

**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  
2024 年第 1 季度报告  
2024 年 3 月 31 日**

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年四月二十二日

## §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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 月 19 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 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	海富通上证投资级可转债 ETF
场内简称	上证转债
基金主代码	511180
交易代码	511180
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 13 日
报告期末基金份额总额	45,859,729.00 份
投资目标	本基金将紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.25%，年化跟踪误差不超过 3%。
投资策略	本基金为指数基金，将采用分层抽样复制法对业绩比较基准进行跟踪。当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券及备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券及备选成份券外寻找其他债券构建替代组合，对指数进行跟踪复制。对于非成份券的债券，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进

	行日常管理。另外，本基金债券投资将适当运用杠杆策略，通过债券回购融入资金，然后买入收益率更高的债券以获得收益。对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳定收益。
业绩比较基准	上证投资级可转债及可交换债券指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金属于指数基金，采用分层抽样策略，跟踪上证投资级可转债及可交换债券指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司

### §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 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	657,132.27
2.本期利润	8,808,454.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.2247
4.期末基金资产净值	483,089,700.10
5.期末基金份额净值	10.5341

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）本基金已于2020年07月31日进行了基金份额折算，折算比例为0.1。

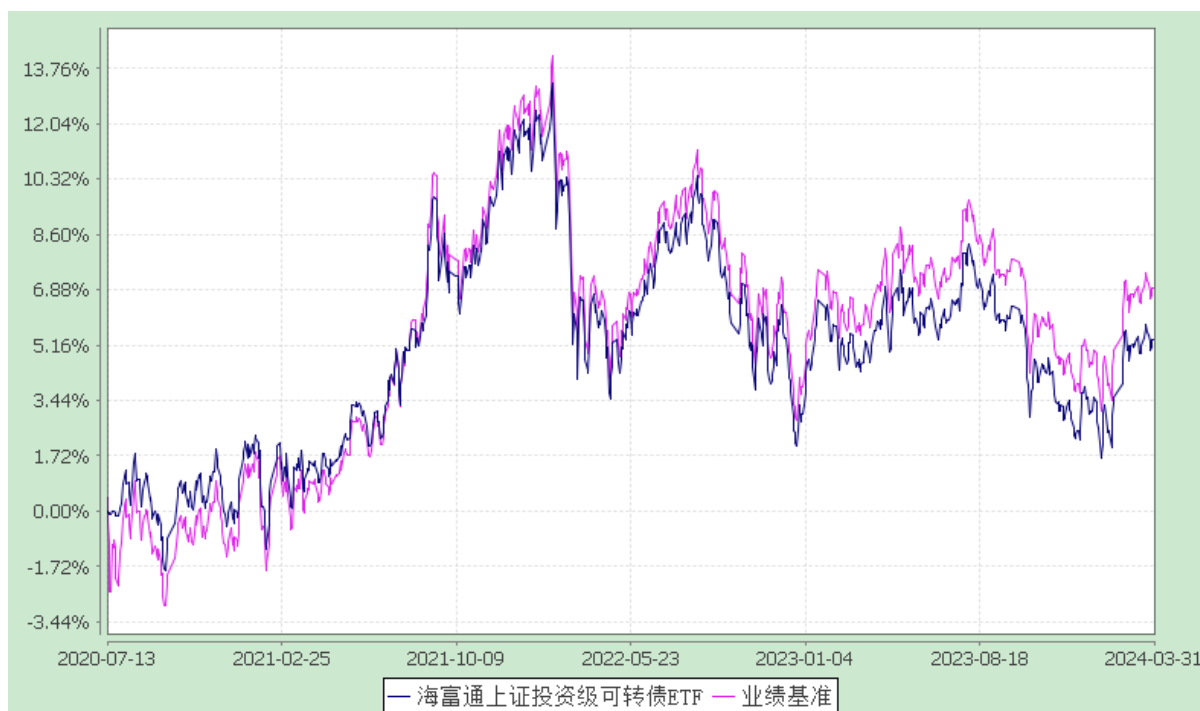
## 3.2 基金净值表现

### 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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.62%	0.34%	1.69%	0.35%	-0.07%	-0.01%
过去六个月	-0.97%	0.32%	-0.84%	0.33%	-0.13%	-0.01%
过去一年	0.20%	0.31%	0.65%	0.31%	-0.45%	0.00%
过去三年	4.01%	0.39%	6.23%	0.39%	-2.22%	0.00%
自基金合同生效起至今	5.34%	0.38%	6.92%	0.40%	-1.58%	-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  
 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  
 (2020年7月13日至2024年3月31日)



注：本基金合同于2020年7月13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十四部分(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		
陈轶平	本基金的基金经理；固定收益投资总监兼债券基金部总监。	2020-07-13	-	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兼债券基金部总监。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

				<p>年 10 月兼任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</p>
--	--	--	--	---

					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。
唐灵儿	本基金的基金经理	2022-07-18	-	6 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2017 年 7 月加入海富通基金管理有限公司，历任固定收益研究部助理固定收益分析师、债券基金部基金经理助理。2022 年 7 月起任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF、海富通上证 10 年期地方政府债 ETF、海富通上证投资级可转债 ETF、海富通上证城投债 ETF、海富通中证短融 ETF 基金经理。
陶斐然	本基金的基金经理	2023-06-02	-	9 年	金融学硕士，持有基金从业人员资格证书。2014 年 12 月加入海富通基金管理有限公司，历任助理交易员、交易员、高级交易员。2020 年 6 月至 2023 年 6 月任

					债券基金部基金经理助理。2023 年 6 月起任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF、海富通上证投资级可转债 ETF、海富通中证短融 ETF、海富通上证 10 年期地方政府债 ETF、海富通上证城投债 ETF 基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通美元债（QDII）基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

1 季度，国内经济基本面企稳回升，其中生产端修复节奏好于需求端。通胀方面，



CPI 由于基数效应波动较大；PPI 由于需求偏弱，跌幅略有走扩。货币政策方面，由于汇率方面压力较大，因此在政策利率方面的操作偏谨慎，但 2 月调降 5 年期 LPR25bp，全面降准 0.5 个百分点，体现了货币政策引导降低实体融资成本的目的。资金面上，1 季度 R001 与 R007 均值为 1.85% 和 2.13%，较 2023 年 4 季度分别下行 4bp 与 27bp，流动性总体维持合理充裕的状态。对应债市而言，1 季度走出牛市行情。1-2 月，受到货币政策宽松、股债跷跷板效应的影响，同时配合城农商行在年初配置超长期品种利率债，债券收益率明显且快速下行。但 3 月往后基本面利空因素增加，债券收益率下行过程中遇到一定阻力，但总体继续维持牛市行情，10 年期国债收益率季末收于 2.29% 的位置。

信用债方面，供给略有放量，但主要是金融债及大型央企产业债，城投债发行审核未见明显放松，高息资产荒持续。实体融资需求不振，叠加非银欠配，信用债收益率整体跟随利率债下行。不过，利率低位且长端、超长端交易拥挤，债市波动加大。

可转债方面，转债市场有所分化，一季度中证转债指数下跌 0.81%，而本基金跟踪的上证投资级可转债及可交换债券指数上涨 1.69%。

作为指数基金，本基金应用指数复制策略构建组合，以跟踪指数并控制跟踪偏离度及跟踪误差。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 1.62%，同期业绩比较基准收益率为 1.69%，基金净值跑输业绩比较基准 0.07 个百分点。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	466,453,690.35	96.51
	其中：债券	466,453,690.35	96.51
	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	14,100,000.00	2.92
	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	2,153,048.71	0.45
8	其他资产	628,263.26	0.13
9	合计	483,335,002.32	100.00

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	466,453,690.35	96.56
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	466,453,690.35	96.56

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	414,950	45,233,244.76	9.36
2	113052	兴业转债	414,920	43,222,330.08	8.95
3	113021	中信转债	330,270	38,138,539.02	7.89
4	113044	大秦转债	184,650	22,121,550.60	4.58
5	113042	上银转债	165,950	18,406,560.21	3.81

## 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，本基金暂不投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中信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，上海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上海监管局的处罚。

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。

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	258,767.18
2	应收证券清算款	369,496.08
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	628,263.26

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	45,233,244.76	9.36
2	113052	兴业转债	43,222,330.08	8.95
3	113021	中信转债	38,138,539.02	7.89
4	113044	大秦转债	22,121,550.60	4.58
5	113042	上银转债	18,406,560.21	3.81
6	113050	南银转债	15,715,934.07	3.25
7	132018	G 三峡 EB1	14,231,398.71	2.95
8	110079	杭银转债	13,901,652.94	2.88

9	113056	重银转债	11,287,986.85	2.34
10	110085	通 22 转债	10,744,324.08	2.22
11	132026	G 三峡 EB2	9,827,189.34	2.03
12	118034	晶能转债	8,718,674.50	1.80
13	118031	天 23 转债	7,446,618.54	1.54
14	110081	闻泰转债	7,347,918.27	1.52
15	113060	浙 22 转债	7,233,386.33	1.50
16	110073	国投转债	7,144,739.59	1.48
17	113641	华友转债	6,480,062.49	1.34
18	113065	齐鲁转债	6,401,018.10	1.33
19	113053	隆 22 转债	5,867,606.53	1.21
20	110075	南航转债	5,845,579.96	1.21
21	113062	常银转债	5,722,367.92	1.18
22	110083	苏租转债	5,633,772.93	1.17
23	113055	成银转债	5,093,369.07	1.05
24	113037	紫银转债	4,008,504.33	0.83
25	113059	福莱转债	3,708,988.34	0.77
26	132020	19 蓝星 EB	3,490,830.42	0.72
27	113043	财通转债	3,440,112.60	0.71
28	113066	平煤转债	3,122,452.19	0.65
29	113045	环旭转债	3,117,169.75	0.65
30	113049	长汽转债	3,027,163.01	0.63
31	113067	燃 23 转债	3,009,416.49	0.62
32	111010	立昂转债	3,003,918.02	0.62
33	110062	烽火转债	2,938,781.44	0.61
34	113051	节能转债	2,821,920.54	0.58
35	113615	金诚转债	2,750,018.42	0.57
36	113661	福 22 转债	2,723,993.93	0.56
37	110093	神马转债	2,718,673.33	0.56
38	118024	冠宇转债	2,705,190.32	0.56
39	113024	核建转债	2,657,022.51	0.55

40	118022	锂科转债	2,645,736.22	0.55
41	110067	华安转债	2,566,618.46	0.53
42	110087	天业转债	2,476,531.13	0.51
43	113061	拓普转债	2,470,984.89	0.51
44	110089	兴发转债	2,462,650.49	0.51
45	110091	合力转债	2,420,829.30	0.50
46	113623	凤 21 转债	2,416,227.05	0.50
47	113616	韦尔转债	2,259,479.96	0.47
48	110095	双良转债	2,225,146.43	0.46
49	110068	龙净转债	2,084,128.06	0.43
50	113054	绿动转债	2,043,972.30	0.42
51	110048	福能转债	2,020,573.45	0.42
52	113048	晶科转债	1,999,385.18	0.41
53	113632	鹤 21 转债	1,957,127.47	0.41
54	110092	三房转债	1,946,383.66	0.40
55	113058	友发转债	1,873,599.60	0.39
56	113666	爱玛转债	1,832,210.96	0.38
57	110082	宏发转债	1,790,801.87	0.37
58	113655	欧 22 转债	1,739,198.85	0.36
59	110077	洪城转债	1,713,410.27	0.35
60	113602	景 20 转债	1,703,685.62	0.35
61	118030	睿创转债	1,633,167.72	0.34
62	110076	华海转债	1,620,542.38	0.34
63	110090	爱迪转债	1,596,178.57	0.33
64	113033	利群转债	1,581,548.40	0.33
65	110086	精工转债	1,553,126.53	0.32
66	118025	奕瑞转债	1,455,396.45	0.30
67	110094	众和转债	1,445,269.35	0.30
68	113068	金铜转债	1,365,469.27	0.28
69	113047	旗滨转债	1,346,288.87	0.28
70	113046	金田转债	1,307,706.43	0.27

71	113064	东材转债	1,299,543.83	0.27
72	113647	禾丰转债	1,282,976.40	0.27
73	113652	伟 22 转债	1,272,008.79	0.26
74	113605	大参转债	1,240,540.18	0.26
75	113516	苏农转债	1,170,346.25	0.24
76	110064	建工转债	1,159,342.10	0.24
77	118013	道通转债	1,132,582.82	0.23
78	113659	莱克转债	1,086,455.49	0.22
79	113669	景 23 转债	1,068,115.23	0.22
80	118019	金盘转债	1,027,240.89	0.21
81	113619	世运转债	1,020,347.96	0.21
82	111017	蓝天转债	986,094.74	0.20
83	113631	皖天转债	949,920.62	0.20
84	113672	福蓉转债	917,609.92	0.19
85	113633	科沃转债	896,003.25	0.19
86	113673	岱美转债	891,410.68	0.18
87	110084	贵燃转债	866,547.68	0.18
88	113545	金能转债	861,805.55	0.18
89	118003	华兴转债	796,117.96	0.16
90	113563	柳药转债	794,270.69	0.16
91	113634	珀莱转债	779,016.13	0.16
92	113549	白电转债	764,521.35	0.16
93	113627	太平转债	723,908.26	0.15
94	113670	金 23 转债	671,811.90	0.14
95	111002	特纸转债	651,652.81	0.13
96	113651	松霖转债	640,997.33	0.13
97	110074	精达转债	615,184.81	0.13
98	113530	大丰转债	603,584.21	0.12
99	111009	盛泰转债	590,108.87	0.12
100	113584	家悦转债	568,698.45	0.12
101	110060	天路转债	555,936.60	0.12

102	111014	李子转债	543,689.41	0.11
103	113542	好客转债	542,674.96	0.11
104	113621	彤程转债	536,383.63	0.11
105	113638	台 21 转债	530,411.02	0.11
106	113579	健友转债	448,696.29	0.09
107	113588	润达转债	447,372.37	0.09
108	113532	海环转债	437,627.26	0.09
109	113582	火炬转债	416,850.62	0.09
110	113674	华设转债	412,157.12	0.09
111	113671	武进转债	319,101.41	0.07
112	110055	伊力转债	294,502.16	0.06
113	113039	嘉泽转债	283,776.10	0.06
114	113030	东风转债	283,147.96	0.06
115	110052	贵广转债	264,382.80	0.05
116	113519	长久转债	211,310.23	0.04
117	110070	凌钢转债	199,330.59	0.04

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	33,459,729.00
本报告期基金总申购份额	38,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	26,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	45,859,729.00

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况



本报告期基金管理人未持有本基金。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	2024/1/1-2024/1/4	8,654,168.00	40,213,154.00	46,140,313.00	2,727,009.00	5.95%
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>4、其他可能的风险。</p>							

注：报告期内单一投资者申购赎回份额包含二级市场交易数据。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 119 只公募基金。截至 2024 年 3 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1643 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”。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通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的文件
- (二)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基金

合同

(三)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招募说明书

(四)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托管协议

(五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

(六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

## 9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

## 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司  
二〇二四年四月二十二日