

海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金  
2024 年年度报告  
2024 年 12 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年三月三十一日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 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
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
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	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	21
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	21
§ 5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	21
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	21
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	21
§ 6 审计报告	21
6.1 审计意见	22
6.2 形成审计意见的基础	22
6.3 其他信息	22
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	22
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	23
§ 7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表	24
7.2 利润表	25
7.3 净资产变动表	26
7.4 报表附注	28
§ 8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
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	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	80

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	83
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 .....	83
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 .....	83
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 .....	84
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 .....	84
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	84
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	84
8.12 投资组合报告附注 .....	84
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>85</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	85
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	86
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的情况 .....	86
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 .....	86
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>86</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>87</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	87
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 .....	87
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	87
11.4 基金投资策略的改变 .....	87
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	87
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 .....	87
11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	87
11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	88
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	88
11.8 其他重大事件 .....	89
<b>12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>91</b>
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>93</b>
13.1 备查文件目录 .....	93
13.2 存放地点 .....	93
13.3 查阅方式 .....	93



## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	海富通欣荣混合	
基金主代码	519223	
交易代码	519223	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 22 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	107,342,379.89 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
下属分级基金的交易代码	519224	519223
报告期末下属分级基金的份 额总额	105,651,523.29 份	1,690,856.60 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金坚持灵活的资产配置,在严格控制下跌风险的基础上,积极把握证券市场的投资机会,追求资产的保值增值。
投资策略	本基金的资产配置策略以基金的投资目标为中心,首先按照投资时钟理论,根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段,作出权益类资产的初步配置,并根据投资时钟判断大致的行业配置;其次结合证券市场趋势指标,判断证券市场指数的大致风险收益比,从而做出权益类资产的具体仓位选择。债券投资采取“自上而下”的策略,深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以价值发现为基础,在市场创新和变化中寻找投资机会,采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略和套利等积极投资管理方式,确定和构造

	合理的债券组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	方圆
	联系电话	021-38650788	95559
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559
传真		021-33830166	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
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	中国（上海）长宁区仙霞路 18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		路颖	任德奇

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
基金年度报告备置地点	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
----	----	------

会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	
	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
本期已实现收益	11,696,044.68	646,382.41	-46,643,333.73	-9,827,710.66	-14,890,134.18	-4,843,369.34
本期利润	8,811,517.09	6,209,431.19	-42,266,445.73	-10,238,618.95	-72,892,953.37	-29,065,265.85
加权平均基金份额本期利润	0.0321	0.2095	-0.1650	-0.1619	-0.6187	-0.6910
本期加权平均净值利润率	2.86%	18.94%	-13.18%	-12.94%	-36.34%	-40.30%
本期基金份额净值增长率	4.79%	4.62%	-8.04%	-8.23%	-24.39%	-24.54%

3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
期末可供分配利润	15,874,612.53	233,931.11	21,837,405.64	4,183,156.23	28,723,641.91	908,157.78
期末可供分配基金份额利润	0.1503	0.1384	0.0666	0.0573	0.5107	0.5046
期末基金资产净值	122,031,098.52	1,935,409.42	361,286,881.06	79,812,110.37	84,971,804.14	2,707,904.29
期末基金份额净值	1.1550	1.1446	1.1022	1.0941	1.5107	1.5046
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
基金份额累计净值增长率	45.57%	44.45%	38.92%	38.08%	51.07%	50.46%

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

##### 1. 海富通欣荣混合 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	-4.31%	1.72%	0.48%	0.87%	-4.79%	0.85%
过去六个月	0.24%	1.57%	9.42%	0.83%	-9.18%	0.74%
过去一年	4.79%	1.41%	12.46%	0.67%	-7.67%	0.74%
过去三年	-27.14%	1.16%	-1.26%	0.58%	-25.88%	0.58%
过去五年	11.81%	1.22%	13.93%	0.61%	-2.12%	0.61%
自基金合同生效起至今	45.57%	1.10%	35.52%	0.58%	10.05%	0.52%

##### 2. 海富通欣荣混合 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	-4.36%	1.72%	0.48%	0.87%	-4.84%	0.85%
过去六个月	0.14%	1.58%	9.42%	0.83%	-9.28%	0.75%
过去一年	4.62%	1.41%	12.46%	0.67%	-7.84%	0.74%
过去三年	-27.55%	1.16%	-1.26%	0.58%	-26.29%	0.58%
过去五年	10.73%	1.22%	13.93%	0.61%	-3.20%	0.61%
自基金合同生效起至今	44.45%	1.10%	35.52%	0.58%	8.93%	0.52%

#### 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

海富通欣荣灵活配置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的历史走势对比图

## 1. 海富通欣荣混合 A

(2016 年 9 月 22 日至 2024 年 12 月 31 日)



## 2. 海富通欣荣混合 C

(2016 年 9 月 22 日至 2024 年 12 月 31 日)



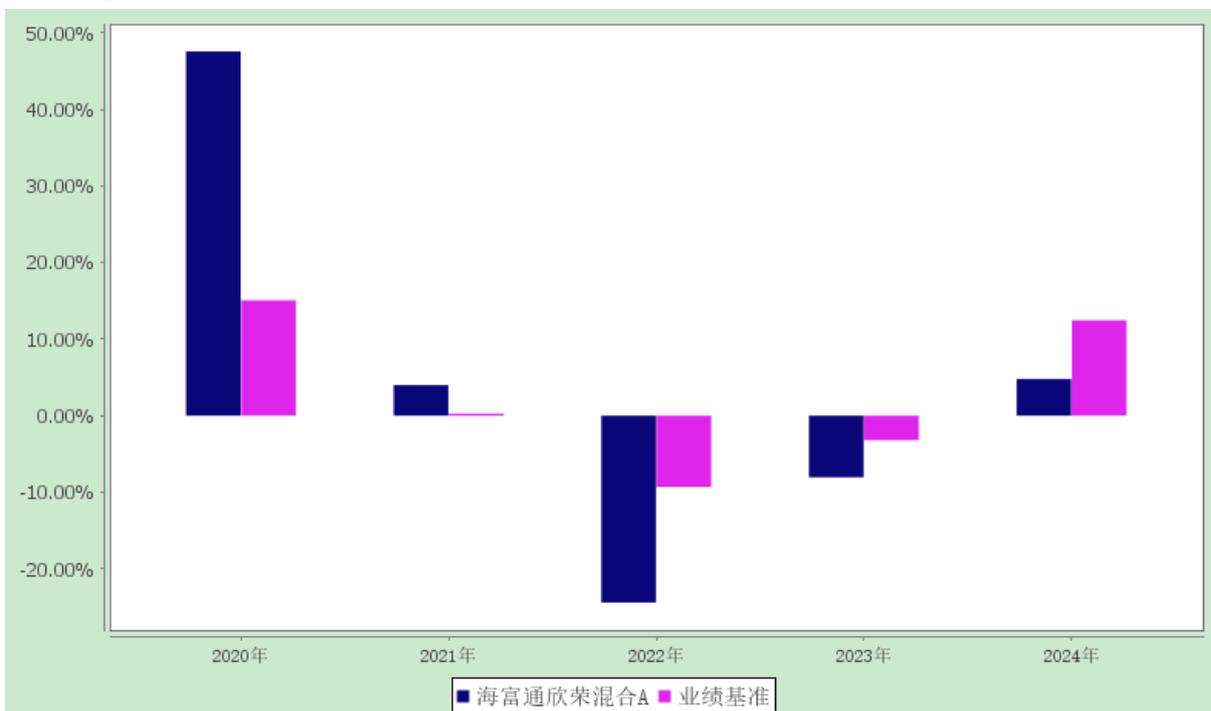
注：本基金合同于 2016 年 9 月 22 日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

### 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

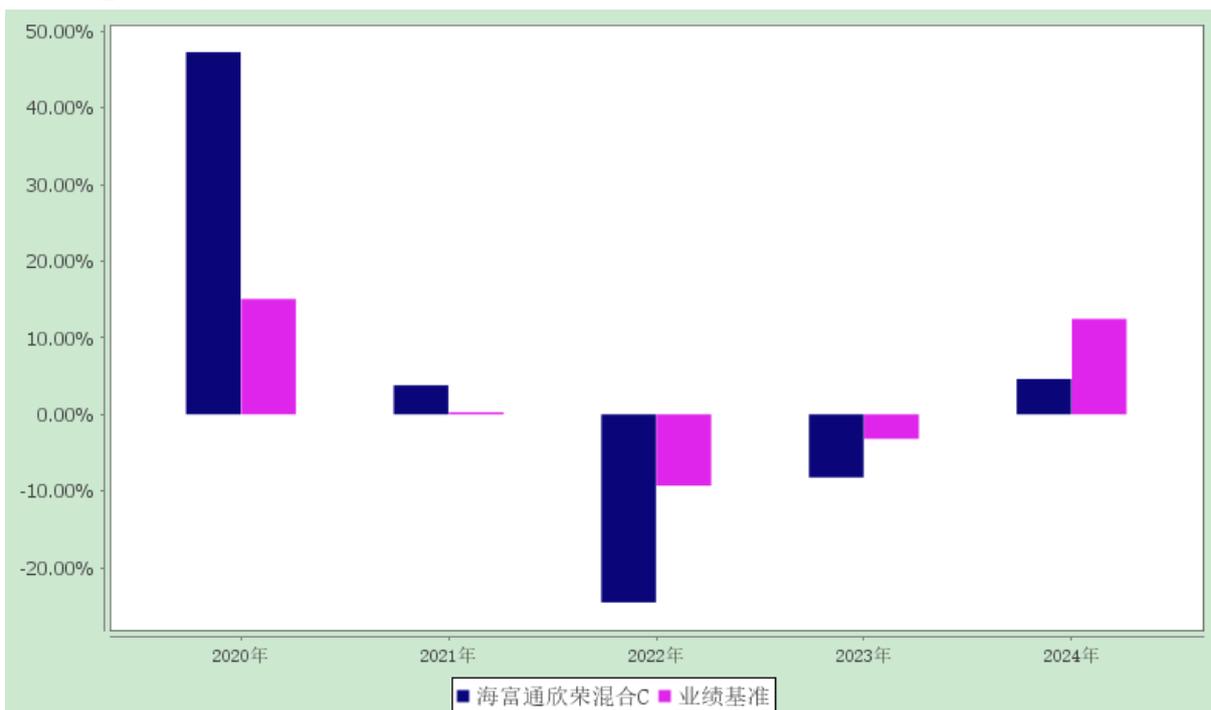
海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金

过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

#### 1. 海富通欣荣混合 A



#### 2. 海富通欣荣混合 C



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 1、海富通欣荣混合 A:

单位：人民币元

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	3.159	68,964,400.20	54,313,844.98	123,278,245.18	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	3.159	68,964,400.20	54,313,844.98	123,278,245.18	-

#### 2、海富通欣荣混合 C:

单位：人民币元

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	3.159	44,127,915.94	284,431.59	44,412,347.53	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	3.159	44,127,915.94	284,431.59	44,412,347.53	-

## §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 12 月 31 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 A100 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、海富通量化选股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		
杜晓海	本基金的基金经理；总经理助理。	2016-09-28	-	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。

				<p>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 月至 2024 年 9 月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。</p>
--	--	--	--	---

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。

#### 4.1.3 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
----	------	---------	---------	------

杜晓海	公募基金	8	1,699,854,288.77	2016/06/22
	私募资产管理计划	2	395,716,104.78	2024/11/18
	其他组合	1	273,254,028.49	2021/06/28
	合计	11	2,368,824,422.04	-

注：表内任职日期为基金经理加入公司以来首次开始管理各类产品的时间。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现直接挂钩的情况。

#### 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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了一级市场和二级市场的所有投资交易管理活动以及公司内部的证券分配，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

##### 4.3.2 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同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金的投资运作符合法律法规和基金合同的规定，未发生内幕交易、

操纵市场、不当关联交易以及其他损害委托人利益的违规行为。本基金与本基金管理人所管理的其他资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待、独立运作。本基金的基金经理同时兼任私募资产管理计划的投资经理，公司根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，对相关基金经理的同反向交易、交易价差等加强了管理、监控和分析。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金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

2024年，国内经济整体维持弱修复状态，实际GDP同比实现5%增长，高于2022-2023年的复合增速4.3%。物价也保持相对平稳，全年居民消费价格指数同比上涨0.2%。从节奏上看，年初经济实现开门红，二季度经济增长开始放缓。但是，随着9月24日以来一系列宏观政策持续加码，市场信心开始回暖，房地产成交显著放量，居民消费开始好转，股市也震荡走强，最终四季度实际GDP实现了5.4%的增长。

海外经济方面，2024年美国积极的财政和宽松的货币政策共同支撑其国内经济。随着美国通胀开始降温，9月美联储启动了降息，年内累计降息100BP，2024财年财政赤字率达到了6.6%，高于2023年的6.2%。在宽松货币政策和积极财政政策下，短期美国经济还难言衰退。此外，特朗普赢得了美国总统大选，需要关注未来中美关系及特朗普对华政策变化。

本报告期内，在大盘上半年震荡下跌、下半年大幅反弹的背景下，因子方面，上半年基本面类因子表现较好，价量表现较差。下半年发生了较为剧烈的风格反转，基本面因子的超额收益持续回撤，而价量因子表现回暖。风格的剧烈切换对超额收益造成了较大的负面影响。9月下旬市场发生反转后，量化模型的常用因子集体阶段性失效，超额收益亦受到负面影响。但这一现象在11月后有所缓解，超额收益开始回升。

行业方面，截止报告期末相对沪深300，本基金显著超配了景气度较好的电子、通信行业，显著低配了金融板块、食品饮料。其余行业配置相对均衡。组合风格上偏向高景气和基本面类因子，根据公司基本面在业绩和估值匹配的公司中寻找投资机会，同时积极运用量价模型在低关注股票中挖掘机会。本基金通过多策略并行的方式，力争在风险可控的基础上为投资者赢得收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通欣荣混合 A 净值增长率为 4.79%，同期业绩比较基准收益率为 12.46%。海富通欣荣混合 C 净值增长率为 4.62%，同期业绩比较基准收益率为 12.46%。

#### 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，2025 年美国财政刺激力度依然不弱，叠加降息周期还没结束，居民和企业部门资产负债表相对健康，短期美国经济还难言衰退。不过，随着特朗普关税、移民、减税等政策落地，美国通胀压力可能会抬升，美联储的降息节奏和幅度可能还存在变数，经济也存在滞胀风险。同时，美国债务上限问题依旧困扰财政政策，下半年国债发行冲击可能导致美债收益率冲高，这对全球金融市场、各类资产都将产生较为显著的影响，未来需要密切跟踪。

从市场方向看，当前中国经济持续修复，随着 924 以来一系列政策出台，官方积极回应市场的关切，市场信心已较大改善，上证指数震荡走高，2024 年第 4 季度 GDP 增速也超预期增长，相关政策对经济有提振作用。在最新中央经济工作会议中，提出了“稳住楼市股市”、“创新金融工具，维护金融市场稳定”等，我们认为国内资本市场风险可控，积极可为。展望未来，我们对 A 股充满信心，将积极跟踪国内政策和经济的变化，把握投资机会。

投资策略上，我们将坚持多策略并行，一方面通过基本面策略跟踪公司的业绩，挖掘估值与成长相匹配、具备投资价值的好公司，另一方面通过深度学习策略在交易中获取超额，力争在风险可控的基础上跑赢市场。同时，我们会根据期货基差以及模型超标的情况，动态调整不同策略单元的权重和整体的权益权重。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过业务审核、合规检查、系统监控、重点抽查、专项审计等一系列方式开展工作，强化基金运作和公司运营的合规性，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

##### 一、加强合规管理，持续完善公司的规章制度体系

报告期内，坚持以法律法规和公司制度为依据，对公司和基金运作的各项业务开展提供全面的合规咨询、审核、监测与检查，确保基金运作的合法合规性。根据法律法规、监管政策的变化，结合业务发展及公司管理需要，对公司内控制度体系进行了完善和全面梳理，新增和修订了多项内部制度和流程，提升了公司的合规管理水平。

##### 二、客观开展内外部内控评估，进一步优化内控措施

根据法规、监管要求并结合风险导向和全覆盖原则，公司继续通过日常业务的定期合规检查、不定期自查等方式，重点关注规章制度的执行情况、第一道防线风险控制的有效性和投资运作与产品合同约定的一致性。同时，对各部门的业务有重点的开展了多项专项检查和内部审计。另外，根据法规和公司管理需要，公司聘请会计师事务所等外部专业机构对公司开展了内部控制评价等方面的审计。通过内外部审计及合规检查，审

视法律法规和监管要求的落实情况、监督公司制度流程的执行情况，及时发现存在的问题，并通过加强跨部门的协作沟通，形成合力，认真整改，进一步健全完善了公司的内部控制体系。

### 三、有效推进反洗钱与反恐怖融资工作

报告期内，结合反洗钱法规及公司业务特点完善了反洗钱制度，组织多场反洗钱培训和宣传活动；基于风险为本的工作思路，继续开展客户信息数据治理工作，稳步推进代销机构分类管理工作，持续优化监测模型，强化可疑交易监控，并按时向中国反洗钱监测分析中心报送相关数据。报告期内，公司根据监管要求完成了各项洗钱固有风险评估及洗钱风险控制措施有效性调查工作，有效管控公司洗钱固有风险敞口。另外，公司加大反洗钱课题研习工作力度，组织反洗钱专兼职人员深入开展相关课题研究和投稿，提升反洗钱工作质效。

### 四、强化合规文化培训，提升员工的合规及风险意识

本报告期内，为提高公司全员的合规意识，加大了合规培训力度，强化主动合规意识培育。公司进一步加强组织各类合规培训频率，及时对法规、监管精神和公司要求进行宣导，并通过制作合规法务月刊、开展“合规文化宣传月”主题活动等多样化的合规宣传培训方式进一步提高法律法规宣导工作的及时性，丰富合规宣导工作的形式，激发全体员工学习合规内控政策的积极性，营造合规文化浓厚氛围。通过培训，增强了全体员工的合规意识和风险防范意识，提升了员工的主动识别和控制业务风险的积极性和能力。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金财产安全、合规、诚信运作。

## 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，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 10%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

#### 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

本基金本报告期无需要说明的情形。

### §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，基金托管人在海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，海富通基金管理有限公司在海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金投资运作、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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### §6 审计报告

毕马威华振审字第 2502196 号

海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

## 6.1 审计意见

我们审计了后附的海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“该基金”)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中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 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”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金 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。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“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,我们独立于该基金,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。

## 6.3 其他信息

该基金管理人海富通基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,

使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

## 6.5 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)评价该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)对该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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。

(5)评价财务报表的总体列报（包括披露）、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。

我们与该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。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师  
虞京京 何晨  
北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层  
2025 年 3 月 27 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	1,427,521.72	11,682,588.44
结算备付金		1,162,151.35	10,149,972.83
存出保证金		159,326.87	1,487,094.89
交易性金融资产	7.4.7.2	122,083,417.58	426,612,738.40
其中：股票投资		115,796,018.78	405,510,557.25
基金投资		-	-
债券投资		6,287,398.80	21,102,181.15
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	-	-
应收清算款		-	447,220.20
应收股利		-	-
应收申购款		41.00	29.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		124,832,458.52	450,379,644.74
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		299,734.24	7,734,809.56
应付赎回款		114.49	2,223.05
应付管理人报酬		65,050.42	243,774.21
应付托管费		16,262.62	60,943.58
应付销售服务费		330.93	13,551.17
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	484,457.88	1,225,351.74
负债合计		865,950.58	9,280,653.31
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.7	107,342,379.89	400,749,220.71
未分配利润	7.4.7.8	16,624,128.05	40,349,770.72
净资产合计		123,966,507.94	441,098,991.43
负债和净资产总计		124,832,458.52	450,379,644.74

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.1550 元，C 类基金份额净值 1.1446 元。基金份额总额 107,342,379.89 份，其中 A 类基金份额 105,651,523.29 份，C 类基金份额 1,690,856.60 份。

## 7.2 利润表

会计主体：海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		17,866,127.51	-49,188,214.54
1.利息收入		177,211.66	366,384.32
其中：存款利息收入	7.4.7.9	175,340.35	359,214.19
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		1,871.31	7,170.13

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,008,169.94	-53,821,372.78
其中：股票投资收益	7.4.7.10	5,920,676.76	-63,409,888.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	562,088.47	608,211.40
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	206,436.05	-1,782,534.25
股利收益	7.4.7.14	8,318,968.66	10,762,838.50
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	2,678,521.19	3,965,979.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	2,224.72	300,794.21
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,845,179.23</b>	<b>3,316,850.14</b>
1. 管理人报酬		2,052,589.64	2,367,988.41
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		513,147.48	591,997.20
3. 销售服务费		67,669.53	155,671.43
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		5,919.30	332.55
8. 其他费用	7.4.7.17	205,853.28	200,860.55
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>15,020,948.28</b>	<b>-52,505,064.68</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>15,020,948.28</b>	<b>-52,505,064.68</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>15,020,948.28</b>	<b>-52,505,064.68</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金

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	400,749,220.71	-	40,349,770.72	441,098,991.43
二、本期期初净资产	400,749,220.71	-	40,349,770.72	441,098,991.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-293,406,840.82	-	-23,725,642.67	-317,132,483.49
（一）、综合收益总额	-	-	15,020,948.28	15,020,948.28
（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）	-293,406,840.82	-	-38,746,590.95	-332,153,431.77
其中：1. 基金申购款	648,319.34	-	99,044.36	747,363.70
2. 基金赎回款	-294,055,160.16	-	-38,845,635.31	-332,900,795.47
（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	107,342,379.89	-	16,624,128.05	123,966,507.94
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	58,047,908.74	-	29,631,799.69	87,679,708.43
二、本期期初净资产	58,047,908.74	-	29,631,799.69	87,679,708.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	342,701,311.97	-	10,717,971.03	353,419,283.00

(一)、综合收益总额	-	-	-52,505,064.68	-52,505,064.68
(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)	342,701,311.97	-	230,913,628.42	573,614,940.39
其中: 1. 基金申购款	532,459,908.06	-	269,531,962.01	801,991,870.07
2. 基金赎回款	-189,758,596.09	-	-38,618,333.59	-228,376,929.68
(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)	-	-	-167,690,592.71	-167,690,592.71
四、本期期末净资产	400,749,220.71	-	40,349,770.72	441,098,991.43

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：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

海富通欣荣灵活配置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[2016]1480 号《关于准予海富通欣荣灵活配置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《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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 450,020,570.20 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1193 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 450,135,331.01 份，其中认购资金利息折合 114,760.81 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《海富通欣荣灵活配

置混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、权证、股指期货等权益类品种，债券等固定收益类品种（包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等），国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。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。本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

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 2025 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、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

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券投资、衍生工具等。

本基金通常根据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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

**(b) 金融负债的分类**

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无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。

**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****(a) 金融工具的初始确认**

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

**(b) 后续计量**

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

**(c) 金融工具的终止确认**

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 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；

- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

#### 预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

#### 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

#### 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在

本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金

申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

##### 投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

##### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 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逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 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股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)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》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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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[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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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号文《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号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

(b)对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公司（“挂牌公司”）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。

(d)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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

#### 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	1,427,521.72	11,682,588.44
等于：本金	1,427,393.16	11,679,408.34
加：应计利息	128.56	3,180.10
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	1,427,521.72	11,682,588.44

## 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		111,239,278.65	-	115,796,018.78	4,556,740.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	6,205,463.38	78,118.80	6,287,398.80	3,816.62
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,205,463.38	78,118.80	6,287,398.80	3,816.62
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		117,444,742.03	78,118.80	122,083,417.58	4,560,556.75
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		403,707,844.11	-	405,510,557.25	1,802,713.14
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-

债券	交易所市场	20,712,667.58	400,111.15	21,102,181.15	-10,597.58
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	20,712,667.58	400,111.15	21,102,181.15	-10,597.58
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		424,420,511.69	400,111.15	426,612,738.40	1,792,115.56

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 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	10,277,480.00	-	-	-
——股指期货	10,277,480.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,277,480.00	-	-	-

### 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

本基金于本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有从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其他资产无余额。

**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	-	0.45
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	319,457.88	1,065,351.29
其中：交易所市场	319,457.88	1,065,351.29
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	165,000.00	160,000.00
合计	484,457.88	1,225,351.74

**7.4.7.7 实收基金****海富通欣荣混合 A**

金额单位：人民币元

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	327,798,186.97	327,798,186.97
本期申购	219,111.65	219,111.65
本期赎回（以“-”号填列）	-222,365,775.33	-222,365,775.33
本期末	105,651,523.29	105,651,523.29

**海富通欣荣混合 C**

金额单位：人民币元

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	72,951,033.74	72,951,033.74
本期申购	429,207.69	429,207.69
本期赎回（以“-”号填列）	-71,689,384.83	-71,689,384.83
本期末	1,690,856.60	1,690,856.60

**7.4.7.8 未分配利润****海富通欣荣混合 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	21,837,405.64	11,651,288.45	33,488,694.09
本期期初	21,837,405.64	11,651,288.45	33,488,694.09
本期利润	11,696,044.68	-2,884,527.59	8,811,517.09
本期基金份额交易产生的变动数	-17,658,837.79	-8,261,798.16	-25,920,635.95
其中：基金申购款	15,960.20	21,263.02	37,223.22
基金赎回款	-17,674,797.99	-8,283,061.18	-25,957,859.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,874,612.53	504,962.70	16,379,575.23

**海富通欣荣混合 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	4,183,156.23	2,677,920.40	6,861,076.63
本期期初	4,183,156.23	2,677,920.40	6,861,076.63
本期利润	646,382.41	5,563,048.78	6,209,431.19
本期基金份额交易产生的变动数	-4,595,607.53	-8,230,347.47	-12,825,955.00
其中：基金申购款	23,091.01	38,730.13	61,821.14
基金赎回款	-4,618,698.54	-8,269,077.60	-12,887,776.14

本期已分配利润	-	-	-
本期末	233,931.11	10,621.71	244,552.82

#### 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	83,529.57	129,801.54
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	88,814.16	167,547.08
其他	2,996.62	61,865.57
合计	175,340.35	359,214.19

#### 7.4.7.10 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
卖出股票成交总额	2,523,934,947.69	1,988,183,371.36
减：卖出股票成本总额	2,513,496,713.43	2,046,594,026.12
减：交易费用	4,517,557.50	4,999,233.67
买卖股票差价收入	5,920,676.76	-63,409,888.43

#### 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	331,318.40	391,412.76
债券投资收益——买卖债券(债转股及 债券到期兑付)差价收入	230,770.07	216,798.64
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	562,088.47	608,211.40

#### 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	103,241,594.41	36,261,854.98
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	101,343,648.98	35,609,621.73
减：应计利息总额	1,665,879.67	435,270.98
减：交易费用	1,295.69	163.63
买卖债券差价收入	230,770.07	216,798.64

#### 7.4.7.12 贵金属投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.13 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12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
股指期货投资收益（税前）	307,460.00	-1,729,980.00
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	48,983.30	2,552.62
减：交易费用	52,040.65	50,001.63
合计	206,436.05	-1,782,534.25

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
股票投资产生的股利收益	8,318,968.66	10,762,838.50
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	8,318,968.66	10,762,838.50

## 7.4.7.15 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	2,768,441.19	3,876,059.71
——股票投资	2,754,026.99	3,894,130.58
——债券投资	14,414.20	-18,070.87
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-89,920.00	89,920.00
——权证投资	-	-
——股指期货	-89,920.00	89,920.00
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	2,678,521.19	3,965,979.71

## 7.4.7.16 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	2,224.72	300,794.21
合计	2,224.72	300,794.21

### 7.4.7.17 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	45,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	110,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	3,653.28	3,660.55
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他费用	1,200.00	1,200.00
合计	205,853.28	200,860.55

### 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日出具《关于同意国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司并募集配套资金注册、核准国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司、海富通基金管理有限公司变更主要股东及实际控制人、富国基金管理有限公司变更主要股东、海通期货股份有限公司变更主要股东及实际控制人的批复》（证监许可〔2025〕96 号）核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持海富通基金管理有限公司股权亦归属于合并后的国泰君安，即合并后的国泰君安成为海富通基金管理有限公司的主要股东，上海国际集团有限公司成为海富通基金管理有限公司实际控制人。

### 7.4.9 关联方关系

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、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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
法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东
上海富诚海富通资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	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	190,304,912.63	4.01%	239,793,410.41	5.51%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

##### 7.4.10.1.3 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12月31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	139,911.25	4.74%	196.17	0.06%
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	176,058.89	5.52%	96,335.72	9.04%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金管理人提

供的证券投资研究服务等。

2.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。公司的该类佣金协议符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

## 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	2,052,589.64	2,367,988.41
其中：应支付销售机构的客户维护费	15,569.98	19,528.65
应支付基金管理人的净管理费	2,037,019.66	2,348,459.76

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 0.60%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 x0.60%/当年天数。

### 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	513,147.48	591,997.20

注：支付基金托管人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 x0.15%/当年天数。

### 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		
	海富通欣荣混合A	海富通欣荣混合C	合计
海通证券	-	3.66	3.66
海富通	-	61,604.47	61,604.47
合计	-	61,608.13	61,608.13
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		
	海富通欣荣混合A	海富通欣荣混合C	合计
海通证券	-	3.65	3.65
海富通	-	148,551.42	148,551.42
合计	-	148,555.07	148,555.07

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 0.20%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

#### 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

本基金在本报告期内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

本基金在本报告期内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

本基金在本报告期内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**

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

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。

**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
	交通银行	1,427,521.72	83,529.57	11,682,588.44

**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。

**7.4.10.8 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。

**7.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未实施利润分配。

**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。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000777	中核科技	2024-12-30	重大事项	18.07	2025-01-14	19.88	200	2,678.28	3,614.00	-
002252	上海莱士	2024-12-23	重大事项	7.22	2025-01-07	6.93	43,000	296,341.04	310,460.00	-

688139	海尔生物	2024-12-23	重大事项	35.20	2025-01-07	30.60	130	4,320.96	4,576.00	-
--------	------	------------	------	-------	------------	-------	-----	----------	----------	---

### 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

于 2024 年 12 月 31 日,本基金无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2024 年 12 月 31 日,本基金无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2024 年 12 月 31 日,本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型的证券投资基金,属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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以上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“风险和收益相匹配”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系统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立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。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券（2023 年 12 月 31 日：无）。

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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	6,287,398.80	21,102,181.15
合计	6,287,398.80	21,102,181.15

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、无第三方评级机构评级的债券。

#### 7.4.13.3 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 7.4.12 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。

##### 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该比例限制）。

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 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%。

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。

#### **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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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	1,427,521.72	-	-	-	1,427,521.72
结算备付金	1,162,151.35	-	-	-	1,162,151.35
存出保证金	159,326.87	-	-	-	159,326.87
交易性金融资产	6,287,398.80	-	-	115,796,018.78	122,083,417.58
应收申购款	-	-	-	41.00	41.00
资产总计	9,036,398.74	-	-	115,796,059.78	124,832,458.52
负债					
应付清算款	-	-	-	299,734.24	299,734.24
应付赎回款	-	-	-	114.49	114.49
应付管理人报酬	-	-	-	65,050.42	65,050.42
应付托管费	-	-	-	16,262.62	16,262.62
应付销售服务费	-	-	-	330.93	330.93
其他负债	-	-	-	484,457.88	484,457.88
负债总计	-	-	-	865,950.58	865,950.58
利率敏感度缺口	9,036,398.74	-	-	114,930,109.20	123,966,507.94
上年度末 2023年12月 31日					

资产					
货币资金	11,682,588.44	-	-	-	11,682,588.44
结算备付金	10,149,972.83	-	-	-	10,149,972.83
存出保证金	243,006.89	-	-	1,244,088.00	1,487,094.89
交易性金融资产	21,102,181.15	-	-	405,510,557.25	426,612,738.40
应收清算款	-	-	-	447,220.20	447,220.20
应收申购款	-	-	-	29.98	29.98
资产总计	43,177,749.31	-	-	407,201,895.43	450,379,644.74
负债					
应付清算款	-	-	-	7,734,809.56	7,734,809.56
应付赎回款	-	-	-	2,223.05	2,223.05
应付管理人报酬	-	-	-	243,774.21	243,774.21
应付托管费	-	-	-	60,943.58	60,943.58
应付销售服务费	-	-	-	13,551.17	13,551.17
其他负债	-	-	-	1,225,351.74	1,225,351.74
负债总计	-	-	-	9,280,653.31	9,280,653.31
利率敏感度缺口	43,177,749.31	-	-	397,921,242.12	441,098,991.43

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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12月31日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-3,977.84	-2,382.82
市场利率下降 25 个基点	3,990.65	2,389.01	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的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，采用“自上而下”的策略，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市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资及存托凭证比例为基金总资产的 0%-95%。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。

##### 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	115,796,018.78	93.41	405,510,557.25	91.93
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	115,796,018.78	93.41	405,510,557.25	91.93

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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12月31日	2023年12月31日
1.业绩比较基准上升 5%	6,198,138.57	17,286,318.77
2.业绩比较基准下降 5%	-6,198,138.57	-17,286,318.77

#### 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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	115,477,368.78	405,067,000.40
第二层次	6,606,048.80	21,102,181.15
第三层次	-	443,556.85
合计	122,083,417.58	426,612,738.40

###### 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。

对于证券交易所上市的股票和债券等，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，本基金分别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不会将相关股票和债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	443,556.85	443,556.85
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	391,698.35	391,698.35
当期利得或损失总额	-	-51,858.50	-51,858.50
其中：计入损益的利得或损失	-	-51,858.50	-51,858.50
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	525,584.52	525,584.52
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	493,738.34	493,738.34
转出第三层次	-	677,686.52	677,686.52
当期利得或损失总额	-	101,920.51	101,920.51
其中：计入损益的利得或损失	-	101,920.51	101,920.51
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	443,556.85	443,556.85
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	205.67	205.67

注：于2024年12月31日，本基金未持有第三层次的交易性金融资产（2023年12月31日：持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投

资)。于2024年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资（2023年度：同）。

计入损益的利得或损失计入利润表中的投资收益及公允价值变动损益项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	443,556.85	亚式期权模型	预期年化波动率	19.62%~194.82%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2023年12月31日：无)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2024年12月31日，本基金无有助于理解和分析会计报表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	115,796,018.78	92.76
	其中：股票	115,796,018.78	92.76
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	6,287,398.80	5.04
	其中：债券	6,287,398.80	5.04
	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	2,589,673.07	2.07
8	其他各项资产	159,367.87	0.13
9	合计	124,832,458.52	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

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	8,550.00	0.01
B	采矿业	2,275,140.14	1.84
C	制造业	83,788,619.40	67.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,195,599.00	2.58
E	建筑业	778,453.00	0.63
F	批发和零售业	1,222,993.34	0.99
G	交通运输、仓储和邮政业	1,833,692.95	1.48
H	住宿和餐饮业	2,934.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,002,084.80	6.46
J	金融业	11,397,062.64	9.19
K	房地产业	726,438.00	0.59
L	租赁和商务服务业	1,046,124.80	0.84
M	科学研究和技术服务业	38,263.80	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	644,283.44	0.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	98,656.00	0.08

Q	卫生和社会工作	40,529.59	0.03
R	文化、体育和娱乐业	696,593.88	0.56
S	综合	-	-
	合计	115,796,018.78	93.41

### 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

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	300750	宁德时代	16,580	4,410,280.00	3.56
2	600487	亨通光电	159,200	2,741,424.00	2.21
3	000997	新大陆	126,500	2,523,675.00	2.04
4	600522	中天科技	171,000	2,448,720.00	1.98
5	000651	格力电器	49,600	2,254,320.00	1.82
6	002475	立讯精密	49,191	2,005,025.16	1.62
7	002463	沪电股份	45,420	1,800,903.00	1.45
8	601688	华泰证券	100,700	1,771,313.00	1.43
9	002371	北方华创	4,300	1,681,300.00	1.36
10	000100	TCL 科技	320,400	1,611,612.00	1.30
11	600066	宇通客车	57,700	1,522,126.00	1.23
12	600900	长江电力	48,600	1,436,130.00	1.16
13	000333	美的集团	18,464	1,388,862.08	1.12
14	603508	思维列控	58,200	1,383,996.00	1.12
15	600519	贵州茅台	800	1,219,200.00	0.98
16	300628	亿联网络	31,400	1,212,040.00	0.98
17	601077	渝农商行	187,800	1,136,190.00	0.92
18	002126	银轮股份	59,400	1,111,968.00	0.90
19	603766	隆鑫通用	120,500	1,096,550.00	0.88
20	603129	春风动力	6,900	1,083,783.00	0.87
21	300433	蓝思科技	49,300	1,079,670.00	0.87
22	000425	徐工机械	134,000	1,062,620.00	0.86
23	601398	工商银行	144,900	1,002,708.00	0.81
24	688093	世华科技	48,905	987,391.95	0.80
25	603258	电魂网络	44,900	893,061.00	0.72
26	300979	华利集团	11,000	865,150.00	0.70
27	600941	中国移动	7,100	838,936.00	0.68

28	600153	建发股份	79,600	837,392.00	0.68
29	002241	歌尔股份	32,400	836,244.00	0.67
30	603296	华勤技术	11,640	825,858.00	0.67
31	301345	涛涛车业	12,400	819,640.00	0.66
32	603283	赛腾股份	11,700	809,172.00	0.65
33	000776	广发证券	49,000	794,290.00	0.64
34	601665	齐鲁银行	140,500	785,395.00	0.63
35	601138	工业富联	35,600	765,400.00	0.62
36	601963	重庆银行	82,400	764,672.00	0.62
37	600873	梅花生物	75,300	755,259.00	0.61
38	002483	润邦股份	142,660	743,258.60	0.60
39	000001	平安银行	62,300	728,910.00	0.59
40	601577	长沙银行	81,900	728,091.00	0.59
41	000400	许继电气	26,098	718,477.94	0.58
42	300679	电连技术	11,594	692,161.80	0.56
43	002311	海大集团	13,920	682,776.00	0.55
44	600131	国网信通	35,800	676,978.00	0.55
45	601169	北京银行	110,000	676,500.00	0.55
46	600750	江中药业	29,800	676,460.00	0.55
47	300476	胜宏科技	16,000	673,440.00	0.54
48	003000	劲仔食品	48,700	667,190.00	0.54
49	600765	中航重机	32,500	665,275.00	0.54
50	600497	驰宏锌锗	118,800	661,716.00	0.53
51	300482	万孚生物	28,400	636,444.00	0.51
52	300308	中际旭创	5,060	624,960.60	0.50
53	300408	三环集团	16,220	624,632.20	0.50
54	688361	中科飞测	7,055	617,665.25	0.50
55	301191	菲菱科思	6,900	617,205.00	0.50
56	300888	稳健医疗	14,600	614,368.00	0.50
57	600163	中闽能源	97,900	596,211.00	0.48
58	601000	唐山港	125,900	592,989.00	0.48
59	603871	嘉友国际	30,640	592,884.00	0.48
60	300502	新易盛	5,100	589,458.00	0.48
61	000902	新洋丰	45,200	589,408.00	0.48
62	601088	中国神华	13,500	586,980.00	0.47
63	688330	宏力达	22,320	585,676.80	0.47
64	601717	郑煤机	45,100	585,398.00	0.47
65	688187	时代电气	12,183	583,809.36	0.47
66	002558	巨人网络	46,000	583,740.00	0.47
67	600458	时代新材	45,500	582,855.00	0.47
68	300181	佐力药业	37,100	569,856.00	0.46
69	002078	太阳纸业	37,520	557,922.40	0.45
70	601916	浙商银行	187,300	545,043.00	0.44
71	605009	豪悦护理	13,400	535,464.00	0.43

72	600150	中国船舶	14,700	528,612.00	0.43
73	300990	同飞股份	12,700	524,510.00	0.42
74	002139	拓邦股份	38,300	521,263.00	0.42
75	600028	中国石化	78,000	521,040.00	0.42
76	300770	新媒股份	12,500	505,125.00	0.41
77	603338	浙江鼎力	7,800	503,256.00	0.41
78	002541	鸿路钢构	27,908	500,390.44	0.40
79	002557	洽洽食品	17,187	499,282.35	0.40
80	002532	天山铝业	63,300	498,171.00	0.40
81	002180	纳思达	17,400	490,158.00	0.40
82	688550	瑞联新材	15,159	474,325.11	0.38
83	002001	新和成	21,456	471,388.32	0.38
84	605319	无锡振华	22,000	463,100.00	0.37
85	000157	中联重科	62,200	449,706.00	0.36
86	300304	云意电气	56,100	448,800.00	0.36
87	002422	科伦药业	14,800	442,964.00	0.36
88	300926	博俊科技	19,650	432,496.50	0.35
89	000719	中原传媒	38,000	431,680.00	0.35
90	603055	台华新材	38,000	421,040.00	0.34
91	002832	比音勒芬	19,600	419,636.00	0.34
92	002966	苏州银行	51,000	413,610.00	0.33
93	688036	传音控股	4,277	406,315.00	0.33
94	002011	盾安环境	37,500	405,375.00	0.33
95	603507	振江股份	16,840	404,833.60	0.33
96	603606	东方电缆	7,200	378,360.00	0.31
97	688663	新风光	17,348	376,625.08	0.30
98	002850	科达利	3,800	371,184.00	0.30
99	688016	心脉医疗	3,360	369,096.00	0.30
100	688501	青达环保	26,165	367,094.95	0.30
101	601058	赛轮轮胎	25,500	365,415.00	0.29
102	600894	广日股份	24,600	359,160.00	0.29
103	601766	中国中车	42,700	357,826.00	0.29
104	300017	网宿科技	33,800	357,266.00	0.29
105	600601	方正科技	79,200	347,688.00	0.28
106	002130	沃尔核材	13,600	343,400.00	0.28
107	002472	双环传动	11,200	342,944.00	0.28
108	600064	南京高科	44,100	342,657.00	0.28
109	605507	国邦医药	16,400	341,612.00	0.28
110	600710	苏美达	36,528	339,710.40	0.27
111	603368	柳药集团	18,800	335,768.00	0.27
112	688408	中信博	4,599	331,128.00	0.27
113	600660	福耀玻璃	5,200	324,480.00	0.26
114	000921	海信家电	11,100	320,790.00	0.26
115	603529	爱玛科技	7,800	319,956.00	0.26

116	600422	昆药集团	19,900	315,415.00	0.25
117	600027	华电国际	56,000	314,160.00	0.25
118	603341	龙旗科技	6,700	313,225.00	0.25
119	600096	云天化	14,000	312,200.00	0.25
120	000928	中钢国际	49,000	312,130.00	0.25
121	301305	朗坤环境	17,700	311,874.00	0.25
122	601318	中国平安	5,900	310,635.00	0.25
123	002252	上海莱士	43,000	310,460.00	0.25
124	600664	哈药股份	75,100	310,163.00	0.25
125	000028	国药一致	10,600	310,050.00	0.25
126	000682	东方电子	28,900	309,519.00	0.25
127	000725	京东方 A	70,400	309,056.00	0.25
128	601877	正泰电器	13,100	306,671.00	0.25
129	600483	福能股份	30,700	306,079.00	0.25
130	688002	睿创微纳	6,510	306,035.10	0.25
131	603558	健盛集团	28,400	305,584.00	0.25
132	600388	龙净环保	24,100	304,865.00	0.25
133	601567	三星医疗	9,900	304,524.00	0.25
134	688123	聚辰股份	5,154	301,612.08	0.24
135	605305	中际联合	10,600	300,298.00	0.24
136	300740	水羊股份	22,600	298,772.00	0.24
137	000807	云铝股份	22,000	297,660.00	0.24
138	001308	康冠科技	10,800	297,000.00	0.24
139	601702	华峰铝业	16,200	296,784.00	0.24
140	002865	钧达股份	5,800	296,380.00	0.24
141	600887	伊利股份	9,800	295,764.00	0.24
142	688480	赛恩斯	10,846	294,360.44	0.24
143	002517	恺英网络	21,600	293,976.00	0.24
144	603855	华荣股份	14,400	292,176.00	0.24
145	601728	中国电信	40,400	291,688.00	0.24
146	000603	盛达资源	24,000	287,760.00	0.23
147	600050	中国联通	51,800	275,058.00	0.22
148	601225	陕西煤业	11,600	269,816.00	0.22
149	600919	江苏银行	27,300	268,086.00	0.22
150	002353	杰瑞股份	6,900	255,231.00	0.21
151	000938	紫光股份	8,800	244,904.00	0.20
152	603565	中谷物流	24,700	242,060.00	0.20
153	600183	生益科技	9,900	238,095.00	0.19
154	605499	东鹏饮料	930	231,123.60	0.19
155	600079	人福医药	9,800	229,124.00	0.18
156	002415	海康威视	7,276	223,373.20	0.18
157	000768	中航西飞	7,900	223,096.00	0.18
158	000848	承德露露	24,800	222,456.00	0.18
159	300274	阳光电源	3,000	221,490.00	0.18

160	600649	城投控股	49,100	218,495.00	0.18
161	600875	东方电气	13,700	217,693.00	0.18
162	688169	石头科技	947	207,667.63	0.17
163	002035	华帝股份	27,500	201,850.00	0.16
164	601857	中国石油	22,500	201,150.00	0.16
165	600019	宝钢股份	28,700	200,900.00	0.16
166	600741	华域汽车	11,400	200,754.00	0.16
167	603102	百合股份	5,700	200,070.00	0.16
168	002916	深南电路	1,600	200,000.00	0.16
169	601668	中国建筑	33,300	199,800.00	0.16
170	601881	中国银河	12,700	193,421.00	0.16
171	300432	富临精工	12,500	192,250.00	0.16
172	600015	华夏银行	24,000	192,240.00	0.16
173	002027	分众传媒	27,300	191,919.00	0.15
174	603786	科博达	3,100	191,580.00	0.15
175	002991	甘源食品	2,041	190,874.32	0.15
176	601117	中国化学	22,400	185,696.00	0.15
177	300525	博思软件	11,900	185,402.00	0.15
178	601607	上海医药	8,600	180,600.00	0.15
179	301087	可孚医疗	5,100	180,336.00	0.15
180	002236	大华股份	11,100	177,600.00	0.14
181	600332	白云山	6,116	173,816.72	0.14
182	603986	兆易创新	1,600	170,880.00	0.14
183	600018	上港集团	26,300	160,956.00	0.13
184	000895	双汇发展	6,200	160,952.00	0.13
185	000876	新希望	17,600	158,048.00	0.13
186	600219	南山铝业	39,300	153,663.00	0.12
187	601808	中海油服	10,000	152,500.00	0.12
188	603993	洛阳钼业	22,800	151,620.00	0.12
189	600161	天坛生物	7,316	149,978.00	0.12
190	603173	福斯达	6,200	142,910.00	0.12
191	601019	山东出版	12,500	141,875.00	0.11
192	601601	中国太保	4,100	139,728.00	0.11
193	600372	中航机载	11,100	136,863.00	0.11
194	600266	城建发展	25,600	130,560.00	0.11
195	000543	皖能电力	16,500	130,515.00	0.11
196	688009	中国通号	20,443	127,973.18	0.10
197	688041	海光信息	839	125,673.81	0.10
198	000977	浪潮信息	2,400	124,512.00	0.10
199	002601	龙佰集团	6,700	118,389.00	0.10
200	600036	招商银行	3,000	117,900.00	0.10
201	601939	建设银行	13,300	116,907.00	0.09
202	600285	羚锐制药	4,800	106,368.00	0.09
203	601628	中国人寿	2,500	104,800.00	0.08

204	300059	东方财富	3,872	99,975.04	0.08
205	603998	方盛制药	9,300	96,906.00	0.08
206	601319	中国人保	12,500	95,250.00	0.08
207	688210	统联精密	4,752	94,849.92	0.08
208	002756	永兴材料	2,400	90,528.00	0.07
209	600418	江淮汽车	2,400	90,000.00	0.07
210	000526	学大教育	2,100	88,326.00	0.07
211	300435	中泰股份	7,300	88,184.00	0.07
212	300001	特锐德	4,000	87,800.00	0.07
213	601985	中国核电	8,200	85,526.00	0.07
214	600999	招商证券	4,000	76,640.00	0.06
215	688012	中微公司	400	75,664.00	0.06
216	605090	九丰能源	2,500	71,325.00	0.06
217	600585	海螺水泥	2,800	66,584.00	0.05
218	002595	豪迈科技	1,300	65,247.00	0.05
219	600958	东方证券	5,200	54,912.00	0.04
220	300896	爱美客	300	54,750.00	0.04
221	601998	中信银行	7,600	53,048.00	0.04
222	300232	洲明科技	7,600	52,212.00	0.04
223	002179	中航光电	1,326	52,111.80	0.04
224	600114	东睦股份	3,200	51,744.00	0.04
225	002014	永新股份	4,500	49,320.00	0.04
226	300144	宋城演艺	5,100	47,379.00	0.04
227	600863	内蒙华电	10,600	45,898.00	0.04
228	600584	长电科技	1,100	44,946.00	0.04
229	688208	道通科技	1,139	44,603.24	0.04
230	688099	晶晨股份	631	43,337.08	0.03
231	000338	潍柴动力	3,100	42,470.00	0.03
232	603392	万泰生物	600	42,276.00	0.03
233	000858	五粮液	300	42,012.00	0.03
234	601211	国泰君安	2,200	41,030.00	0.03
235	601021	春秋航空	700	40,369.00	0.03
236	601127	赛力斯	300	40,017.00	0.03
237	000700	模塑科技	5,700	40,014.00	0.03
238	600521	华海药业	2,200	39,314.00	0.03
239	601298	青岛港	4,300	39,173.00	0.03
240	603209	兴通股份	2,400	38,352.00	0.03
241	000568	泸州老窖	300	37,560.00	0.03
242	601098	中南传媒	2,500	37,525.00	0.03
243	002533	金杯电工	3,700	36,408.00	0.03
244	603112	华翔股份	2,900	36,250.00	0.03
245	601528	瑞丰银行	6,400	36,032.00	0.03
246	603611	诺力股份	2,000	35,900.00	0.03
247	600030	中信证券	1,200	35,004.00	0.03

248	000596	古井贡酒	200	34,660.00	0.03
249	603600	永艺股份	2,900	34,481.00	0.03
250	603236	移远通信	500	34,220.00	0.03
251	601288	农业银行	6,400	34,176.00	0.03
252	002230	科大讯飞	700	33,824.00	0.03
253	603889	新澳股份	4,700	32,947.00	0.03
254	000960	锡业股份	2,300	32,269.00	0.03
255	300820	英杰电气	569	31,437.25	0.03
256	601390	中国中铁	4,800	30,672.00	0.02
257	600282	南钢股份	6,500	30,485.00	0.02
258	600026	中远海能	2,500	29,000.00	0.02
259	002594	比亚迪	100	28,266.00	0.02
260	301301	川宁生物	2,300	27,278.00	0.02
261	601799	星宇股份	200	26,696.00	0.02
262	300470	中密控股	700	26,390.00	0.02
263	600023	浙能电力	4,600	26,036.00	0.02
264	300760	迈瑞医疗	100	25,500.00	0.02
265	601336	新华保险	500	24,850.00	0.02
266	300122	智飞生物	900	23,670.00	0.02
267	300866	安克创新	240	23,433.60	0.02
268	603225	新凤鸣	2,100	23,373.00	0.02
269	002273	水晶光电	1,000	22,220.00	0.02
270	603444	吉比特	100	21,884.00	0.02
271	002028	思源电气	300	21,810.00	0.02
272	688029	南微医学	300	20,277.00	0.02
273	300015	爱尔眼科	1,523	20,179.75	0.02
274	603662	柯力传感	300	19,380.00	0.02
275	688128	中国电研	909	19,098.09	0.02
276	000423	东阿阿胶	300	18,816.00	0.02
277	688579	山大地纬	2,029	18,646.51	0.02
278	600025	华能水电	1,900	18,069.00	0.01
279	301165	锐捷网络	242	17,472.40	0.01
280	002304	洋河股份	200	16,706.00	0.01
281	688301	奕瑞科技	172	16,438.04	0.01
282	301267	华夏眼科	800	15,232.00	0.01
283	605117	德业股份	174	14,755.20	0.01
284	600809	山西汾酒	80	14,736.80	0.01
285	688257	新锐股份	797	14,513.37	0.01
286	688596	正帆科技	406	14,433.30	0.01
287	603195	公牛集团	184	12,924.16	0.01
288	300592	华凯易佰	900	12,852.00	0.01
289	600998	九州通	2,482	12,707.84	0.01
290	688331	荣昌生物	410	12,345.10	0.01
291	002352	顺丰控股	300	12,090.00	0.01

292	603317	天味食品	900	12,006.00	0.01
293	601825	沪农商行	1,400	11,914.00	0.01
294	002270	华明装备	700	11,823.00	0.01
295	000683	远兴能源	2,100	11,739.00	0.01
296	600745	闻泰科技	300	11,634.00	0.01
297	301004	嘉益股份	100	11,565.00	0.01
298	002920	德赛西威	100	11,011.00	0.01
299	603345	安井食品	134	10,918.32	0.01
300	300303	聚飞光电	1,600	10,912.00	0.01
301	603979	金诚信	300	10,890.00	0.01
302	300857	协创数据	100	10,689.00	0.01
303	603501	韦尔股份	100	10,441.00	0.01
304	301031	中熔电气	100	10,402.00	0.01
305	002487	大金重工	500	10,245.00	0.01
306	603713	密尔克卫	199	10,188.80	0.01
307	600256	广汇能源	1,500	10,095.00	0.01
308	600820	隧道股份	1,400	10,066.00	0.01
309	600160	巨化股份	400	9,648.00	0.01
310	001205	盛航股份	500	9,645.00	0.01
311	002970	锐明技术	200	9,526.00	0.01
312	603096	新经典	500	9,475.00	0.01
313	002244	滨江集团	1,100	9,471.00	0.01
314	603297	永新光学	100	9,382.00	0.01
315	603259	药明康德	170	9,356.80	0.01
316	603040	新坐标	400	9,168.00	0.01
317	600938	中国海油	304	8,971.04	0.01
318	300035	中科电气	600	8,970.00	0.01
319	300782	卓胜微	100	8,970.00	0.01
320	000999	华润三九	200	8,868.00	0.01
321	600438	通威股份	400	8,844.00	0.01
322	002384	东山精密	300	8,760.00	0.01
323	603658	安图生物	200	8,728.00	0.01
324	000988	华工科技	200	8,660.00	0.01
325	600740	山西焦化	2,144	8,640.32	0.01
326	600642	申能股份	900	8,541.00	0.01
327	603179	新泉股份	200	8,540.00	0.01
328	605183	确成股份	500	8,425.00	0.01
329	000630	铜陵有色	2,600	8,398.00	0.01
330	300627	华测导航	200	8,360.00	0.01
331	603228	景旺电子	300	8,352.00	0.01
332	688376	美埃科技	250	8,347.50	0.01
333	301280	珠城科技	200	8,334.00	0.01
334	600104	上汽集团	400	8,304.00	0.01
335	600893	航发动力	200	8,290.00	0.01

336	603733	仙鹤股份	400	8,252.00	0.01
337	600795	国电电力	1,800	8,244.00	0.01
338	603496	恒为科技	300	8,154.00	0.01
339	601611	中国核建	900	8,136.00	0.01
340	688486	龙迅股份	104	8,116.16	0.01
341	688698	伟创电气	184	8,096.00	0.01
342	600600	青岛啤酒	100	8,092.00	0.01
343	000063	中兴通讯	200	8,080.00	0.01
344	001965	招商公路	577	8,049.15	0.01
345	301061	匠心家居	130	8,034.00	0.01
346	603596	伯特利	180	8,026.20	0.01
347	600060	海信视像	400	7,976.00	0.01
348	601658	邮储银行	1,400	7,952.00	0.01
349	002668	TCL 智家	600	7,872.00	0.01
350	601900	南方传媒	500	7,555.00	0.01
351	600486	扬农化工	130	7,523.10	0.01
352	002847	盐津铺子	120	7,512.00	0.01
353	688516	奥特维	172	7,449.32	0.01
354	002380	科远智慧	400	7,392.00	0.01
355	002895	川恒股份	300	7,380.00	0.01
356	000429	粤高速 A	500	7,350.00	0.01
357	002142	宁波银行	300	7,293.00	0.01
358	300570	太辰光	100	7,270.00	0.01
359	601618	中国中冶	2,200	7,260.00	0.01
360	002891	中宠股份	200	7,140.00	0.01
361	600309	万华化学	100	7,135.00	0.01
362	600177	雅戈尔	800	7,120.00	0.01
363	002531	天顺风能	900	7,119.00	0.01
364	600233	圆通速递	500	7,095.00	0.01
365	301179	泽宇智能	380	7,094.60	0.01
366	300832	新产业	100	7,085.00	0.01
367	600406	国电南瑞	280	7,061.60	0.01
368	002050	三花智控	300	7,053.00	0.01
369	003816	中国广核	1,700	7,021.00	0.01
370	603650	彤程新材	200	6,994.00	0.01
371	001311	多利科技	270	6,963.30	0.01
372	300354	东华测试	200	6,958.00	0.01
373	002429	兆驰股份	1,200	6,936.00	0.01
374	002572	索菲亚	400	6,872.00	0.01
375	001301	尚太科技	100	6,855.00	0.01
376	000598	兴蓉环境	900	6,831.00	0.01
377	300223	北京君正	100	6,820.00	0.01
378	600548	深高速	500	6,740.00	0.01
379	600989	宝丰能源	400	6,736.00	0.01

380	601989	中国重工	1,400	6,734.00	0.01
381	002929	润建股份	200	6,724.00	0.01
382	300811	铂科新材	124	6,684.84	0.01
383	002648	卫星化学	352	6,614.08	0.01
384	300498	温氏股份	400	6,604.00	0.01
385	000885	城发环境	500	6,555.00	0.01
386	600933	爱柯迪	400	6,520.00	0.01
387	600803	新奥股份	300	6,504.00	0.01
388	001286	陕西能源	700	6,496.00	0.01
389	688080	映翰通	197	6,485.24	0.01
390	000883	湖北能源	1,300	6,474.00	0.01
391	300567	精测电子	100	6,430.00	0.01
392	600098	广州发展	1,000	6,420.00	0.01
393	300765	新诺威	240	6,381.60	0.01
394	688410	山外山	567	6,327.72	0.01
395	600132	重庆啤酒	100	6,302.00	0.01
396	002155	湖南黄金	400	6,292.00	0.01
397	600988	赤峰黄金	400	6,244.00	0.01
398	600499	科达制造	800	6,240.00	0.01
399	002150	通润装备	500	6,200.00	0.01
400	000975	山金国际	400	6,148.00	0.00
401	002851	麦格米特	100	6,146.00	0.00
402	001215	千味央厨	200	6,136.00	0.00
403	600383	金地集团	1,400	6,132.00	0.00
404	002039	黔源电力	400	6,104.00	0.00
405	603927	中科软	280	6,076.00	0.00
406	688777	中控技术	122	6,059.74	0.00
407	000552	甘肃能化	2,200	6,050.00	0.00
408	601899	紫金矿业	400	6,048.00	0.00
409	002444	巨星科技	186	6,017.10	0.00
410	601827	三峰环境	700	6,006.00	0.00
411	000538	云南白药	100	5,995.00	0.00
412	603050	科林电气	288	5,944.32	0.00
413	600062	华润双鹤	300	5,940.00	0.00
414	002276	万马股份	700	5,922.00	0.00
415	600546	山煤国际	500	5,915.00	0.00
416	688389	普门科技	395	5,881.55	0.00
417	600845	宝信软件	200	5,852.00	0.00
418	600566	济川药业	200	5,816.00	0.00
419	002335	科华数据	200	5,784.00	0.00
420	601872	招商轮船	900	5,769.00	0.00
421	603035	常熟汽饰	400	5,756.00	0.00
422	688401	路维光电	218	5,753.02	0.00
423	300850	新强联	300	5,733.00	0.00

424	605368	蓝天燃气	500	5,715.00	0.00
425	000521	长虹美菱	700	5,712.00	0.00
426	600456	宝钛股份	200	5,690.00	0.00
427	600970	中材国际	600	5,688.00	0.00
428	002738	中矿资源	160	5,680.00	0.00
429	688502	茂莱光学	28	5,639.20	0.00
430	601689	拓普集团	115	5,635.00	0.00
431	000831	中国稀土	200	5,610.00	0.00
432	300908	仲景食品	182	5,594.68	0.00
433	688506	百利天恒	29	5,560.17	0.00
434	688533	上声电子	159	5,536.38	0.00
435	603816	顾家家居	200	5,516.00	0.00
436	600612	老凤祥	100	5,427.00	0.00
437	002984	森麒麟	220	5,425.20	0.00
438	002226	江南化工	1,000	5,420.00	0.00
439	603198	迎驾贡酒	100	5,394.00	0.00
440	300558	贝达药业	100	5,393.00	0.00
441	600835	上海机电	300	5,376.00	0.00
442	002922	伊戈尔	300	5,346.00	0.00
443	000090	天健集团	1,300	5,343.00	0.00
444	301155	海力风电	100	5,331.00	0.00
445	002032	苏泊尔	100	5,321.00	0.00
446	603383	顶点软件	140	5,250.00	0.00
447	600993	马应龙	200	5,222.00	0.00
448	301095	广立微	100	5,207.00	0.00
449	300442	润泽科技	100	5,196.00	0.00
450	300075	数字政通	300	5,190.00	0.00
451	301391	卡莱特	140	5,181.40	0.00
452	600580	卧龙电驱	300	5,157.00	0.00
453	002698	博实股份	300	5,100.00	0.00
454	603690	至纯科技	200	5,022.00	0.00
455	605289	罗曼股份	200	5,012.00	0.00
456	603380	易德龙	200	4,998.00	0.00
457	601311	骆驼股份	600	4,974.00	0.00
458	002343	慈文传媒	800	4,960.00	0.00
459	688032	禾迈股份	44	4,956.16	0.00
460	688606	奥泰生物	78	4,937.40	0.00
461	002967	广电计量	300	4,920.00	0.00
462	600482	中国动力	200	4,894.00	0.00
463	603185	弘元绿能	300	4,875.00	0.00
464	002025	航天电器	100	4,856.00	0.00
465	601677	明泰铝业	400	4,812.00	0.00
466	600489	中金黄金	400	4,812.00	0.00
467	002600	领益智造	600	4,800.00	0.00

468	002959	小熊电器	100	4,791.00	0.00
469	300487	蓝晓科技	100	4,787.00	0.00
470	002807	江阴银行	1,100	4,785.00	0.00
471	000498	山东路桥	800	4,760.00	0.00
472	300910	瑞丰新材	100	4,759.00	0.00
473	600216	浙江医药	300	4,758.00	0.00
474	600323	瀚蓝环境	200	4,724.00	0.00
475	600961	株冶集团	600	4,722.00	0.00
476	603486	科沃斯	100	4,700.00	0.00
477	600665	天地源	1,500	4,695.00	0.00
478	300014	亿纬锂能	100	4,674.00	0.00
479	688100	威胜信息	129	4,669.80	0.00
480	688789	宏华数科	70	4,646.60	0.00
481	600529	山东药玻	180	4,638.60	0.00
482	603277	银都股份	200	4,634.00	0.00
483	300092	科新机电	400	4,616.00	0.00
484	000932	华菱钢铁	1,100	4,598.00	0.00
485	600276	恒瑞医药	100	4,590.00	0.00
486	688139	海尔生物	130	4,576.00	0.00
487	688179	阿拉丁	331	4,567.80	0.00
488	002701	奥瑞金	800	4,536.00	0.00
489	603355	莱克电气	200	4,530.00	0.00
490	603369	今世缘	100	4,523.00	0.00
491	600475	华光环能	500	4,505.00	0.00
492	301052	果麦文化	177	4,502.88	0.00
493	300604	长川科技	100	4,413.00	0.00
494	300019	硅宝科技	300	4,392.00	0.00
495	301291	明阳电气	100	4,392.00	0.00
496	300827	上能电气	100	4,390.00	0.00
497	300855	图南股份	200	4,384.00	0.00
498	002430	杭氧股份	200	4,360.00	0.00
499	300373	扬杰科技	100	4,352.00	0.00
500	600535	天士力	300	4,338.00	0.00
501	601033	永兴股份	300	4,338.00	0.00
502	605555	德昌股份	200	4,328.00	0.00
503	600582	天地科技	700	4,326.00	0.00
504	688111	金山办公	15	4,295.85	0.00
505	300653	正海生物	200	4,260.00	0.00
506	000733	振华科技	100	4,217.00	0.00
507	688503	聚和材料	95	4,207.55	0.00
508	603416	信捷电气	100	4,195.00	0.00
509	300951	博硕科技	140	4,181.80	0.00
510	002315	焦点科技	100	4,168.00	0.00
511	603868	飞科电器	100	4,152.00	0.00

512	002859	洁美科技	200	4,150.00	0.00
513	603203	快克智能	180	4,143.60	0.00
514	600908	无锡银行	700	4,137.00	0.00
515	002897	意华股份	100	4,135.00	0.00
516	600459	贵研铂业	300	4,119.00	0.00
517	603885	吉祥航空	300	4,110.00	0.00
518	600426	华鲁恒升	190	4,105.90	0.00
519	300842	帝科股份	100	4,102.00	0.00
520	601001	晋控煤业	300	4,101.00	0.00
521	002993	奥海科技	100	4,100.00	0.00
522	688037	芯源微	49	4,097.87	0.00
523	002543	万和电气	400	4,096.00	0.00
524	603100	川仪股份	190	4,094.50	0.00
525	600557	康缘药业	300	4,086.00	0.00
526	600415	小商品城	300	4,023.00	0.00
527	300709	精研科技	100	4,017.00	0.00
528	603063	禾望电气	200	3,992.00	0.00
529	603707	健友股份	300	3,981.00	0.00
530	688127	蓝特光学	146	3,956.60	0.00
531	601865	福莱特	200	3,938.00	0.00
532	000887	中鼎股份	300	3,936.00	0.00
533	603619	中曼石油	200	3,872.00	0.00
534	600861	北京人力	200	3,870.00	0.00
535	002810	山东赫达	300	3,855.00	0.00
536	601166	兴业银行	200	3,832.00	0.00
537	002332	仙琚制药	385	3,826.90	0.00
538	301096	百诚医药	100	3,794.00	0.00
539	603067	振华股份	300	3,789.00	0.00
540	002322	理工能科	300	3,777.00	0.00
541	603197	保隆科技	100	3,775.00	0.00
542	688019	安集科技	27	3,762.72	0.00
543	002334	英威腾	500	3,760.00	0.00
544	601598	中国外运	700	3,745.00	0.00
545	605377	华旺科技	280	3,738.00	0.00
546	300384	三联虹普	200	3,724.00	0.00
547	688226	威腾电气	148	3,719.24	0.00
548	002158	汉钟精机	200	3,704.00	0.00
549	603556	海兴电力	100	3,699.00	0.00
550	002540	亚太科技	600	3,696.00	0.00
551	002841	视源股份	100	3,691.00	0.00
552	300783	三只松鼠	100	3,687.00	0.00
553	000811	冰轮环境	300	3,678.00	0.00
554	300394	天孚通信	40	3,654.40	0.00
555	600428	中远海特	500	3,650.00	0.00

556	002223	鱼跃医疗	100	3,649.00	0.00
557	002938	鹏鼎控股	100	3,648.00	0.00
558	300687	赛意信息	200	3,640.00	0.00
559	000777	中核科技	200	3,614.00	0.00
560	600648	外高桥	300	3,573.00	0.00
561	002949	华阳国际	200	3,564.00	0.00
562	300351	永贵电器	200	3,548.00	0.00
563	600048	保利发展	400	3,544.00	0.00
564	300532	今天国际	310	3,540.20	0.00
565	601233	桐昆股份	300	3,540.00	0.00
566	601222	林洋能源	500	3,535.00	0.00
567	605098	行动教育	100	3,524.00	0.00
568	603882	金域医学	128	3,523.84	0.00
569	002484	江海股份	200	3,516.00	0.00
570	600661	昂立教育	300	3,516.00	0.00
571	605196	华通线缆	300	3,504.00	0.00
572	603227	雪峰科技	400	3,476.00	0.00
573	000963	华东医药	100	3,460.00	0.00
574	601838	成都银行	200	3,422.00	0.00
575	600511	国药股份	100	3,422.00	0.00
576	605599	菜百股份	300	3,405.00	0.00
577	000933	神火股份	200	3,380.00	0.00
578	002937	兴瑞科技	200	3,380.00	0.00
579	603199	九华旅游	100	3,375.00	0.00
580	601156	东航物流	200	3,374.00	0.00
581	002947	恒铭达	100	3,333.00	0.00
582	600639	浦东金桥	300	3,330.00	0.00
583	603515	欧普照明	200	3,290.00	0.00
584	605333	沪光股份	100	3,263.00	0.00
585	000726	鲁泰 A	500	3,260.00	0.00
586	301363	美好医疗	100	3,242.00	0.00
587	600867	通化东宝	400	3,224.00	0.00
588	601168	西部矿业	200	3,214.00	0.00
589	301195	北路智控	100	3,211.00	0.00
590	300226	上海钢联	140	3,201.80	0.00
591	600885	宏发股份	100	3,182.00	0.00
592	001328	登康口腔	100	3,176.00	0.00
593	300729	乐歌股份	200	3,176.00	0.00
594	002439	启明星辰	200	3,164.00	0.00
595	603306	华懋科技	100	3,161.00	0.00
596	002138	顺络电子	100	3,148.00	0.00
597	600699	均胜电子	200	3,134.00	0.00
598	002539	云图控股	400	3,128.00	0.00
599	002159	三特索道	200	3,122.00	0.00

600	601919	中远海控	200	3,100.00	0.00
601	002264	新华都	500	3,090.00	0.00
602	601333	广深铁路	900	3,087.00	0.00
603	605222	起帆电缆	200	3,080.00	0.00
604	002906	华阳集团	100	3,075.00	0.00
605	300881	盛德鑫泰	100	3,074.00	0.00
606	001979	招商蛇口	300	3,072.00	0.00
607	300718	长盛轴承	100	3,069.00	0.00
608	603661	恒林股份	100	3,064.00	0.00
609	600737	中粮糖业	300	3,063.00	0.00
610	300596	利安隆	100	3,050.00	0.00
611	002864	盘龙药业	100	3,041.00	0.00
612	002237	恒邦股份	300	3,030.00	0.00
613	600901	江苏金租	580	3,027.60	0.00
614	603393	新天然气	100	3,027.00	0.00
615	600061	国投资本	400	3,008.00	0.00
616	603220	中贝通信	130	2,986.10	0.00
617	603305	旭升集团	224	2,945.60	0.00
618	300174	元力股份	200	2,944.00	0.00
619	603920	世运电路	100	2,940.00	0.00
620	600258	首旅酒店	200	2,934.00	0.00
621	300124	汇川技术	50	2,929.00	0.00
622	600729	重庆百货	100	2,925.00	0.00
623	002271	东方雨虹	225	2,920.50	0.00
624	600694	大商股份	110	2,900.70	0.00
625	603031	安孚科技	100	2,860.00	0.00
626	600690	海尔智家	100	2,847.00	0.00
627	002978	安宁股份	100	2,842.00	0.00
628	002003	伟星股份	200	2,834.00	0.00
629	688472	阿特斯	225	2,826.00	0.00
630	600971	恒源煤电	300	2,823.00	0.00
631	003019	宸展光电	110	2,813.80	0.00
632	002545	东方铁塔	400	2,812.00	0.00
633	002046	国机精工	200	2,800.00	0.00
634	600570	恒生电子	100	2,799.00	0.00
635	300573	兴齐眼药	40	2,791.20	0.00
636	300349	金卡智能	200	2,734.00	0.00
637	688275	万润新能	56	2,706.48	0.00
638	300693	盛弘股份	100	2,696.00	0.00
639	002833	弘亚数控	160	2,692.80	0.00
640	603239	浙江仙通	200	2,690.00	0.00
641	002605	姚记科技	100	2,666.00	0.00
642	603806	福斯特	180	2,664.00	0.00
643	002154	报喜鸟	600	2,646.00	0.00

644	688589	力合微	96	2,627.52	0.00
645	600109	国金证券	300	2,619.00	0.00
646	002170	芭田股份	300	2,619.00	0.00
647	002080	中材科技	200	2,616.00	0.00
648	603439	贵州三力	200	2,600.00	0.00
649	688612	威迈斯	110	2,589.40	0.00
650	301397	溯联股份	100	2,575.00	0.00
651	300856	科思股份	100	2,562.00	0.00
652	002020	京新药业	200	2,560.00	0.00
653	000589	贵州轮胎	500	2,515.00	0.00
654	603298	杭叉集团	140	2,504.60	0.00
655	688621	阳光诺和	66	2,488.20	0.00
656	300577	开润股份	100	2,485.00	0.00
657	603667	五洲新春	100	2,475.00	0.00
658	600129	太极集团	100	2,472.00	0.00
659	001330	博纳影业	400	2,452.00	0.00
660	002801	微光股份	100	2,446.00	0.00
661	002438	江苏神通	200	2,440.00	0.00
662	002262	恩华药业	100	2,435.00	0.00
663	002739	万达电影	200	2,428.00	0.00
664	688518	联赢激光	153	2,423.52	0.00
665	603027	千禾味业	200	2,422.00	0.00
666	300121	阳谷华泰	200	2,418.00	0.00
667	605133	嵘泰股份	102	2,400.06	0.00
668	003006	百亚股份	100	2,399.00	0.00
669	688097	博众精工	90	2,362.50	0.00
670	605589	圣泉集团	100	2,358.00	0.00
671	002318	久立特材	100	2,341.00	0.00
672	002015	协鑫能科	300	2,328.00	0.00
673	300002	神州泰岳	200	2,318.00	0.00
674	002990	盛视科技	100	2,317.00	0.00
675	301208	中亦科技	60	2,313.00	0.00
676	600325	华发股份	400	2,304.00	0.00
677	603076	乐惠国际	100	2,304.00	0.00
678	688109	品茗科技	94	2,303.94	0.00
679	301376	致欧科技	120	2,294.40	0.00
680	603156	养元饮品	100	2,284.00	0.00
681	002597	金禾实业	100	2,283.00	0.00
682	603081	大丰实业	200	2,260.00	0.00
683	000922	佳电股份	200	2,258.00	0.00
684	600380	健康元	200	2,254.00	0.00
685	688233	神工股份	96	2,251.20	0.00
686	688525	佰维存储	36	2,230.92	0.00
687	603699	纽威股份	100	2,217.00	0.00

688	688800	瑞可达	44	2,204.84	0.00
689	002111	威海广泰	200	2,204.00	0.00
690	002266	浙富控股	700	2,184.00	0.00
691	000002	万科 A	300	2,178.00	0.00
692	600141	兴发集团	100	2,170.00	0.00
693	002045	国光电器	100	2,169.00	0.00
694	300130	新国都	100	2,166.00	0.00
695	003020	立方制药	120	2,164.80	0.00
696	601009	南京银行	200	2,130.00	0.00
697	002068	黑猫股份	200	2,128.00	0.00
698	600623	华谊集团	300	2,100.00	0.00
699	600559	老白干酒	100	2,099.00	0.00
700	688599	天合光能	108	2,084.40	0.00
701	300286	安科瑞	100	2,055.00	0.00
702	002737	葵花药业	100	2,049.00	0.00
703	301276	嘉曼服饰	100	2,035.00	0.00
704	601137	博威合金	100	2,030.00	0.00
705	300291	百纳千成	400	2,012.00	0.00
706	300415	伊之密	100	2,006.00	0.00
707	300795	米奥会展	100	2,001.00	0.00
708	600587	新华医疗	120	1,998.00	0.00
709	600562	国睿科技	100	1,993.00	0.00
710	300443	金雷股份	100	1,992.00	0.00
711	002461	珠江啤酒	200	1,978.00	0.00
712	300566	激智科技	100	1,972.00	0.00
713	603518	锦泓集团	200	1,960.00	0.00
714	300674	宇信科技	100	1,952.00	0.00
715	688676	金盘科技	47	1,946.74	0.00
716	300761	立华股份	100	1,946.00	0.00
717	605167	利柏特	200	1,928.00	0.00
718	600312	平高电气	100	1,920.00	0.00
719	300457	赢合科技	100	1,914.00	0.00
720	300251	光线传媒	200	1,888.00	0.00
721	002254	泰和新材	200	1,880.00	0.00
722	601816	京沪高铁	300	1,848.00	0.00
723	688072	拓荆科技	12	1,844.04	0.00
724	600188	兖矿能源	130	1,842.10	0.00
725	002884	凌霄泵业	100	1,827.00	0.00
726	688110	东芯股份	73	1,817.70	0.00
727	603357	设计总院	200	1,812.00	0.00
728	300996	普联软件	100	1,812.00	0.00
729	002402	和而泰	100	1,811.00	0.00
730	603801	志邦家居	140	1,793.40	0.00
731	603187	海容冷链	160	1,790.40	0.00

732	603279	景津装备	100	1,788.00	0.00
733	603730	岱美股份	198	1,780.02	0.00
734	600720	中交设计	200	1,772.00	0.00
735	600761	安徽合力	100	1,765.00	0.00
736	600012	皖通高速	100	1,765.00	0.00
737	601369	陕鼓动力	200	1,740.00	0.00
738	600399	抚顺特钢	300	1,740.00	0.00
739	603300	海南华铁	300	1,734.00	0.00
740	000650	仁和药业	300	1,728.00	0.00
741	002777	久远银海	100	1,722.00	0.00
742	688073	毕得医药	35	1,720.60	0.00
743	600123	兰花科创	200	1,712.00	0.00
744	002987	京北方	120	1,707.60	0.00
745	300723	一品红	100	1,706.00	0.00
746	300416	苏试试验	145	1,705.20	0.00
747	002607	中公教育	500	1,700.00	0.00
748	300036	超图软件	100	1,698.00	0.00
749	600595	中孚实业	600	1,698.00	0.00
750	601126	四方股份	100	1,696.00	0.00
751	300873	海晨股份	100	1,691.00	0.00
752	300360	炬华科技	100	1,677.00	0.00
753	301109	军信股份	100	1,668.00	0.00
754	002956	西麦食品	100	1,667.00	0.00
755	600886	国投电力	100	1,662.00	0.00
756	002073	软控股份	200	1,652.00	0.00
757	000983	山西焦煤	200	1,648.00	0.00
758	300396	迪瑞医疗	100	1,634.00	0.00
759	301227	森鹰窗业	100	1,620.00	0.00
760	688025	杰普特	34	1,615.00	0.00
761	000950	重药控股	300	1,614.00	0.00
762	600528	中铁工业	200	1,612.00	0.00
763	300638	广和通	80	1,612.00	0.00
764	603108	润达医疗	100	1,593.00	0.00
765	000810	创维数字	100	1,592.00	0.00
766	300192	科德教育	100	1,590.00	0.00
767	603323	苏农银行	300	1,587.00	0.00
768	300791	仙乐健康	60	1,579.80	0.00
769	603588	高能环境	300	1,572.00	0.00
770	002555	三七互娱	100	1,564.00	0.00
771	603966	法兰泰克	200	1,544.00	0.00
772	688772	珠海冠宇	96	1,543.68	0.00
773	002567	唐人神	300	1,530.00	0.00
774	300026	红日药业	400	1,516.00	0.00
775	688106	金宏气体	89	1,513.89	0.00

776	600223	福瑞达	200	1,512.00	0.00
777	601208	东材科技	200	1,508.00	0.00
778	600398	海澜之家	200	1,500.00	0.00
779	002705	新宝股份	100	1,500.00	0.00
780	300569	天能重工	300	1,494.00	0.00
781	688443	智翔金泰	59	1,480.31	0.00
782	601038	一拖股份	100	1,478.00	0.00
783	601801	皖新传媒	200	1,468.00	0.00
784	002790	瑞尔特	200	1,460.00	0.00
785	002867	周大生	100	1,453.00	0.00
786	603886	元祖股份	100	1,442.00	0.00
787	601699	潞安环能	100	1,436.00	0.00
788	688687	凯因科技	66	1,424.28	0.00
789	600348	华阳股份	200	1,418.00	0.00
790	688239	航宇科技	38	1,417.40	0.00
791	603308	应流股份	100	1,410.00	0.00
792	688236	春立医疗	110	1,408.00	0.00
793	600985	淮北矿业	100	1,407.00	0.00
794	600229	城市传媒	200	1,394.00	0.00
795	000923	河钢资源	100	1,390.00	0.00
796	300041	回天新材	150	1,380.00	0.00
797	000708	中信特钢	120	1,369.20	0.00
798	605068	明新旭腾	100	1,345.00	0.00
799	300406	九强生物	100	1,336.00	0.00
800	000625	长安汽车	100	1,336.00	0.00
801	688639	华恒生物	41	1,320.61	0.00
802	000906	浙商中拓	200	1,320.00	0.00
803	601012	隆基绿能	84	1,319.64	0.00
804	002056	横店东磁	100	1,296.00	0.00
805	603128	华贸物流	200	1,286.00	0.00
806	600787	中储股份	200	1,276.00	0.00
807	000937	冀中能源	200	1,264.00	0.00
808	300319	麦捷科技	100	1,248.00	0.00
809	603639	海利尔	100	1,240.00	0.00
810	600801	华新水泥	100	1,210.00	0.00
811	688575	亚辉龙	76	1,200.80	0.00
812	600420	国药现代	100	1,194.00	0.00
813	002096	易普力	100	1,188.00	0.00
814	688628	优利德	32	1,178.88	0.00
815	002960	青鸟消防	100	1,167.00	0.00
816	603181	皇马科技	100	1,153.00	0.00
817	601028	玉龙股份	100	1,146.00	0.00
818	300244	迪安诊断	100	1,135.00	0.00
819	300003	乐普医疗	100	1,134.00	0.00

820	300196	长海股份	100	1,089.00	0.00
821	600479	千金药业	100	1,068.00	0.00
822	688177	百奥泰	55	1,065.90	0.00
823	601800	中国交建	100	1,045.00	0.00
824	600350	山东高速	100	1,028.00	0.00
825	688357	建龙微纳	46	1,008.78	0.00
826	688369	致远互联	50	1,003.50	0.00
827	601666	平煤股份	100	1,002.00	0.00
828	600461	洪城环境	100	995.00	0.00
829	603328	依顿电子	100	986.00	0.00
830	000065	北方国际	100	978.00	0.00
831	300371	汇中股份	100	959.00	0.00
832	601186	中国铁建	100	917.00	0.00
833	603118	共进股份	100	890.00	0.00
834	600063	皖维高新	200	800.00	0.00
835	000039	中集集团	100	777.00	0.00
836	002452	长高电新	100	742.00	0.00
837	002588	史丹利	100	738.00	0.00
838	601600	中国铝业	100	735.00	0.00
839	002469	三维化学	100	730.00	0.00
840	600577	精达股份	100	729.00	0.00
841	601918	新集能源	100	718.00	0.00
842	300129	泰胜风能	100	705.00	0.00
843	002563	森马服饰	100	702.00	0.00
844	002063	远光软件	120	691.20	0.00
845	300494	盛天网络	60	674.40	0.00
846	600755	厦门国贸	100	664.00	0.00
847	600008	首创环保	200	656.00	0.00
848	002446	盛路通信	100	655.00	0.00
849	300088	长信科技	100	654.00	0.00
850	601975	招商南油	200	626.00	0.00
851	300887	谱尼测试	80	611.20	0.00
852	002345	潮宏基	100	581.00	0.00
853	603878	武进不锈	100	572.00	0.00
854	600583	海油工程	100	547.00	0.00
855	601500	通用股份	100	533.00	0.00
856	002478	常宝股份	100	529.00	0.00
857	600966	博汇纸业	100	516.00	0.00
858	688668	鼎通科技	11	515.46	0.00
859	688378	奥来德	21	479.01	0.00
860	000059	华锦股份	100	479.00	0.00
861	600572	康恩贝	100	466.00	0.00
862	002044	美年健康	100	459.00	0.00
863	688066	航天宏图	22	448.80	0.00

864	000690	宝新能源	100	448.00	0.00
865	002206	海利得	100	429.00	0.00
866	600968	海油发展	100	427.00	0.00
867	688766	普冉股份	4	405.04	0.00
868	600575	淮河能源	100	397.00	0.00
869	688586	江航装备	40	382.80	0.00
870	300037	新宙邦	10	374.40	0.00

## 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

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	600522	中天科技	22,186,955.00	5.03
2	300274	阳光电源	21,886,622.40	4.96
3	300750	宁德时代	19,372,574.00	4.39
4	000333	美的集团	19,261,675.10	4.37
5	601077	渝农商行	15,891,816.00	3.60
6	601138	工业富联	15,438,973.00	3.50
7	300308	中际旭创	15,263,611.45	3.46
8	600919	江苏银行	15,163,093.00	3.44
9	600900	长江电力	14,817,332.00	3.36
10	000338	潍柴动力	14,678,441.00	3.33
11	000100	TCL 科技	13,449,112.50	3.05
12	002463	沪电股份	13,168,059.30	2.99
13	603129	春风动力	13,160,021.26	2.98
14	000921	海信家电	13,013,650.91	2.95
15	600941	中国移动	12,940,961.81	2.93
16	002452	长高电新	12,899,558.00	2.92
17	600048	保利发展	12,639,716.00	2.87
18	601601	中国太保	12,605,757.00	2.86
19	002353	杰瑞股份	12,293,529.41	2.79
20	601028	玉龙股份	12,177,914.00	2.76
21	601001	晋控煤业	11,891,574.00	2.70
22	600642	申能股份	11,788,682.00	2.67
23	300502	新易盛	11,565,722.00	2.62
24	603283	赛腾股份	11,492,234.40	2.61
25	002422	科伦药业	11,386,330.85	2.58
26	002594	比亚迪	11,232,143.94	2.55

27	601088	中国神华	11,108,815.14	2.52
28	600487	亨通光电	11,070,432.00	2.51
29	000858	五粮液	10,970,582.00	2.49
30	600795	国电电力	10,912,308.00	2.47
31	600519	贵州茅台	10,795,376.85	2.45
32	600023	浙能电力	10,482,594.00	2.38
33	000034	神州数码	10,408,996.73	2.36
34	688408	中信博	10,234,294.94	2.32
35	601668	中国建筑	10,060,081.00	2.28
36	000997	新大陆	10,053,560.70	2.28
37	300857	协创数据	9,248,690.00	2.10
38	300433	蓝思科技	9,052,628.00	2.05
39	688093	世华科技	9,002,800.91	2.04
40	601899	紫金矿业	8,988,115.00	2.04
41	000400	许继电气	8,976,817.00	2.04
42	000543	皖能电力	8,921,941.00	2.02
43	601872	招商轮船	8,889,682.09	2.02
44	000090	天健集团	8,888,784.00	2.02
45	002475	立讯精密	8,842,843.00	2.00

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。

#### 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

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	300274	阳光电源	23,594,291.88	5.35
2	601138	工业富联	22,063,259.00	5.00
3	000921	海信家电	20,786,143.00	4.71
4	000333	美的集团	20,568,548.00	4.66
5	600900	长江电力	19,446,331.00	4.41
6	600919	江苏银行	18,696,533.45	4.24
7	600522	中天科技	18,372,126.86	4.17
8	300750	宁德时代	18,232,174.00	4.13
9	601601	中国太保	17,170,410.14	3.89
10	000338	潍柴动力	17,039,699.00	3.86
11	600941	中国移动	17,027,040.50	3.86
12	002463	沪电股份	16,562,407.96	3.75
13	000034	神州数码	15,719,557.00	3.56
14	300308	中际旭创	15,718,011.96	3.56
15	300502	新易盛	15,641,104.82	3.55
16	601077	渝农商行	14,959,558.00	3.39

17	600795	国电电力	14,877,582.98	3.37
18	600519	贵州茅台	14,727,442.65	3.34
19	002452	长高电新	14,559,910.00	3.30
20	002027	分众传媒	13,968,841.00	3.17
21	601899	紫金矿业	13,940,799.00	3.16
22	601668	中国建筑	13,938,441.00	3.16
23	601001	晋控煤业	13,703,507.00	3.11
24	002353	杰瑞股份	13,693,342.00	3.10
25	601088	中国神华	13,579,089.47	3.08
26	601028	玉龙股份	12,835,207.08	2.91
27	603129	春风动力	12,740,030.00	2.89
28	300130	新国都	12,739,172.28	2.89
29	000400	许继电气	12,392,367.00	2.81
30	600048	保利发展	12,356,445.59	2.80
31	002126	银轮股份	12,112,351.41	2.75
32	000100	TCL 科技	12,100,261.00	2.74
33	600642	申能股份	11,960,455.93	2.71
34	600060	海信视像	11,571,696.90	2.62
35	002130	沃尔核材	11,458,651.21	2.60
36	600023	浙能电力	11,211,733.00	2.54
37	002422	科伦药业	11,186,743.00	2.54
38	002594	比亚迪	11,115,580.29	2.52
39	000858	五粮液	10,906,374.00	2.47
40	603283	赛腾股份	10,838,397.00	2.46
41	603556	海兴电力	10,564,438.00	2.40
42	600422	昆药集团	10,377,761.37	2.35
43	000933	神火股份	10,351,219.60	2.35
44	300857	协创数据	10,146,597.00	2.30
45	000543	皖能电力	9,720,411.00	2.20
46	603993	洛阳钼业	9,611,971.00	2.18
47	000039	中集集团	9,567,272.50	2.17
48	300433	蓝思科技	9,561,320.00	2.17
49	601658	邮储银行	9,541,183.00	2.16
50	688408	中信博	9,474,325.49	2.15
51	300592	华凯易佰	9,314,081.00	2.11
52	601872	招商轮船	9,238,226.60	2.09
53	601058	赛轮轮胎	9,225,094.01	2.09
54	603558	健盛集团	9,195,687.00	2.08
55	000700	模塑科技	9,168,867.00	2.08
56	000997	新大陆	9,139,818.00	2.07
57	000568	泸州老窖	9,052,191.16	2.05

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。

**8.4.3 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	2,221,028,147.97
卖出股票的收入（成交）总额	2,523,934,947.69

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。

**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	6,287,398.80	5.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,287,398.80	5.07

**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	019740	24 国债 09	48,000	4,860,643.07	3.92
2	019733	24 国债 02	14,000	1,426,755.73	1.15

**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投资。

## 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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资用于套期保值。在预期市场上涨时，可以通过买入股指期货作为股票替代，增加股票仓位，同时提高资金的利用效率；在预期市场下跌时，可以通过卖出股指期货对冲股市整体下跌的系统性风险，对投资组合的价值进行保护。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金的国债期货投资以风险管理为原则，以套期保值为目的。管理人按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

**8.12.2** 本基金投资的前十名证券中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 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	159,326.87
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	41.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	159,367.87

#### 8.12.4 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换债券。

#### 8.12.5 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。

### §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
海富通欣荣混合 A	1,407	75,089.92	105,086,507.19	99.47%	565,016.10	0.53%
海富通欣荣混合 C	666	2,538.82	1,304,200.87	77.13%	386,655.73	22.87%
合计	2,073	51,781.18	106,390,708.06	99.11%	951,671.83	0.89%

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)。

**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	海富通欣荣混合 A	173,146.49	0.1639%
	海富通欣荣混合 C	27,531.78	1.6283%
	合计	200,678.27	0.1870%

**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	海富通欣荣混合 A	10~50
	海富通欣荣混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通欣荣混合 A	10~50
	海富通欣荣混合 C	0
	合计	10~50

**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**

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的基金份额总量的数量区间（万份）
杜晓海	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
基金合同生效日（2016 年 9 月 22 日）基金份额总额	250,120,830.38	200,014,500.63
本报告期期初基金份额总额	327,798,186.97	72,951,033.74
本报告期基金总申购份额	219,111.65	429,207.69

减：本报告期基金总赎回份额	222,365,775.33	71,689,384.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	105,651,523.29	1,690,856.60

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

2024 年 9 月 4 日，海富通基金管理有限公司发布公告，路颖女士自 2024 年 9 月 2 日起担任公司董事长，杨仓兵先生因退休不再担任公司董事长。

2024 年 12 月 11 日，海富通基金管理有限公司发布公告，周小波先生自 2024 年 12 月 9 日起担任公司副总经理。

基金托管人：

本报告期内，本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

报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内改聘毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所，并依法履行了公告手续。报告期内本基金应支付给所聘任会计师事务所的报酬为 45,000.00 元，该审计机构已为本基金提供审计服务的连续年限为 1 年。

### 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，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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	
兴业证券	1	950,249,755.57	20.03%	629,456.05	21.33%	-
招商证券	1	903,831,816.61	19.05%	593,958.39	20.13%	-
国泰君安	2	838,113,305.01	17.66%	555,472.99	18.82%	-
华创证券	1	754,665,759.97	15.90%	487,716.19	16.53%	-
平安证券	1	369,332,691.59	7.78%	175,015.42	5.93%	-
国金证券	1	249,100,535.28	5.25%	108,583.98	3.68%	-
华泰证券	1	193,699,175.53	4.08%	84,431.21	2.86%	-
海通证券	2	190,304,912.63	4.01%	139,911.25	4.74%	-
长江证券	1	162,724,779.70	3.43%	77,588.38	2.63%	-
太平洋证券	1	132,940,363.77	2.80%	99,160.75	3.36%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金未新租券商交易单元，退租川财证券 1 个交易单元、国元证券 1 个交易单元、太平洋证券 2 个交易单元、中信建投 1 个交易单元。

#### 2、交易单元的选择标准：

基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司，租用其交易单元供本基金证券交易。

#### 3、交易单元的选择程序：

(1) 由牵头部门依据上述交易单元选择标准及公司内控制度要求，对候选券商开展尽职调查，综合评估其财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力。

(2) 经评估，牵头部门将符合公司制度要求的券商相关材料提交督察长进行合规性审查，再提交基金管理人的总经理办公会审议。

(3) 基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》。

#### 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		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
兴业证券	35,704,547.05	18.95%	23,500,000.00	82.46%	-	-
招商证券	7,719,433.26	4.10%	-	-	-	-
国泰君安	58,824,838.76	31.22%	-	-	-	-
华创证券	4,298,811.18	2.28%	-	-	-	-
平安证券	63,159,198.33	33.52%	5,000,000.00	17.54%	-	-
国金证券	1,608,741.71	0.85%	-	-	-	-
华泰证券	7,434,890.84	3.95%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	8,262,364.81	4.39%	-	-	-	-
太平洋证券	1,404,721.44	0.75%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

### 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	海富通基金管理有限公司关于海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金新增东兴证券股份有限公司为销售机构的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-07
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-18
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增销售机构并参加其申购费率优	证券日报、基金管理人网站及中国证监	2024-06-25

	惠活动的公告	会基金电子披露网 站	
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增湘财证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网 站	2024-07-04
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网 站	2024-07-25
6	海富通基金管理有限公司关于董事长变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网 站	2024-09-04
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增爱建证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网 站	2024-09-25
8	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网 站	2024-09-30
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网 站	2024-10-18
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网 站	2024-11-22
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国泰君安证券股份有限公司为销售机构的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网 站	2024-11-25
12	海富通基金管理有限公司关于海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金新增上海万得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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网 站	2024-12-05
13	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网 站	2024-12-11
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网 站	2024-12-13

	公告	站	
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-12-26

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024/11/1-2024/12/31	38,884,000.22	-	-	38,884,000.22	36.22%
	2	2024/11/13-2024/12/31	32,927,494.80	-	-	32,927,494.80	30.68%
	3	2024/1/1-2024/8/18	163,942,716.05	-	163,942,716.05	-	-
	4	2024/11/1-2024/12/1	40,417,710.16	-	40,417,710.16	-	-
	5	2024/1/1-2024/1/5	81,674,915.98	-	81,674,915.98	-	-

#### 产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额；
- 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于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；
- 4、其他可能的风险。

另外,当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始,海富通先后募集成立了 124 只公募基金。截至 2024 年 12 月 31 日,海富通管理的公募基金资产规模约 1722 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”。

2024 年 12 月,海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“债券型 ETF 典型精品案例”。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通欣荣灵活配置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他文件

### 13.2 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

### 13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司  
二〇二五年三月三十一日