

海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	55
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	55
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	56
§ 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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	59
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	64

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	海富通富利三个月持有	
基金主代码	010850	
交易代码	010850	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 7 月 20 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	48,051,493.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
下属分级基金的交易代码	010850	010851
报告期末下属分级基金的份额总额	26,291,610.90 份	21,759,882.58 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。
投资策略	<p>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。</p> <p>股票投资方面，本基金将采用量化选股策略、风险估测模型——有效控制预期风险、交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩、投资组合的优化及调整、港股通标的股票的投资策略等策略；</p> <p>债券投资方面，本基金将采用利率策略、信用策略、收益率曲线策略、杠杆策略等策略。</p>
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+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	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	滕菲菲
	联系电话	021-38650788	4006800000
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		40088-40099	95558
传真		021-33830166	010-85230024
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	北京市朝阳区光华路10号院1 号楼6-30层、32-42层
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	北京市朝阳区光华路10号院1 号楼6-30层、32-42层
邮政编码		200120	100020
法定代表人		杨仓兵	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）	
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
本期已实现收益	308,759.63	203,805.26

本期利润	699,715.87	554,076.51
加权平均基金份额本期利润	0.0258	0.0233
本期加权平均净值利润率	2.71%	2.48%
本期基金份额净值增长率	2.77%	2.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
期末可供分配利润	-967,497.89	-1,047,825.92
期末可供分配基金份额利润	-0.0368	-0.0482
期末基金资产净值	25,324,113.01	20,712,056.66
期末基金份额净值	0.9632	0.9518
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
基金份额累计净值增长率	-3.68%	-4.82%

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

海富通富利三个月持有 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.50%	0.17%	-0.06%	0.10%	-0.44%	0.07%
过去三个月	1.64%	0.19%	0.95%	0.14%	0.69%	0.05%
过去六个月	2.77%	0.28%	2.42%	0.18%	0.35%	0.10%
过去一年	-0.09%	0.27%	0.86%	0.18%	-0.95%	0.09%
自基金合同生效起至今	-3.68%	0.28%	-2.05%	0.22%	-1.63%	0.06%

海富通富利三个月持有 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.53%	0.17%	-0.06%	0.10%	-0.47%	0.07%

过去三个月	1.53%	0.18%	0.95%	0.14%	0.58%	0.04%
过去六个月	2.56%	0.28%	2.42%	0.18%	0.14%	0.10%
过去一年	-0.50%	0.27%	0.86%	0.18%	-1.36%	0.09%
自基金合同生效起至今	-4.82%	0.28%	-2.05%	0.22%	-2.77%	0.06%

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

海富通富利三个月持有期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7月20日至2024年6月30日)

海富通富利三个月持有 A



海富通富利三个月持有 C



注：本基金合同于 2021 年 7 月 20 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，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 97 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型

证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、

海富通盈丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资基金、海富通瑞鑫 30 天持有期债券型证券投资基金、海富通优势驱动混合型证券投资基金、海富通 ESG 领先股票型证券投资基金、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金、海富通红利优选混合型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通数字经济混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张靖爽	本基金的基金经理；债券基金部副总监。	2021-07-20	-	14 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中银基金管理有限公司研究员，交银施罗德基金管理有限公司投资经理、基金经理助理、研究员。2016 年 7 月至 2017 年 10 月任海富通双利债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 11 月兼任海富通纯债债券基金经理。2017 年 8 月起兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）和海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2018 年 2 月至 2021 年 2 月任海富通融丰定开债券基金经理。2018 年 11 月至 2020 年 10 月任海富通鼎丰定开债券基金经理。2019 年 5 月至 2022 年 12 月兼任海富通新内需混合基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 4 月任海富通聚合纯债基金经理。2019 年 12 月起兼任海富通裕通 30 个月定开债券基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通裕昇三年定开债券基金经理。2020 年 5 月至 2021 年 7 月兼任海富通瑞弘 6 个月定开债券基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金

					经理。2022 年 8 月起兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通瑞兴 3 个月定开债券基金经理。
杜晓海	本基金的基金经理；公司总经理助理。	2021-07-20	-	24 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监、量化投资部总监，现任海富通基金管理有限公司总经理助理。2016 年 6 月起任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 10 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 增强）基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至 2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月至 2021 年 7 月兼任海富通中证 500 增强（原海富通中证内地低碳指数）基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月至 2023 年 10 月兼任海富通

					富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。2023 年 10 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通 ESG 领先股票基金经理。2024 年 6 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 发起联接基金经理。
林立禾	本基金的基金经理	2023-11-23	-	5 年	美国密歇根大学定量金融与风险管理硕士,持有基金从业人员资格证书。历任中欧基金管理有限公司风险管理部量化风控岗。2020 年 8 月加入海富通基金管理有限公司,历任量化研究员、量化投资部基金经理助理。2023 年 11 月起任海富通欣益混合、海富通富利三个月持有、海富通沪深 300 增强的基金经理。

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的样本，对其进行了 95%置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组

合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

从 A 股市场看，上半年主要指数多以下跌为主，上证指数为-0.25%，沪深 300 为 0.89%，中证 800 为-1.76%，创业板指为-10.99%。行业板块方面，根据中信一级行业分类，表现靠前的板块是银行、煤炭、石油石化、家电、电力及公用事业，跌幅较大的板块是消费者服务、计算机、商品零售、传媒、医药。

本报告期内，本基金在股票策略上优选具有长期价值增长和红利属性的公司作为核心持仓标的，并在二季度增配了拥有良好现金流的沪港深公司，转债策略上也以具有股性的价值型转债为主，今年以来整体趋势是择机增配转债。

因子方面，本基金在红利和价值因子上有持续明显的正暴露，一季度基金在小市值因子上有所暴露，并因此造成超额损失，而后小市值因子暴露有所减小，与基准的偏离保持在较低水平。报告期内价值和红利因子超额明显，而小市值因子造成明显负超额。

回顾本报告期的投资操作，本报告期内，配置趋势上看，基金的权益仓位不断降低，转债仓位不断增加，其中权益上将中小价值的权益配置比例降低，增加了港股红利和现金流充裕标的的配置比例。

固定收益方面，上半年国内经济企稳回升，实际 GDP 增速达到 5%。整体来看，生产端修复节奏好于需求端，PMI 在 3 月重回扩张区间，但持续性略有不足。投资端方面，制造业与基建投资实现高增，地产投资跌幅走扩。消费增速回落，可选消费与地产后周期消费偏弱。出口方面，出口同比与贸易顺差双双回升。通胀方面，CPI 总体弹性有限，维持在 0-1% 的区间窄幅震荡；PPI 在基数效应下跌幅收窄但仍未转正。货币政策方面，上半年调降 5 年期 LPR25bp，全面降准 0.5 个百分点，体现了货币政策引导降低实体融资成本的目的。财政政策方面，超长期特别国债落地，2024 年将率先发行 1 万亿；同时地方债稳步发行。流动性方面，总体维持合理充裕的状态，但分层的现象较为突出。资金价格方面，上半年 R001 与 R007 均值为 1.84% 和 2.03%。对应债市而言，上半年走出牛市行情。

信用债方面，供求矛盾持续，收益率进一步走低，2.3% 以上合意资产难觅，不过结构特征较去年有所变化。需求端，大行存款流失而理财规模快速增长，市场定价权一定程度向非银倾斜，非银主导的中短端信用债表现较强；供给端，信用债供给总量并不少，主要是收益率低位，超长信用债供给放量，以高等级央国企产业债为主，城投债净融资额持续低位徘徊。整体而言，随着资产荒持续演绎，今年信用债“利率化”趋势加大，市场对信用风险钝化，等级利差、期限利差多数创历史新低。

报告期内，本基金主要投资于利率债，根据市场情况灵活调整组合久期和杠杆。鉴于上半年的基本面、资金面和政策面，组合维持较高的债券仓位，并依据利率曲线的变化，针对不同期限的利率债和不同品种的信用债进行积极的交易以增厚收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通富利三个月持有 A 净值增长率为 2.77%，同期业绩比较基准收益率为 2.42%。海富通富利三个月持有 C 净值增长率为 2.56%，同期业绩比较基准收益率为 2.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

中国经济暂时仍面临着总需求不足、结构调整阵痛的冲击，在这过程中市场信心较为脆弱和不

足。目前政策的重心仍主要在供给端，短期而言，在破立并举、先立后破的政策基调下，若未来内需进一步下滑，不排除阶段性向需求端倾斜的可能，这需要进一步跟踪。此外，监管层也在积极呵护市场，下行空间可能有限，这时候更重要的是行业配置。

展望后市，股票资产上，二季度末市场的情绪面和资金面并未延续一季度趋势，有所走弱。风格上，由于美联储的预期降息时间不断延后，价值和红利风格或继续阶段性占优，所以风格选择上或将继续偏向这个方向。权益配置结构上，我们试图更加多元化，以包括 A 股价值、港股红利和现金流充裕等多视角选择具有绝对收益属性的标的进行配置。转债上，中证转债在近期有一波明显下跌，原因上考虑为信用风险恐慌导致的流动性冲击，我们认为部分转债是情绪面的错杀，下跌反而使得其配置价值凸显，所以转债配置上我们依旧会保持积极。另外，我们还会继续使用股指期货和多策略的方式，平衡向上弹性和回撤风险。

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

信用债方面，实体融资需求修复仍是核心，预计资产荒仍会持续。需求端，需谨防理财规模持续膨胀与净值平滑监管趋严的扰动；供给方面，除利率债外，金融债或有放量，但扰动有限，重点关注城投政策动向。

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

一、本基金本报告期内无应分配的收益。

二、已实施的利润分配：无。

三、不存在应分配但尚未实施的利润。

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

本基金自 2024 年 1 月 19 日至 2024 年 3 月 7 日，连续二十九个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形；自 2024 年 3 月 11 日至 2024 年 6 月 30 日，连续超过六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人拟持续运作本基金，解决方案已根据法规要求向中国证券监督管理委员会上海监管局进行了报告。

§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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《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，对海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金 2024 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，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

本托管人认为，海富通基金管理有限公司在海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，海富通基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2024 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§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：海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	855,750.69	135,763.80
结算备付金		892,390.92	1,313,384.44
存出保证金		130,007.96	18,728.13
交易性金融资产	6.4.7.2	44,381,706.81	48,421,681.79
其中：股票投资		9,894,848.42	18,122,091.59
基金投资		-	-
债券投资		34,486,858.39	30,299,590.20
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	-	979,854.64
应收清算款		49,546.85	80,591.93
应收股利		14,540.55	-
应收申购款		41,162.48	10,011.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		46,365,106.26	50,960,016.72
负债和净资产			
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		216,871.29	122,954.77
应付赎回款		4,969.48	23,254.62
应付管理人报酬		30,324.65	34,563.83
应付托管费		5,685.89	6,480.74
应付销售服务费		6,800.63	8,194.62
应付投资顾问费		-	-
应交税费		96.91	222.43
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	64,187.74	220,300.36
负债合计		328,936.59	415,971.37
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	48,051,493.48	54,183,980.67
未分配利润	6.4.7.8	-2,015,323.81	-3,639,935.32
净资产合计		46,036,169.67	50,544,045.35
负债和净资产总计		46,365,106.26	50,960,016.72

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 0.9632 元，C 类基金份额净值 0.9518 元。基金份额总额 48,051,493.48 份，其中 A 类基金份额 26,291,610.90 份，C 类基金份额 21,759,882.58 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,602,508.91	585,821.57
1.利息收入		38,325.95	156,329.71
其中：存款利息收入	6.4.7.9	11,096.48	34,418.72
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		27,229.47	121,910.99
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		822,947.06	229,507.04
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-235,792.83	-312,248.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	451,635.84	376,413.14
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	390,846.28	-38,255.03
股利收益	6.4.7.14	216,257.77	203,597.39
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	741,227.49	199,974.72
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	8.41	10.10
减：二、营业总支出		348,716.53	419,363.68
1. 管理人报酬		191,655.08	236,444.62
2. 托管费		35,935.36	44,333.37
3. 销售服务费		44,500.70	53,062.34
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		974.68	-
其中：卖出回购金融资产支出		974.68	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		1,579.39	802.61
8. 其他费用	6.4.7.17	74,071.32	84,720.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,253,792.38	166,457.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,253,792.38	166,457.89
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,253,792.38	166,457.89

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	54,183,980.67	-	-3,639,935.32	50,544,045.35
二、本期期初净资产	54,183,980.67	-	-3,639,935.32	50,544,045.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,132,487.19	-	1,624,611.51	-4,507,875.68

(一)、综合收益总额	-	-	1,253,792.38	1,253,792.38
(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)	-6,132,487.19	-	370,819.13	-5,761,668.06
其中: 1.基金申购款	255,033.75	-	-9,774.19	245,259.56
2.基金赎回款	-6,387,520.94	-	380,593.32	-6,006,927.62
(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	48,051,493.48	-	-2,015,323.81	46,036,169.67
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	67,259,915.49	-	-2,727,859.86	64,532,055.63
二、本期期初净资产	67,259,915.49	-	-2,727,859.86	64,532,055.63
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-8,931,496.58	-	433,076.96	-8,498,419.62
(一)、综合收益总额	-	-	166,457.89	166,457.89
(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)	-8,931,496.58	-	266,619.07	-8,664,877.51
其中: 1.基金申购款	711,435.89	-	-28,961.55	682,474.34
2.基金赎回款	-9,642,932.47	-	295,580.62	-9,347,351.85
(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	58,328,418.91	-	-2,294,782.90	56,033,636.01

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

海富通富利三个月持有期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[2020]第 3093 号《关于准予海富通富利三个月持有期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《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，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 277,601,007.94 元。经向中国证监会备案，《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 7 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 277,641,140.11 份，其中认购资金利息折合 40,132.17 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/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/申购基金份额时不收取认/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。

本基金对每份基金份额设置三个月的最短持有期。对于每份基金份额，最短持有期起始日指基金合同生效日（对认购份额而言）、基金份额申购申请确认日（对申购份额而言）或基金份额转换转入确认日（对转换转入份额而言）；最短持有期到期日指该基金份额持有期起始日起三个月后的对应日（指某一个特定日期在后续月份中的对应日期），如该对应日为非工作日，则顺延至下一工作日。如无此对应日期，则取该月份的最后一日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通富利三个月持有期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（包含创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、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、国债期货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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产及存托凭证投资占基金资产的比例为 0-40%（其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%）；本基金投资同业存单不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金业绩比较基准为：中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+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 2024 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2024 年 6 月 30 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已根据法规要求向中国证券监督管理委员会上海监管局进行了报告，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024

年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 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]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股

息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	855,750.69
等于：本金	855,675.49
加：应计利息	75.20
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	855,750.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	9,892,047.87	-	9,894,848.42	2,800.55
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	185,468.90	23,898,814.55	259,244.24
	银行间市场	10,249,490.00	10,588,043.84	243,510.00
	合计	33,703,591.41	280,512.74	34,486,858.39
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	43,595,639.28	280,512.74	44,381,706.81	505,554.79

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 2024 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	-974,600.00	-	-	-
——股指期货	-974,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-974,600.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2409	IC2409	-1.00	-975,040.00	-440.00
合计	-	-	-	-440.00

减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-440.00
净额	-	-	-	-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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 2024年6月30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	9,529.28
其中：交易所市场	9,529.28
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	54,658.46
合计	64,187.74

6.4.7.7 实收基金

海富通富利三个月持有 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,219,622.95	28,219,622.95
本期申购	201,918.91	201,918.91
本期赎回（以“-”号填列）	-2,129,930.96	-2,129,930.96
本期末	26,291,610.90	26,291,610.90

海富通富利三个月持有 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,964,357.72	25,964,357.72
本期申购	53,114.84	53,114.84
本期赎回（以“-”号填列）	-4,257,589.98	-4,257,589.98
本期末	21,759,882.58	21,759,882.58

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

海富通富利三个月持有 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	-1,346,155.30	-425,228.12	-1,771,383.42
本期期初	-1,346,155.30	-425,228.12	-1,771,383.42
本期利润	308,759.63	390,956.24	699,715.87
本期基金份额交易产生的变动数	93,629.97	10,539.69	104,169.66
其中：基金申购款	-8,566.88	1,484.87	-7,082.01
基金赎回款	102,196.85	9,054.82	111,251.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-943,765.70	-23,732.19	-967,497.89

海富通富利三个月持有 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	-1,479,082.17	-389,469.73	-1,868,551.90
本期期初	-1,479,082.17	-389,469.73	-1,868,551.90
本期利润	203,805.26	350,271.25	554,076.51
本期基金份额交易产生的	248,629.38	18,020.09	266,649.47

变动数			
其中：基金申购款	-2,621.58	-70.60	-2,692.18
基金赎回款	251,250.96	18,090.69	269,341.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,026,647.53	-21,178.39	-1,047,825.92

6.4.7.9 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 6 月 30 日	
活期存款利息收入	979.73	
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	9,982.32	
其他	134.43	
合计	11,096.48	

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	44,212,078.25	
减：卖出股票成本总额	44,360,888.89	
减：交易费用	86,982.19	
买卖股票差价收入	-235,792.83	

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入	387,224.73	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	64,411.11	
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	451,635.84	

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	32,749,072.17
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	32,530,849.72
减：应计利息总额	152,357.24
减：交易费用	1,454.10
买卖债券差价收入	64,411.11

6.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益（税前）	440,000.00
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	12,068.16
减：股指期货交易费用	2,867.18
国债期货投资收益（税前）	-34,200.00
减：国债期货差价收入应缴纳增值税额	-
减：国债期货交易费用	18.38
合计	390,846.28

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	216,257.77
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	216,257.77

6.4.7.15 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6月30日
1.交易性金融资产	741,667.49

——股票投资	248,267.23
——债券投资	493,400.26
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-440.00
——权证投资	-
——股指期货	-440.00
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	741,227.49

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	8.41
合计	8.41

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	22,376.90
信息披露费	32,281.56
证券出借违约金	-
银行划款手续费	806.59
证券组合费	6.27
债券托管账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	74,071.32

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

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
海通证券	80,097,456.74	100.00%	134,651,598.22	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例
海通证券	58,930.18	100.00%	9,529.28	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
海通证券	98,064.04	100.00%	68,989.38	100.00%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	191,655.08	236,444.62
其中：应支付销售机构的客户维护费	85,197.55	101,923.66
应支付基金管理人的净管理费	106,457.53	134,520.96

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 0.80% 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 × 0.80% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	35,935.36	44,333.37

注：支付基金托管人中信银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 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 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C	合计
中信银行	-	36,567.70	36,567.70
海通证券	-	131.58	131.58

海富通基金	-	3,568.00	3,568.00
合计	-	40,267.28	40,267.28
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通富利三个月持有A	海富通富利三个月持有C	合计
中信银行	-	39,579.74	39,579.74
海通证券	-	33.65	33.65
海富通基金	-	7,351.55	7,351.55
合计	-	46,964.94	46,964.94

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 0.40%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 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 x 0.40% / 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自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	855,750.69	979.73	1,424,250.86	2,981.76

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，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及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 38.03%（2023 年 12 月 31 日：12.79%）。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,545,476.03	-
合计	2,545,476.03	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债。

6.4.13.2 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6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	14,461,559.16	3,528,138.83
AAA 以下	3,047,825.03	2,936,311.22
未评级	14,431,998.17	23,835,140.15
合计	31,941,382.36	30,299,590.20

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债、政策性金融债。

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在满足基金合同规定的持有期后随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	855,750.69	-	-	-	855,750.69
结算备付金	892,390.92	-	-	-	892,390.92
存出保证金	13,003.16	-	-	117,004.80	130,007.96
交易性金融资产	2,894,441.78	12,801,801.98	18,790,614.63	9,894,848.42	44,381,706.81
应收清算款				49,546.85	49,546.85
应收股利				14,540.55	14,540.55
应收申购款				41,162.48	41,162.48
资产总计	4,655,586.55	12,801,801.98	18,790,614.63	10,117,103.10	46,365,106.26
负债					
应付清算款				216,871.29	216,871.29
应付赎回款				4,969.48	4,969.48
应付管理人报酬				30,324.65	30,324.65
应付托管费				5,685.89	5,685.89
应付销售服务费				6,800.63	6,800.63
应交税费				96.91	96.91
其他负债				64,187.74	64,187.74
负债总计				328,936.59	328,936.59
利率敏感度缺口	4,655,586.55	12,801,801.98	18,790,614.63	9,788,166.51	46,036,169.67
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	135,763.80	-	-	-	135,763.80
结算备付金	1,313,384.44	-	-	-	1,313,384.44
存出保证金	18,728.13	-	-	-	18,728.13
交易性金融资产	3,540,030.60	5,510,839.84	21,248,719.76	18,122,091.59	48,421,681.79
买入返售金融资产	979,854.64	-	-	-	979,854.64
应收清算款				80,591.93	80,591.93
应收申购款				10,011.99	10,011.99

资产总计	5,987,761.61	5,510,839.84	21,248,719.76	18,212,695.51	50,960,016.72
负债					
应付清算款	-	-	-	122,954.77	122,954.77
应付赎回款	-	-	-	23,254.62	23,254.62
应付管理人报酬	-	-	-	34,563.83	34,563.83
应付托管费	-	-	-	6,480.74	6,480.74
应付销售服务费	-	-	-	8,194.62	8,194.62
应交税费	-	-	-	222.43	222.43
其他负债	-	-	-	220,300.36	220,300.36
负债总计	-	-	-	415,971.37	415,971.37
利率敏感度缺口	5,987,761.61	5,510,839.84	21,248,719.76	17,796,724.14	50,544,045.35

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-405,265.80	-322,418.42
市场利率下降 25 个基点	412,794.14	327,641.01	

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 2024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	-	658,413.73	658,413.73
资产合计	-	658,413.73	658,413.73
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	-	658,413.73	658,413.73
项目	上年度末 2023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			
资产合计	-	-	-
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	-	-	-

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日

1. 所有外币相对人民币升值 5%	32,920.69	-
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-32,920.69	-

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。本基金股票资产及存托凭证投资占基金资产的比例为 0-40%（其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%）；本基金投资同业存单不超过基金资产的 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 2024 年 6 月 30 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	9,894,848.42	21.49	18,122,091.59	35.85
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	9,894,848.42	21.49	18,122,091.59	35.85

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	上年度末
		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	296,167.34	608,211.69
2.业绩比较基准下降 5%	-296,167.34	-608,211.69	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	18,738,198.50	24,586,541.64
第二层次	25,643,508.31	23,835,140.15
第三层次	-	-
合计	44,381,706.81	48,421,681.79

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	9,894,848.42	21.34
	其中：股票	9,894,848.42	21.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,486,858.39	74.38
	其中：债券	34,486,858.39	74.38
	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	1,748,141.61	3.77
8	其他各项资产	235,257.84	0.51
9	合计	46,365,106.26	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 658,413.73 元，占资产净值比例为 1.43%。

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	1,100,788.50	2.39
C	制造业	3,847,223.21	8.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	399,412.06	0.87
E	建筑业	530,637.00	1.15
F	批发和零售业	429,104.00	0.93
G	交通运输、仓储和邮政业	661,496.60	1.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	162,246.62	0.35
J	金融业	1,511,423.60	3.28
K	房地产业	154,206.00	0.33
L	租赁和商务服务业	155,360.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	42,402.10	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	127,287.00	0.28
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	114,848.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	9,236,434.69	20.06

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（%）
能源	220,062.67	0.48
原材料	79,631.33	0.17
工业	95,356.80	0.21
金融	136,600.81	0.30
通信服务	43,078.49	0.09
公用事业	38,560.73	0.08
房地产	45,122.90	0.10
合计	658,413.73	1.43

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	601939	建设银行	25,900	191,660.00	0.42
1	00939	建设银行	3,000	15,798.49	0.03
2	601668	中国建筑	34,300	182,133.00	0.40
3	600901	江苏金租	36,000	181,800.00	0.39
4	601088	中国神华	2,350	104,269.50	0.23
4	01088	中国神华	1,500	49,216.27	0.11
5	601717	郑煤机	9,600	142,080.00	0.31
6	002128	电投能源	6,600	139,260.00	0.30
7	600028	中国石化	16,550	104,596.00	0.23
7	00386	中国石油化工股份	6,000	27,708.96	0.06
8	000651	格力电器	3,200	125,504.00	0.27
9	002064	华峰化学	17,000	121,890.00	0.26
10	002788	鹭燕医药	15,300	120,564.00	0.26
11	000333	美的集团	1,700	109,650.00	0.24
12	601225	陕西煤业	4,200	108,234.00	0.24
13	600887	伊利股份	4,000	103,360.00	0.22
14	601398	工商银行	15,100	86,070.00	0.19
14	01398	工商银行	4,000	16,939.34	0.04
15	002332	仙琚制药	8,900	101,549.00	0.22
16	002078	太阳纸业	7,200	100,440.00	0.22
17	603298	杭叉集团	5,020	98,592.80	0.21
18	600018	上港集团	17,000	98,260.00	0.21
19	601677	明泰铝业	8,300	95,948.00	0.21
20	601288	农业银行	18,150	79,134.00	0.17
20	01288	农业银行	5,000	15,241.76	0.03
21	601988	中国银行	16,600	76,692.00	0.17
21	03988	中国银行	5,000	17,569.09	0.04
22	300770	新媒股份	2,600	86,788.00	0.19
23	600012	皖通高速	6,200	86,614.00	0.19
24	601997	贵阳银行	16,300	85,901.00	0.19
25	601006	大秦铁路	11,700	83,772.00	0.18
26	600479	千金药业	8,200	83,394.00	0.18
27	601328	交通银行	10,950	81,796.50	0.18
28	600050	中国联通	11,800	55,460.00	0.12
28	00762	中国联通	4,000	26,175.66	0.06
29	601898	中煤能源	6,400	79,872.00	0.17
30	300815	玉禾田	6,800	79,152.00	0.17

31	600064	南京高科	13,000	78,910.00	0.17
32	000498	山东路桥	15,000	78,450.00	0.17
33	01308	海丰国际	4,000	77,395.26	0.17
34	600566	济川药业	2,400	76,104.00	0.17
35	002032	苏泊尔	1,500	75,150.00	0.16
36	601166	兴业银行	4,200	74,004.00	0.16
37	000895	双汇发展	3,100	73,687.00	0.16
38	600177	雅戈尔	10,150	72,268.00	0.16
39	600348	华阳股份	7,100	70,716.00	0.15
40	600710	苏美达	8,500	69,275.00	0.15
41	600919	江苏银行	9,300	69,099.00	0.15
42	603757	大元泵业	3,600	68,760.00	0.15
43	002027	分众传媒	11,300	68,478.00	0.15
44	000090	天健集团	17,000	68,340.00	0.15
45	600900	长江电力	2,350	67,962.00	0.15
46	01171	兖矿能源	5,200	52,964.65	0.12
46	600188	兖矿能源	500	11,365.00	0.02
47	601918	新集能源	6,400	62,400.00	0.14
48	600015	华夏银行	9,700	62,080.00	0.13
49	00883	中国海洋石油	3,000	61,332.10	0.13
50	600398	海澜之家	6,600	60,984.00	0.13
51	601138	工业富联	2,200	60,280.00	0.13
52	601838	成都银行	3,900	59,241.00	0.13
53	603228	景旺电子	1,800	57,240.00	0.12
54	601818	光大银行	17,900	56,743.00	0.12
55	002327	富安娜	5,600	56,280.00	0.12
56	600938	中国海油	1,700	56,100.00	0.12
57	601666	平煤股份	5,000	56,000.00	0.12
58	601857	中国石油	5,400	55,728.00	0.12
59	601168	西部矿业	3,100	55,645.00	0.12
60	000338	潍柴动力	3,400	55,216.00	0.12
61	601000	唐山港	11,700	54,990.00	0.12
62	601128	常熟银行	7,230	54,731.10	0.12
63	600036	招商银行	1,600	54,704.00	0.12
64	002043	兔宝宝	5,100	52,887.00	0.11
65	600660	福耀玻璃	1,100	52,690.00	0.11
66	603040	新坐标	2,600	51,818.00	0.11
67	600025	华能水电	4,700	50,666.00	0.11
68	600461	洪城环境	4,200	48,636.00	0.11
69	600750	江中药业	2,100	48,531.00	0.11
70	600248	陕建股份	13,100	47,553.00	0.10
71	600886	国投电力	2,600	47,424.00	0.10
72	603871	嘉友国际	2,640	46,701.60	0.10
73	600039	四川路桥	5,900	46,551.00	0.10

74	601126	四方股份	2,400	46,128.00	0.10
75	002833	弘亚数控	2,500	45,600.00	0.10
76	600029	南方航空	7,700	45,353.00	0.10
77	002687	乔治白	10,751	45,154.20	0.10
78	601816	京沪高铁	8,400	45,108.00	0.10
79	601600	中国铝业	5,900	45,017.00	0.10
80	601009	南京银行	4,300	44,677.00	0.10
81	000786	北新建材	1,500	44,490.00	0.10
82	000625	长安汽车	3,300	44,319.00	0.10
83	601766	中国中车	5,900	44,309.00	0.10
84	002091	江苏国泰	6,500	44,265.00	0.10
85	002911	佛燃能源	4,829	44,137.06	0.10
86	600285	羚锐制药	1,800	43,578.00	0.09
87	600970	中材国际	3,600	43,416.00	0.09
88	601919	中远海控	2,800	43,372.00	0.09
89	600273	嘉化能源	6,000	42,840.00	0.09
90	00914	海螺水泥	2,500	42,439.62	0.09
91	603357	设计总院	4,600	42,274.00	0.09
92	000725	京东方 A	10,300	42,127.00	0.09
93	600123	兰花科创	4,700	42,065.00	0.09
94	000906	浙商中拓	6,100	41,114.00	0.09
95	002267	陕天然气	5,400	40,824.00	0.09
96	600985	淮北矿业	2,400	40,176.00	0.09
97	601699	潞安环能	2,200	39,886.00	0.09
98	600007	中国国贸	1,800	39,528.00	0.09
99	600741	华域汽车	2,400	39,312.00	0.09
100	601211	国泰君安	2,900	39,295.00	0.09
101	001965	招商公路	3,300	39,138.00	0.09
102	00006	电能实业	1,000	38,560.73	0.08
103	002757	南兴股份	3,200	38,560.00	0.08
104	603611	诺力股份	2,200	37,488.00	0.08
105	002736	国信证券	4,300	37,367.00	0.08
106	600967	内蒙一机	5,100	36,720.00	0.08
107	601985	中国核电	3,400	36,244.00	0.08
108	000848	承德露露	4,600	36,156.00	0.08
109	002110	三钢闽光	12,200	35,990.00	0.08
110	600755	厦门国贸	5,000	35,850.00	0.08
111	002441	众业达	4,700	35,626.00	0.08
112	603013	亚普股份	2,600	35,022.00	0.08
113	002318	久立特材	1,500	34,995.00	0.08
114	601019	山东出版	2,900	34,278.00	0.07
115	002003	伟星股份	2,700	33,885.00	0.07
116	600757	长江传媒	4,200	33,852.00	0.07
117	600997	开滦股份	4,800	32,928.00	0.07

118	000876	新希望	3,600	32,904.00	0.07
119	600528	中铁工业	4,300	31,476.00	0.07
120	600820	隧道股份	4,800	31,344.00	0.07
121	000830	鲁西化工	2,700	31,293.00	0.07
122	000012	南玻 A	6,200	31,248.00	0.07
123	600971	恒源煤电	2,600	31,044.00	0.07
124	600548	深高速	2,900	30,827.00	0.07
125	002160	常铝股份	11,300	30,623.00	0.07
126	603283	赛腾股份	400	30,560.00	0.07
127	01336	新华保险	2,200	29,917.65	0.06
128	002807	江阴银行	7,900	29,783.00	0.06
129	600704	物产中大	6,800	29,512.00	0.06
130	600323	瀚蓝环境	1,400	29,260.00	0.06
131	000157	中联重科	3,800	29,184.00	0.06
132	600713	南京医药	6,900	29,118.00	0.06
133	601077	渝农商行	5,800	29,116.00	0.06
134	00857	中国石油股份	4,000	28,840.69	0.06
135	000807	云铝股份	2,100	28,371.00	0.06
136	000792	盐湖股份	1,600	27,920.00	0.06
137	000789	万年青	6,000	27,240.00	0.06
138	01378	中国宏桥	2,500	26,969.69	0.06
139	300259	新天科技	10,500	26,565.00	0.06
140	01908	建发国际集团	2,000	26,504.23	0.06
141	002004	华邦健康	6,900	26,220.00	0.06
142	00728	中国电信	4,000	16,902.83	0.04
142	601728	中国电信	1,500	9,225.00	0.02
143	600623	华谊集团	4,500	26,010.00	0.06
144	601169	北京银行	4,450	25,988.00	0.06
145	002353	杰瑞股份	700	24,556.00	0.05
146	601577	长沙银行	3,000	24,540.00	0.05
147	000933	神火股份	1,200	24,276.00	0.05
148	603699	纽威股份	1,400	23,968.00	0.05
149	000932	华菱钢铁	5,300	23,479.00	0.05
150	600269	赣粤高速	4,400	22,748.00	0.05
151	600846	同济科技	3,200	21,856.00	0.05
152	002697	红旗连锁	4,700	21,761.00	0.05
153	600096	云天化	1,100	21,362.00	0.05
154	600350	山东高速	2,400	21,240.00	0.05
155	000930	中粮科技	4,200	21,126.00	0.05
156	601098	中南传媒	1,700	21,114.00	0.05
157	600104	上汽集团	1,500	20,790.00	0.05
158	300073	当升科技	600	20,586.00	0.04
159	601658	邮储银行	4,000	20,280.00	0.04
160	002448	中原内配	3,400	19,516.00	0.04

161	603816	顾家家居	600	19,374.00	0.04
162	600048	保利发展	2,200	19,272.00	0.04
163	603368	柳药集团	1,100	19,250.00	0.04
164	002737	葵花药业	800	18,704.00	0.04
165	600019	宝钢股份	2,800	18,620.00	0.04
166	00123	越秀地产	4,000	18,618.67	0.04
167	301004	嘉益股份	200	18,200.00	0.04
168	600066	宇通客车	700	18,060.00	0.04
169	02343	太平洋航运	8,000	17,961.54	0.04
170	600583	海油工程	3,000	17,730.00	0.04
171	02328	中国财险	2,000	17,705.99	0.04
172	600808	马钢股份	8,400	16,968.00	0.04
173	601318	中国平安	400	16,544.00	0.04
174	603811	诚意药业	2,600	16,250.00	0.04
175	600854	春兰股份	4,700	16,074.00	0.03
176	603122	合富中国	3,100	15,779.00	0.03
177	603995	甬金股份	900	15,768.00	0.03
178	600157	永泰能源	13,300	15,694.00	0.03
179	603166	福达股份	3,100	15,190.00	0.03
180	000630	铜陵有色	4,200	15,162.00	0.03
181	600489	中金黄金	1,000	14,800.00	0.03
182	002867	周大生	1,100	14,366.00	0.03
183	002249	大洋电机	2,900	13,717.00	0.03
184	600482	中国动力	700	13,636.00	0.03
185	603355	莱克电气	600	12,960.00	0.03
186	601229	上海银行	1,750	12,705.00	0.03
187	600803	新奥股份	600	12,480.00	0.03
188	01339	中国人民保险集团	5,000	12,229.91	0.03
189	601928	凤凰传媒	1,100	12,056.00	0.03
190	000507	珠海港	2,700	11,961.00	0.03
191	002938	鹏鼎控股	300	11,928.00	0.03
192	06881	中国银河	3,000	11,198.58	0.02
193	002142	宁波银行	500	11,030.00	0.02
194	600941	中国移动	100	10,750.00	0.02
195	603301	振德医疗	500	10,430.00	0.02
196	002048	宁波华翔	800	10,352.00	0.02
197	03323	中国建材	4,000	10,222.02	0.02
198	600377	宁沪高速	800	10,080.00	0.02
199	002540	亚太科技	1,900	10,051.00	0.02
200	600409	三友化工	2,000	10,040.00	0.02
201	603329	上海雅仕	900	9,918.00	0.02
202	000885	城发环境	800	9,736.00	0.02
203	600582	天地科技	1,400	9,646.00	0.02

204	601231	环旭电子	600	9,630.00	0.02
205	301198	喜悦智行	1,200	9,612.00	0.02
206	600674	川投能源	500	9,375.00	0.02
207	000661	长春高新	100	9,177.00	0.02
208	603177	德创环保	1,300	9,139.00	0.02
209	600825	新华传媒	2,400	9,096.00	0.02
210	002762	金发拉比	1,800	9,036.00	0.02
211	600873	梅花生物	900	9,018.00	0.02
212	300112	万讯自控	1,300	8,970.00	0.02
213	301009	可靠股份	1,200	8,964.00	0.02
214	301088	戎美股份	800	8,960.00	0.02
215	600380	健康元	800	8,936.00	0.02
216	300853	申昊科技	600	8,724.00	0.02
217	002443	金洲管道	1,600	8,544.00	0.02
218	300453	三鑫医疗	1,300	8,307.00	0.02
219	603839	安正时尚	1,900	8,303.00	0.02
220	002462	嘉事堂	750	8,205.00	0.02
221	300642	透景生命	700	8,148.00	0.02
222	601156	东航物流	400	8,140.00	0.02
223	000513	丽珠集团	200	7,442.00	0.02
224	000565	渝三峡 A	1,800	7,254.00	0.02
225	601390	中国中铁	1,100	7,172.00	0.02
226	600089	特变电工	500	6,935.00	0.02
227	000400	许继电气	200	6,882.00	0.01
228	600219	南山铝业	1,800	6,858.00	0.01
229	600729	重庆百货	300	6,708.00	0.01
230	601880	辽港股份	5,400	6,642.00	0.01
231	603056	德邦股份	500	6,550.00	0.01
232	000975	银泰黄金	400	6,516.00	0.01
233	603279	景津装备	300	6,507.00	0.01
234	600016	民生银行	1,700	6,443.00	0.01
235	600642	申能股份	700	6,181.00	0.01
236	600236	桂冠电力	800	6,136.00	0.01
237	600325	华发股份	900	5,850.00	0.01
238	600612	老凤祥	100	5,819.00	0.01
239	600737	中粮糖业	600	5,754.00	0.01
240	603113	金能科技	1,050	5,743.50	0.01
241	600180	瑞茂通	1,500	5,715.00	0.01
242	601512	中新集团	700	5,334.00	0.01
243	600649	城投控股	1,600	5,312.00	0.01
244	002563	森马服饰	900	5,229.00	0.01
245	600098	广州发展	800	5,120.00	0.01
246	002831	裕同科技	200	5,118.00	0.01
247	600795	国电电力	800	4,792.00	0.01

248	300269	联建光电	1,900	4,769.00	0.01
249	600373	中文传媒	300	4,452.00	0.01
250	002508	老板电器	200	4,420.00	0.01
251	600546	山煤国际	300	4,386.00	0.01
252	603917	合力科技	400	4,328.00	0.01
253	000778	新兴铸管	1,200	4,176.00	0.01
254	002701	奥瑞金	1,000	4,160.00	0.01
255	601609	金田股份	700	3,962.00	0.01
256	002628	成都路桥	1,800	3,474.00	0.01
257	605158	华达新材	500	3,215.00	0.01
258	600167	联美控股	600	3,126.00	0.01
259	300082	奥克股份	700	2,982.00	0.01
260	000970	中科三环	300	2,295.00	0.00
261	002487	大金重工	100	2,288.00	0.00
262	002233	塔牌集团	250	1,827.50	0.00
263	688329	艾隆科技	49	728.14	0.00
264	002312	川发龙蟒	100	673.00	0.00
265	600101	明星电力	50	615.00	0.00
266	688678	福立旺	56	606.48	0.00
267	688389	普门科技	36	585.36	0.00
268	688128	中国电研	31	533.51	0.00
269	688332	中科蓝讯	8	471.92	0.00
270	002062	宏润建设	100	348.00	0.00
271	688223	晶科能源	38	269.80	0.00
272	688388	嘉元科技	24	234.00	0.00
273	688033	天宜上佳	36	216.00	0.00
274	688226	威腾电气	12	209.76	0.00
275	688621	阳光诺和	3	128.10	0.00
276	688819	天能股份	1	23.86	0.00
277	688561	奇安信	1	23.62	0.00
278	688079	美迪凯	1	7.42	0.00
279	688597	煜邦电力	1	6.96	0.00

注：1. 建设银行、中国神华、中国石化、工商银行、农业银行、中国银行、中国联通、兖矿能源和中国电信同时在 A+H 股上市，合并计算其公允价值参与排序。

2. 根据银泰黄金股份有限公司于 2024 年 7 月 24 日发布的《关于变更公司全称及证券简称暨完成变更登记的公告》，自 2024 年 7 月 25 日起，公司的证券简称由“银泰黄金”变更为“山金国际”，证券代码“000975”保持不变。

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	002327	富安娜	591,194.00	1.17
2	000333	美的集团	559,058.00	1.11
3	603757	大元泵业	539,610.00	1.07
4	601939	建设银行	526,280.00	1.04
5	603357	设计总院	519,087.00	1.03
6	002027	分众传媒	510,611.00	1.01
7	600323	瀚蓝环境	479,827.00	0.95
8	600887	伊利股份	465,655.00	0.92
9	601126	四方股份	465,010.00	0.92
10	600036	招商银行	460,813.00	0.91
11	603228	景旺电子	449,675.00	0.89
12	002128	电投能源	446,814.00	0.88
13	601677	明泰铝业	445,317.00	0.88
14	300770	新媒股份	439,334.00	0.87
15	002332	仙琚制药	436,482.00	0.86
16	002032	苏泊尔	434,967.00	0.86
17	000848	承德露露	432,944.00	0.86
18	002091	江苏国泰	425,451.00	0.84
19	002078	太阳纸业	416,707.00	0.82
20	000498	山东路桥	413,412.00	0.82

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	603283	赛腾股份	566,395.00	1.12
2	002327	富安娜	544,626.00	1.08
3	603357	设计总院	484,479.00	0.96
4	000333	美的集团	480,016.00	0.95
5	002027	分众传媒	465,231.00	0.92
6	601126	四方股份	452,963.00	0.90
7	600479	千金药业	450,601.00	0.89
8	600323	瀚蓝环境	450,095.00	0.89
9	603757	大元泵业	441,292.00	0.87
10	600007	中国国贸	436,648.00	0.86
11	002911	佛燃能源	433,047.00	0.86

12	601088	中国神华	431,173.50	0.85
13	601666	平煤股份	419,686.00	0.83
14	600036	招商银行	415,533.00	0.82
15	002091	江苏国泰	411,087.00	0.81
16	603228	景旺电子	404,986.00	0.80
17	601939	建设银行	402,192.00	0.80
18	000848	承德露露	400,096.00	0.79
19	601668	中国建筑	398,351.00	0.79
20	601138	工业富联	398,074.00	0.79

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	35,885,378.49
卖出股票的收入（成交）总额	44,212,078.25

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	6,389,430.36	13.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,588,043.84	23.00
	其中：政策性金融债	10,588,043.84	23.00
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）	8,843,350.08	19.21
8	同业存单	-	-
9	其他	8,666,034.11	18.82
10	合计	34,486,858.39	74.91

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	200205	20 国开 05	100,000	10,588,043.84	23.00
2	231601	24 湖南 01	45,000	4,613,110.27	10.02
3	198952	24 安徽 13	40,000	4,052,923.84	8.80
4	019729	23 国债 26	37,000	3,843,954.33	8.35
5	019727	23 国债 24	25,000	2,545,476.03	5.53

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**

根据风险管理原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

7.11.2 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。

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，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。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	130,007.96
2	应收清算款	49,546.85
3	应收股利	14,540.55
4	应收利息	-
5	应收申购款	41,162.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	235,257.84

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	113042	上银转债	1,439,106.60	3.13
2	110059	浦发转债	1,413,730.24	3.07
3	113052	兴业转债	1,366,789.19	2.97
4	113056	重银转债	924,072.20	2.01
5	113037	紫银转债	849,876.81	1.85
6	128129	青农转债	103,232.58	0.22

7	127049	希望转 2	92,117.29	0.20
8	127022	恒逸转债	86,877.29	0.19
9	110087	天业转债	84,991.64	0.18
10	127067	恒逸转 2	84,445.48	0.18
11	113046	金田转债	84,346.96	0.18
12	113065	齐鲁转债	83,218.26	0.18
13	113068	金铜转债	83,016.12	0.18
14	113532	海环转债	81,310.70	0.18
15	127040	国泰转债	79,451.48	0.17
16	113641	华友转债	79,144.27	0.17
17	127015	希望转债	77,495.14	0.17
18	127024	盈峰转债	76,799.34	0.17
19	113044	大秦转债	62,537.85	0.14
20	127017	万青转债	56,463.50	0.12
21	113054	绿动转债	53,874.21	0.12
22	110093	神马转债	51,936.79	0.11
23	118034	晶能转债	43,930.41	0.10
24	110095	双良转债	42,698.57	0.09
25	118022	锂科转债	41,667.45	0.09
26	128071	合兴转债	41,138.24	0.09
27	110079	杭银转债	41,060.86	0.09
28	110083	苏租转债	40,705.22	0.09
29	128144	利民转债	39,342.96	0.09
30	127018	本钢转债	38,374.91	0.08
31	128083	新北转债	38,213.62	0.08
32	127089	晶澳转债	36,001.94	0.08
33	110064	建工转债	35,706.77	0.08
34	113048	晶科转债	34,967.53	0.08
35	128136	立讯转债	33,117.72	0.07
36	127084	柳工转 2	32,890.92	0.07
37	110048	福能转债	32,130.45	0.07
38	110089	兴发转债	31,466.13	0.07
39	113616	韦尔转债	31,435.10	0.07
40	113051	节能转债	31,049.95	0.07
41	113047	旗滨转债	28,509.50	0.06
42	127014	北方转债	27,796.30	0.06
43	127016	鲁泰转债	27,748.08	0.06
44	123035	利德转债	27,600.83	0.06
45	113651	松霖转债	27,472.03	0.06
46	111002	特纸转债	27,307.74	0.06
47	113639	华正转债	26,726.95	0.06
48	113647	禾丰转债	25,018.42	0.05
49	127045	牧原转债	23,669.87	0.05
50	123108	乐普转 2	21,780.38	0.05

51	128048	张行转债	20,588.37	0.04
52	123208	孩王转债	19,494.88	0.04
53	123022	长信转债	19,415.75	0.04
54	127032	苏行转债	16,969.91	0.04
55	110077	洪城转债	16,861.68	0.04
56	110082	宏发转债	14,523.49	0.03
57	111010	立昂转债	14,387.22	0.03
58	127085	韵达转债	14,313.13	0.03
59	113627	太平转债	14,041.21	0.03
60	128134	鸿路转债	13,921.86	0.03
61	113584	家悦转债	13,806.33	0.03
62	128116	瑞达转债	13,703.08	0.03
63	113061	拓普转债	13,056.85	0.03
64	127030	盛虹转债	12,876.25	0.03
65	113519	长久转债	12,623.00	0.03
66	118030	睿创转债	12,178.16	0.03
67	113045	环旭转债	11,878.91	0.03
68	113545	金能转债	11,877.33	0.03
69	128130	景兴转债	11,862.34	0.03
70	113059	福莱转债	11,749.33	0.03
71	111014	李子转债	11,674.53	0.03
72	110070	凌钢转债	11,600.19	0.03
73	113050	南银转债	11,287.09	0.02
74	123130	设研转债	10,834.06	0.02
75	123161	强联转债	10,818.30	0.02
76	123216	科顺转债	10,490.44	0.02
77	123119	康泰转 2	10,395.84	0.02
78	123104	卫宁转债	10,330.36	0.02
79	123145	药石转债	10,187.80	0.02
80	113638	台 21 转债	10,088.40	0.02
81	128109	楚江转债	9,974.39	0.02
82	128081	海亮转债	9,765.53	0.02
83	113670	金 23 转债	9,644.60	0.02
84	128133	奇正转债	9,589.37	0.02
85	127042	嘉美转债	9,505.31	0.02
86	111009	盛泰转债	8,591.28	0.02
87	118013	道通转债	7,994.16	0.02
88	118024	冠宇转债	7,675.78	0.02
89	113516	苏农转债	6,598.78	0.01
90	127026	超声转债	3,354.42	0.01
91	113631	皖天转债	1,265.89	0.00
92	113549	白电转债	1,196.00	0.00
93	128053	尚荣转债	1,076.51	0.00
94	118031	天 23 转债	928.51	0.00

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
海富通富利三个月持有 A	899	29,245.40	9,942.61	0.04%	26,281,668.29	99.96%
海富通富利三个月持有 C	296	73,513.12	-	-	21,759,882.58	100.00%
合计	1,195	40,210.45	9,942.61	0.02%	48,041,550.87	99.98%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,A、C级比例分母为各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通富利三个月持有 A	397,496.67	1.5119%
	海富通富利三个月持有 C	70.97	0.0003%
	合计	397,567.64	0.8274%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海富通富利三个月持有 A	10~50
	海富通富利三个月持有 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开	海富通富利三个月持有	10~50

开放式基金	A	
	海富通富利三个月持有 C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
基金合同生效日（2021 年 7 月 20 日）基金份额总额	120,616,157.58	157,024,982.53
本报告期期初基金份额总额	28,219,622.95	25,964,357.72
本报告期基金总申购份额	201,918.91	53,114.84
减：本报告期基金总赎回份额	2,129,930.96	4,257,589.98
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	26,291,610.90	21,759,882.58

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	80,097,456.74	100.00%	58,930.18	100.00%	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉、研究水平和综合服务支持三个部分进行评议，形成证券公司交易单元租用意见。

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门内部讨论，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会审议。

<2> 核准。在完成对证券公司的评估和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	56,083,512.22	100.00%	212,188,000.00	100.00%	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金	证券时报、基金管理人网	2024-01-12

	新增贵州省贵文文化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	站及中国证监会基金电子披露网站	
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增京东肯特瑞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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-17
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-07

§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
个人	1	2024/3/29-2024/6/30	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	20.81%
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> <p>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。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 123 只公募基金。截至 2024 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1613 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服

务。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联《上海证券报》颁发的“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获中国保险资产管理业协会颁发的“IAMAC 推介 2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《上海证券报》颁发的“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。2023 年 8 月，海富通荣获《上海证券报》颁发的“上证中国基金投教创新案例奖”。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通富利三个月持有期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

二〇二四年八月三十日