

华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资  
基金  
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 29 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。本年度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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 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。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
4.9 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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
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 .....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	17
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	17
6.2 审计报告的基本内容 .....	17
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表 .....	19
7.2 利润表 .....	20
7.3 净资产变动表 .....	21
7.4 报表附注 .....	23
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>52</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53

8.3 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 .....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	53
8.6 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 .....	54
8.7 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 .....	54
8.8 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 .....	54
8.9 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 .....	54
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	54
8.11 投资组合报告附注 .....	54
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
9.3 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情况 .....	56
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
11.2 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 .....	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
11.4 基金投资策略的改变 .....	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
11.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
12.1 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 .....	61
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
13.1 备查文件目录 .....	62
13.2 存放地点 .....	62
13.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金	
基金简称	华富吉禄 90 天滚动持有债券	
基金主代码	020135	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 12 月 1 日	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	115,360,240.67 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华富吉禄 90 天滚动持有债券 A	华富吉禄 90 天滚动持有债券 C
下属分级基金的交易代码	020135	020136
报告期末下属分级基金的份额总额	16,384,040.89 份	98,976,199.78 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上，追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。
投资策略	根据对国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合流动性、估值水平、风险偏好等因素，综合评价各类资产的风险收益水平。本基金以久期和流动性管理作为债券投资的核心，在动态避险的基础上，追求适度收益。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×80%+一年期定期存款基准利率（税后）×20%
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。

### 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		华富基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林之懿	张姗
	联系电话	021-68886996	400-61-95555
	电子邮箱	linzy@hffund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-700-8001	400-61-95555
传真		021-68887997	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区栖霞路 18 号陆	深圳市深南大道 7088 号招商银

	家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	赵万里	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号 6 楼
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2024 年		2023 年 12 月 1 日 (基金合同生效日) - 2023 年 12 月 31 日	
	华富吉禄 90 天滚动持有债券 A	华富吉禄 90 天滚动持有债券 C	华富吉禄 90 天滚动持有债券 A	华富吉禄 90 天滚动持有债券 C
本期已实现收益	519,325.26	4,287,423.33	17,716.35	449,645.44
本期利润	547,342.61	4,521,746.96	23,735.13	614,979.28
加权平均基金份额本期利润	0.0348	0.0388	0.0029	0.0027
本期加权平均净值利润率	3.40%	3.82%	0.29%	0.27%
本期基金份额净值增长率	3.98%	3.76%	0.29%	0.27%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	629,681.46	3,568,189.92	17,716.35	449,732.89
期末可供分配基金份额利润	0.0384	0.0361	0.0022	0.0020

期末基金资产净值	17,085,545.88	102,976,964.27	8,223,038.56	225,927,915.66
期末基金份额净值	1.0428	1.0404	1.0029	1.0027
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	4.28%	4.04%	0.29%	0.27%

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) 以上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（例如，开放式基金的申购赎回费等），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。

4) 本基金成立于 2023 年 12 月 1 日。

### 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

华富吉禄 90 天滚动持有债券 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	1.28%	0.03%	1.86%	0.08%	-0.58%	-0.05%
过去六个月	1.73%	0.03%	2.15%	0.08%	-0.42%	-0.05%
过去一年	3.98%	0.02%	4.28%	0.07%	-0.30%	-0.05%
自基金合同生效起至今	4.28%	0.02%	5.01%	0.07%	-0.73%	-0.05%

华富吉禄 90 天滚动持有债券 C

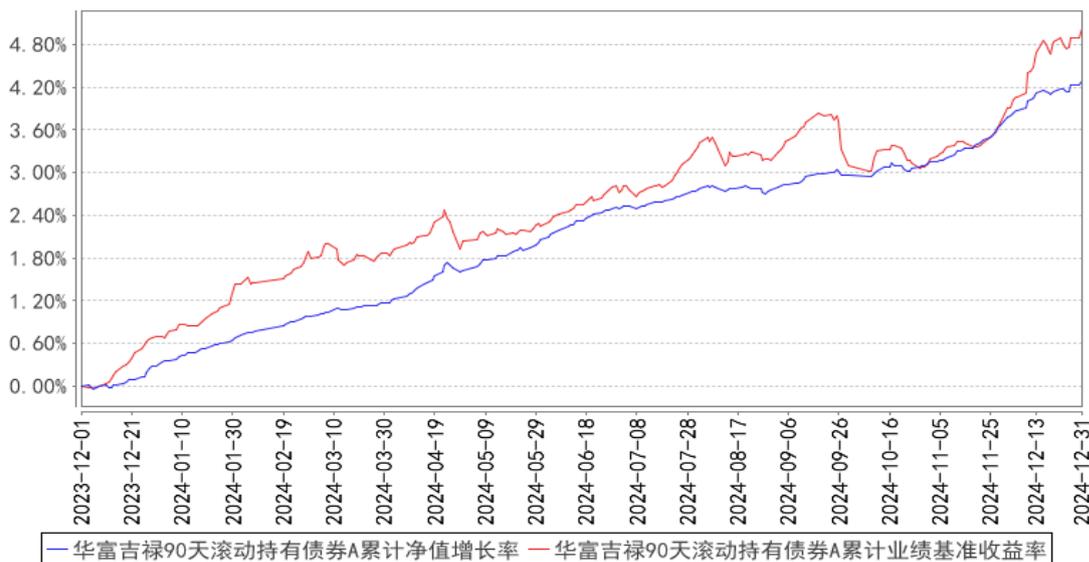
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.24%	0.03%	1.86%	0.08%	-0.62%	-0.05%
过去六个月	1.62%	0.03%	2.15%	0.08%	-0.53%	-0.05%

过去一年	3.76%	0.02%	4.28%	0.07%	-0.52%	-0.05%
自基金合同生效起至今	4.04%	0.02%	5.01%	0.07%	-0.97%	-0.05%

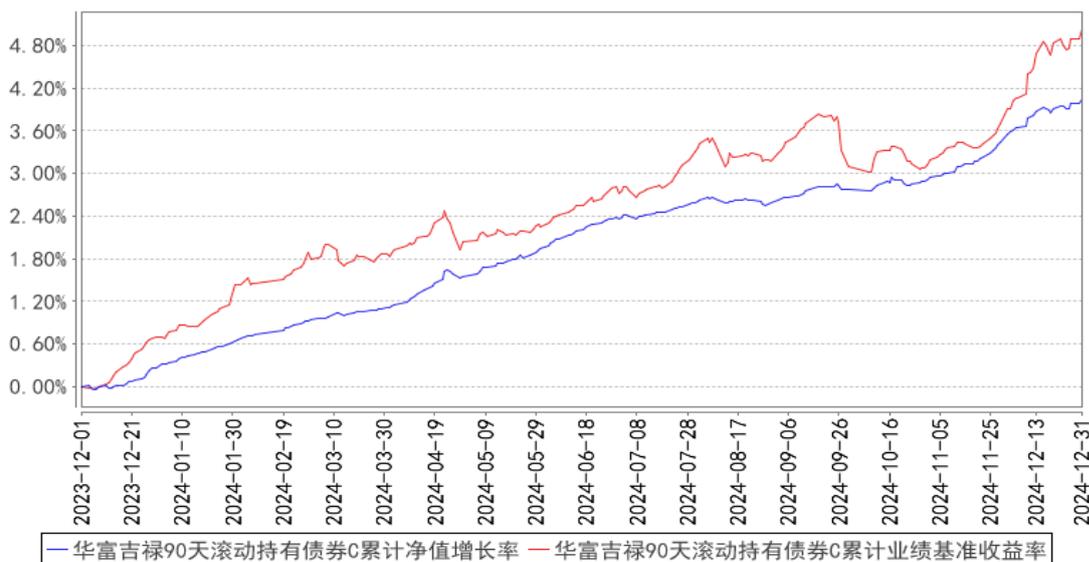
注：业绩比较基准收益率=中债综合全价（总值）指数收益率\*80%+一年期定期存款基准利率（税后）\*20%

### 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

华富吉禄90天滚动持有债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华富吉禄90天滚动持有债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

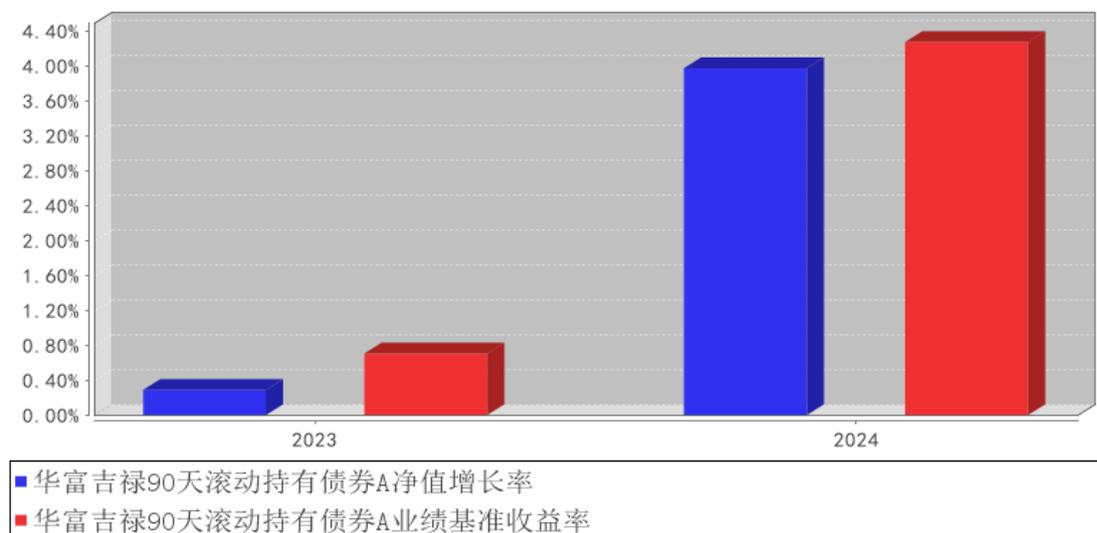


注：本基金建仓期为 2023 年 12 月 1 日到 2024 年 6 月 1 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合

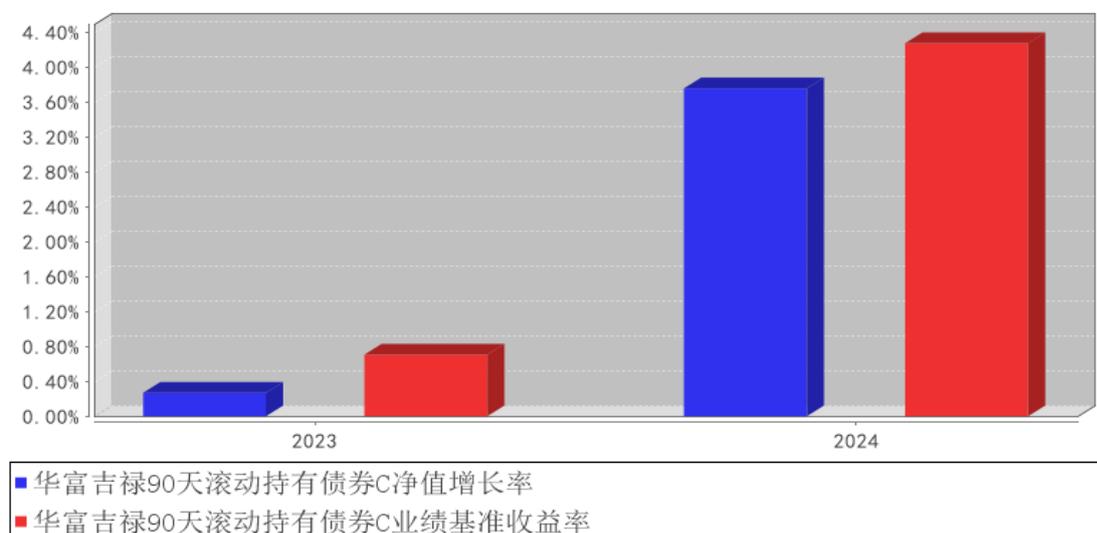
同》的相关规定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华富吉禄90天滚动持有债券A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



华富吉禄90天滚动持有债券C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用融资担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2024 年 12 月 31 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 A100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金、华富新能源股票型发起式证券投资基金、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华富匠心明选一年持有期混合型证券投资基金、华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富安业一年持有期债券型证券投资基金、华富消费成长股票型证券投资基金、华富中证科创创业 50

指数增强型证券投资基金、华富时代锐选混合型证券投资基金、华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富匠心领航 18 个月持有期混合型证券投资基金、华富数字经济混合型证券投资基金、华富荣盛一年持有期混合型证券投资基金、华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金、华富泰合平衡 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华富恒享纯债债券型证券投资基金、华富恒惠纯债债券型证券投资基金、华富半导体产业混合型发起式证券投资基金、华富祥晖 6 个月持有期债券型证券投资基金共六十五只基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
尤之奇	本基金基金经理、固定收益部总监助理	2024 年 8 月 21 日	-	十四年	上海财经大学经济学硕士，本科学历。历任毕马威会计师事务所审计员、华泰柏瑞基金管理有限公司市场部总监助理、兴业银行银行合作中心基金负责人。2017 年 6 月加入华富基金管理有限公司，曾任指数投资部基金经理助理、基金经理、总监助理，自 2020 年 8 月 17 日起任华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 9 月 15 日起任华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 3 月 14 日起任华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金基金经理，自 2024 年 8 月 16 日起任华富恒盛纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2024 年 8 月 21 日起任华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理，自 2024 年 8 月 21 日起任华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理，自 2024 年 8 月 21 日起任华富恒享纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2024 年 9 月 24 日起任华富恒惠纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2024 年 11 月 26 日起任华富祥晖 6 个月持有期债券型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。
倪莉莎	本基金基金经理、固定收益部总监助理	2023 年 12 月 1 日	2024 年 8 月 23 日	十年	英国曼彻斯特大学理学硕士，硕士研究生学历。2014 年 2 月加入华富基金管理有限公司，曾任集中交易部助理交易员、交易员，固定收益部基金经理助理、基金经理，固定收益部总监助理，具有基金从业资格。

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

## 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》及相关法律法规，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公司的公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体控制措施如下：

在研究分析和投资决策环节，公司通过建立规范、完善的研究管理平台，为所有的投资组合经理提供公平的研究服务和支持。公司的各类投资组合，在保证其决策相对独立的同时，在获取投资信息、投资建议及决策实施方面均享有公平的机会。各投资组合经理根据其管理的投资组合的投资风格和投资策略，制定客观、完整的交易决策规则，并按照这些规则进行投资决策，保证各投资组合投资决策的客观性和独立性。

在交易执行环节，公司设立独立的集中交易部门，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。交易执行的公平原则：“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。公司通过完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，确保各投资组合获得公平的交易机会。

在行为监控和分析评估环节，公司将公平交易作为日常交易监控的重要关注内容，加强对投资交易行为的监督力度，公司集中交易部、风险管理部等相关部门严格按照公司关于异常交易的界定规则对违反公平交易原则的异常交易进行识别、监控与分析。每日交易时间结束后，集中交易部对每一笔公平交易的执行结果进行登记，逐笔备注发生公平交易各指令的先后顺序及实际执行结

果，由具体执行的交易员签字确认留档，并交风险管理部备案。公司风险管理部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，对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）同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，根据纳入样本内的数据分析结果，未发现明显异常情况。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

### 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

2024 年国内生产总值各季度分别同比增长 5.3%、4.7%、4.6%、5.4%。全年出口表现较好，国内假期旅游消费数据超过 2019 年，但社零和服务业增速有所走低，物价温和复苏。地产政策 5 月和 9 月分别放宽限购条件，降低首付比例和贷款利率，并明确政府收购存量房，下半年二手房成交出现明显起色。同时在下半年以旧换新、设备更新补贴力度加大，财政力度加码的作用下，四季度经济数据出现全面向好。海外经济总体保持了稳定增长态势，美联储降息低于预期，人民币汇率阶段性承压。

2024 年央行保持支持性货币政策，将稳健的货币政策转向为适度宽松。两次下调 LPR 利率，并降准两次。同时采用新的货币政策工具为市场提供流动性。下半年持续买入国债，同时通过买断式回购投放流动性，全年总体资金宽松，季末年末价格稳定。

债券市场走出近年来牛市，10 年、30 年期债券品种的收益率不断刷新历史新低。2024 年年初在配置盘和降准带动下，收益率快速下行，同时股市表现一般，导致更多资产配置资金涌入股市。二季度由于政府债券发行节奏较慢，以及禁止手工贴息导致存款搬家，进一步增加了资产配置压力。期间央行虽然屡次提示长债风险，但依旧无法阻挡市场对高安全性资产的配置倾向。债券市场在三季度大幅波动，分别在 8 月初和 9 月底出现大幅调整。9 月底之后，市场对未来经济

预期出现反转，利率快速上行。随着央行流动性呵护及配置盘提前反应，利率在 11 月下旬快速下行，随着 12 月同业存款自律机制出台及定调货币政策转为适度宽松后，下行幅度进一步增强，短端利率和资金价格严重倒挂。2024 全年，3 年国开债收益率下行 91BP，5 年国开债收益率下行 102BP。

信用债由于化债影响持续，净发行量较往年大幅减少，2024 年上半年信用利差继续压缩。同长期、超长期产业债受到市场追捧。但下半年信用债流动性瑕疵影响放大，自 8 月起持续调整并在 10 月出现一波较大幅度调整，随着 11 月利率下行，流动性恢复收益率下行，但利差始终维持在年内高位。

报告期内本产品坚持配置中高等级中短债，以提高持有人在持有期的体验为目标，严格匹配投资人风险偏好，适时使用杠杆、骑乘、轮动等策略。积极跟上市场的流动性方向，选择不同的债券品种，组合轮动，为组合提供稳定合理的收益。由于本产品 90 天持有期的特点，产品于 2024 年 8 月逐步减仓信用，趁 10 月调整期间逐步加仓信用债，并适度参与利率交易，获得了较好收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富吉禄 90 天滚动持有债券 A 份额净值为 1.0428 元，累计份额净值为 1.0428 元。报告期，华富吉禄 90 天滚动持有债券 A 份额净值增长率为 3.98%，同期业绩比较基准收益率为 4.28%。截止本期末，华富吉禄 90 天滚动持有债券 C 份额净值为 1.0404 元，累计份额净值为 1.0404 元。报告期，华富吉禄 90 天滚动持有债券 C 份额净值增长率为 3.76%，同期业绩比较基准收益率为 4.28%。

#### 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 2025 年，从外部环境来看，世界经济增长动能不强，通胀压力有所缓解，主要经济体经济表现或面临分化，货币政策预计进入降息周期。我国经济运行总体平稳，高质量发展扎实推进，但也面临一些挑战。我们认为未来政策发力还是需要更多的货币政策配合，随着化债的进行，2025 年的资产适配压力或将更大，市场对票息资产追逐可能还会持续，因而债券是受益品种。考虑到短期债券收益率下行过快提前交易了部分降准降息的预期，同时资金和短债收益率倒挂加剧了市场不稳定性。未来短期波动或将增加，但中期趋势依旧。我们预计在经济转型大背景下，央行适度宽松的货币政策将持续下调存款利率和 LPR，债券依旧值得配置。信用债目前利差依旧在较高分位数，在利率债收益率倒挂情况下更值得配置，但是由于利率潜在波动增大，理财等机构可能更容易采用基金作为流动性管理工具，因此未来信用债波动也会相应增加。

本基金作为中短债基金，仍然坚持以提高投资人持有体验为目标，利用管理人对信用债的研

究能力，对交易情绪的把握，以及流动性轮动节奏的判断，在坚持配置与投资人风险偏好符合的中短债券基础上，提升持有人体验。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 年度，为加强公司内部控制，监察稽核工作从制度建设和内部监察稽核入手为公司持续发展奠定坚实的基础。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，独立、客观、公正地开展基金运作和公司管理的合规性监察，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

1、逐步建立和完善架构清晰、控制有效的内部控制机制。2024 年为进一步加强公司党建，完善高管人员定期稽核审计，提升公司治理水平，对《华富基金管理有限公司章程》进行了修订；为忠实履行基金管理人的诚信义务，防范利益输送，进一步完善《华富基金管理有限公司旗下基金投资关联方证券管理制度》；为加强公司反洗钱内部控制，有效防控洗钱风险，加强反洗钱客户身份识别和可疑交易调查工作，制定了《华富基金管理有限公司反洗钱客户尽职调查管理办法》；根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，修订《华富基金管理有限公司基金交易席位管理办法》；为加强公司旗下投资组合程序化交易管理，遵守《证券市场程序化交易管理规定》等法规，制定了《华富基金管理有限公司程序化交易、算法交易管理办法》；为进一步优化股票池管理流程与规范，明确股票池的评议、决策、维护机制，修订了《华富基金管理有限公司股票池管理办法》；为了促进公司规章制度制定与管理工作的规范化、程序化，提高建章立制的质量，修订了《华富基金管理有限公司规章制度制定与管理规定》；为有效发挥互联网平台在公司品牌形象、业务发展、企业文化建设、意识形态建设等方面的作用，加强公司互联网平台管理，修订了《华富基金管理有限公司互联网平台管理办法》；为提高投资决策委员会对于资产运作决策的合规性、科学性，加强决策流程的规范性，提高决策效率，降低决策风险，修订了《华富基金管理有限公司投资决策委员会工作制度》；为规范公司从业人员及其配偶、利害关系人的投资行为，维护基金份额持有人利益，防范利益冲突和道德风险，修订了《华富基金管理有限公司基金从业人员投资申报管理制度》。为了有效应对和处置信息系统突发事件，最大程度防范和降低信息系统突发事件对公司各项业务的影响，修订了《华富基金管理有限公司信息系统应急管理制度》等多项信息技术管理相关制度。为加强公司声誉风险管理，制定了《华富基金管理有限公司声誉风险管理制度》；为有效管理核心系统权限，提高信息安全，制定了《华富基金管理有限公司系统权限管理制度》；为提高内控规范性，修订了《华富基金管理有限公司从业人员监控系统管理办法》；为强化内控质效、明确管理目标、运用考核约束，梳理修订了全员合规考核指标体系和反洗钱考核指标体系。

2、多方位开展监察稽核工作，不断提高稽核覆盖面和检查力度。通过定期和不定期监察稽核工作的开展，公司的各个部门、各项业务的规范性和完善性都得到了较大的提高，各部门及时发现和弥补了制度建设中的漏洞和缺陷，实际业务操作流程更加科学有效。

3、加强风险监控，严格控制投资风险，通过对各基金的运行状况、投资比例、相关指标进行监控和跟踪，及时报告异常情况，确保基金投资规范运作。

4、扩大风险控制工作的覆盖面。风险控制工作不再局限于投资管理，从公司运营整体规范要求，风险控制渗透在业务的各个环节和所有部门，由风险控制委员会组织、监察稽核部执行，识别和评估从治理结构到一线业务操作等公司各方面、各业务流程中公司运作和基金管理的风险点和风险程度，明确划分风险责任，并制定相应的风险控制措施。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

#### 4.7 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》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 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

从 2024 年 09 月 12 日起至 2024 年 10 月 29 日，本基金基金资产净值存在连续二十个工作日低于 5000 万元的情形，从 2024 年 10 月 30 日起至本报告期末（2024 年 12 月 31 日），本基金基金资产净值已不存在连续二十个工作日低于 5000 万元的情形。

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

## § 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职

责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审（2025）6-93 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金（以下简称华富吉禄 90 天基金）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表，以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华富吉禄 90 天基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况，以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华富吉禄 90 天基金及其管理人华富基金管理有限公司（以下简称基金管理人），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-

<p>其他信息</p>	<p>基金管理人管理层（以下简称管理层）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估华富吉禄 90 天基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层（以下简称治理层）负责监督华富吉禄 90 天基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（三）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华富吉禄 90 天基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大</p>

	<p>不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华富吉禄 90 天基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	义国兵	沈文伟
会计师事务所的地址	浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号 6 楼	
审计报告日期	2025 年 03 月 28 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	431,191.86	113,262.02
结算备付金		6,052,217.02	-
存出保证金		840.21	-
交易性金融资产	7.4.7.2	128,669,960.74	278,207,708.44
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		122,666,028.68	258,540,717.75
资产支持证券投资		6,003,932.06	19,666,990.69
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	9,954,177.92
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		208,167.36	50,300.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-

资产总计		135,362,377.19	288,325,448.38
负债和净资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		15,001,088.03	54,025,810.15
应付清算款		-	-
应付赎回款		63,420.88	-
应付管理人报酬		25,473.73	57,599.37
应付托管费		8,491.23	19,199.80
应付销售服务费		14,556.64	37,050.88
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,132.33	16,237.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	182,704.20	18,596.35
负债合计		15,299,867.04	54,174,494.16
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.7	115,360,240.67	233,512,129.39
未分配利润	7.4.7.8	4,702,269.48	638,824.83
净资产合计		120,062,510.15	234,150,954.22
负债和净资产总计		135,362,377.19	288,325,448.38

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 115,360,240.67 份，其中华富吉禄 90 天滚动持有债券 A 基金份额总额 16,384,040.89 份，基金份额净值 1.0428 元；华富吉禄 90 天滚动持有债券 C 基金份额总额 98,976,199.78 份，基金份额净值 1.0404 元。

## 7.2 利润表

会计主体：华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年12月1日（基 金合同生效日）至2023 年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		6,478,566.30	822,356.57
1. 利息收入		145,172.35	159,455.33
其中：存款利息收入	7.4.7.9	45,177.03	38,883.91
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		99,995.32	120,571.42
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,071,004.36	491,548.62
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	5,747,475.51	461,380.86
资产支持证券投资	7.4.7.12	323,528.85	30,167.76
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	262,340.98	171,352.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	48.61	-
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,409,476.73</b>	<b>183,642.16</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	403,796.37	57,599.37
2. 托管费	7.4.10.2.2	134,598.78	19,199.80
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	237,955.85	37,050.88
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		414,841.10	53,748.22
其中：卖出回购金融资产支出		414,841.10	53,748.22
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		14,913.43	1,739.75
8. 其他费用	7.4.7.19	203,371.20	14,304.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>5,069,089.57</b>	<b>638,714.41</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>5,069,089.57</b>	<b>638,714.41</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>5,069,089.57</b>	<b>638,714.41</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	233,512,129.39	-	638,824.83	234,150,954.22
二、本期期初净资产	233,512,129.39	-	638,824.83	234,150,954.22
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 118,151,888.72	-	4,063,444.65	-114,088,444.07
(一)、综合收益总额	-	-	5,069,089.57	5,069,089.57
(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)	- 118,151,888.72	-	-1,005,644.92	-119,157,533.64
其中：1. 基金申购款	244,474,429.52	-	5,822,599.19	250,297,028.71
2. 基金赎回款	- 362,626,318.24	-	-6,828,244.11	-369,454,562.35
(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	115,360,240.67	-	4,702,269.48	120,062,510.15
项目	上年度可比期间 2023 年 12 月 1 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	233,461,939.81	-	-	233,461,939.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	50,189.58	-	638,824.83	689,014.41
(一)、综合收益总额	-	-	638,714.41	638,714.41
(二)、本期基金份额交易产生的	50,189.58	-	110.42	50,300.00

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1. 基金申 购款	50,189.58	-	110.42	50,300.00
2. 基金赎 回款	-	-	-	-
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的净 资产变动(净资 产减少以“-”号 填列)	-	-	-	-
四、本期期末净 资产	233,512,129.39	-	638,824.83	234,150,954.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

赵万里

曹华玮

邵恒

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证监会 2023 年 11 月 14 日证监许可[2023]2553 号核准，基金合同于 2023 年 12 月 1 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具《验资报告》（天健验[2023]6-57 号）。有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》的规定，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各类债券（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、公开发行的次级债、地方政府债、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、国债期货、银行存款、同业存单、货币市场工具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）。本基金不投资于股票等权益资产，也不投资于可转换债券、可交换债券。如法律法

规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净资产变动等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金目前暂无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金持有的其他金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

###### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。在考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息的基础上，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失，应当分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，按照未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。本基金确定金融工具在估值日只具有较低的信用风险的，可以假设该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加（即处于第一阶段）。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取金融资产现金流量的合同权利终止；（2）金融资产已转移，且已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；（3）金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对金融资产的控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

##### （1） 估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

- 1) 第一层次输入值是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；
- 2) 第二层次输入值是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，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的

其他可观察输入值,如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等;市场验证的输入值等;

3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值,包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据做出的财务预测等。

## (2) 估值方法及关键假设

1) 根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证券监督管理委员会公告(2017)13号)规定,在下列情况下本基金采用的估值方法及关键假设如下:

① 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种,在估值日有报价的,除会计准则规定的例外情况外,将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。

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

③ 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,对估值进行调整并确定公允价值。

2) 对于发行时明确一定期限限售期的股票(包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),根据中国证券投资基金业协会《关于发布《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》的通知》(中基协发(2017)6号),估值处理如下:

① 流通受限股票按以下公式确定估值日该流通受限股票的价值:  $FV=S \times (1-LoMD)$

其中: FV: 估值日该流通受限股票的价值; S: 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值; LoMD: 该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣。

② 引入看跌期权计算该流通受限股票对应的流动性折扣。  $LoMD=P/S$ , P 是估值日看跌期权的价格。

③ 证券投资基金持有的流通受限股票在估值日按平均价格亚式期权模型确定估值日看跌期权的价格。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认；

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后最后一位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式及红利再投资形式分配。期末可供分

配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

无。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告(2017)13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发(2017)6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告(2017)13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》以及《关于固定收益品种的估值处理标准》采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无重大变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无重大变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1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〔2012〕85号)、《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》(财税〔2014〕81号)、《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》(财税〔2016〕127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〔2015〕101号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36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〕46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〔2016〕140号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税〔2017〕56号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税〔2017〕90号)及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(一) 自 2018 年 1 月 1 日起,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。

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、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。

(三) 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。证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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。

(四) 对基金通过沪港通/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。基金通过沪港通/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。

(五) 主要税种及税率列示如下:

税 种	计 税 依 据	税 率
增值税	以按税法规定计算的金融服务销售额	3%

城市维护建设税	实际缴纳的流转税税额	7%
教育费附加	实际缴纳的流转税税额	3%
地方教育附加	实际缴纳的流转税税额	2%

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
活期存款	431,191.86	113,262.02
等于：本金	430,660.30	113,201.25
加：应计利息	531.56	60.77
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
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	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	431,191.86	113,262.02

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2024 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,000,603.72	13,052.49	8,052,452.49	38,796.28
	银行间市场	113,700,102.68	518,576.19	114,613,576.19	394,897.32
	合计	121,700,706.40	531,628.68	122,666,028.68	433,693.60
资产支持证券	6,000,000.00	3,932.06	6,003,932.06	0.00	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	

合计	127,700,706.40	535,560.74	128,669,960.74	433,693.60	
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	50,208,450.69	427,331.50	50,696,831.50	61,049.31
	银行间市场	204,450,817.24	3,219,686.25	207,843,886.25	173,382.76
	合计	254,659,267.93	3,647,017.75	258,540,717.75	234,432.07
资产支持证券	19,549,079.45	180,990.69	19,666,990.69	-63,079.45	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	274,208,347.38	3,828,008.44	278,207,708.44	171,352.62	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	9,954,177.92	-
合计	9,954,177.92	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

注：本基金本期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	16,190.71	4,692.21
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	16,190.71	4,692.21
应付利息	-	-
应付审计费	50,000.00	3,904.14
中债账户维护费	4,500.00	-
应付信息披露费	107,213.49	10,000.00
上清账户维护费	4,800.00	-
合计	182,704.20	18,596.35

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 华富吉禄 90 天滚动持有债券 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,199,303.43	8,199,303.43
本期申购	42,177,760.58	42,177,760.58
本期赎回（以“-”号填列）	-33,993,023.12	-33,993,023.12
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	16,384,040.89	16,384,040.89

##### 华富吉禄 90 天滚动持有债券 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	225,312,825.96	225,312,825.96
本期申购	202,296,668.94	202,296,668.94
本期赎回（以“-”号填列）	-328,633,295.12	-328,633,295.12

基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	98,976,199.78	98,976,199.78

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华富吉禄 90 天滚动持有债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,716.35	6,018.78	23,735.13
本期期初	17,716.35	6,018.78	23,735.13
本期利润	519,325.26	28,017.35	547,342.61
本期基金份额交易产生的变动数	92,639.85	37,787.40	130,427.25
其中：基金申购款	1,039,817.92	64,937.29	1,104,755.21
基金赎回款	-947,178.07	-27,149.89	-974,327.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	629,681.46	71,823.53	701,504.99

华富吉禄 90 天滚动持有债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	449,732.89	165,356.81	615,089.70
本期期初	449,732.89	165,356.81	615,089.70
本期利润	4,287,423.33	234,323.63	4,521,746.96
本期基金份额交易产生的变动数	-1,168,966.30	32,894.13	-1,136,072.17
其中：基金申购款	4,412,451.19	305,392.79	4,717,843.98
基金赎回款	-5,581,417.49	-272,498.66	-5,853,916.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,568,189.92	432,574.57	4,000,764.49

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 12 月 1 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	41,516.25	38,883.91
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	3,593.39	-
其他	67.39	-
合计	45,177.03	38,883.91

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间无股票投资收益。

##### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：无。

##### 7.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年12月1日（基金合同生 效日）至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	4,399,296.04	463,810.86
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,348,179.47	-2,430.00
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	5,747,475.51	461,380.86

##### 7.4.7.11.2 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12月 31日	上年度可比期间 2023年12月1日（基金合同生 效日）至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	855,996,866.65	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	841,619,835.83	-
减：应计利息总额	12,999,526.35	-
减：交易费用	29,325.00	2,430.00

买卖债券差价收入	1,348,179.47	-2,430.00
----------	--------------	-----------

#### 7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年12月1日（基金合同生效日）至2023年12月31日
资产支持证券投资收益——利息收入	208,540.46	30,167.76
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	114,988.39	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	323,528.85	30,167.76

##### 7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年12月1日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	24,055,923.18	0.00
减：卖出资产支持证券成本总额	23,549,079.45	-
减：应计利息总额	391,855.34	0.00
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	114,988.39	-

##### 7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

### 7.4.7.13 贵金属投资收益

#### 7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

### 7.4.7.14 衍生工具收益

#### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

### 7.4.7.15 股利收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年12月1日（基金 合同生效日）至2023年12月 31日
1. 交易性金融资产	262,340.98	171,352.62
股票投资	-	-
债券投资	199,261.53	234,432.07
资产支持证券投资	63,079.45	-63,079.45
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	262,340.98	171,352.62

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
其他	48.61	-
合计	48.61	-

注：其他所列金额为债券认购期利息。

#### 7.4.7.18 信用减值损失

注：无。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	46,095.86	3,904.14
信息披露费	107,213.49	10,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	12,861.85	-
账户维护费	37,200.00	-
其他	-	400.00
合计	203,371.20	14,304.14

注：上年度所列其他为证券账户开户费。

#### 7.4.7.20 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本管理人分别于 2025 年 1 月 18 日、2025 年 2 月 26 日发布的分红公告，本基金于 2025 年 1 月 21 日（除权日）、2025 年 2 月 27 日（除权日）、2025 年 3 月 27 日（除权日）进行 2025 年度第一、第二次、第三次分红。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华安证券股份有限公司(“华安证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
安徽省信用融资担保集团有限公司	基金管理人的股东
合肥兴泰金融控股(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期和上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年12月1日(基金 合同生效日)至2023年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	403,796.37	57,599.37
其中:应支付销售机构的客户维护 费	188,099.99	27,168.09
应支付基金管理人的净管理费	215,696.38	30,431.28

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法  $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$  (H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值)。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年12月1日(基金 合同生效日)至2023年 12月31日

当期发生的基金应支付的托管费	134,598.78	19,199.80
----------------	------------	-----------

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法  $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富吉禄 90 天滚动 持有债券 A	华富吉禄 90 天滚动 持有债券 C	合计
华富基金管理有限公司 (管理人)	-	-	-
招商银行股份有限公司 (托管人)	-	196,284.80	196,284.80
华安证券股份有限公司 (管理人股东)	-	48.57	48.57
合计	-	196,333.37	196,333.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富吉禄 90 天滚动 持有债券 A	华富吉禄 90 天滚动 持有债券 C	合计
华富基金管理有限公司 (管理人)	-	-	-
招商银行股份有限公司 (托管人)	-	37,048.74	37,048.74
华安证券股份有限公司 (管理人股东)	-	-	-
合计	-	37,048.74	37,048.74

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。计算公式  $H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$ （H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费，E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值）。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内和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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

注：无。

7.4.10.4.2 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

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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

注：本基金本报告期间基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日		上年度可比期间 2023年12月1日（基金合同生效日）至 2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	431,191.86	41,516.25	113,262.02	38,883.91

注：本表仅列示活期存款余额及产生的利息收入。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限	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

				类型						
264165	熙悦 27 优	2024 年 12 月 18 日	1-6 个月 (含)	资产支持证券未上市	100.00	100.07	60,000	6,000,000.00	6,003,932.06	-

注：实际可流通日以该证券公告为准。本报告期间若有除权，认购价格为除权后价格，数量为期末实际持有数量。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 15,001,088.03 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102485409	24 滨建投 MTN017	2025 年 1 月 2 日	100.22	77,000	7,717,320.99
102485466	24 云南交 投 MTN009(乡 村振兴)	2025 年 1 月 2 日	100.19	100,000	10,019,495.89
合计				177,000	17,736,816.88

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无未到期交易所市场债券正回购。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的 风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管

理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。

公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的风险管理部、监察稽核部，对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

#### 7.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	40,207,675.45	86,695,965.58
合计	40,207,675.45	86,695,965.58

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	6,003,932.06	19,666,990.69
合计	6,003,932.06	19,666,990.69

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	80,751,291.61	169,194,098.53
AAA 以下	30,295,920.21	77,308,403.84
未评级	-	-
合计	111,047,211.82	246,502,502.37

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	6,003,932.06	15,158,942.47
AAA 以下	-	4,508,048.22
未评级	-	-
合计	6,003,932.06	19,666,990.69

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

### 7.4.13.3 流动性风险

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 7.4.13.4 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。

### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 4 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资 产							
货 币 资 金	431,191.86	-	-	-	-	-	431,191.86
结 算 备 付 金	6,052,217.02	-	-	-	-	-	6,052,217.02
存 出 保 证 金	840.21	-	-	-	-	-	840.21
交 易 性 金 融 资 产	-	-	64,499,953.91	58,591,564.21	5,578,442.62	-	128,669,960.74
衍 生 金 融 资	-	-	-	-	-	-	-

产							
买入返售金融资产							
债权投资							
应收股利							
应收申购款						208,167.36	208,167.36
应收清算款							
其他资产							
资产总计	6,484,249.09		64,499,953.91	58,591,564.21	5,578,442.62	208,167.36	135,362,377.19
负债							
应付赎回款						63,420.88	63,420.88
应付管						25,473.73	25,473.73

理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	8,491.23	8,491.23
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	15,001,088.03	-	-	-	-	-	15,001,088.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	14,556.64	14,556.64
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	4,132.33	4,132.33

其他 负债	-	-	-	-	-	182,704. 20	182,704.20
负债 总计	15,001,088. 03	-	-	-	-	298,779. 01	15,299,867.0 4
利率 敏 感 度 缺 口	8,516,838.9 4	-	64,499,953.9 1	58,591,564. 21	5,578,442. 62	90,611.6 5	120,062,510. 15
上 年 度 末 202 3 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资 产							
货 币 资 金	113,262.02	-	-	-	-	-	113,262.02
结 算 备 付 金	-	-	-	-	-	-	-
存 出 保 证 金	-	-	-	-	-	-	-
交 易 性 金	-	14,309,887. 56	203,053,256. 94	60,844,563. 94	-	-	278,207,708. 44

融 资 产							
衍 生 金 融 资 产	-	-	-	-	-	-	-
买 入 返 售 金 融 资 产	9,954,177.92	-	-	-	-	-	9,954,177.92
债 权 投 资	-	-	-	-	-	-	-
应 收 股 利	-	-	-	-	-	-	-
应 收 申 购 款	-	-	-	-	-	50,300.00	50,300.00
应 收 清 算 款	-	-	-	-	-	-	-
其 他 资 产	-	-	-	-	-	-	-
资 产 总 计	10,067,439.94	14,309,887.56	203,053,256.94	60,844,563.94	-	50,300.00	288,325,448.38
负 债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	57,599.37	57,599.37
应付托管费	-	-	-	-	-	19,199.80	19,199.80
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	54,025,810.15	-	-	-	-	-	54,025,810.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-	37,050.88	37,050.88
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	16,237.61	16,237.61
其他负债	-	-	-	-	-	18,596.35	18,596.35
负债总计	54,025,810.15	-	-	-	-	148,684.01	54,174,494.16
利率敏感度缺口	43,958,370.21	14,309,887.56	203,053,256.94	60,844,563.94	-	98,384.01	234,150,954.22

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 除利率外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年12月31日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率下降 25 基点	613,670.55	415,829.69
市场利率上升 25 基点	-607,628.70	-414,255.74	

#### 7.4.13.4.2 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。

### 7.4.13.4.3 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其他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，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	122,666,028.68	102.17	258,540,717.75	110.42
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	6,003,932.06	5.00	19,666,990.69	8.40
合计	128,669,960.74	107.17	278,207,708.44	118.82

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本期及上期末股票类权益资产占基金资产净值的比例为 0%，因此若除利率和汇率外的其他市场因素变化导致本基金持有的权益性工具的公允价值变动 5%而其他市场变量保持不变，则本基金资产净值不会发生重大变动。

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	128,669,960.74	278,207,708.44
第三层次	-	-
合计	128,669,960.74	278,207,708.44

7.4.14.2.2 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。  
本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	128,669,960.74	95.06
	其中：债券	122,666,028.68	90.62
	资产支持证券	6,003,932.06	4.44
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	6,483,408.88	4.79
8	其他各项资产	209,007.57	0.15
9	合计	135,362,377.19	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金报告期末未持有境内股票投资。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 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

注：本基金报告期末未持有股票投资。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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

注：本基金本报告期内无股票买入。

### 8.4.2 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

注：本基金本报告期内无股票卖出。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

## 8.5 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	3,986,078.90	3.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	24,941,303.27	20.77
	其中：政策性金融债	7,632,737.96	6.36
4	企业债券	8,052,452.49	6.71
5	企业短期融资券	40,207,675.45	33.49
6	中期票据	45,478,518.57	37.88
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	122,666,028.68	102.17

### 8.6 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	102484813	24 龙城发展 MTN005A	100,000	10,129,212.05	8.44
2	102485409	24 滨建投 MTN017	100,000	10,022,494.79	8.35
3	102485466	24 云南交投 MTN009(乡村 振兴)	100,000	10,019,495.89	8.35
4	042480623	24 津南城投 CP006	100,000	9,999,661.92	8.33
5	220205	22 国开 05	50,000	5,578,442.62	4.65

### 8.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代 码	证券名称	数量 (份)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	264165	熙悦 27 优	60,000	6,003,932.06	5.00

### 8.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货

#### 8.10.2 本期国债期货投资评价

无。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行、阳光财产保险股份有限公司、交通银行股份有限公司曾出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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报告期内被监

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。

### 8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

### 8.11.3 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	840.21
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	208,167.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	209,007.57

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 (%)
华富吉禄 90天滚动 持有债券 A	1,341	12,217.78	0.00	0.00	16,384,040.89	100.00
华富吉禄 90天滚动 持有债券	1,611	61,437.74	0.00	0.00	98,976,199.78	100.00

C						
合计	2,952	39,078.67	0.00	0.00	115,360,240.67	100.00

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华富吉禄 90 天滚动持有债券 A	498,469.79	3.0424
	华富吉禄 90 天滚动持有债券 C	3,607.15	0.0036
	合计	502,076.94	0.4352

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

### 9.3 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	华富吉禄 90 天滚动持有债券 A	0
	华富吉禄 90 天滚动持有债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华富吉禄 90 天滚动持有债券 A	0
	华富吉禄 90 天滚动持有债券 C	0
	合计	0

注：本期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本开放式基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富吉禄 90 天滚动持有债券 A	华富吉禄 90 天滚动持有债券 C
基金合同生效日（2023 年 12 月 1 日）基金份额总额	8,199,303.43	225,262,636.38
本报告期初基金	8,199,303.43	225,312,825.96

份额总额		
本报告期基金总申购份额	42,177,760.58	202,296,668.94
减：本报告期基金总赎回份额	33,993,023.12	328,633,295.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	16,384,040.89	98,976,199.78

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

本报告期内，基金管理人重大人事变动情况如下：

2024 年 7 月 10 日，经公司董事会审议批准，聘任王瑞华女士担任公司副总经理。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。本基金本年度需支付给审计机构天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计报酬为 46,095.86 元人民币。天健会计师事务所（特殊普通合伙）从 2012 年起为本公司提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 (%)	
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：1) 根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称“规定”）（证监会公告[2024]3号），我公司在综合比较多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的券商租用了基金专用交易单元。

2) 我公司自 2024 年 7 月 1 日起执行法规关于佣金比例的规定，本产品本报告期内佣金比例符合法规有关要求。

3) 此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

4) 本报告期本基金退租华安证券、德邦证券等 8 个交易单元。

11.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券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 (%)
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	40,734,081.79	25.78	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	117,249,776.64	74.22	50,500,000.00	100.00	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	华富基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年度最后一日基金份额净值及基金份额累计净值的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 1 月 1 日
2	华富基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 1 月 12 日
3	华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 1 月 24 日
4	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金开放日常赎回及转换转出业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 2 月 27 日
5	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入、定期定额投资公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 3 月 2 日
6	华富基金管理有限公司关于系统暂停服务的通知	中国证监会指定披露媒介	2024 年 3 月 15 日
7	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 4 月 20 日
8	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2024 年 6 月 27 日
9	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2024 年 6 月 27 日
10	华富基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 7 月 12 日
11	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 7 月 19 日
12	华富基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 7 月 22 日
13	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 8 月 23 日
14	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 8 月 24 日
15	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会指定披露媒介	2024 年 8 月 24 日

16	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2024 年 8 月 24 日
17	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2024 年 8 月 24 日
18	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 8 月 30 日
19	华富基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换、定投及最低持有份额的数量限制的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 9 月 28 日
20	华富基金管理有限公司关于调整旗下部分基金销售对象、申购业务限额并修改招募说明书的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 10 月 19 日
21	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会指定披露媒介	2024 年 10 月 21 日
22	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 10 月 25 日
23	华富基金管理有限公司澄清公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 10 月 26 日
24	华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 11 月 6 日
25	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2024 年 11 月 27 日
26	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会指定披露媒介	2024 年 11 月 27 日
27	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2024 年 11 月 27 日
28	华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金恢复大额申购、大额转换转入、定期定额投资公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 12 月 5 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20240304- 20240530	20,000,90 0.00	29,720, 626.11	49,721,52 6.11	0.00	0.00
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同
- 2、华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金托管协议
- 3、华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅, 相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2025 年 3 月 29 日