

华宸未来稳健添利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：华宸未来基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 03 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 21 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。

华宸未来稳健添利债券型证券投资基金由华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金变更注册而来。2018 年 7 月 30 日至 2018 年 8 月 21 日期间，华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金召开基金份额持有人大会，基金份额持有人大会计票日期为 2018 年 8 月 22 日。会议审议通过了《关于华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金变更的议案》，内容包括华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金调整基金投资范围、投资策略、投资限制、基金费用、估值方法、增设收取销售服务费的 C 类份额，并根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法律法规修订基金合同等，同意将“华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金”更名为“华宸未来稳健添利债券型证券投资基金”，上述基金份额持有人大会决议自表决之日起生效。自 2018 年 8 月 24 日起，《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金基金合同》生效，《华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金基金合同》同日起失效。

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。

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

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	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	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.10 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	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51

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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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	53
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	53
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
8.14 投资组合报告附注	53
§ 9 基金份额持有人信息	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	55
§ 10 开放式基金份额变动	55
§ 11 重大事件揭示	55
11.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
11.4 基金投资策略的改变	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
11.8 其他重大事件	57
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
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	59
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 13 备查文件目录	59
13.1 备查文件目录	59
13.2 存放地点	60
13.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宸未来稳健添利债券型证券投资基金	
基金简称	华宸稳健债券	
基金主代码	000104	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 8 月 24 日	
基金管理人	华宸未来基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	501,482,274.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C
下属分级基金的交 易代码	000104	006258
报告期末下属分级 基金的份额总额	106,612,841.47 份	394,869,433.14 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	资产配置策略。本基金奉行“自上而下”和“自下而上”相结合的主动式投资管理理念，采用价值分析方法，在分析和判断财政政策、货币政策、宏观经济运行指标的基础上，自上而下确定和动态调整大类资产比例和债券的组合目标久期、期限结构配置及类属配置；同时，采用“自下而上”的方法，在研究分析信用风险、流动性风险、收益率水平、市场环境等因素基础上，自下而上的精选投资品种。 普通债券投资策略。本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。 可转换债券投资策略。可转换债券不同于一般的公司债券，该债券赋予投资者在一定条件下将可转换债券转换成股票的权利，投资者可能还具有回售等其他权利，因此从这方面看可转换债券的理论价值应等于普通债券的基础价值和可转换债券自身内含的期权价值之和。本基金在合理地给出可转换债券估值的基础上，尽量有效地挖掘出投资价值较高的可转换债券。 回购套利策略。本基金重要的操作策略之一，把信用产品投资和回购交易结合起来，管理人根据信用产品的特征，在信用风险和流动

	性风险可控的前提下，或者通过回购融资来获取超额收益，或者通过回购的不断滚动来获取信用债收益率和资金成本的利差。 资产支持证券投资策略。本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，以在控制风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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		华宸未来基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	邓升军	郭明
	联系电话	021-26066866	010-66105799
	电子邮箱	dengsj@hcmirae.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009200699	95588
传真		021-65870287	010-66105798
注册地址		上海市虹口区四川北路 859 号中信广场 1608 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市虹口区四川北路 859 号中信广场 1608 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200085	100140
法定代表人		孙琦	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hcmirae.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、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	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢外经贸大厦 901-22 至 901-26
注册登记机构	华宸未来基金管理有限公司	上海市虹口区四川北路 859 号中信广场 1608 室

§ 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	2024 年		2023 年		2022 年	
	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C

指标						
本期已实现收益	3, 517, 888. 38	36, 402, 223. 39	32, 072. 07	2, 531, 456. 32	47, 296. 50	515, 037. 65
本期利润	2, 991, 345. 58	38, 647, 809. 46	98, 894. 61	8, 214, 884. 79	42, 953. 58	-482, 001. 06
加权平均基金份额本期利润	0. 0513	0. 0537	0. 0595	0. 0825	0. 0271	-0. 0042
本期加权平均净值利润率	4. 07%	4. 34%	4. 99%	6. 89%	2. 26%	-0. 36%
本期基金份额净值增长率	4. 59%	4. 17%	4. 59%	4. 33%	2. 69%	2. 16%
3. 1. 2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	24, 524, 510. 91	75, 509, 800. 66	988, 643. 66	141, 356, 823. 97	211, 137. 11	10, 183, 222. 66
期末可供分配基金份额利润	0. 2300	0. 1912	0. 1715	0. 1382	0. 1547	0. 1245
期末基金资产净值	136, 157, 183. 43	498, 950, 619. 94	7, 039, 503. 15	1, 240, 984, 969. 79	1, 593, 042. 29	95, 062, 445. 74
期末	1. 2771	1. 2636	1. 2210	1. 2130	1. 1674	1. 1627

基金 份额 净值						
3.1. 3 累 计期 末指 标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金 份额 累计 净值 增长 率	26.26%	32.45%	20.72%	27.14%	15.42%	21.87%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

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、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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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

华宸稳健债券 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	1.19%	0.04%	2.23%	0.09%	-1.04%	-0.05%
过去六个月	1.79%	0.04%	2.50%	0.10%	-0.71%	-0.06%
过去一年	4.59%	0.03%	4.98%	0.09%	-0.39%	-0.06%
过去三年	12.34%	0.05%	7.69%	0.06%	4.65%	-0.01%

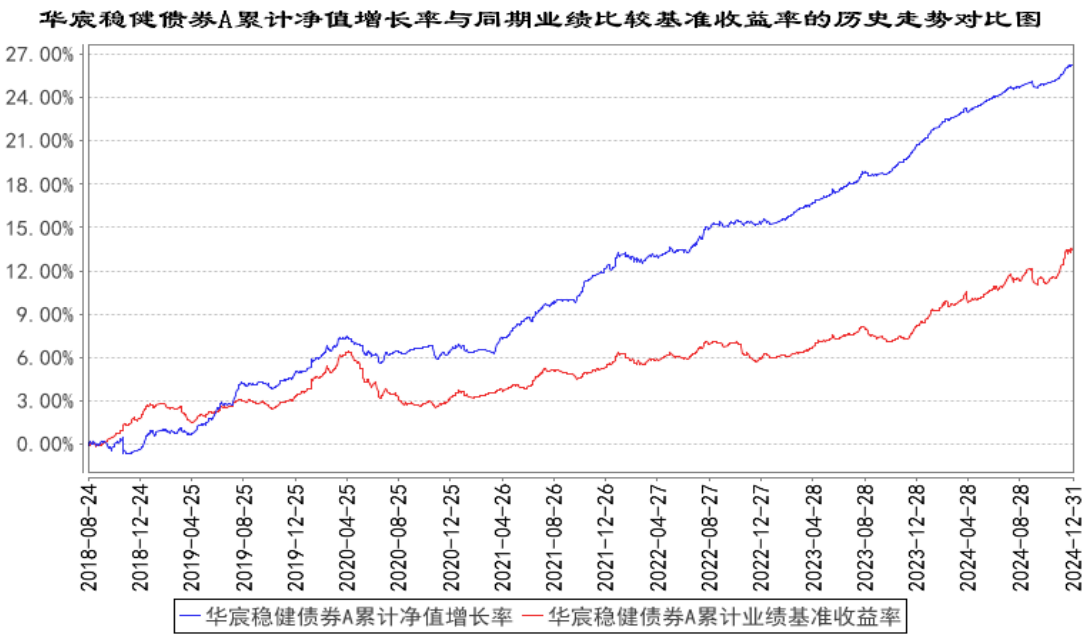
过去五年	20.19%	0.06%	9.88%	0.07%	10.31%	-0.01%
自基金合同生效 起至今	26.26%	0.07%	13.66%	0.06%	12.60%	0.01%

华宸稳健债券 C

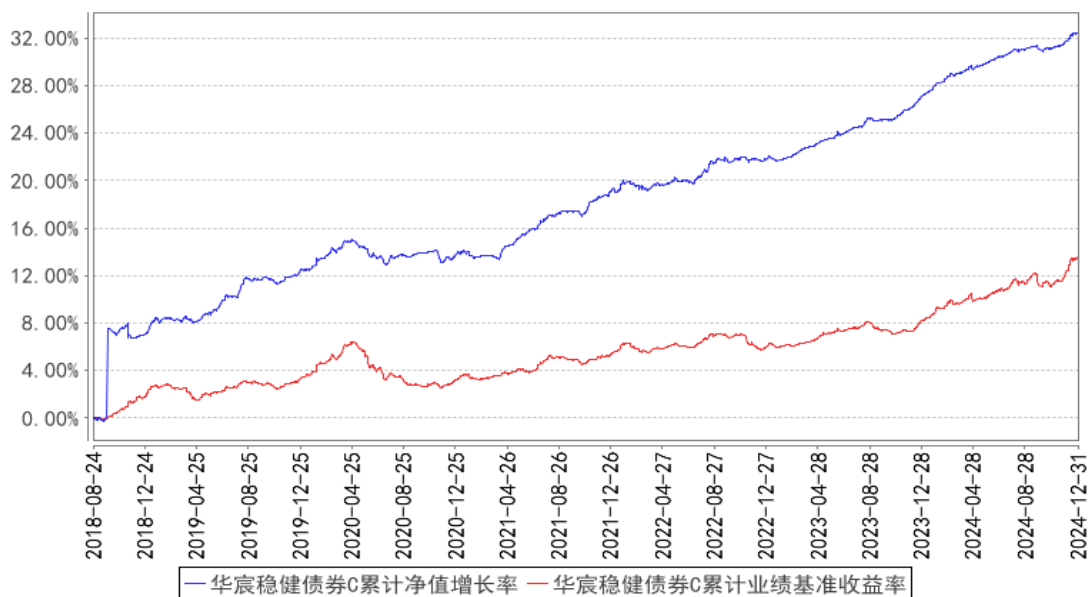
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.07%	0.04%	2.23%	0.09%	-1.16%	-0.05%
过去六个月	1.57%	0.04%	2.50%	0.10%	-0.93%	-0.06%
过去一年	4.17%	0.04%	4.98%	0.09%	-0.81%	-0.05%
过去三年	11.02%	0.05%	7.69%	0.06%	3.33%	-0.01%
过去五年	17.69%	0.06%	9.88%	0.07%	7.81%	-0.01%
自基金合同生效 起至今	32.45%	0.20%	13.66%	0.06%	18.79%	0.14%

注：转型后的合同生效日：2018 年 8 月 24 日。

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



华宸稳健债券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



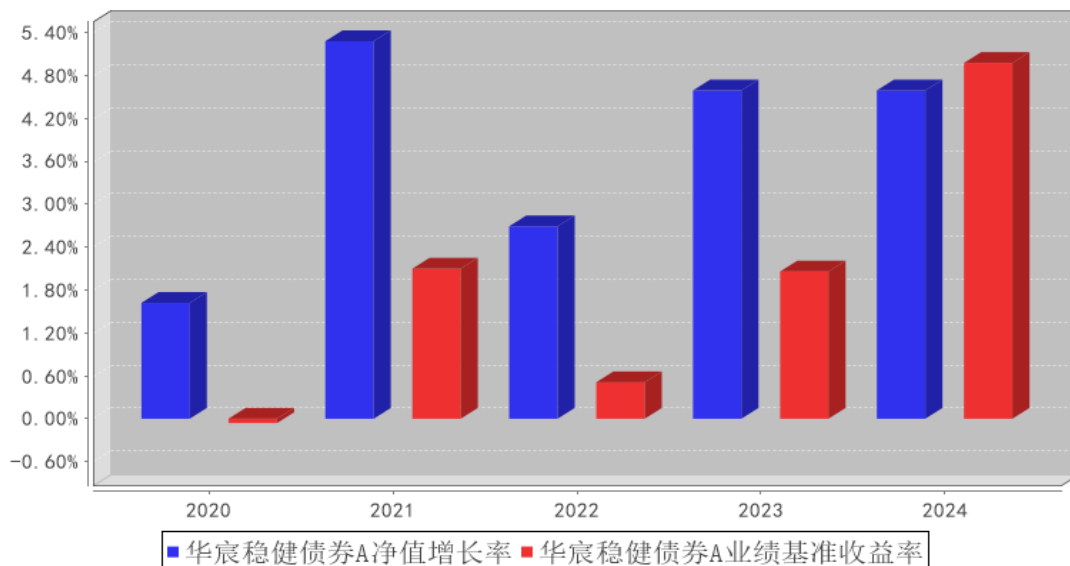
注：1、本基金业绩比较基准为中债综合全价指数。

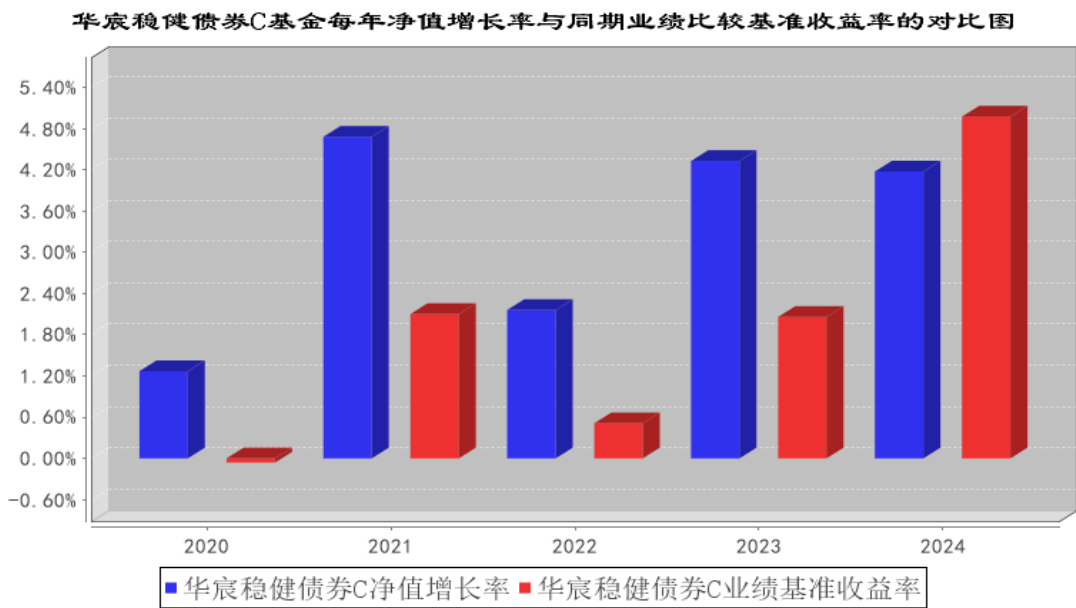
2、本基金转型日期为 2018 年 8 月 24 日。截至本报告期末，本基金转型后基金合同生效已满一年。

3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，截至本报告期末建仓期已结束。

3.2.3 过去五年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

华宸稳健债券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





注：本基金转型日期为 2018 年 8 月 24 日。截至本报告期末，本基金转型后基金合同生效已满一年。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

华宸稳健债券 A					
年度	每 10 份基金 份额分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	0.5600	61,131.09	15,584.23	76,715.32	-
合计	0.5600	61,131.09	15,584.23	76,715.32	-

华宸稳健债券 C					
年度	每 10 份基金 份额分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	0.5600	23,632,869.61	3,962,201.05	27,595,070.66	-
合计	0.5600	23,632,869.61	3,962,201.05	27,595,070.66	-

§ 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

华宸未来基金管理有限公司是经证监许可[2012]370 号文批准于 2012 年 6 月 20 日成立。截

至本报告期末，公司股东由华宸信托有限责任公司、韩国未来资产基金管理公司、咸阳长涛电子科技有限公司组成，公司性质为中外合资企业。公司注册资本 2 亿元人民币。公司秉承“规范创造价值，创新推动成长”的经营理念，贯彻投资人利益优先原则，树立长期价值投资理念，专心致力于细分市场的经营战略，从公司品牌、运行机制、企业文化和团队建设等方面构筑公司核心竞争力，努力做到“沉得下来不浮躁，专得下去不浮浅”，将公司打造成为受尊重的资产管理人。

截至本报告期末，本基金管理人管理 3 只开放式基金：华宸未来稳健添利债券型证券投资基金、华宸未来价值先锋混合型发起式证券投资基金、华宸未来稳健添盈债券型证券投资基金。

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		
王斌	本基金基金经理	2022 年 10 月 31 日	-	8	王斌，2016 年 8 月至 2019 年 6 月先后就职于东北证券、新时代证券，担任行业研究员。2019 年 7 月加入华宸未来基金管理有限公司任信用研究员，2020 年 9 月任基金经理助理。2022 年 10 月 31 日任华宸未来稳健添利债券型证券投资基金基金经理。2022 年 12 月 31 日任华宸未来稳健添盈债券型证券投资基金基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

在本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金基金合同》、《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人已依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易控制机制，确保管理的不同受托资产得到公平对待，保护投资者合法权益。

在投资决策方面，本基金管理人建立了科学的研究方法以及规范的研究管理平台，实行证券备选库和交易对手备选库制度，各受托资产之间实行防火墙制度，通过系统的投资决策方法和明

确的投资授权制度，保证受托投资决策的客观性和独立性。

在交易执行方面，本基金管理人实行集中交易制度，并建立了公平的交易分配流程，保证投资指令得以公平对待。对以本基金管理人的名义参与债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易的，相关基金经理或投资经理应独立确定各受托资产拟申购的价格和数量，基金管理人在获配额度后，按照价格优先、比例分配的原则进行分配。对以各受托资产名义参与银行间交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的，交易部应充分询价，利用市场公认的第三方信息对交易价格的公允性进行审查，确保各受托资产获得公平的交易机会。

风险管理部对投资交易行为进行定期或不定期检查，重点关注公平交易的执行情况和异常交易行为的监控情况。严禁同一受托资产的同日反向交易及其他可能导致不公平或利益输送的交易行为，但完全按照有关指数构成比例进行证券投资的受托资产除外。严格控制不同受托资产间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易或利益输送的同日反向交易行为。风险管理部门对不同受托资产，尤其是同一位基金经理或投资经理管理的不同受托资产同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同受托资产临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。发现异常交易情况的，可要求相关基金经理或投资经理对交易的合理性进行解释。风险管理部门对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同受托资产买卖该异常交易证券的情况进行分析。发现异常交易情况的，可要求相关基金经理或投资经理对交易的合理性进行解释。风险管理部门编制定期公平交易报告，重点分析本基金管理人管理的不同受托资产整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及同一期间、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同受托资产同向交易的交易价差。公平交易报告由基金经理或投资经理确认后报督察长、总经理审阅。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易的情形，未发生所有投资组合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。

本报告期内，基金管理人未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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，中国经济延续温和修复，通胀底部企稳，社融增速下移，货币政策宽松加码，流动性保持充裕。在此宏观背景下，债券市场收益率大幅下行。本基金在此期间，通过密切研究宏观经济和市场变化，积极调整组合久期，严控信用风险，取得了稳健回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华宸稳健债券 A 基金份额净值为 1.2771 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.59%；截至本报告期末华宸稳健债券 C 基金份额净值为 1.2636 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.17%；同期业绩比较基准收益率为 4.98%。

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，国内经济基本面修复尚需时间，货币政策延续宽松，利率将维持较低水平。我们将严控信用风险，积极调整组合久期，以利率债和 AAA 信用债券为主，追求获取稳健回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益，监察稽核人员在督察长的领导下，按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用例行检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，按期制作监察稽核报告，并及时呈报公司总经理、董事。

本基金管理人采取的主要措施包括：

（1）梳理规章制度，完善内控体系

根据行业法律法规的变化以及公司内部部门结构调整等情况，公司从治理制度、基本管理制度、部门级规章以及部门具体管理制度四个层面搭建了较为完善的制度体系，形成了公司制度汇编。本报告期内公司共制定和修订了 120 项制度规章。监察稽核部牵头，对涉及公司层面及具体业务部门层面的制度及流程进行了持续梳理，并根据实际运作情况进行修订和完善。这些制度的修订和完善对确保公司各项业务顺利、规范地进行起到了很好的促进作用。

（2）发挥内部审计作用，改进内控流程

公司通过各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改。

（3）开展合规培训，强化员工意识

监察稽核部及时将新颁布的法律法规传递给各相关部门，并对具体的执行和合规要求进行提示。在日常工作中通过邀请外部律所及利用基金业协会、上海基金同业公会等业内组织提供的培训交流机会对公司员工进行合规培训。

（4）审查文件材料，确保合法合规

监察稽核部审查法定信息披露文件、基金的宣传推介材料以及各类合同协议，确保上述文件、材料内容的合法合规、真实完整。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续以风险控制为核心，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规、安全运作。

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，本基金管理人严格按照本公司制订的《基金会计制度》《基金会计管理制度》《证券投资基金估值制度》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。

在每个估值日，本基金管理人按照最新的会计准则、业务指引、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值，确定证券投资基金的份额净值。基金管理人对基金资产进行估值后，将估值结果发送基金托管人。基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，由总经理、督察长、运营管理部负责人、研究发展部负责人、投资部门负责人、市场管理部负责人、风险管理部负责人、监察稽核部负责人、首席信息官等相关专业人士组成。估值委员会专门负责基金估值工作，直接向公司管理层负责，在确定公司旗下基金的估值方法、估值模型选择、估值模型假设及估值政策和程序的建立等方面为公司管理层提供参考意见，为业务部门的操作提供指导意见并对执行情况进行监督。在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后或基金资产在采用新投资策略和新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，并在不适用的情况下，及时召开估值委员会修订相关估值方法，以确保其持续适用。涉及估值政策的变更均须经估值委员会决议批准后执行。

上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本报告期内不存在连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，且不存在连续 20 个

工作日基金份额持有人人数不满 200 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人—华宸未来基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对华宸未来基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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	容诚审字[2025]200Z0653 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	华宸未来稳健添利债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了华宸未来稳健添利债券型证券投资基金（以下简称“华宸未来稳健添利基金”）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和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公允反映了华宸未来稳健添利基金 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，我们独立于华宸未来稳健添利基金，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	—
其他信息	—
管理层和治理层对财务报表的责任	华宸未来稳健添利基金的基金管理人华宸未来基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华宸未来稳健添利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，除非基金管理人管理层计划清算华宸未来稳健添利基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督华宸未来稳健添利基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： （1）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。 （2）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。 （3）评价基金管理人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。 （4）对基金管理人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，就可能导致对华宸未来稳健添利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宸未来稳健添利基金不能持续经营。 (5) 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。 我们与基金管理人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。	
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	赵钰	金诗涛
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢外经贸大厦 901-22 至 901-26	
审计报告日期	2025 年 03 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华宸未来稳健添利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
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	5,292,828.34	116,987,326.69
结算备付金		4,774,084.61	2,347,110.21
存出保证金		13,404.15	14,481.52
交易性金融资产	7.4.7.2	556,699,193.72	790,793,441.20
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		556,699,193.72	790,793,441.20
资产支持证券投资		-	-
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	66,995,129.10	365,096,370.02
应收清算款		609,741.81	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,020,830.26	81,684,535.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		638,405,211.99	1,356,923,265.50
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

负 债：			
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		-	-
应付清算款		-	107,100,483.56
应付赎回款		2,253,674.22	229,033.69
应付管理人报酬		219,125.08	195,974.51
应付托管费		109,562.57	97,987.27
应付销售服务费		130,730.43	146,099.93
应付投资顾问费		-	-
应交税费		510,375.94	544,762.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	73,940.38	584,450.91
负债合计		3,297,408.62	108,898,792.56
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	501,482,274.61	1,028,866,388.07
未分配利润	7.4.7.8	133,625,528.76	219,158,084.87
净资产合计		635,107,803.37	1,248,024,472.94
负债和净资产总计		638,405,211.99	1,356,923,265.50

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2665 元，基金份额总额 501,482,274.61 份。其中 A 类基金份额净值 1.2771 元，份额总额 106,612,841.47 份；C 类基金份额净值 1.2636 元，份额总额 394,869,433.14 份。

7.2 利润表

会计主体：华宸未来稳健添利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 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		50,500,587.20	9,567,063.88
1. 利息收入		1,628,107.89	455,003.22
其中：存款利息收入	7.4.7.9	206,248.73	55,297.49
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,421,859.16	399,705.73
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”		46,952,055.00	3,339,574.51

填列)			
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	46,952,055.00	3,339,574.51
资产支持证券投资 收益	7.4.7.12	-	-
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	1,719,043.27	5,750,251.01
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	201,381.04	22,235.14
减：二、营业总支出		8,861,432.16	1,253,284.48
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,906,047.72	467,053.27
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,953,023.91	233,526.59
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,711,271.24	344,382.87
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		36,425.87	3,468.01
其中：卖出回购金融资产 支出		36,425.87	3,468.01
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		59,351.64	8,874.11
8. 其他费用	7.4.7.19	195,311.78	195,979.63
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		41,639,155.04	8,313,779.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		41,639,155.04	8,313,779.40
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		41,639,155.04	8,313,779.40

7.3 净资产变动表

会计主体：华宸未来稳健添利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	1, 028, 866, 388.07	-	219, 158, 084. 87	1, 248, 024, 472. 94
二、本期期初净资产	1, 028, 866, 388.07	-	219, 158, 084. 87	1, 248, 024, 472. 94
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-527, 384, 113. 46	-	-85, 532, 556. 11	-612, 916, 669. 57
(一)、综合收益总额	-	-	41, 639, 155. 04	41, 639, 155. 04
(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)	-527, 384, 113. 46	-	-127, 171, 711. 15	-654, 555, 824. 61
其中：1. 基金申购款	2, 557, 852, 954.61	-	600, 287, 882. 91	3, 158, 140, 837. 52
2. 基金赎回款	-3, 085, 237, 068.07	-	-727, 459, 594. 06	-3, 812, 696, 662.13
(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	501, 482, 274. 61	-	133, 625, 528. 76	635, 107, 803. 37
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 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	83, 126, 569. 82	-	13, 528, 918. 21	96, 655, 488. 03
二、本期期初净资产	83, 126, 569. 82	-	13, 528, 918. 21	96, 655, 488. 03
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	945, 739, 818. 25	-	205, 629, 166. 66	1, 151, 368, 984. 91
(一)、综合收益总额	-	-	8, 313, 779. 40	8, 313, 779. 40
(二)、本期基金	945, 739, 818. 25	-	197, 315, 387. 26	1, 143, 055, 205. 5

份额交易产生的 净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				1
其中：1. 基金申 购款	1, 194, 963, 014. 83	-	244, 414, 314. 32	1, 439, 377, 329. 1 5
2. 基金赎 回款	-249, 223, 196. 5 8	-	-47, 098, 927. 06	-296, 322, 123. 64
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的净 资产变动(净资 产减少以“-”号 填列)	-	-	-	-
四、本期期末净 资产	1, 028, 866, 388. 07	-	219, 158, 084. 87	1, 248, 024, 472. 9 4

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：

邓升军

基金管理人负责人

刘宇

主管会计工作负责人

陈婉琪

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宸未来稳健添利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）是由华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金转型而成。华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金系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[2013]177 号文《关于核准华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人华宸未来基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于 2013 年 8 月 20 日正式生效。首次设立募集规模为 197,981,907.82 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为华宸未来基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金基金合同》及《关于华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自 2018 年 8 月 24 日起转型并更名为华宸未来稳健添利债券型证券投资基金。

本基金将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金的 A 类基金份额在申购时收取申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费；C 类基金份额不收取申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费，但从该类别基金资产中计提销售服务费。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券、可分离债券）、同业存单、资产支持证券、债券回购等金融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相关规定）。本基金不直接投资股票、权证等权益类资产，但可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于可分离交易可转债等金融工具而产生的权证。因上述原因持有的股票、权证，本基金应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。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。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华宸未来基金管理有限公司于 2025 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本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》、《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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，真实、完整地反映了本基金于 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现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。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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；对于应收款项和其他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。

本基金考虑有关过去事项、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，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。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。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，本基金按照未来 12 个月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，本基金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，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，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，但是放弃了对该金融资产控制。

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

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 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中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法

都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

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净资产比例计算的金额。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损益占净资产比例计算的金额。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

债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，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则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直

线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位各类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各基金份额类别分别制定收益分配方案，本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 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(可转换债券和可交换债券除外)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》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 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[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]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，以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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 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。

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	5,292,828.34	116,987,326.69
等于：本金	5,292,240.84	116,979,147.51
加：应计利息	587.50	8,179.18
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	5,292,828.34	116,987,326.69

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	80,203,924.62	876,073.18	81,993,503.88	913,506.08
	银行间市场	458,724,982.74	9,736,889.84	474,705,689.84	6,243,817.26
	合计	538,928,907.36	10,612,963.02	556,699,193.72	7,157,323.34
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		538,928,907.36	10,612,963.02	556,699,193.72	7,157,323.34
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	331,976,036.93	3,521,228.20	337,002,777.70	1,505,512.57
	银行间市场	438,705,932.50	11,151,963.50	453,790,663.50	3,932,767.50
	合计	770,681,969.43	14,673,191.70	790,793,441.20	5,438,280.07
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		0.00	0.00	0.00	0.00
合计		770,681,969.43	14,673,191.70	790,793,441.20	5,438,280.07

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

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

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	66,995,129.10	-
银行间市场	-	-
合计	66,995,129.10	-
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	365,096,370.02	-
银行间市场	-	-
合计	365,096,370.02	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

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	1,072.67	193.01
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	22,867.71	54,257.90
其中：交易所市场	14,597.71	45,322.90
银行间市场	8,270.00	8,935.00
应付利息	-	-
预提费用	50,000.00	530,000.00
合计	73,940.38	584,450.91

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宸稳健债券 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	5,765,156.71	5,765,156.71
本期申购	157,183,105.56	157,183,105.56
本期赎回（以“-”号填列）	-56,335,420.80	-56,335,420.80
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	106,612,841.47	106,612,841.47

华宸稳健债券 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	1,023,101,231.36	1,023,101,231.36
本期申购	2,400,669,849.05	2,400,669,849.05
本期赎回（以“-”号填列）	-3,028,901,647.27	-3,028,901,647.27
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	394,869,433.14	394,869,433.14

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华宸稳健债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	988,643.66	285,702.78	1,274,346.44
本期期初	988,643.66	285,702.78	1,274,346.44
本期利润	3,517,888.38	-526,542.80	2,991,345.58

本期基金份额交易产生的变动数	20,017,978.87	5,260,671.07	25,278,649.94
其中：基金申购款	31,800,127.81	8,075,625.70	39,875,753.51
基金赎回款	-11,782,148.94	-2,814,954.63	-14,597,103.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,524,510.91	5,019,831.05	29,544,341.96

华宸稳健债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	141,356,823.97	76,526,914.46	217,883,738.43
本期期初	141,356,823.97	76,526,914.46	217,883,738.43
本期利润	36,402,223.39	2,245,586.07	38,647,809.46
本期基金份额交易产生的变动数	-102,249,246.70	-50,201,114.39	-152,450,361.09
其中：基金申购款	367,018,395.86	193,393,733.54	560,412,129.40
基金赎回款	-469,267,642.56	-243,594,847.93	-712,862,490.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	75,509,800.66	28,571,386.14	104,081,186.80

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 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	107,106.97	26,060.87
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	95,773.14	21,149.07
其他	3,368.62	8,087.55
合计	206,248.73	55,297.49

注：表中“其他”为直销申购款利息收入及保证金利息收入。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益—买卖股票差价收入。

7.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益—证券出借差价收入。

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1月1日至2023年12月31 日
债券投资收益——利息收入	36,262,268.57	3,656,975.60
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	10,689,786.43	-317,401.09
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	46,952,055.00	3,339,574.51

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1月1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	2,453,841,813.04	403,336,445.99
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,396,759,851.18	395,962,437.48
减：应计利息总额	46,195,469.40	7,608,557.09
减：交易费用	196,706.03	82,852.51
买卖债券差价收入	10,689,786.43	-317,401.09

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益——申购差价收入。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益项目构成。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

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 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	1,719,043.27	5,750,251.01
股票投资	-	-
债券投资	1,719,043.27	5,750,251.01
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
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	1,719,043.27	5,750,251.01
----	--------------	--------------

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 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	201,381.04	22,235.13
基金转换费收入	-	0.01
合计	201,381.04	22,235.14

注：注：本基金基金份额的赎回费率按照持有时间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

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 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	34,500.00	18,000.00
其他	1,100.00	-
银行汇划费用	29,711.78	7,979.63
合计	195,311.78	195,979.63

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华宸未来基金管理有限公司（“华宸未来”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
华宸信托有限责任公司	基金管理人的股东

咸阳长涛电子科技有限公司	基金管理人的股东
韩国未来资产基金管理公司	基金管理人的股东
上海华宸未来资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期存在控制关系或其他重大利害的关联方未发生变化。

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

本基金本报告期及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

本基金本报告期及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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及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

本基金本报告期及上年度可比期间均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 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,906,047.72	467,053.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,655,745.06	85,465.82
应支付基金管理人的净管理费	2,250,302.66	381,587.45

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.40%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times \text{基金管理费年费率}/\text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

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 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,953,023.91	233,526.59

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

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		
	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C	合计
	华宸未来基金管理有限公司	141,417.56	141,417.56
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	-	-	-
合计	-	141,417.56	141,417.56
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C	合计
	华宸未来基金管理有限公司	193,470.90	193,470.90
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	-	-	-
合计	-	193,470.90	193,470.90

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年费率为 0.30%。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.30% 年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times \text{C 类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C
基金合同生效日（2018 年 8 月 24 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C
基金合同生效日（2018 年	10,000,000.00	-

8 月 24 日)持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	-	4, 403, 539. 90
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	4, 403, 539. 90
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：(1)期间申购/买入总份额含转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

(2)关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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 1 月 1 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
工商银行	5, 292, 828. 34	107, 106. 97	116, 987, 326. 69	26, 060. 87

7. 4. 10. 7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7. 4. 10. 8 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

7. 4. 11 利润分配情况

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7. 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。

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 2024 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

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

本基金金融工具的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险, 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。

本基金管理人奉行全面风险管理、全员风险管理, 公司构建了分工明确、相互协作、彼此制约的风险管理组织架构体系。董事会负责公司整体经营风险的管理, 对公司建立风险管理体系和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险管理委员会, 协助董事会进行风险管理, 风险管理委员会负责起草公司风险管理战略, 审议、监督、检查、评估公司经营管理与受托投资的风险控制状况。管理层负责落实董事会拟定的风险管理政策, 并对风险控制的有效执行承担责任。公司内设风险控制委员会, 协助管理层进行风险控制, 风险控制委员会负责组织风险管理体系的建设, 确定风险管理原则、目标和方法, 审议风险管理制度和流程, 指导重大风险事件的处理。督察长负责监督检查公司风险管理工作的执行情况, 评价公司内部风险控制制度的合法性、合规性和有效性, 并向董事会报告。公司各部门是风险控制措施的执行部门, 负责识别和控制业务活动中潜在风险, 做好风险的事先防范与控制, 作为一线责任人将风险控制在最小范围内。同时, 公司设立监察稽核部和风险管理部, 两者依各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控与分析, 并向管理层汇报。

本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。同时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, 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，将风险控制可在承受的范围内。

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同责任，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在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司，因而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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 35.99%（于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 34.37%）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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(净资产)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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品

种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金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 7.4.12。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%。于 2024 年 12 月 31 日，本基金无流动性受限资产。

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。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

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	5,292,828.34	-	-	-	-	-	5,292,828.34
结算 备付 金	4,774,084.61	-	-	-	-	-	4,774,084.61
存出 保证 金	13,404.15	-	-	-	-	-	13,404.15
交易 性金 融资 产	52,541,420.77	52,576,670.52	185,725,978.75	198,214,049.55	67,641,074.13	-	556,699,193.72
买入 返售 金融 资产	66,995,129.10	-	-	-	-	-	66,995,129.10
应收 申购 款	-	-	-	-	-	4,020,830.26	4,020,830.26

应 收 清 算 款	-	-	-	-	-	609,741.81	609,741.81
资 产 总 计	129,616,866.97	52,576,670.52	185,725,978.75	198,214,049.55	67,641,074.13	4,630,572.07	638,405,211.99
负 债							
应 付 赎 回 款	-	-	-	-	-	2,253,674.22	2,253,674.22
应 付 管 理 人 报 酬	-	-	-	-	-	219,125.08	219,125.08
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	109,562.57	109,562.57
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	130,730.43	130,730.43
应 交 税 费	-	-	-	-	-	510,375.94	510,375.94
其 他 负 债	-	-	-	-	-	73,940.38	73,940.38
负 债	-	-	-	-	-	3,297,408.62	3,297,408.62

总计							
利率敏感 度缺口	129,616,866.97	52,576,670.52	185,725,978.75	198,214,049.55	67,641,074.13	1,333,163.45	635,107,803.37
上年度末 2023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	116,987,326.69	-	-	-	-	-	116,987,326.69
结算备付金	2,347,110.21	-	-	-	-	-	2,347,110.21
存出保证金	14,481.52	-	-	-	-	-	14,481.52
交易性金融资产	61,371,929.52	91,259,367.71	249,966,027.78	375,281,465.06	12,914,651.13	-	790,793,441.20
买入返	365,096,370.02	-	-	-	-	-	365,096,370.02

售金融资产							
应收申购款	-	-	-	-	-	81,684,535.86	81,684,535.86
资产总计	545,817,217.96	91,259,367.71	249,966,027.78	375,281,465.06	12,914,651.13	81,684,535.86	1,356,923,265.50
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	229,033.69	229,033.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	195,974.51	195,974.51
应付托管费	-	-	-	-	-	97,987.27	97,987.27
应付清算款	-	-	-	-	-	107,100,483.56	107,100,483.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-	146,099.93	146,099.93

应 交 税 费	-	-	-	-	-	544,762.69	544,762.69
其 他 负 债	-	-	-	-	-	584,450.91	584,450.91
负 债 总 计	-	-	-	-	-	108,898,792.56	108,898,792.56
利 率 敏 感 度 缺 口	545,817,217.96	91,259,367.71	249,966,027.78	375,281,465.06	12,914,651.13	-27,214,256.70	1,248,024,472.94

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；		
	利率变动范围合理。		
	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）
分析	基准点利率减少 0.1%	1,154,869.65	1,043,421.14
	基准点利率增加 0.1%	-1,154,869.65	-1,043,421.14

注：1、上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响；

- 2、本期末时间为 2024 年 12 月 31 日；
- 3、资产负债表日基金资产净值的影响金额单位为人民币元。

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。本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

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或银行间同业市场交易的固定收益品种，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中债券资产的比例不低于基金资产的 80%。本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	556,699,193.72	87.65	790,793,441.20	63.36
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	556,699,193.72	87.65	790,793,441.20	63.36

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；
	以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值风险变量保

	持不变。		
	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）
分析	业绩比较基准减少 1%	-2, 128, 343. 27	-8, 729, 606. 67
	业绩比较基准增加 1%	2, 128, 343. 27	8, 729, 606. 67

注：1、本基金管理人运用资本-资产定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响；

2、本期末时间为 2024 年 12 月 31 日；

3、资产负债表日基金资产净值的影响金额单位为人民币元。

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	556, 699, 193. 72	790, 793, 441. 20
第三层次	-	-
合计	556, 699, 193. 72	790, 793, 441. 20

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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

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均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 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事项。

§ 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	556,699,193.72	87.20
	其中：债券	556,699,193.72	87.20
	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	66,995,129.10	10.49
	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	10,066,912.95	1.58
8	其他各项资产	4,643,976.22	0.73
9	合计	638,405,211.99	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

本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2 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。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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	72,922,385.23	11.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	305,835,405.66	48.15
	其中：政策性金融债	255,208,893.33	40.18
4	企业债券	9,071,118.65	1.43
5	企业短期融资券	20,372,784.93	3.21
6	中期票据	75,388,533.27	11.87
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	73,108,965.98	11.51
10	合计	556,699,193.72	87.65

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	019706	23 国债 13	701,000	71,197,689.18	11.21
2	230210	23 国开 10	600,000	65,916,378.08	10.38
3	240203	24 国开 03	600,000	63,193,934.43	9.95
4	230208	23 国开 08	600,000	63,087,484.93	9.93
5	210203	21 国开 03	600,000	63,011,095.89	9.92

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

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

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

本基金本报告期末投资国债期货。

8.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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本期末未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。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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	13,404.15
2	应收清算款	609,741.81
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	4,020,830.26
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,643,976.22

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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 (%)
华宸稳健 债券 A	5,125	20,802.51	59.27	—	106,612,782.20	100.00
华宸稳健 债券 C	13,234	29,837.50	82,351,065.61	20.86	312,518,367.53	79.14
合计	18,359	27,315.34	82,351,124.88	16.42	419,131,149.73	83.58

注：① 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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	华宸稳健债券 A	1,852.14	0.0017
	华宸稳健债券 C	1,009.03	0.0003
	合计	2,861.17	0.0006

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	华宸稳健债券 A	—
	华宸稳健债券 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华宸稳健债券 A	—
	华宸稳健债券 C	0~10
	合计	0~10

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C
基金合同生效日 (2018 年 8 月 24 日) 基金份额总额	12,574,950.54	—
本报告期期初基金份 额总额	5,765,156.71	1,023,101,231.36
本报告期基金总申购 份额	157,183,105.56	2,400,669,849.05
减：本报告期基金总 赎回份额	56,335,420.80	3,028,901,647.27
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	106,612,841.47	394,869,433.14

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

(1) 报告期内基金管理人重大人事变动

公司自收到《关于对聂志刚担任华宸未来基金管理有限公司督察长的无异议函》，督察长聂志刚先生于 2024 年 1 月 9 日起正式履职。聂志刚先生任职之日起，管华先生不再代任公司督察长。

经公司第四届董事会第十八次会议决议，任命邓升军先生为公司总经理，自邓升军先生任职之日起，孙琦先生不再代任公司总经理。公司总经理邓升军于 2024 年 6 月 4 日起正式履职。

公司首席信息官管华先生于 2024 年 7 月 15 日离任，自管华先生离任之日起，由总经理邓升军先生代任公司首席信息官。

公司新任首席信息官刘宇先生于 2024 年 8 月 22 日任职，自刘宇先生任职之日起，邓升军

先生不再代任公司首席信息官。

(2) 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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘任的会计师事务所由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）变更为容诚会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

本报告期内，管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

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 (%)	
海通证券	2	-	-	150,900.05	89.84	-
兴业证券	2	-	-	11,190.53	6.66	-
西藏东方财富证券	1	-	-	5,879.72	3.50	-

注：1、基金选择代理证券买卖的证券经营机构并租用其专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；财务状况良好，经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需

定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告；2、基金租用专用交易单元的程序：本基金管理人根据上述标准考察证券经营机构，考察结果经公司领导审批后，与被选中的证券经营机构签订《券商交易单元租用协议》并办理基金专用交易单元租用手续；交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

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(%)
海通证券	1,509,000,053.29	94.74	9,849,910,000.00	70.89	-	-
兴业证券	22,686,208.00	1.42	1,372,600,000.00	9.88	-	-
西藏东方财富证券	61,187,861.00	3.84	2,672,600,000.00	19.23	-	-

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	华宸未来基金管理有限公司关于旗下证券投资基金 2023 年度最后一个市场交易日基金份额净值和基金份额累计净值公告	本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 1 日
2	华宸未来基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、证券时报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 10 日
3	华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	上海证券报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 19 日
4	华宸未来稳健添利债券型证券投资基金恢复大额申购（含定投）、大额转换转入公告	上海证券报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 26 日
5	华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2023 年年度报告	上海证券报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 27 日

6	华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	上海证券报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 19 日
7	华宸未来基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、证券时报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 5 日
8	华宸未来基金旗下部分开放式基金增加乾道基金销售有限公司为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 7 日
9	华宸未来基金管理有限公司关于旗下证券投资基金 2024 年半年度最后一日基金份额净值和基金份额累计净值的公告	本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 1 日
10	华宸未来基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、证券时报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 17 日
11	华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	上海证券报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 19 日
12	华宸未来稳健添利债券型证券投资基金（华宸稳健债券 A 份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 26 日
13	华宸未来稳健添利债券型证券投资基金（华宸稳健债券 C 份额）基金产品资料概要更新	上海证券报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 26 日
14	华宸未来稳健添利债券型证券投资基金更新招募说明书（2024 年第 1 号）	上海证券报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 26 日
15	华宸未来基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加贵州省贵文文化基金销售有限公司为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 8 月 13 日
16	华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2024 年中期报告	上海证券报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 8 月 23 日
17	华宸未来基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、证券时报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 8 月 24 日
18	华宸未来基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加麦高证券有限责	上海证券报、证券时报、本公司网站及中国	2024 年 9 月 24 日

	任公司为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	证监会基金电子披露网站	
19	华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	上海证券报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 24 日
20	华宸未来基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、证券时报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 26 日
21	华宸未来基金管理有限公司基金改聘会计师事务所公告	上海证券报、证券时报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 21 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 (%)
产品特有风险							
本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，存在以下特有风险： （1）持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的基金净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的流动性风险；（3）持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险；（4）本年度管理人旗下所管理的产品，作为一致行动人进行合并计算；（5）管理人自有资金作为一致行动人进行合并计算。							

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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、中国证监会批准本基金设立的文件；
- 2、《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站 (<http://www.hcmirae.com>) 查阅, 或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查询。

华宸未来基金管理有限公司

2025 年 3 月 27 日

华宸未来稳健添利债券型证券投资基金

2024 年年度报告

董事审阅意见

本人已阅读华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2024 年年度报告，并知晓本报告内容。

本人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。

董事签字： 

日期： 2025.3.21

华宸未来稳健添利债券型证券投资基金

2024 年年度报告

董事审阅意见

本人已阅读华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2024 年年度报告，并知晓本报告内容。

本人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。

董事签字：



日期：

3.21

华宸未来稳健添利债券型证券投资基金

2024 年年度报告

董事审阅意见

本人已阅读华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2024 年年度报告，并知晓本报告内容。

本人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。

董事签字: LZZ SUNG WON

日期: 2025.3.17

华宸未来稳健添利债券型证券投资基金

2024 年年度报告

董事审阅意见

本人已阅读华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2024 年年度报告，并知晓本报告内容。

本人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。

董事签字： 陈弘毅

日期： 2025年3月14日

华宸未来稳健添利债券型证券投资基金

2024 年年度报告

董事审阅意见

本人已阅读华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2024 年年度报告，并知晓本报告内容。

本人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。

董事签字： 顾晶

日期： 2025.3.18

华宸未来稳健添利债券型证券投资基金

2024 年年度报告

董事审阅意见

本人已阅读华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2024 年年度报告，并知晓本报告内容。

本人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。

董事签字： 郭明
2025.3.19
日期：

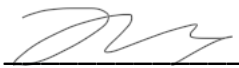
华宸未来稳健添利债券型证券投资基金

2024 年年度报告

董事审阅意见

本人已阅读华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2024 年年度报告，并知晓本报告内容。

本人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。

董事签字： 

日期： 2025/03/17

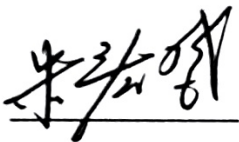
华宸未来稳健添利债券型证券投资基金

2024 年年度报告

董事审阅意见

本人已阅读华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2024 年年度报告，并知晓本报告内容。

本人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。

董事签字： 

日期： 