

# 海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金

## 2024 年第 3 季度报告

### 2024 年 9 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年十月二十五日

## §1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	海富通添利收益一年持有期债券
基金主代码	019038
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 7 日
报告期末基金份额总额	551,753,558.32 份
投资目标	本基金通过合理运用投资组合优化策略，力争实现基金收益随着时间增长的逐步提升。
投资策略	<p>1、资产配置策略：在投资比例限制的约束下，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对不同大类资产的预期收益和风险进行动态跟踪，从而决定具体资产配置比例。</p> <p>2、债券投资组合策略：主要采取利率策略、信用债和资产支持证券投资策略、收益率曲线策略以及杠杆策略。</p> <p>3、股票投资策略：本基金将适度参与股票资产投资。在大类资产配置框架下，本基金通过定量和定性分析相结合、基本面与模型相结合、基金经理和研究团队相结合的研究方法，甄选优质上市公司构建投资组合，以获得长期持续稳健的投资收益。</p> <p>另外，本基金的投资策略还包括存托凭证投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、国债期货投资策略、基金的投资策略等。</p>

业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*8%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*2%+银行活期存款利率(税后)*5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，还将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通添利收益一年持有期债券 A	海富通添利收益一年持有期债券 C
下属两级基金的交易代码	019038	019039
报告期末下属两级基金的份额总额	415,133,243.14 份	136,620,315.18 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)	
	海富通添利收益一年持有期债券 A	海富通添利收益一年持有期债券 C
1.本期已实现收益	1,498,278.56	439,080.55
2.本期利润	4,860,694.38	1,354,768.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0133	0.0100
4.期末基金资产净值	433,898,911.02	142,286,308.94
5.期末基金份额净值	1.0452	1.0415

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

###### 1、海富通添利收益一年持有期债券 A：

阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①—③	②—④
----	------	------	------	------	-----	-----

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	1.05%	0.14%	2.38%	0.12%	-1.33%	0.02%
过去六个月	2.77%	0.13%	3.90%	0.10%	-1.13%	0.03%
自基金合同 生效起至今	4.52%	0.12%	6.45%	0.10%	-1.93%	0.02%

## 2、海富通添利收益一年持有期债券 C:

阶段	净值增长 率①	净值增长 率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	0.96%	0.14%	2.38%	0.12%	-1.42%	0.02%
过去六个月	2.57%	0.13%	3.90%	0.10%	-1.33%	0.03%
自基金合同 生效起至今	4.15%	0.12%	6.45%	0.10%	-2.30%	0.02%

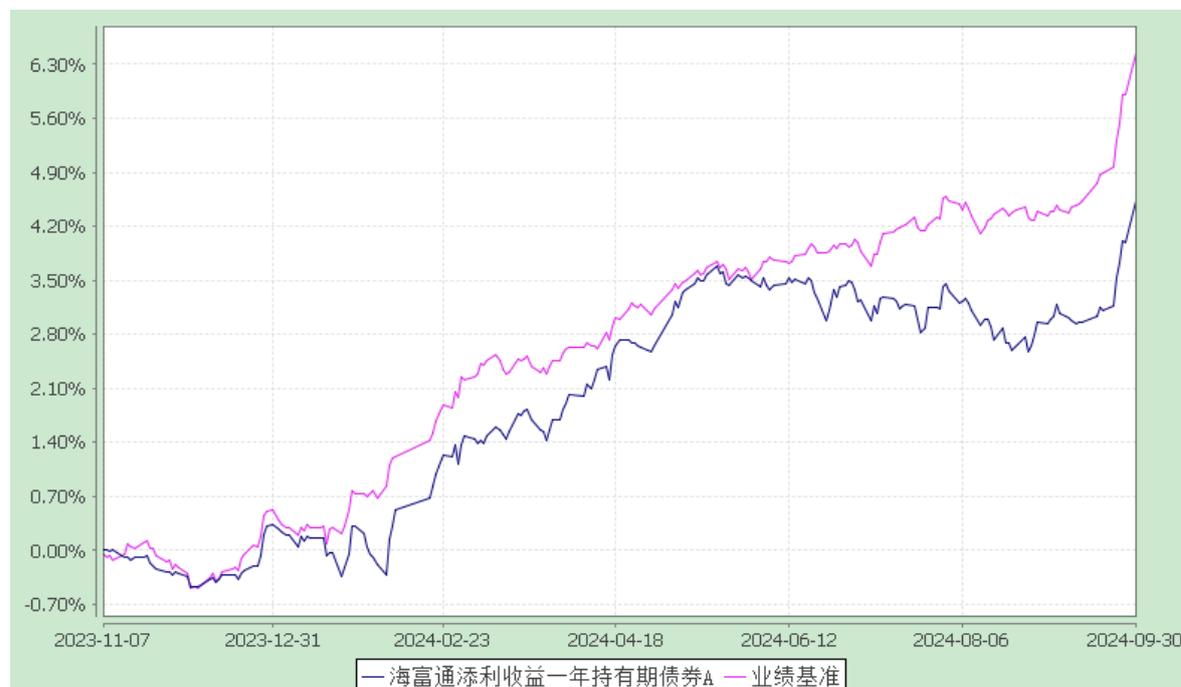
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金

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

#### 1. 海富通添利收益一年持有期债券 A:

(2023 年 11 月 7 日至 2024 年 9 月 30 日)



#### 2. 海富通添利收益一年持有期债券 C:

(2023 年 11 月 7 日至 2024 年 9 月 30 日)



注：1、本基金合同于2023年11月7日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。  
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
江勇	本基金的基金经理；混合资产投资部总经理。	2023-11-07	-	13年	经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师，资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017年6月加入海富通基金管理有限公司，现任混合资产投资部总经理。2018年7月至2023年7月任海富通上证非周期ETF联接基金经理。

					<p>2018 年 7 月至 2022 年 5 月任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF、海富通中证 100 指数(LOF)基金经理。2018 年 7 月至 2020 年 3 月任海富通中证内地低碳指数(现海富通中证 500 增强)基金经理。2020 年 8 月至 2022 年 5 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 联接基金经理。2020 年 8 月至 2023 年 3 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通稳固收益债券的基金经理。2021 年 2 月起兼任海富通欣睿混合基金经理。2021 年 6 月起兼任海富通策略收益债券基金经理。2021 年 6 月至 2023 年 10 月兼任海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。2021 年 9 月起兼任海富通欣利混合基金经理。2023 年 1 月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2023 年 11 月起兼任海富通添利收益一年持有期债券基金经理。2023 年 12 月起兼任海富通悦享一年持有期混合基金经理。2024 年 3</p>
--	--	--	--	--	--

					月起兼任海富通欣盈 6 个月持有期混合基金经理。2024 年 6 月起兼任海富通红利优选混合基金经理。
陈轶平	本基金的基金经理；固定收益投资总监。	2023-11-07	-	15 年	博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011 年 10 月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固定收益投资总监。2013 年 8 月至 2020 年 7 月任海富通货币基金经理。2014 年 8 月至 2019 年 9 月兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014 年 11 月起兼任海富通上证可质押城投债 ETF（现为海富通上证城投债 ETF）基金经理。2015 年 12 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 7 月兼任海富通稳进增利债券（LOF）基金经理。2016 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定开债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任

					<p>海富通富祥混合基金经理。2016 年 8 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞丰一年定开债券(现为海富通瑞丰债券)基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 11 月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 10 月兼任海富通美元债(QDII)基金经理。2017 年 1 月至 2021 年 3 月兼任海富通上证周期产业债 ETF 基金经理。2017 年 2 月至 2023 年 7 月兼任海富通瑞利债券基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 6 月兼任海富通富源债券基金经理。2017 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 9 月兼任海富通富睿混合(现海富通沪深 300 指数增强)基金经理。2017 年 7 月至 2019 年 9 月兼任海富通瑞福一年定开债券(现为海富通瑞福债券)、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2017 年 7 月至 2018 年 12 月兼任海富通欣悦混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018 年 10 月至 2023 年 12 月兼任海</p>
--	--	--	--	--	---

					富通上证 10 年期地方政府债 ETF 基金经理。2018 年 11 月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。2019 年 1 月至 2023 年 12 月兼任海富通上清所短融债券基金经理。2019 年 11 月起兼任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金经理。2020 年 4 月至 2022 年 08 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 7 月起兼任海富通上证投资级可转债 ETF 基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通利率债债券基金经理。2022 年 3 月起兼任海富通恒益一年定开债券发起式基金经理。2022 年 7 月起兼任海富通中证短融 ETF 基金经理。2023 年 8 月起兼任海富通盈丰一年定开债券发起式基金经理。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。
--	--	--	--	--	--

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遵规守信情况说明

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

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

权益方面，从 A 股市场看，三季度市场先跌后涨，三季度上证指数涨幅为 12.4%，沪深 300 为 16.1%，中证 800 为 16.1%，创业板指为 29.2%。行业板块方面，根据中信一级行业分类，表现靠前的板块是非银、综合金融、房地产、消费者服务、计算机，表现靠后的板块是石油石化、煤炭、电力及公用事业、农林牧渔、纺织服装。从行情主线看，三季度以来市场持续调整。但是，随着 9 月 24 日国新办新闻发布会释放了政策暖意，降低存量房贷利率和首付比例以支持地产，创设新工具支持资本市场发展，9 月 26 日中共中央政治局会议分析研究当前经济形势和经济工作，将宏观政策放在更重要的位置，并提出“加力推出增量政策”、“提振资本市场”等，市场信心显著提振。在此背景下，市场做多情绪被激发，迎来了直线拉涨行情，前期超跌的板块迎来了大幅上涨。

报告期间，本基金秉承绝对收益的投资思路投资。权益仓位上，保持相对低位；权益配置上，组合整体偏价值风格，行业分布较为均衡，持仓个股较为分散。组合相对较低的权益仓位在 9 月底之前的下跌中有所受益，但在季末的大幅反弹中有所落后。转债方面，在 7、8 月的转债市场调整中，继续择机增持部分低价且信用风险较低的

可转债，整体在三季度为组合提供了正贡献，但弹性显著弱于正股。目前来看，转债市场虽然已有所反弹，但仍有较多个券存在较高的性价比，部分信用风险较低的转债自身未来的票息收入提供了较为充分的安全垫，在整体权益市场风险偏好已有所抬升的基础上，具备潜在的弹性。

固定收益方面，三季度国内经济修复动能走弱，PMI 维持在收缩区间。经济数据方面，生产端略有走弱；投资方面，制造业与基建维持高增，地产投资惯性下滑。消费需求偏弱，可选消费与地产后周期消费拖累。出口方面，海外需求旺盛，出口同比维持高增。通胀方面，CPI 总体弹性有限，维持在 0-1% 的区间；PPI 由于需求偏弱仍未转正。货币政策方面较为积极，7 月调降 OMO 利率 10bp、MLF 利率 20bp 以及 LPR 利率 10bp。9 月末国新办举行新闻发布会后，再度调降 OMO 利率 20bp、MLF 利率 30bp。财政政策方面，地方债发行明显提速。流动性方面，由于利率债发行造成一定的“抽水效应”，中长期流动性阶段性短缺，在 7 月末降息落地后，流动性总体维持中性偏紧张的情况，9 月末央行重启 14 天逆回购投放操作后流动性偏紧的情况有所缓解。资金价格方面，三季度 R001 均值为 1.79%，较二季度下行 5.4bp；R007 均值为 1.90%，较二季度下行 4.1bp。

对应债市而言，内需不足，货币政策宽松支撑三季度总体维持牛市行情，但在 8 月与 9 月末出现明显调整。7 月政策利率调降，基本面与政策面双利好债券市场；8 月央行买卖国债操作落地，债券抛盘压力陡增，理财产品预防性赎回放大市场波动，收益率一度回到接近 7 月降息前的水平。9 月降息降准预期再度升温，配合调降存量房贷的预期，收益率下行并突破新低。但月末降准降息落地后，债市演绎利好出尽的行情，收益率大幅波动并有上行。全季度来看，10 年期国债到期收益率累计下行 5.4bp。

信用债方面，走势一波三折。7 月，央行对利率约束加大，在利率波动受限、高息资产供给有限的情况下，市场机构普遍通过下沉、拉久期的方式挖掘绝对票息，信用债收益率全线下行，其中长久期、弱资质主体收益率下行幅度最大；8 月，信用债市场经历大幅调整，究其原因，信用利差过低是关键，“固收+”基金赎回是调整的触发剂，不少理财等机构预防式、止盈式地赎回基金，市场流动性缺乏进一步放大了债市的波动，在持续的“地量”成交下，流动性天然劣势的信用债率先快速调整；9 月以来，由于理财实际规模尚未明显下行，叠加央行放开做市，市场情绪好转，信用债有所修复，但信用债内部仍有分层，中高等级收益率普遍下行，低等级、长品种收

益率上行，信用债表现整体不及同期限利率债，信用利差普遍走扩。

本基金在三季度根据组合规模情况，以高等级信用债作为配置底仓，同时主动使用利率债和国债期货等工具，在市场出现明显波动时，参与了波段机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通添利收益一年持有期债券 A 净值增长率为 1.05%，同期业绩比较基准收益率为 2.38%。海富通添利收益一年持有期债券 C 净值增长率为 0.96%，同期业绩比较基准收益率为 2.38%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	32,291,794.48	4.85
	其中：股票	32,291,794.48	4.85
2	基金投资	3,090,753.35	0.46
3	固定收益投资	613,803,947.85	92.21
	其中：债券	613,803,947.85	92.21
	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	14,670,777.01	2.20
8	其他资产	1,834,008.15	0.28
9	合计	665,691,280.84	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5,673,998.64元，占资产净值比例为0.98%。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	707,545.00	0.12
C	制造业	16,181,301.98	2.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,907,142.00	0.33
E	建筑业	1,233,738.00	0.21
F	批发和零售业	1,098,125.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	407,886.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,685,661.00	0.29
J	金融业	1,979,344.00	0.34
K	房地产业	191,750.00	0.03
L	租赁和商务服务业	222,388.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	402,633.86	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	600,281.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	26,617,795.84	4.62

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	132,608.22	0.02
原材料	265,505.01	0.05
工业	1,236,562.41	0.21
非日常生活消费品	134,348.67	0.02
医疗保健	186,372.94	0.03
金融	2,737,156.28	0.48
通信服务	198,709.43	0.03
公用事业	533,030.03	0.09
房地产	249,705.65	0.04
合计	5,673,998.64	0.98

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	000333	美的集团	11,200	851,872.00	0.15
2	06886	HTSC	39,000	440,326.02	0.08
2	601688	华泰证券	20,400	359,040.00	0.06
3	600941	中国移动	4,900	537,530.00	0.09
3	00941	中国移动	3,000	198,709.43	0.03
4	002353	杰瑞股份	21,400	704,060.00	0.12
5	01336	新华保险	16,600	363,015.56	0.06
5	601336	新华保险	6,500	301,730.00	0.05
6	600487	亨通光电	38,500	651,035.00	0.11
7	002035	华帝股份	77,900	622,421.00	0.11
8	600803	新奥股份	29,700	611,226.00	0.11
9	601668	中国建筑	98,400	608,112.00	0.11
10	02601	中国太保	18,200	459,552.18	0.08
10	601601	中国太保	3,200	125,120.00	0.02

注：华泰证券、中国移动、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。

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	60,168,973.38	10.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	338,650,559.51	58.77
	其中：政策性金融债	61,800,969.86	10.73
4	企业债券	114,069,215.35	19.80
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,424,798.90	3.54
7	可转债（可交换债）	80,490,400.71	13.97
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	613,803,947.85	106.53

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	240410	24 农发 10	600,000	61,800,969.86	10.73
2	184108	21 福能 01	300,000	31,434,672.33	5.46
3	2128022	21 交通银行永续债	300,000	31,240,663.56	5.42
4	240246	GR 中电 02	300,000	31,054,094.80	5.39

5	240119	23 华电 K1	300,000	30,990,394.52	5.38
---	--------	----------	---------	---------------	------

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。国债期货相关投资严格遵循法律法规及中国证监会的规定。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变 动(元)	风险指标说 明
TL2412	TL2412	39.00	43,180,800. 00	-447,971.19	-
公允价值变动总额合计(元)					-447,971.19
国债期货投资本期收益(元)					529,600.56
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-595,521.19

注：国债期货投资本期收益中已扣除本期国债期货差价收入应缴纳增值税额。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险，符合既定投资政策及投资目标。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,534,327.78
2	应收证券清算款	280,375.70
3	应收股利	19,304.67
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,834,008.15

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113644	艾迪转债	2,693,195.35	0.47
2	113584	家悦转债	2,670,778.91	0.46
3	113657	再 22 转债	2,477,387.26	0.43
4	110079	杭银转债	2,371,379.51	0.41
5	113633	科沃转债	2,349,509.32	0.41
6	128071	合兴转债	2,301,515.03	0.40
7	113605	大参转债	2,288,874.95	0.40
8	123071	天能转债	2,217,981.04	0.38
9	127024	盈峰转债	2,072,808.39	0.36
10	127088	赫达转债	2,066,375.34	0.36
11	123100	朗科转债	2,039,912.88	0.35
12	128134	鸿路转债	1,929,138.28	0.33
13	128131	崇达转 2	1,916,722.45	0.33
14	118030	睿创转债	1,760,776.27	0.31
15	128121	宏川转债	1,730,623.31	0.30
16	113597	佳力转债	1,710,895.56	0.30
17	128066	亚泰转债	1,705,468.13	0.30
18	128142	新乳转债	1,525,187.65	0.26
19	110076	华海转债	1,449,787.15	0.25
20	123115	捷捷转债	1,442,544.26	0.25
21	128081	海亮转债	1,405,448.86	0.24
22	128116	瑞达转债	1,280,807.38	0.22

23	127041	弘亚转债	1,262,154.87	0.22
24	113625	江山转债	1,174,591.63	0.20
25	128117	道恩转债	1,165,021.98	0.20
26	113050	南银转债	1,143,906.90	0.20
27	113052	兴业转债	1,127,430.95	0.20
28	128125	华阳转债	1,050,511.73	0.18
29	113653	永 22 转债	1,013,590.89	0.18
30	123169	正海转债	916,761.22	0.16
31	127026	超声转债	908,700.76	0.16
32	123109	昌红转债	906,031.48	0.16
33	127072	博实转债	904,329.95	0.16
34	127051	博杰转债	860,569.51	0.15
35	123113	仙乐转债	857,564.48	0.15
36	127035	濮耐转债	775,665.00	0.13
37	113563	柳药转债	773,841.79	0.13
38	123059	银信转债	767,904.90	0.13
39	123121	帝尔转债	730,108.11	0.13
40	113606	荣泰转债	723,392.58	0.13
41	123108	乐普转 2	684,438.42	0.12
42	123104	卫宁转债	680,785.90	0.12
43	127052	西子转债	630,582.51	0.11
44	113650	博 22 转债	582,748.67	0.10
45	123126	瑞丰转债	565,890.19	0.10
46	113636	甬金转债	524,462.58	0.09
47	123063	大禹转债	524,269.15	0.09
48	123213	天源转债	503,884.81	0.09
49	118038	金宏转债	495,761.14	0.09
50	111002	特纸转债	488,805.93	0.08
51	127046	百润转债	455,474.82	0.08
52	128109	楚江转债	446,634.75	0.08
53	123178	花园转债	434,373.47	0.08
54	113676	荣 23 转债	430,156.73	0.07
55	123165	回天转债	428,478.63	0.07
56	127099	盛航转债	410,178.79	0.07
57	127070	大中转债	406,261.11	0.07
58	113637	华翔转债	406,185.89	0.07
59	123120	隆华转债	385,186.98	0.07
60	123212	立中转债	374,227.68	0.06
61	123078	飞凯转债	361,778.07	0.06
62	113618	美诺转债	361,368.30	0.06
63	123146	中环转 2	347,425.34	0.06
64	127077	华宏转债	342,725.17	0.06
65	123085	万顺转 2	336,529.18	0.06

66	118036	力合转债	329,656.53	0.06
67	113640	苏利转债	323,399.62	0.06
68	118009	华锐转债	321,380.96	0.06
69	123154	火星转债	309,494.79	0.05
70	111008	沿浦转债	298,075.00	0.05
71	118032	建龙转债	285,186.67	0.05
72	118005	天奈转债	280,535.84	0.05
73	127034	绿茵转债	273,473.17	0.05
74	123133	佩蒂转债	270,720.66	0.05
75	127059	永东转 2	265,051.53	0.05
76	111005	富春转债	264,070.03	0.05
77	127062	垒知转债	258,848.88	0.04
78	123124	晶瑞转 2	253,203.08	0.04
79	113047	旗滨转债	243,578.19	0.04
80	113624	正川转债	235,455.99	0.04
81	111014	李子转债	227,860.33	0.04
82	118028	会通转债	224,895.34	0.04
83	113647	禾丰转债	209,233.64	0.04
84	113632	鹤 21 转债	203,484.85	0.04
85	118000	嘉元转债	195,906.58	0.03
86	123180	浙矿转债	189,393.72	0.03
87	113643	风语转债	189,281.59	0.03
88	111000	起帆转债	173,981.10	0.03
89	123039	开润转债	163,095.05	0.03
90	127016	鲁泰转债	157,918.78	0.03
91	123221	力诺转债	157,641.56	0.03
92	113655	欧 22 转债	146,907.81	0.03
93	127076	中宠转 2	132,789.30	0.02
94	128063	未来转债	130,696.85	0.02
95	111009	盛泰转债	130,437.23	0.02
96	123091	长海转债	125,528.84	0.02
97	113054	绿动转债	104,596.68	0.02
98	127053	豪美转债	81,289.56	0.01
99	113542	好客转债	75,080.18	0.01
100	118010	浩特转债	68,514.75	0.01
101	113663	新化转债	63,788.22	0.01
102	123149	通裕转债	61,215.45	0.01
103	123211	阳谷转债	56,601.16	0.01
104	128101	联创转债	55,647.55	0.01
105	113652	伟 22 转债	54,692.25	0.01
106	113064	东材转债	54,249.79	0.01
107	127030	盛虹转债	51,282.26	0.01
108	128087	孚日转债	51,246.49	0.01

109	118033	华特转债	34,100.81	0.01
110	110062	烽火转债	33,919.62	0.01
111	118041	星球转债	33,901.31	0.01
112	123184	天阳转债	25,999.67	0.00
113	127086	恒邦转债	23,869.46	0.00
114	113039	嘉泽转债	23,605.98	0.00
115	113579	健友转债	21,783.04	0.00
116	123214	东宝转债	21,119.59	0.00
117	123179	立高转债	20,400.47	0.00
118	113053	隆 22 转债	20,366.33	0.00
119	118035	国力转债	19,822.33	0.00
120	123103	震安转债	18,673.32	0.00
121	123158	宙邦转债	11,690.10	0.00
122	123119	康泰转 2	11,569.64	0.00
123	118018	瑞科转债	9,387.79	0.00

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

## §6 基金中基金

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

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	510310	易方达沪深300ETF发起式	交易型开放式	574,093.00	2,341,725.35	0.41%	否
2	512120	华安中证细分医药ETF	交易型开放式	1,687,000.00	749,028.00	0.13%	否

### 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	4,668.72	-
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,033.41	-
当期交易基金产生的交易费（元）	145.91	-
当期交易基金产生的转换费（元）	-	-

注：当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况，根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

### 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

## §7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通添利收益一年持有期债券A	海富通添利收益一年持有期债券C
本报告期期初基金份额总额	267,089,852.45	131,847,952.13
本报告期基金总申购份额	148,043,390.69	4,772,363.05
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	415,133,243.14	136,620,315.18

## §8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

## 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	2024/7/1-2024/8/1	100,003,500.00	-	-	100,003,500.00	18.12%

#### 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五十个工作日低于5000万元的风险，本基金可能会面临终止基金合同的情形；
- 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。

### 9.2 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 124 只公募基金。截至 2024 年 9 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1584 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”。

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金的文件
- (二)海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金基金合同
- (三)海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通添利收益一年持有期债券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

**10.2 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

**10.3 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

二〇二四年十月二十五日