600.68

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	6,158,813.05

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,229,767.37
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	9,388,580.42

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	64,381,715.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	60,556,084.75
减：应计利息总额	589,316.07
减：交易费用	6,547.03
买卖债券差价收入	3,229,767.37

6.4.7.12 贵金属投资收益

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益（税前）	7,663,929.69
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	223,221.26
减：交易费用	14,818.30
合计	7,425,890.13

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,050,674.61
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	6,050,674.61

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-43,884,809.68
——股票投资	-41,036,273.67
——债券投资	-2,848,536.01
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-1,059,779.69
——权证投资	-
——股指期货	-1,059,779.69
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-44,944,589.37

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	1,126,391.23
基金转换费收入	470.30
合计	1,126,861.53

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
证券组合费	606.29
债券托管账户维护费	16,500.00
上清所查询服务费	200.00
合计	99,129.15

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、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
华夏银行股份有限公司(“华夏银行”)	基金托管人、基金销售机构
国泰海通证券股份有限公司(“国泰海通证券”)	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。关联方国泰海通证券股份有限公司（简称“国泰海通证券”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原关联方海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

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		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025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
国泰海通证券	1,475,780,423.37	90.46%	123,149,281.33	64.21%
海通证券	-	-	68,656,261.71	35.79%

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 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰海通证券	44,198,150.13	54.70%	45,256,698.87	62.97%
海通证券	-	-	26,612,413.31	37.03%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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
国泰海通证券	648,856.94	90.26%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	32,067.54	36.08%	-	-
国泰海通证券	56,810.94	63.92%	-	-

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金管理人提供的证券投资研究服务等。

2.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。公司的该类佣金协议符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,338,760.02	362,879.30
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,086,693.63	103,639.28

应支付基金管理人的净管理费	2,252,066.39	259,240.02
---------------	--------------	------------

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 0.60%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 x0.60%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	556,459.99	60,479.91

注：支付基金托管人华夏银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 x0.10%/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 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通欣利混合 A	海富通欣利混合 C	合计
华夏银行	-	226.05	226.05
海富通	-	155,709.94	155,709.94
国泰海通证券	-	3,468.46	3,468.46
合计	-	159,404.45	159,404.45
获得销售服务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通欣利混合A	海富通欣利混合C	合计
华夏银行	-	44.94	44.94
海通证券	-	2,334.21	2,334.21
海富通	-	14,724.71	14,724.71
国泰海通证券	-	2,576.07	2,576.07
合计	-	19,679.93	19,679.93

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 0.20%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.20%年费率计提，逐日累计至每月月底,按月支付。销售服务费的计算方法如下：日销售服务费＝前一日 C 类份额的基金资产净值 x0.20%/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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	海富通欣利混合A	海富通欣利混合C	海富通欣利混合A	海富通欣利混合C
期初持有的基金份额	13,877,324.45	-	13,877,324.45	-
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	13,877,324.45	-	13,877,324.45	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.12%	-	15.53%	-

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		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025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
华夏银行	12,620,653.54	32,336.87	3,917,948.07	7,452.46
国泰海通证券	49,336,701.79	21,802.29	1,081,990.51	2,421.87
海通证券	-	-	-	984.48

注：本基金的银行存款由基金托管人华夏银行保管，按银行同业利率计息。本基金的其他存款由基金结算机构保管，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰海通证券	688781	视涯科技	网下申购	9,746	221,039.28
国泰海通证券	688818	电科蓝天	网下申购	17,168	162,580.96
国泰海通证券	301666	大普微	网下申购	3,048	140,451.84
国泰海通证券	301599	理奇智能	网下申购	4,325	60,160.75
国泰海通证券	301696	三瑞智能	网下申购	2,157	53,234.76
国泰海通证券	688635	长进光子	网下申购	1,271	52,085.58
国泰海通证券	118064	联瑞转债	可转债优先配售	330	33,000.00
国泰海通证券	920200	振宏股份	网上申购	500	10,290.00
国泰海通证券	920126	永大股份	网上申购	600	4,674.00
国泰海通证券	920218	新天力	网上申购	300	3,657.00
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 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（2026 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新股未上市并锁定	10.11	10.11	42,153	426,166.83	426,166.83	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	18,065	182,637.15	182,637.15	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股锁定	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股锁定	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股锁定	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股锁定	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-

301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股锁定	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	新股锁定	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股锁定	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股锁定	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股锁定	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股锁定	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	612	6,842.16	10,765.08	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股锁定	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股锁定	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月	新股锁定	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-

688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	1,650	32,472.00	233,458.50	-
920136	永励精密	2026-06-25	1 个月内 (含)	新股未上市	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
920189	康美特	2026-06-30	1 个月内 (含)	新股未上市	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-
920193	吉和昌	2026-06-18	1 个月内 (含)	新股未上市	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113705	豪 26 转债	2026-06-16	1 个月内 (含)	老股东配债	100.00	100.01	2,590	259,000.00	259,018.17	-

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债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计委员会，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委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	29,723,406.53	63,114,157.42
合计	29,723,406.53	63,114,157.42

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、无第三方评级机构评级的债券。

6.4.13.2.2 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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	429,898,399.87	52,737,263.99
AAA 以下	6,551,020.50	25,698,315.11
未评级	123,544,668.94	27,249,181.92
合计	559,994,089.31	105,684,761.02

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、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时间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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的

可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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。

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。

本基金的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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金和存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2026 年 6 月 30 日					
资产					
货币资金	62,988,795.95	-	-	-	62,988,795.95
结算备付金	159,332,536.87	-	-	-	159,332,536.87
存出保证金	-	-	-	7,964,395.20	7,964,395.20
交易性金融资产	134,059,718.60	94,276,135.06	361,381,642.18	533,393,693.06	1,123,111,188.90
买入返售金融资产	122,000,000.00	-	-	-	122,000,000.00
应收清算款	-	-	-	241,898.13	241,898.13
应收股利	-	-	-	249,404.69	249,404.69
应收申购款	2,000,000.00	-	-	15,813,993.04	17,813,993.04
资产总计	480,381,051.42	94,276,135.06	361,381,642.18	557,663,384.12	1,493,702,212.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,678,268.99	10,678,268.99
应付管理人报酬	-	-	-	722,164.97	722,164.97
应付托管费	-	-	-	120,360.84	120,360.84
应付销售服务费	-	-	-	132,699.82	132,699.82
应交税费	-	-	-	77,723.21	77,723.21
其他负债	-	-	-	108,605.18	108,605.18
负债总计	-	-	-	11,839,823.01	11,839,823.01
利率敏感度缺口	480,381,051.42	94,276,135.06	361,381,642.18	545,823,561.11	1,481,862,389.77
上年度末 2025 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	13,484,359.99	-	-	-	13,484,359.99
结算备付金	36,297,885.05	-	-	-	36,297,885.05
存出保证金	4,036,452.00	-	-	-	4,036,452.00
交易性金融资产	84,648,684.28	77,104,380.00	7,045,854.16	227,432,137.12	396,231,055.56
买入返售金融资产	178,967,940.22	-	-	-	178,967,940.22

应收股利	-	-	-	24,309.12	24,309.12
应收申购款	-	-	-	4,132,559.90	4,132,559.90
资产总计	317,435,321.54	77,104,380.00	7,045,854.16	231,589,006.14	633,174,561.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,499,867.53	3,499,867.53
应付管理人报酬	-	-	-	281,713.53	281,713.53
应付托管费	-	-	-	46,952.24	46,952.24
应付销售服务费	-	-	-	47,643.31	47,643.31
应交税费	-	-	-	9,906.50	9,906.50
其他负债	-	-	-	143,882.81	143,882.81
负债总计	-	-	-	4,029,965.92	4,029,965.92
利率敏感度缺口	317,435,321.54	77,104,380.00	7,045,854.16	227,559,040.22	629,144,595.92

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 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-6,535,125.25	-1,094,182.88
	市场利率下降 25 个基点	6,680,888.46	1,118,295.70

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------

	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	12,748,810.54	12,748,810.54
资产合计	-	12,748,810.54	12,748,810.54
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	12,748,810.54	12,748,810.54
项目	上年度末 2025年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	13,838,460.90	13,838,460.90
资产合计	-	13,838,460.90	13,838,460.90
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	13,838,460.90	13,838,460.90

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	637,440.53	691,923.05
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-637,440.53	-691,923.05

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产及存托凭证的比例占基金资产的比例为 0%-50%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0%-50%，投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%。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		上年度末	
	2026 年 6 月 30 日		2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	533,393,693.06	35.99	227,432,137.12	36.15
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	533,393,693.06	35.99	227,432,137.12	36.15

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	25,191,618.75	12,944,981.81
	2.业绩比较基准下降 5%	-25,191,618.75	-12,944,981.81

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	544,867,531.89	254,257,554.41
第二层次	576,219,787.27	141,198,384.82
第三层次	2,023,869.74	775,116.33
合计	1,123,111,188.90	396,231,055.56

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等，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，本基金分别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不会将相关股票和债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2025 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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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	533,393,693.06	35.71
	其中：股票	533,393,693.06	35.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	589,717,495.84	39.48
	其中：债券	589,717,495.84	39.48
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	122,000,000.00	8.17
	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	222,321,332.82	14.88
8	其他各项资产	26,269,691.06	1.76
9	合计	1,493,702,212.78	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 12,748,810.54 元，占资产净值比例为 0.86%。

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	13,594,934.40	0.92
C	制造业	318,485,950.16	21.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,015,061.98	0.47
E	建筑业	2,579,244.00	0.17
F	批发和零售业	13,518,518.00	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	33,454,070.46	2.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,567,419.90	0.92
J	金融业	85,896,623.62	5.80
K	房地产业	1,690,698.00	0.11
L	租赁和商务服务业	11,986,316.00	0.81
M	科学研究和技术服务业	9,016,889.00	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	8,178,793.00	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,660,364.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	520,644,882.52	35.13

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
工业	451,437.55	0.03
非日常生活消费品	2,123,900.92	0.14
金融	4,466,125.79	0.30
通信服务	364,929.97	0.02
房地产	5,342,416.31	0.36
合计	12,748,810.54	0.86

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	000100	TCL 科技	2,265,700	13,186,374.00	0.89
2	601336	新华保险	147,300	8,787,918.00	0.59
2	01336	新华保险	84,800	3,389,512.90	0.23
3	601688	华泰证券	581,900	11,998,778.00	0.81
4	000776	广发证券	486,700	11,388,780.00	0.77
5	000977	浪潮信息	139,900	9,793,000.00	0.66
6	600919	江苏银行	799,100	8,614,298.00	0.58
7	002142	宁波银行	265,400	7,879,726.00	0.53
8	002078	太阳纸业	609,300	7,610,157.00	0.51
9	000415	渤海租赁	1,734,900	7,061,043.00	0.48
10	601333	广深铁路	2,422,800	6,662,700.00	0.45
11	600020	中原高速	1,726,200	6,369,678.00	0.43
12	603599	广信股份	660,400	6,326,632.00	0.43
13	002444	巨星科技	197,200	6,132,920.00	0.41
14	688188	柏楚电子	57,271	6,110,815.70	0.41
15	300037	新宙邦	64,400	5,979,540.00	0.40
16	603197	保隆科技	196,200	5,481,828.00	0.37
17	002380	科远智慧	153,600	5,250,048.00	0.35
18	601009	南京银行	530,100	5,242,689.00	0.35
19	601128	常熟银行	900,041	5,238,238.62	0.35
20	601058	赛轮轮胎	434,000	5,004,020.00	0.34
21	603049	中策橡胶	110,600	4,955,986.00	0.33
22	603889	新澳股份	956,950	4,890,014.50	0.33
23	601702	华峰铝业	342,000	4,822,200.00	0.33
24	601601	中国太保	135,600	3,867,312.00	0.26
24	02601	中国太保	38,400	896,510.36	0.06
25	600285	羚锐制药	241,300	4,676,394.00	0.32

26	002266	浙富控股	914,700	4,628,382.00	0.31
27	600710	苏美达	483,900	4,626,084.00	0.31
28	600256	广汇能源	928,700	4,587,778.00	0.31
29	600060	海信视像	161,700	4,506,579.00	0.30
30	601318	中国平安	94,100	4,492,334.00	0.30
31	300693	盛弘股份	89,900	4,382,625.00	0.30
32	000157	中联重科	618,200	4,308,854.00	0.29
33	002850	科达利	22,700	4,297,110.00	0.29
34	300408	三环集团	25,100	4,189,190.00	0.28
35	002483	润邦股份	846,300	4,180,722.00	0.28
36	603871	嘉友国际	397,200	4,055,412.00	0.27
37	600153	建发股份	510,500	4,048,265.00	0.27
38	002415	海康威视	115,900	3,963,780.00	0.27
39	600089	特变电工	175,800	3,955,500.00	0.27
40	301216	万凯新材	169,400	3,894,506.00	0.26
41	688518	联赢激光	125,122	3,866,269.80	0.26
42	600109	国金证券	403,200	3,540,096.00	0.24
43	600603	广汇物流	812,700	3,535,245.00	0.24
44	688169	石头科技	37,104	3,523,766.88	0.24
45	301376	致欧科技	195,000	3,455,400.00	0.23
46	600499	科达制造	250,200	3,452,760.00	0.23
47	601677	明泰铝业	207,600	3,446,160.00	0.23
48	002236	大华股份	206,700	3,408,483.00	0.23
49	600428	中远海特	431,800	3,372,358.00	0.23
50	603181	皇马科技	204,800	3,321,856.00	0.22
51	600999	招商证券	156,900	3,310,590.00	0.22
52	601877	正泰电器	131,600	3,299,212.00	0.22
53	002025	航天电器	42,700	3,254,594.00	0.22
54	002223	鱼跃医疗	126,800	3,253,688.00	0.22
55	603596	伯特利	130,460	3,240,626.40	0.22
56	600378	昊华科技	42,700	3,218,726.00	0.22
57	603379	三美股份	42,200	3,202,558.00	0.22
58	603112	华翔股份	189,700	3,173,681.00	0.21
59	300759	康龙化成	109,700	3,173,621.00	0.21
60	603087	甘李药业	55,900	3,172,884.00	0.21
61	601965	中国汽研	263,700	3,153,852.00	0.21
62	000957	中通客车	335,700	3,142,152.00	0.21
63	600033	福建高速	956,700	3,080,574.00	0.21
64	601108	财通证券	346,200	2,994,630.00	0.20
65	000060	中金岭南	390,100	2,953,057.00	0.20
66	000733	振华科技	51,200	2,899,968.00	0.20
67	002293	罗莱生活	289,600	2,864,144.00	0.19
68	603260	合盛硅业	59,255	2,859,646.30	0.19
69	002448	中原内配	229,900	2,827,770.00	0.19

70	603298	杭叉集团	115,000	2,743,900.00	0.19
71	601628	中国人寿	77,300	2,732,555.00	0.18
72	300750	宁德时代	6,900	2,711,769.00	0.18
73	603259	药明康德	21,600	2,689,416.00	0.18
74	000680	山推股份	264,200	2,655,210.00	0.18
75	601001	晋控煤业	152,500	2,651,975.00	0.18
76	600160	巨化股份	49,800	2,639,898.00	0.18
77	002049	紫光国微	28,700	2,547,125.00	0.17
78	600309	万华化学	37,000	2,531,170.00	0.17
79	301608	博实结	48,276	2,426,351.76	0.16
80	300274	阳光电源	15,200	2,417,104.00	0.16
81	603393	新天然气	111,600	2,389,356.00	0.16
82	300453	三鑫医疗	262,700	2,374,808.00	0.16
83	600018	上港集团	501,300	2,366,136.00	0.16
84	603345	安井食品	29,300	2,349,567.00	0.16
85	601577	长沙银行	267,100	2,326,441.00	0.16
86	600352	浙江龙盛	190,100	2,302,111.00	0.16
87	600482	中国动力	70,000	2,296,000.00	0.15
88	688456	有研粉材	16,342	2,281,343.20	0.15
89	600282	南钢股份	494,200	2,268,378.00	0.15
90	002001	新和成	78,500	2,230,970.00	0.15
91	688155	先惠技术	27,429	2,218,731.81	0.15
92	300532	今天国际	353,740	2,203,800.20	0.15
93	601233	桐昆股份	100,600	2,177,990.00	0.15
94	300866	安克创新	20,800	2,173,600.00	0.15
95	000333	美的集团	28,500	2,152,605.00	0.15
96	600674	川投能源	150,400	2,131,168.00	0.14
97	603227	雪峰科技	302,164	2,121,191.28	0.14
98	600546	山煤国际	191,800	2,096,374.00	0.14
99	688187	时代电气	30,361	2,084,586.26	0.14
100	000902	新洋丰	180,000	2,080,800.00	0.14
101	688239	航宇科技	34,590	2,069,519.70	0.14
102	603816	顾家家居	92,500	2,068,300.00	0.14
103	603605	珀莱雅	33,000	1,977,360.00	0.13
104	600926	杭州银行	136,400	1,970,980.00	0.13
105	01908	建发国际集团	168,000	1,969,871.40	0.13
106	600150	中国船舶	56,700	1,915,893.00	0.13
107	601678	滨化股份	287,700	1,895,943.00	0.13
108	601117	中国化学	257,500	1,892,625.00	0.13
109	300850	新强联	70,300	1,884,040.00	0.13
110	000963	华东医药	65,100	1,830,612.00	0.12
111	01109	华润置地	70,000	1,823,955.00	0.12
112	002895	川恒股份	61,800	1,804,560.00	0.12
113	300832	新产业	42,900	1,801,800.00	0.12

114	002701	奥瑞金	416,000	1,772,160.00	0.12
115	002311	海大集团	39,300	1,753,173.00	0.12
116	600216	浙江医药	150,600	1,716,840.00	0.12
117	600114	东睦股份	45,100	1,702,976.00	0.11
118	603612	索通发展	93,500	1,695,155.00	0.11
119	300855	图南股份	53,600	1,675,536.00	0.11
120	002083	孚日股份	159,700	1,675,253.00	0.11
121	300244	迪安诊断	88,600	1,660,364.00	0.11
122	000885	城发环境	137,700	1,656,531.00	0.11
123	603713	密尔克卫	23,200	1,651,144.00	0.11
124	603939	益丰药房	91,600	1,646,968.00	0.11
125	002345	潮宏基	176,300	1,616,671.00	0.11
126	300415	伊之密	81,100	1,614,701.00	0.11
127	000729	燕京啤酒	155,600	1,576,228.00	0.11
128	603338	浙江鼎力	35,900	1,525,750.00	0.10
129	601339	百隆东方	222,000	1,502,940.00	0.10
130	603195	公牛集团	38,200	1,495,530.00	0.10
131	605123	派克新材	15,400	1,493,954.00	0.10
132	300259	新天科技	224,000	1,485,120.00	0.10
133	300972	万辰集团	8,500	1,473,985.00	0.10
134	605507	国邦医药	99,400	1,471,120.00	0.10
135	301305	朗坤科技	51,000	1,454,520.00	0.10
136	603486	科沃斯	28,000	1,421,000.00	0.10
137	002206	海利得	273,600	1,414,512.00	0.10
138	002039	黔源电力	74,700	1,405,854.00	0.09
139	688410	山外山	97,802	1,404,436.72	0.09
140	600391	航发科技	41,400	1,384,830.00	0.09
141	002475	立讯精密	19,500	1,372,800.00	0.09
142	09988	阿里巴巴-W	16,900	1,362,898.26	0.09
143	600064	南京高科	186,600	1,330,458.00	0.09
144	000949	新乡化纤	208,500	1,321,890.00	0.09
145	600276	恒瑞医药	24,500	1,274,980.00	0.09
146	000550	江铃汽车	75,600	1,226,232.00	0.08
147	301338	凯格精机	7,300	1,189,097.00	0.08
148	600731	湖南海利	230,100	1,178,112.00	0.08
149	00123	越秀地产	393,000	1,140,076.10	0.08
150	688029	南微医学	15,686	1,126,254.80	0.08
151	600587	新华医疗	93,500	1,110,780.00	0.07
152	603855	华荣股份	63,100	1,093,523.00	0.07
153	000933	神火股份	50,700	1,074,840.00	0.07
154	002430	杭氧股份	34,500	1,068,120.00	0.07
155	603198	迎驾贡酒	34,800	1,030,080.00	0.07
156	002668	TCL 智家	92,800	1,028,224.00	0.07
157	600985	淮北矿业	72,800	1,022,840.00	0.07

158	003018	金富科技	12,800	975,744.00	0.07
159	603129	春风动力	3,700	946,460.00	0.06
160	688612	威迈斯	31,834	941,968.06	0.06
161	301606	绿联科技	15,400	939,708.00	0.06
162	600063	皖维高新	122,600	931,760.00	0.06
163	603556	海兴电力	41,000	902,000.00	0.06
164	688016	心脉医疗	10,008	887,109.12	0.06
165	002027	分众传媒	181,200	877,008.00	0.06
166	601699	潞安环能	59,200	845,376.00	0.06
167	000848	承德露露	112,900	835,460.00	0.06
168	300138	晨光生物	91,000	819,000.00	0.06
169	601021	春秋航空	17,800	811,324.00	0.05
170	001207	联科科技	53,500	798,220.00	0.05
171	601077	渝农商行	124,600	761,306.00	0.05
172	601229	上海银行	86,400	749,952.00	0.05
173	600035	楚天高速	218,700	737,019.00	0.05
174	605305	中际联合	17,400	729,408.00	0.05
175	600970	中材国际	96,300	686,619.00	0.05
176	688717	艾罗能源	8,258	681,863.06	0.05
177	688093	世华科技	18,279	674,495.10	0.05
178	601899	紫金矿业	25,800	648,612.00	0.04
179	000425	徐工机械	79,700	644,773.00	0.04
180	600584	长电科技	6,200	642,010.00	0.04
181	301548	崇德科技	7,200	639,144.00	0.04
182	301035	润丰股份	13,170	611,088.00	0.04
183	001248	华润新能源	60,218	608,803.98	0.04
184	09863	零跑汽车	20,000	598,952.08	0.04
185	300873	海晨股份	17,600	594,352.00	0.04
186	603809	豪能股份	64,700	567,419.00	0.04
187	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.04
188	603055	台华新材	72,000	560,880.00	0.04
189	601101	昊华能源	50,700	535,392.00	0.04
190	688550	瑞联新材	8,914	515,674.90	0.03
191	603606	东方电缆	12,260	508,912.60	0.03
192	002158	汉钟精机	13,600	504,288.00	0.03
193	002841	视源股份	14,600	504,138.00	0.03
194	603416	信捷电气	9,500	502,265.00	0.03
195	603456	九洲药业	36,700	501,322.00	0.03
196	601799	星宇股份	5,400	489,348.00	0.03
197	603233	大参林	32,300	485,469.00	0.03
198	002897	意华股份	5,500	483,890.00	0.03
199	000685	中山公用	43,000	479,880.00	0.03
200	300596	利安隆	9,000	472,320.00	0.03
201	600988	赤峰黄金	17,600	463,232.00	0.03

202	02128	中国联塑	146,000	451,437.55	0.03
203	600323	瀚蓝环境	16,000	439,360.00	0.03
204	00688	中国海外发展	39,000	408,513.81	0.03
205	601898	中煤能源	33,400	406,812.00	0.03
206	002572	索菲亚	50,800	370,840.00	0.03
207	01024	快手－W	10,100	364,929.97	0.02
208	603558	健盛集团	32,800	363,752.00	0.02
209	600079	ST 人福	22,100	363,324.00	0.02
210	002244	滨江集团	47,400	360,240.00	0.02
211	688795	摩尔线程	380	272,266.20	0.02
212	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.02
213	688820	盛合晶微	1,650	233,458.50	0.02
214	002588	史丹利	28,600	225,940.00	0.02
215	688802	沐曦股份	265	219,499.50	0.01
216	601298	青岛港	26,900	216,545.00	0.01
217	002128	电投能源	9,300	215,016.00	0.01
218	688778	厦钨新能	3,684	200,409.60	0.01
219	600761	安徽合力	12,100	197,956.00	0.01
220	000651	格力电器	5,000	187,500.00	0.01
221	03698	徽商银行	48,000	180,102.53	0.01
222	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
223	01999	敏华控股	62,400	162,050.58	0.01
224	600987	航民股份	24,900	150,645.00	0.01
225	001280	中国铀业	1,822	121,527.40	0.01
226	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
227	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
228	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
229	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
230	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
231	688807	优迅股份	131	52,718.33	0.00
232	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
233	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
234	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
235	603279	景津装备	1,900	22,800.00	0.00
236	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
237	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
238	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
239	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
240	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
241	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
242	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
243	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
244	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
245	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00

246	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
247	601112	振石股份	612	10,765.08	0.00
248	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
249	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
250	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
251	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
252	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
253	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
254	002558	巨人网络	100	2,756.00	0.00
255	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
256	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
257	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
258	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
259	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
260	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

注：新华保险、中国太保同时在 A+H 股上市，合并计算其公允价值参与排序。

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	000977	浪潮信息	11,723,695.10	1.86
2	002380	科远智慧	11,578,463.00	1.84
3	000100	TCL 科技	10,741,347.60	1.71
4	601688	华泰证券	10,344,436.58	1.64
5	601009	南京银行	9,892,832.00	1.57
6	600919	江苏银行	9,719,826.00	1.54
7	603049	中策橡胶	9,248,850.00	1.47
8	601336	新华保险	8,778,592.00	1.40
9	000776	广发证券	8,068,543.00	1.28
10	601333	广深铁路	7,522,556.00	1.20
11	601702	华峰铝业	7,171,186.88	1.14
12	000415	渤海租赁	7,108,952.00	1.13
13	600089	特变电工	6,925,924.32	1.10
14	603599	广信股份	6,711,307.40	1.07
15	000733	振华科技	6,632,288.00	1.05
16	002056	横店东磁	6,575,177.00	1.05
17	600710	苏美达	6,543,671.00	1.04
18	002078	太阳纸业	6,489,799.88	1.03
19	300415	伊之密	6,482,926.00	1.03

20	002444	巨星科技	6,407,910.00	1.02
----	--------	------	--------------	------

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	002056	横店东磁	8,549,802.00	1.36
2	000725	京东方 A	7,594,944.00	1.21
3	002643	万润股份	6,728,534.00	1.07
4	002648	卫星化学	6,578,771.00	1.05
5	002340	格林美	6,495,825.00	1.03
6	002380	科远智慧	6,495,732.00	1.03
7	600522	中天科技	6,458,038.00	1.03
8	603588	高能环境	6,380,324.00	1.01
9	002897	意华股份	6,255,970.00	0.99
10	600352	浙江龙盛	5,931,898.00	0.94
11	300014	亿纬锂能	5,856,322.65	0.93
12	600999	招商证券	5,747,697.00	0.91
13	600961	株冶集团	5,697,724.02	0.91
14	300001	特锐德	5,196,675.99	0.83
15	002150	正泰电源	4,833,650.00	0.77
16	002831	裕同科技	4,829,807.90	0.77
17	002352	顺丰控股	4,753,530.89	0.76
18	301580	爱迪特	4,729,634.40	0.75
19	603713	密尔克卫	4,640,468.00	0.74
20	600378	昊华科技	4,613,305.00	0.73

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	981,823,430.27
卖出股票的收入（成交）总额	652,969,747.79

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	61,736,828.89	4.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	493,367,935.35	33.29
	其中：政策性金融债	71,294,013.70	4.81
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,237,232.88	1.37
7	可转债（可交换债）	14,375,498.72	0.97
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	589,717,495.84	39.80

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	2228041	22 农业银行二级 01	700,000	71,375,931.51	4.82
2	092280131	22 建行二级资本债 02A	500,000	51,945,890.41	3.51
3	092280033	22 宁波银行二级资本债 01	400,000	41,904,221.37	2.83
4	2228006	22 中国银行二级 01	400,000	40,954,191.78	2.76
5	220203	22 国开 03	400,000	40,716,821.92	2.75

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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，国家开发银行在本报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚，宁波银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到中国人民银行宁波市分行的处罚，中国工商银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚，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、中国人民银行的处罚，中国农业银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，中国银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，中国邮政储蓄银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到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约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	7,964,395.20
2	应收清算款	241,898.13
3	应收股利	249,404.69
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,813,993.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,269,691.06

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	127025	冀东转债	4,055,716.58	0.27
2	128129	青农转债	3,768,761.64	0.25
3	128135	洽洽转债	3,390,282.54	0.23
4	113647	禾丰转债	1,152,394.06	0.08
5	123179	立高转债	783,321.73	0.05
6	113670	金 23 转债	528,093.33	0.04
7	123104	卫宁转债	437,910.67	0.03

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通欣利混合 A	215,639	2,063.30	175,353,231.95	39.41%	269,573,794.30	60.59%
海富通欣利混合 C	13,918	42,711.49	489,343,909.93	82.32%	105,114,615.74	17.68%
合计	229,557	4,527.79	664,697,141.88	63.95%	374,688,410.04	36.05%

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 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	37.36%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通欣利混合 A	4,770,351.46	1.0722%
	海富通欣利混合 C	4,344,101.31	0.7308%
	合计	9,114,452.77	0.8769%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海富通欣利混合 A	>100
	海富通欣利混合 C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通欣利混合 A	>100
	海富通欣利混合 C	0
	合计	>100

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通欣利混合 A	海富通欣利混合 C
----	-----------	-----------

基金合同生效日（2021 年 9 月 14 日）基金份额总额	120,410,992.42	101,223,867.70
本报告期期初基金份额总额	236,601,189.26	210,415,668.04
本报告期基金总申购份额	404,118,099.15	669,088,955.38
减：本报告期基金总赎回份额	195,792,262.16	285,046,097.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	444,927,026.25	594,458,525.67

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

基金管理人：

2026 年 4 月 30 日，海富通基金管理有限公司发布公告，魏峻先生不再担任公司副总经理。

2026 年 5 月 23 日，海富通基金管理有限公司发布公告，总经理任志强先生自 2026 年 5 月 22 日起兼任公司首席信息官，陶网雄先生不再担任公司首席信息官。

基金托管人：

本报告期内，本基金托管人于 2026 年 3 月 12 日发布公告，朱绍纲先生自 2026 年 3 月 9 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人于 2026 年 4 月 21 日发布公告，陈秀良先生自 2026 年 3 月 16 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部总经理。

本报告期内，本基金托管人于 2026 年 6 月 22 日发布公告，赵伟婧女士自 2026 年 6 月 22 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及本基金基金管理人基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人无受调查或处罚情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
国泰海通证券	3	1,475,780,423.37	90.46%	648,856.94	90.26%	-
西南证券	2	155,679,355.93	9.54%	70,033.37	9.74%	-

注：1、本基金自 2023 年 05 月 19 日起开始采用券商交易结算模式，可免于执行《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》关于交易佣金分仓的规定。

2、基金管理人根据监管规定选择具备证券经纪业务资格的证券公司，并签订证券经纪服务协议。本基金选择国泰海通证券、西南证券作为证券经纪商，其中国泰海通证券系基金管理人的股东。

10.7.2 基金租用或者通过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
国泰海通证券	44,198,150.13	54.70%	10,541,000,000.00	51.52%	-	-
西南证券	36,598,191.62	45.30%	9,918,581,000.00	48.48%	-	-

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	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-12
2	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-04
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华福证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-04
4	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-19
5	海富通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
6	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-01
7	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-09
8	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东莞证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
10	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-28
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增广东顺德农村商业银行股份有限公司为销售机构的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-28
12	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-28
13	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-30
14	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资	证券日报、基金管理人网	2026-05-21

	关联方承销期内承销证券的公告	站及中国证监会基金电子披露网站	
15	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
16	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-26
17	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-09
18	关于海富通欣利混合型证券投资基金新增方正证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-12
19	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所上市股票及相关风险提示的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-13

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026/6/23-2026/6/30	-	208,295,134.98	-	208,295,134.98	20.04%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括： 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险； 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额； 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形； 4、其他可能的风险。 另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。							

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 137 只公募基金。截至 2026 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 3108 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。2008 年 3 月，海富通获批从事特定客户资产管理业务。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，中国保险监督管理委员会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人。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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

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

二〇二六年八月三十一日