

海富通富利三个月持有期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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§ 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合规守信情况的说明	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	18
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	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	22
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	22
§ 5 托管人报告	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	22
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	23
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	23
§ 6 审计报告	23
6.1 审计意见	23
6.2 形成审计意见的基础	23
6.3 其他信息	24
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	24
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	24
§ 7 年度财务报表	25
7.1 资产负债表	25
7.2 利润表	27
7.3 净资产变动表	28
7.4 报表附注	30
§ 8 投资组合报告	62
8.1 期末基金资产组合情况	62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	63
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	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	74
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	74
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	74
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	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12 投资组合报告附注	75
§ 9 基金份额持有人信息	78
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	78
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	79
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	79
§ 10 开放式基金份额变动	80
§ 11 重大事件揭示	80
11.1 基金份额持有人大会决议	80
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	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
11.4 基金投资策略的改变	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	81
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	81
11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	81
11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	81
11.8 其他重大事件	82
12 影响投资者决策的其他重要信息	83
§ 13 备查文件目录	85
13.1 备查文件目录	85
13.2 存放地点	85
13.3 查阅方式	85

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	海富通富利三个月持有	
基金主代码	010850	
交易代码	010850	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 7 月 20 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	28,119,115.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
下属分级基金的交易代码	010850	010851
报告期末下属分级基金的份 额总额	18,618,099.91 份	9,501,016.04 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。
投资策略	本基金通过对宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究，同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素，兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动，结合投资时钟理论，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例。并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，或借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应，以规避或分散市场风险。 股票投资方面，本基金将采用量化选股策略、风险估测模型——有效控制预期风险、交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩、投资组合的优化及调整、港股通标的股票的投资策略等策略；

	债券投资方面，本基金将采用利率策略、信用策略、收益率曲线策略、杠杆策略等策略。
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	滕菲菲
	联系电话	021-38650788	4006800000
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		40088-40099	95558
传真		021-33830166	010-85230024
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京市朝阳区光华路10号院 1号楼6-30层、32-42层
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京市朝阳区光华路10号院 1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		200120	100020
法定代表人		路颖	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
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	海富通基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

§3 主要财务指标、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	
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
本期已实现收益	755,402.89	395,040.58	-913,911.74	-885,184.88	-1,307,574.25	-1,784,500.05
本期利润	1,746,395.74	840,503.21	-716,218.33	-684,857.56	-3,161,292.74	-4,311,558.52
加权平均基金份额本期利润	0.0681	0.0442	-0.0225	-0.0254	-0.0609	-0.0708
本期加权平均净值利	7.09%	4.67%	-2.34%	-2.67%	-6.14%	-7.15%

润率						
本期基金 份额 净值增 长率	7.51%	7.12%	-2.58%	-2.96%	-5.99%	-6.37%
3.1.2 期 末 数 据 和 指 标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	海富通富利 三个月持有 A	海富通富利 三个月持有 C	海富通富利 三个月持有 A	海富通富利 三个月持有 C	海富通富利 三个月持有 A	海富通富利三 个月持有 C
期末可 供分配 利润	-291,925.8 2	-276,644.6 1	-1,771,383. 42	-1,868,551. 90	-1,410,563. 68	-1,317,296.1 8
期末可 供分配 基金份 额利润	-0.0157	-0.0291	-0.0628	-0.0720	-0.0380	-0.0437
期末基 金资产 净值	18,760,37 7.10	9,445,007. 76	26,448,239. 53	24,095,805. 82	35,672,231. 86	28,859,823.7 7
期末基 金份额 净值	1.0076	0.9941	0.9372	0.9280	0.9620	0.9563
3.1.3 累 计 期 末 指 标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	海富通富 利三个月 持有 A	海富通富 利三个月 持有 C	海富通富 利三个月 持有 A	海富通富利 三个月持有 C	海富通富利 三个月持有 A	海富通富利 三个月持有 C
基金份 额累计 净值增 长率	0.76%	-0.59%	-6.28%	-7.20%	-3.80%	-4.37%

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. 海富通富利三个月持有 A：

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个 月	1.35%	0.43%	1.48%	0.31%	-0.13%	0.12%
过去六个 月	4.61%	0.39%	4.98%	0.28%	-0.37%	0.11%
过去一年	7.51%	0.34%	7.52%	0.23%	-0.01%	0.11%
过去三年	-1.53%	0.31%	3.47%	0.23%	-5.00%	0.08%
自基金合 同生效起 至今	0.76%	0.30%	2.82%	0.23%	-2.06%	0.07%

2. 海富通富利三个月持有 C：

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个 月	1.25%	0.43%	1.48%	0.31%	-0.23%	0.12%
过去六个 月	4.44%	0.39%	4.98%	0.28%	-0.54%	0.11%
过去一年	7.12%	0.34%	7.52%	0.23%	-0.40%	0.11%
过去三年	-2.67%	0.31%	3.47%	0.23%	-6.14%	0.08%
自基金合	-0.59%	0.30%	2.82%	0.23%	-3.41%	0.07%

同生效起 至今						
------------	--	--	--	--	--	--

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1. 海富通富利三个月持有 A
(2021 年 7 月 20 日至 2024 年 12 月 31 日)



2. 海富通富利三个月持有 C
(2021 年 7 月 20 日至 2024 年 12 月 31 日)



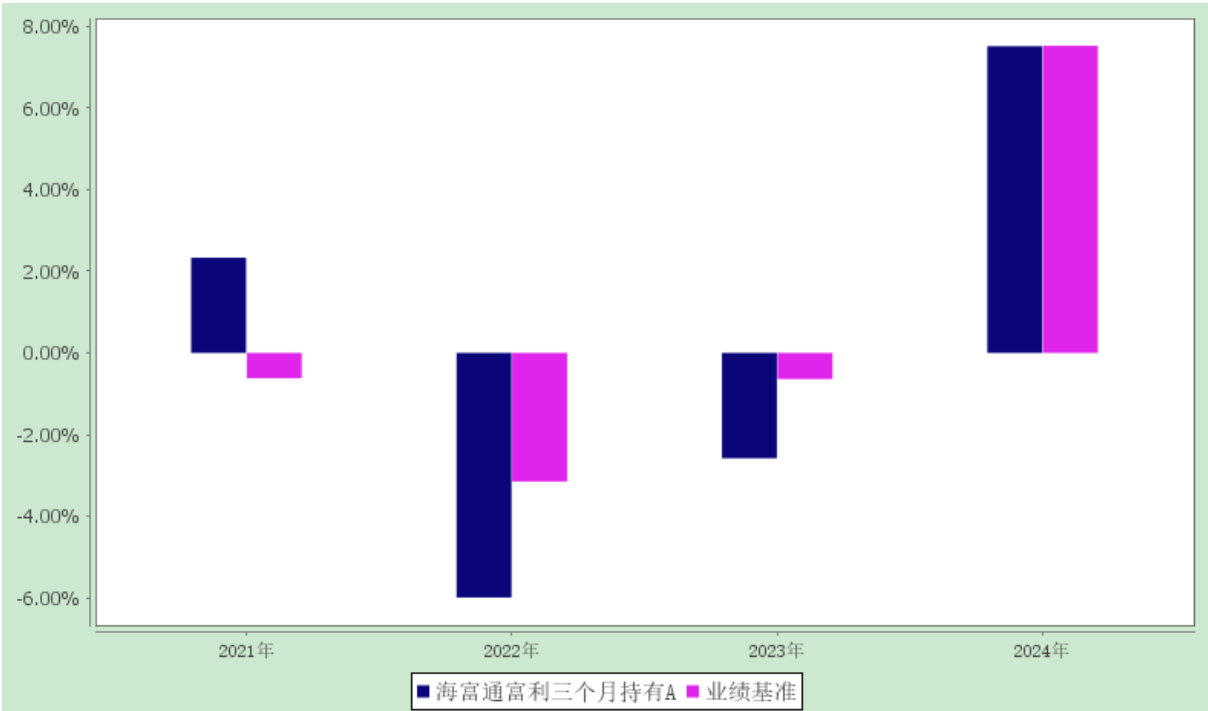
注：本基金合同于 2021 年 7 月 20 日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

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

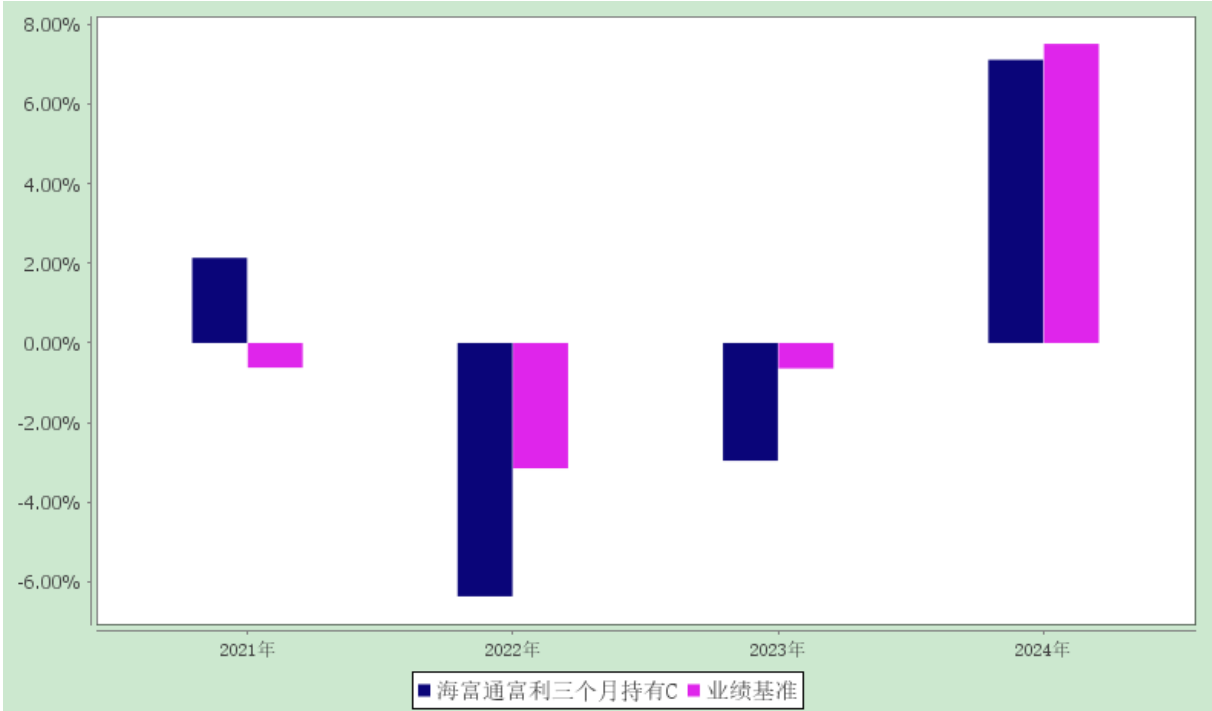
海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1. 海富通富利三个月持有 A



2. 海富通富利三个月持有 C



注：图中列示的 2021 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 7 月 20 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、海富通富利三个月持有 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	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

2、海富通富利三个月持有 C：

单位：人民币元

年度	每 10 份基	现金形式发放	再投资形式发放	年度利润分配	备注
----	---------	--------	---------	--------	----

	金份额分 红数	总额	总额	合计	
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金过去三年未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人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		
张靖爽	本基金的 基金经 理；债 券基金	2021-07-20	-	14 年	硕士，持有基金从业人员 资格证书。历任中银基金 管理有限公司研究员，交 银施罗德基金管理有限公

	部副总监。				司投资经理、基金经理助理、研究员。现任海富通基金管理有限公司债券基金部副总监（主持工作）。2016 年 7 月至 2017 年 10 月任海富通双利债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 11 月兼任海富通纯债债券基金经理。2017 年 8 月起兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）和海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2018 年 2 月至 2021 年 2 月任海富通融丰定开债券基金经理。2018 年 11 月至 2020 年 10 月任海富通鼎丰定开债券基金经理。2019 年 5 月至 2022 年 12 月兼任海富通新内需混合基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 4 月任海富通聚合纯债基金经理。2019 年 12 月起兼任海富通裕通 30 个月定开债券基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通裕昇三年定开债券基金经理。2020 年 5 月至 2021 年 7 月兼任海富通瑞弘 6 个月定开债券基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。2022 年 8 月至 2024 年 8 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通瑞兴 3 个月定开债券基金经理。
杜晓海	本基金的基金经理；总	2021-07-20	2024-09-26	24 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金

	经理助理。				融 工 程 师 ， American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监、量化投资部总监，现任海富通基金管理有限公司总经理助理。2016 年 6 月起任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 10 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 增强）基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至 2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月
--	-------	--	--	--	--

					至 2021 年 7 月兼任海富通中证 500 增强（原海富通中证内地低碳指数）基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月至 2023 年 10 月兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月至 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。
林立禾	本基金的基金经理	2023-11-23	-	6 年	美国密歇根大学定量金融与风险管理硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中欧基金管理有限公司风险管理部量化风控岗。2020 年 8 月加入海富通基金管理有限公司，历任量化研究员、量化投资部基金经理助理。2023 年 11 月起任海富通欣益混合、海富通富利三个月持有、海富通沪深 300 增强的基金经理。2024 年 10 月起兼任海富通量化多因子混合基金经理。

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.3 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。

从 A 股市场看，全年市场震荡走高。2024 年，上证指数涨幅为 12.7%，沪深 300 为 14.7%，中证 800 为 12.2%。其中，924 以来中小成长风格弹性更大，创业板指涨幅为 39.9%，中证 1000 为 33.3%，中证 800 为 23.7%。行业板块方面，根据中信一级行业分类，2024 年表现靠前的板块是银行、非银、家电、通信、交运，靠后的板块是医药、农林牧渔、消费者服务、房地产、食品饮料。其中，924 以来成长行业表现更强，计算机、商贸零售、电子、综合金融和传媒涨幅靠前。总体而言，全年市场结构性机会不少，中小成长和红利策略轮流表现占优，前期主要是高股息红利相关行业走强，924 新政以后 TMT 相关科技板块表现更好。

本报告期内，本基金在股票策略上优选具有长期价值增长、红利属性以及良好现金流的 A 股和港股公司作为核心持仓标的，转债策略上也以具有股性的价值型转债为主。另外，进一步增加了衍生品的使用频率。

固定收益方面，2024 年国内经济企稳，实际 GDP 增速达到 5%。整体来看，生产端修复节奏好于需求端，制造业 PMI 在四季度维持在扩张区间。投资端方面，制造业与基建投资实现高增，地产投资惯性下滑。消费增速在国家补贴、消费券政策的支撑下有一定幅度的回暖。出口方面，海外需求不弱，贸易顺差维持在高位。通胀方面，CPI 总体弹性有限，年初转正后维持在 1% 以下；PPI 在基数效应下跌幅收窄但仍未转正。货币政策方面态度积极，年内两次降准共 100bp；7 天逆回购利率调降 2 次共 30bp；MLF 利率调降 2 次共 50bp；1 年期与 5 年期 LPR 利率调降 2 次共 35bp。除此之外央行通过公开市场买断式逆回购、国债净买入操作投放流动性。财政政策方面同样积极，上半年超长期特别国债落地，2024 年率先发行 1 万亿；下半年新增 2 万亿专项债额度用于化解地方隐性债务。流动性方面总体维持合理充裕的状态，但分层的现象较为突出。资金价格方面，2024 年 R001 与 R007 均值为 1.77% 和 1.96%。对应债市而言，2024 年走出牛市行情，货币政策宽松成为主导。除了在 8 月央行提示债券市场风险、9 月末权益市场火热导致债券市场出现阶段性调整外，其余时间收益率均处于下行趋势。其中收益率下行最快的时间在年末时点，12 月政治局会议与中央经济工作会议打下 2025 年货币政策维持宽松的基础，市场出现一定的抢跑行情。全年来看，10 年期国债到期收益率累计下行 88bp。

信用债方面，回顾 2024 年，可分为三个阶段。第一阶段为 1-8 月，信用债票息难寻。该阶段信用债供给不足，但需求旺盛，期间存款搬家、流向非银，加剧非银配置压力和信用债资产荒，信用利差压降至历史低位。第二阶段为 8-11 月，信用债扰动上升。政策超预期引发债市快速调整，并进一步导致理财-债基赎回反馈。8 月以来的几轮赎回反馈使得信用债表现持续弱于利率债。由于基本面尾部风险缓释，政策还未出尽，投资者对后市仍偏谨慎，信用债配置热情整体不高。第三阶段为 12 月，存款自律机制新规打开同业存款利率下行空间，叠加政治局会议将货币政策立场转向“适度宽松”超预期，多头情绪主导债市走强，信用债收益率全面下行，但利率债下行幅度更大，信用利差被动抬升。

报告期内，本基金主要投资于利率债，根据市场情况灵活调整组合久期和杠杆。鉴于全年的基本面、资金面和政策面情况，组合维持一定的债券仓位，并依据利率曲线的变化，针对不同期限的利率债进行积极的交易以增厚收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通富利三个月持有 A 净值增长率为 7.51%，同期业绩比较基准收益率为 7.52%。海富通富利三个月持有 C 净值增长率为 7.12%，同期业绩比较基准收益率为 7.52%。

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，我们依然对 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，我们将会聚焦在价值类策略，优选具有长期价值增长及红利属性的公司作为核心持仓标的，转债上也以价值型转债为主。策略结构上，我们将以 AI 模型为主，行业轮动、事件驱动等卫星策略为辅。另外，我们还将使用股指期货帮助平衡组合的向上弹性和回撤风险。

固定收益方面，展望 2025 年，经济或企稳。投资方面，在财政政策维持宽松的情况下有望保持偏高的景气度；制造业投资在高技术领域将继续发力；地产投资跌幅有望收窄。通胀方面，CPI 有望维持在正增区间，PPI 跌幅有望收窄。货币政策方面，预计基础货币投放方式将会更加多元，降准降息仍有空间。财政政策或仍有加码，提高财政赤字、增加专项债额度、增发特别国债等均可能落地。

信用债方面，市场或将围绕两条核心主线展开：一是债务置换、地方化债与退平台，实体企业融资需求整体仍偏弱；二是信用债资产荒延续，但机构行为稳定性变弱，可能影响信用债需求和信用利差。尽管 2025 年信用利差扰动因素较多，但是拉长时间看，信用债仍有投资机会。

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

- 一、本基金本报告期内无应分配的收益。
- 二、已实施的利润分配：无。
- 三、不存在应分配但尚未实施的利润。

4.9 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

本基金自 2024 年 1 月 19 日至 2024 年 3 月 7 日，连续二十九个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形；自 2024 年 3 月 11 日至 2024 年 12 月 31 日，连续超过六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人拟持续运作本基金，解决方案已根据法规要求向中国证券监督管理委员会上海监管局进行了报告。

因前述迷你基金情形，经公司决策，自 2024 年 7 月 1 日起由基金管理人承担本基金项下相关固定费用。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及

其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金 2024 年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

毕马威华振审字第 2501850 号

海富通富利三个月持有期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富利三个月持有期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

王国蓓 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：海富通富利三个月持有期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
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	320,275.14	135,763.80
结算备付金		728,218.16	1,313,384.44
存出保证金		146,001.11	18,728.13
交易性金融资产	7.4.7.2	27,212,801.30	48,421,681.79
其中：股票投资		7,322,191.79	18,122,091.59
基金投资		-	-
债券投资		19,890,609.51	30,299,590.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	110,988.88	979,854.64
应收清算款		602,332.16	80,591.93
应收股利		1,273.60	-
应收申购款		19.98	10,011.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	66,441.54	-
资产总计		29,188,351.87	50,960,016.72
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.76	122,954.77
应付赎回款		863,674.98	23,254.62
应付管理人报酬		20,911.91	34,563.83
应付托管费		3,921.00	6,480.74
应付销售服务费		3,230.99	8,194.62
应付投资顾问费		-	-
应交税费		77.80	222.43
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	91,149.57	220,300.36
负债合计		982,967.01	415,971.37

净资产：			
实收基金	7.4.7.7	28,119,115.95	54,183,980.67
未分配利润	7.4.7.8	86,268.91	-3,639,935.32
净资产合计		28,205,384.86	50,544,045.35
负债和净资产总计		29,188,351.87	50,960,016.72

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0076 元，C 类基金份额净值 0.9941 元。基金份额总额 28,119,115.95 份，其中 A 类基金份额 18,618,099.91 份，C 类基金份额 9,501,016.04 份。

7.2 利润表

会计主体：海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		3,127,936.78	-591,664.76
1.利息收入		51,530.72	184,103.34
其中：存款利息收入	7.4.7.9	19,404.32	46,783.51
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		32,126.40	137,319.83
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,639,700.34	-1,173,799.10
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-86,833.71	-2,107,988.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,082,455.35	593,311.97
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	255,589.27	11,083.23
股利收益	7.4.7.14	388,489.43	329,793.99
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	1,436,455.48	398,020.73
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	250.24	10.27
减：二、营业总支出		541,037.83	809,411.13

1. 管理人报酬		341,352.88	451,162.48
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		64,003.69	84,592.98
3. 销售服务费		72,039.44	102,714.71
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,307.91	16.92
其中：卖出回购金融资产支出		1,307.91	16.92
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		1,649.00	914.10
8. 其他费用	7.4.7.17	60,684.91	170,009.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,586,898.95	-1,401,075.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,586,898.95	-1,401,075.89
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,586,898.95	-1,401,075.89

7.3 净资产变动表

会计主体：海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 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	54,183,980.67	-	-3,639,935.32	50,544,045.35
二、本期期初净资产	54,183,980.67	-	-3,639,935.32	50,544,045.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-26,064,864.72	-	3,726,204.23	-22,338,660.49
（一）、综合收益总额	-	-	2,586,898.95	2,586,898.95
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减	-26,064,864.72	-	1,139,305.28	-24,925,559.44

少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	1,011,236.56	-	-30,911.72	980,324.84
2. 基金赎回款	-27,076,101.28	-	1,170,217.00	-25,905,884.28
(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	28,119,115.95	-	86,268.91	28,205,384.86
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	67,259,915.49	-	-2,727,859.86	64,532,055.63
二、本期期初净资产	67,259,915.49	-	-2,727,859.86	64,532,055.63
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-13,075,934.82	-	-912,075.46	-13,988,010.28
(一)、综合收益总额	-	-	-1,401,075.89	-1,401,075.89
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-13,075,934.82	-	489,000.43	-12,586,934.39
其中：1. 基金申购款	1,578,158.24	-	-82,352.13	1,495,806.11
2. 基金赎回款	-14,654,093.06	-	571,352.56	-14,082,740.50
(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	54,183,980.67	-	-3,639,935.32	50,544,045.35

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

海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]3093 号《关于准予海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 277,601,007.94 元。经向中国证监会备案，《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 7 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 277,641,140.11 份，其中认购资金利息折合 40,132.17 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购基金份额时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期

融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、同业存单、股指期货、股票期权、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金投资的信用债,其债项评级或主体评级或担保人评级不得低于 AA,信用评级参照国内评级机构(中债资信除外)评定的最新评级结果。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金股票资产及存托凭证投资占基金资产的比例为 0-40%(其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%);本基金投资同业存单不超过基金资产的 20%;每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金业绩比较基准为:中债-综合全价(总值)指数收益率 $\times$ 80%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 15%+恒生指数收益率(经汇率调整) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2024 年 12 月 31 日,本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案,故本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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、买入返售金融资产等。

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等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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继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》、财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行

沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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。

对证券投资基金从中国内地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。

(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众公司（“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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联交所”）上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

(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。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与香港联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	320,275.14	135,763.80
等于：本金	320,234.02	135,750.65
加：应计利息	41.12	13.15
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	320,275.14	135,763.80

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		6,981,439.48	-	7,322,191.79	340,752.31
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,493,412.83	42,510.73	8,886,804.03	350,880.47
	银行间市场	10,249,490.00	249,805.48	11,003,805.48	504,510.00
	合计	18,742,902.83	292,316.21	19,890,609.51	855,390.47
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		25,724,342.31	292,316.21	27,212,801.30	1,196,142.78
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		18,367,558.27	-	18,122,091.59	-245,466.68
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,231,584.62	61,425.70	9,297,344.30	4,333.98
	银行间市场	20,498,980.00	498,245.90	21,002,245.90	5,020.00
	合计	29,730,564.62	559,671.60	30,299,590.20	9,353.98
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		48,098,122.89	559,671.60	48,421,681.79	-236,112.70

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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	-1,185,840.00	-	-	-
——股指期货	-1,185,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-1,185,840.00	-	-	-
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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2501	IF2501	-1.00	-1,181,640.00	4,200.00
合计	-	-	-	4,200.00
减：可抵销期货 暂收款	-	-	-	4,200.00
净额	-	-	-	-

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

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末
	2024 年 12 月 31 日

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	110,988.88	-
银行间市场	-	-
合计	110,988.88	-
项目	上年度末	
	2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	979,854.64	-
银行间市场	-	-
合计	979,854.64	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

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
应收利息	-	-
其他应收款	66,441.54	-
待摊费用	-	-
合计	66,441.54	-

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	3,649.57	90,300.36
其中：交易所市场	3,649.57	90,300.36

银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	87,500.00	130,000.00
合计	91,149.57	220,300.36

7.4.7.7 实收基金
海富通富利三个月持有 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,219,622.95	28,219,622.95
本期申购	637,446.18	637,446.18
本期赎回（以“-”号填列）	-10,238,969.22	-10,238,969.22
本期末	18,618,099.91	18,618,099.91

海富通富利三个月持有 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,964,357.72	25,964,357.72
本期申购	373,790.38	373,790.38
本期赎回（以“-”号填列）	-16,837,132.06	-16,837,132.06
本期末	9,501,016.04	9,501,016.04

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润
海富通富利三个月持有 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,346,155.30	-425,228.12	-1,771,383.42
本期期初	-1,346,155.30	-425,228.12	-1,771,383.42

本期利润	755,402.89	990,992.85	1,746,395.74
本期基金份额交易产生的变动数	298,826.59	-131,561.72	167,264.87
其中：基金申购款	-20,081.59	4,812.71	-15,268.88
基金赎回款	318,908.18	-136,374.43	182,533.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-291,925.82	434,203.01	142,277.19

海富通富利三个月持有 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,479,082.17	-389,469.73	-1,868,551.90
本期期初	-1,479,082.17	-389,469.73	-1,868,551.90
本期利润	395,040.58	445,462.63	840,503.21
本期基金份额交易产生的变动数	807,396.98	164,643.43	972,040.41
其中：基金申购款	-16,931.15	1,288.31	-15,642.84
基金赎回款	824,328.13	163,355.12	987,683.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-276,644.61	220,636.33	-56,008.28

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	1,833.95	4,338.47
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	17,377.42	42,180.89
其他	192.95	264.15
合计	19,404.32	46,783.51

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	55,615,386.70	203,257,863.70
减：卖出股票成本总额	55,599,012.18	204,873,587.77
减：交易费用	103,208.23	492,264.22
买卖股票差价收入	-86,833.71	-2,107,988.29

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	702,435.87	769,451.82
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	380,019.48	-176,139.85
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	1,082,455.35	593,311.97

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	61,363,610.57	65,130,158.19
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	60,571,538.86	64,640,642.09
减：应计利息总额	409,826.91	662,020.10
减：交易费用	2,225.32	3,635.85
买卖债券差价收入	380,019.48	-176,139.85

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）	302,434.00	38,280.00
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	12,188.45	2,896.31
减：股指期货交易费用	3,957.30	21,377.02
国债期货投资收益（税前）	-30,650.00	-2,850.00
减：国债期货差价收入应缴纳增值税额	-	-
减：国债期货交易费用	48.98	73.44
合计	255,589.27	11,083.23

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	388,489.43	329,793.99
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	388,489.43	329,793.99

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	1,432,255.48	398,020.73
——股票投资	586,218.99	292,932.67
——债券投资	846,036.49	105,088.06
——资产支持证券投资	-	-

——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	4,200.00	-
——权证投资	-	-
——股指期货	4,200.00	-
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	1,436,455.48	398,020.73

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	250.24	10.25
基金转换费收入	-	0.02
合计	250.24	10.27

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	7,376.90	50,000.00
信息披露费	32,281.56	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	2,388.90	2,779.21
证券组合费	37.55	30.73
债券托管账户维护费	18,000.00	36,000.00
其他费用	600.00	1,200.00
合计	60,684.91	170,009.94

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，本基金并无须作披露的或有事项。

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、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
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	99,828,280.09	100.00%	307,116,449.71	74.44%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

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	67,562.07	100.00%	3,649.57	100.00%
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	225,242.41	74.38%	90,300.36	100.00%

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	341,352.88	451,162.48
其中：应支付销售机构的客户维护 费	153,418.06	195,369.81
应支付基金管理人的净管理费	187,934.82	255,792.67

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值 x0.80%/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	64,003.69	84,592.98

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		
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有C	合计
中信银行	-	60,059.59	60,059.59
海通证券	-	220.13	220.13
海富通基金	-	3,877.38	3,877.38
合计	-	64,157.10	64,157.10
获得销售服务费	上年度可比期间		

的各关联方名称	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		
	海富通富利三个月持有A	海富通富利三个月持有C	合计
中信银行	-	77,628.61	77,628.61
海通证券	-	116.80	116.80
海富通基金	-	13,303.60	13,303.60
合计	-	91,049.01	91,049.01

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.40%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。销售服务费的计算方法如下：日销售服务费 = 前一日 C 类份额的基金资产净值 x 0.40% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

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

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

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

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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	320,275.14	1,833.95	135,763.80	4,338.47

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

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

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

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

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

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，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 14.20%（2023 年 12 月 31 日：12.79%）。

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

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	1,612,418.63	-
合计	1,612,418.63	-

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。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
AAA	2,633,819.81	3,528,138.83
AAA 以下	1,372,542.19	2,936,311.22
未评级	14,271,828.88	23,835,140.15
合计	18,278,190.88	30,299,590.20

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 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上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

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	320,275.14	-	-	-	320,275.14
结算备付金	728,218.16	-	-	-	728,218.16
存出保证金	4,204.31	-	-	141,796.80	146,001.11
交易性金融资产	2,360,970.29	3,210,490.22	14,319,149.00	7,322,191.79	27,212,801.30
买入返售金融资产	110,988.88	-	-	-	110,988.88
应收清算款	-	-	-	602,332.16	602,332.16
应收股利	-	-	-	1,273.60	1,273.60
应收申购款	-	-	-	19.98	19.98
其他应收款	-	-	-	66,441.54	66,441.54
资产总计	3,524,656.78	3,210,490.22	14,319,149.00	8,134,055.87	29,188,351.87
负债					
应付清算款	-	-	-	0.76	0.76
应付赎回款	-	-	-	863,674.98	863,674.98
应付管理人报酬	-	-	-	20,911.91	20,911.91
应付托管费	-	-	-	3,921.00	3,921.00
应付销售服务费	-	-	-	3,230.99	3,230.99
应交税费	-	-	-	77.80	77.80
其他负债	-	-	-	91,149.57	91,149.57
负债总计	-	-	-	982,967.01	982,967.01
利率敏感度缺口	3,524,656.78	3,210,490.22	14,319,149.00	7,151,088.86	28,205,384.86
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	135,763.80	-	-	-	135,763.80
结算备付金	1,313,384.44	-	-	-	1,313,384.44
存出保证金	18,728.13	-	-	-	18,728.13
交易性金融资产	3,540,030.60	5,510,839.84	21,248,719.76	18,122,091.59	48,421,681.79
买入返售金融资产	979,854.64	-	-	-	979,854.64
应收清算款	-	-	-	80,591.93	80,591.93
应收申购款	-	-	-	10,011.99	10,011.99
资产总计	5,987,761.61	5,510,839.84	21,248,719.76	18,212,695.51	50,960,016.72
负债					
应付清算款	-	-	-	122,954.77	122,954.77
应付赎回款	-	-	-	23,254.62	23,254.62
应付管理人报酬	-	-	-	34,563.83	34,563.83
应付托管费	-	-	-	6,480.74	6,480.74
应付销售服务费	-	-	-	8,194.62	8,194.62
应交税费	-	-	-	222.43	222.43
其他负债	-	-	-	220,300.36	220,300.36
负债总计	-	-	-	415,971.37	415,971.37
利率敏感度缺口	5,987,761.61	5,510,839.84	21,248,719.76	17,796,724.14	50,544,045.35

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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	-217,603.62	-322,418.42
	市场利率下降 25 个基点	221,408.86	327,641.01

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	851,729.90	851,729.90
资产合计	-	851,729.90	851,729.90
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	-	851,729.90	851,729.90
项目	上年度末 2023年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
资产合计	-	-	-
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	-	-	-

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	42,586.50	-
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-42,586.50	-

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的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产及存托凭证投资占基金资产的比例为 0-40%（其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%）；本基金投资同业存单不超过基金资产的 20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	7,322,191.79	25.96	18,122,091.59	35.85
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,322,191.79	25.96	18,122,091.59	35.85

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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	225,295.84	608,211.69
	2.业绩比较基准下降 5%	-225,295.84	-608,211.69

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	11,328,553.79	24,586,541.64
第二层次	15,884,247.51	23,835,140.15
第三层次	-	-
合计	27,212,801.30	48,421,681.79

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。

7.4.14.3 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，本基金无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、买入返售金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	7,322,191.79	25.09
	其中：股票	7,322,191.79	25.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,890,609.51	68.15
	其中：债券	19,890,609.51	68.15
	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	110,988.88	0.38
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	1,048,493.30	3.59
8	其他各项资产	816,068.39	2.80
9	合计	29,188,351.87	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 851,729.90 元，占资产净值比例为 3.02%。

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	-	-
B	采矿业	630,707.92	2.24
C	制造业	3,312,316.32	11.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	239,800.96	0.85
E	建筑业	274,411.27	0.97
F	批发和零售业	286,443.09	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	451,599.38	1.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	112,033.49	0.40
J	金融业	777,816.22	2.76
K	房地产业	132,251.84	0.47
L	租赁和商务服务业	85,762.04	0.30
M	科学研究和技术服务业	26,254.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	56,265.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,400.00	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	81,400.36	0.29
S	综合	-	-
	合计	6,470,461.89	22.94

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	225,361.09	0.80
原材料	115,810.56	0.41
工业	99,456.69	0.35
金融	275,084.82	0.98
通信服务	68,119.50	0.24
公用事业	24,854.91	0.09
房地产	43,042.33	0.15
合计	851,729.90	3.02

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	000333	美的集团	1,500	112,830.00	0.40
2	601939	建设银行	9,400	82,626.00	0.29
2	00939	建设银行	4,000	24,002.96	0.09
3	01088	中国神华	2,000	62,229.89	0.22
3	601088	中国神华	957	41,610.36	0.15
4	000651	格力电器	2,163	98,308.35	0.35
5	601857	中国石油	6,000	53,640.00	0.19
5	00857	中国石油股份	6,000	33,948.63	0.12
6	600900	长江电力	2,950	87,172.50	0.31
7	601225	陕西煤业	3,438	79,967.88	0.28
8	601668	中国建筑	13,000	78,000.00	0.28
9	600064	南京高科	9,900	76,923.00	0.27
10	01308	海丰国际	4,000	76,676.11	0.27
11	600028	中国石化	6,438	43,005.84	0.15
11	00386	中国石油化工股份	8,000	32,967.02	0.12
12	600660	福耀玻璃	1,200	74,880.00	0.27
13	600938	中国海油	2,500	73,775.00	0.26
14	002027	分众传媒	10,300	72,409.00	0.26
15	600096	云天化	3,200	71,360.00	0.25
16	03328	交通银行	6,000	35,504.37	0.13
16	601328	交通银行	4,444	34,529.88	0.12
17	600887	伊利股份	2,300	69,414.00	0.25
18	601988	中国银行	6,575	36,228.25	0.13

18	03988	中国银行	9,000	33,087.41	0.12
19	000513	丽珠集团	1,800	68,400.00	0.24
20	601766	中国中车	7,925	66,411.50	0.24
21	01398	工商银行	7,000	33,772.68	0.12
21	601398	工商银行	4,600	31,832.00	0.11
22	01288	农业银行	8,000	32,818.86	0.12
22	601288	农业银行	5,869	31,340.46	0.11
23	600029	南方航空	9,600	62,304.00	0.22
24	601717	郑煤机	4,700	61,006.00	0.22
25	002705	新宝股份	4,000	60,000.00	0.21
26	600750	江中药业	2,600	59,020.00	0.21
27	00762	中国联通	6,000	41,060.61	0.15
27	600050	中国联通	3,250	17,257.50	0.06
28	600901	江苏金租	11,100	57,942.00	0.21
29	601600	中国铝业	7,700	56,595.00	0.20
30	01339	中国人民保险 集团	8,000	28,670.20	0.10
30	601319	中国人保	3,650	27,813.00	0.10
31	000338	潍柴动力	4,100	56,170.00	0.20
32	00883	中国海洋石油	3,000	53,117.65	0.19
33	002128	电投能源	2,700	52,866.00	0.19
34	601211	国泰君安	2,800	52,220.00	0.19
35	002091	江苏国泰	7,100	51,972.00	0.18
36	601816	京沪高铁	8,400	51,744.00	0.18
37	002001	新和成	2,300	50,531.00	0.18
38	600919	江苏银行	4,975	48,854.50	0.17
39	601006	大秦铁路	7,100	48,138.00	0.17
40	600177	雅戈尔	5,319	47,339.10	0.17
41	000895	双汇发展	1,800	46,728.00	0.17
42	000498	山东路桥	7,800	46,410.00	0.16
43	003019	宸展光电	1,800	46,044.00	0.16
44	00914	海螺水泥	2,500	46,024.19	0.16
45	600710	苏美达	4,900	45,570.00	0.16
46	01171	兖矿能源	5,200	43,097.90	0.15
46	600188	兖矿能源	132	1,870.44	0.01
47	601919	中远海控	2,900	44,950.00	0.16
48	600398	海澜之家	5,900	44,250.00	0.16
49	601898	中煤能源	3,600	43,848.00	0.16
50	601009	南京银行	4,100	43,665.00	0.15
51	600566	济川药业	1,500	43,620.00	0.15
52	01378	中国宏桥	4,000	43,560.92	0.15
53	300628	亿联网络	1,100	42,460.00	0.15
54	600273	嘉化能源	5,300	42,241.00	0.15
55	601168	西部矿业	2,600	41,782.00	0.15

56	601126	四方股份	2,400	40,704.00	0.14
57	000876	新希望	4,400	39,512.00	0.14
58	000807	云铝股份	2,900	39,237.00	0.14
59	002601	龙佰集团	2,200	38,874.00	0.14
60	601818	光大银行	9,500	36,765.00	0.13
61	600248	陕建股份	8,100	36,288.00	0.13
62	000792	盐湖股份	2,200	36,212.00	0.13
63	06881	中国银河	5,500	36,110.93	0.13
64	600015	华夏银行	4,463	35,748.63	0.13
65	600036	招商银行	900	35,370.00	0.13
66	00728	中国电信	6,000	27,058.89	0.10
66	601728	中国电信	1,150	8,303.00	0.03
67	300502	新易盛	300	34,674.00	0.12
68	002911	佛燃能源	2,729	34,494.56	0.12
69	601138	工业富联	1,600	34,400.00	0.12
70	603040	新坐标	1,500	34,380.00	0.12
71	600007	中国国贸	1,400	34,244.00	0.12
72	603368	柳药集团	1,900	33,934.00	0.12
73	000786	北新建材	1,100	33,341.00	0.12
74	600820	隧道股份	4,550	32,714.50	0.12
75	002274	华昌化工	4,200	32,634.00	0.12
76	603871	嘉友国际	1,640	31,734.00	0.11
77	601128	常熟银行	4,130	31,264.10	0.11
78	002318	久立特材	1,300	30,433.00	0.11
79	002064	华峰化学	3,600	29,448.00	0.10
80	605377	华旺科技	2,200	29,370.00	0.10
81	600741	华域汽车	1,625	28,616.25	0.10
82	01336	新华保险	1,300	28,410.91	0.10
83	300770	新媒股份	700	28,287.00	0.10
84	002078	太阳纸业	1,900	28,253.00	0.10
85	600713	南京医药	5,600	27,776.00	0.10
86	000090	天健集团	6,700	27,537.00	0.10
87	600269	赣粤高速	4,888	27,421.68	0.10
88	000933	神火股份	1,600	27,040.00	0.10
89	601811	新华文轩	1,700	26,945.00	0.10
90	600970	中材国际	2,800	26,544.00	0.09
91	000429	粤高速 A	1,800	26,460.00	0.09
92	600066	宇通客车	1,000	26,380.00	0.09
93	03323	中国建材	8,000	26,225.45	0.09
94	000848	承德露露	2,900	26,013.00	0.09
95	600479	千金药业	2,425	25,899.00	0.09
96	601000	唐山港	5,413	25,495.23	0.09
97	603013	亚普股份	1,700	25,466.00	0.09
98	000915	华特达因	900	25,362.00	0.09

99	603611	诺力股份	1,400	25,130.00	0.09
100	00270	粤海投资	4,000	24,854.91	0.09
101	300308	中际旭创	200	24,702.00	0.09
102	603357	设计总院	2,700	24,462.00	0.09
103	002367	康力电梯	3,525	24,216.75	0.09
104	01908	建发国际集团	2,000	24,188.16	0.09
105	000625	长安汽车	1,800	24,048.00	0.09
106	601101	昊华能源	2,900	23,867.00	0.08
107	002043	兔宝宝	2,000	23,760.00	0.08
108	300979	华利集团	300	23,595.00	0.08
109	301004	嘉益股份	200	23,130.00	0.08
110	600873	梅花生物	2,300	23,069.00	0.08
111	02343	太平洋航运	15,000	22,780.58	0.08
112	600690	海尔智家	800	22,776.00	0.08
113	02328	中国财险	2,000	22,706.50	0.08
114	601666	平煤股份	2,263	22,675.26	0.08
115	002444	巨星科技	700	22,645.00	0.08
116	600012	皖通高速	1,275	22,503.75	0.08
117	603699	纽威股份	1,000	22,170.00	0.08
118	001965	招商公路	1,575	21,971.25	0.08
119	601098	中南传媒	1,463	21,959.63	0.08
120	002028	思源电气	300	21,810.00	0.08
121	601166	兴业银行	1,138	21,804.08	0.08
122	601699	潞安环能	1,500	21,540.00	0.08
123	000975	山金国际	1,388	21,333.56	0.08
124	600583	海油工程	3,900	21,333.00	0.08
125	600323	瀚蓝环境	900	21,258.00	0.08
126	603299	苏盐井神	1,900	21,166.00	0.08
127	000885	城发环境	1,600	20,976.00	0.07
128	000902	新洋丰	1,600	20,864.00	0.07
129	002003	伟星股份	1,463	20,730.71	0.07
130	002697	红旗连锁	3,500	20,685.00	0.07
131	600967	内蒙一机	2,425	20,612.50	0.07
132	603799	华友钴业	700	20,482.00	0.07
133	002475	立讯精密	500	20,380.00	0.07
134	603855	华荣股份	1,000	20,290.00	0.07
135	600997	开滦股份	3,000	20,280.00	0.07
136	000921	海信家电	700	20,230.00	0.07
137	002130	沃尔核材	800	20,200.00	0.07
138	300360	炬华科技	1,200	20,124.00	0.07
139	601058	赛轮轮胎	1,400	20,062.00	0.07
140	600348	华阳股份	2,800	19,852.00	0.07
141	600872	中炬高新	900	19,818.00	0.07
142	300002	神州泰岳	1,700	19,703.00	0.07

143	600926	杭州银行	1,300	18,993.00	0.07
144	00123	越秀地产	4,000	18,854.17	0.07
145	601838	成都银行	1,100	18,821.00	0.07
146	600219	南山铝业	4,800	18,768.00	0.07
147	601577	长沙银行	2,100	18,669.00	0.07
148	002353	杰瑞股份	500	18,495.00	0.07
149	000887	中鼎股份	1,400	18,368.00	0.07
150	300394	天孚通信	200	18,272.00	0.06
151	000725	京东方 A	4,100	17,999.00	0.06
152	002416	爱施德	1,100	17,897.00	0.06
153	000630	铜陵有色	5,500	17,765.00	0.06
154	000999	华润三九	400	17,736.00	0.06
155	002517	恺英网络	1,300	17,693.00	0.06
156	600482	中国动力	700	17,129.00	0.06
157	600528	中铁工业	2,125	17,127.50	0.06
158	600511	国药股份	500	17,110.00	0.06
159	601156	东航物流	1,000	16,870.00	0.06
160	002267	陕天然气	1,975	16,688.75	0.06
161	002788	鹭燕医药	2,025	16,625.25	0.06
162	002110	三钢闽光	5,000	16,600.00	0.06
163	002249	大洋电机	2,800	16,436.00	0.06
164	603156	养元饮品	700	15,988.00	0.06
165	002032	苏泊尔	300	15,963.00	0.06
166	600993	马应龙	600	15,666.00	0.06
167	600916	中国黄金	1,800	15,516.00	0.06
168	600989	宝丰能源	900	15,156.00	0.05
169	002508	老板电器	700	15,001.00	0.05
170	000930	中粮科技	2,688	14,918.40	0.05
171	600886	国投电力	888	14,758.56	0.05
172	603298	杭叉集团	820	14,669.80	0.05
173	603618	杭电股份	2,700	14,661.00	0.05
174	002142	宁波银行	600	14,586.00	0.05
175	600309	万华化学	200	14,270.00	0.05
176	600908	无锡银行	2,413	14,260.83	0.05
177	000830	鲁西化工	1,213	14,179.97	0.05
178	600704	物产中大	2,775	14,041.50	0.05
179	300815	玉禾田	900	14,031.00	0.05
180	000858	五粮液	100	14,004.00	0.05
181	603283	赛腾股份	200	13,832.00	0.05
182	605368	蓝天燃气	1,200	13,716.00	0.05
183	002833	弘亚数控	800	13,464.00	0.05
184	600285	羚锐制药	600	13,296.00	0.05
185	600489	中金黄金	1,100	13,233.00	0.05
186	601231	环旭电子	800	13,200.00	0.05

187	002393	力生制药	738	13,018.32	0.05
188	601985	中国核电	1,238	12,912.34	0.05
189	002807	江阴银行	2,963	12,889.05	0.05
190	601169	北京银行	2,057	12,650.55	0.04
191	000708	中信特钢	1,100	12,551.00	0.04
192	603279	景津装备	700	12,516.00	0.04
193	600380	健康元	1,100	12,397.00	0.04
194	601019	山东出版	1,088	12,348.80	0.04
195	601077	渝农商行	2,025	12,251.25	0.04
196	600971	恒源煤电	1,288	12,120.08	0.04
197	603393	新天然气	400	12,108.00	0.04
198	601899	紫金矿业	800	12,096.00	0.04
199	600846	同济科技	1,400	12,068.00	0.04
200	002381	双箭股份	1,775	11,821.50	0.04
201	600582	天地科技	1,900	11,742.00	0.04
202	300019	硅宝科技	800	11,712.00	0.04
203	000157	中联重科	1,613	11,661.99	0.04
204	601872	招商轮船	1,800	11,538.00	0.04
205	002244	滨江集团	1,300	11,193.00	0.04
206	603995	甬金股份	600	10,974.00	0.04
207	601018	宁波港	2,850	10,972.50	0.04
208	002938	鹏鼎控股	300	10,944.00	0.04
209	601001	晋控煤业	800	10,936.00	0.04
210	002448	中原内配	1,725	10,798.50	0.04
211	002643	万润股份	875	10,500.00	0.04
212	000156	华数传媒	1,450	10,440.00	0.04
213	002004	华邦健康	2,300	10,396.00	0.04
214	002687	乔治白	2,300	10,074.00	0.04
215	000661	长春高新	100	9,944.00	0.04
216	002154	报喜鸟	2,200	9,702.00	0.03
217	601658	邮储银行	1,688	9,587.84	0.03
218	600019	宝钢股份	1,275	8,925.00	0.03
219	002948	青岛银行	2,300	8,924.00	0.03
220	600350	山东高速	863	8,871.64	0.03
221	000789	万年青	1,763	8,832.63	0.03
222	603166	福达股份	1,213	8,818.51	0.03
223	600373	中文传媒	700	8,785.00	0.03
224	600729	重庆百货	300	8,775.00	0.03
225	600803	新奥股份	400	8,672.00	0.03
226	688516	奥特维	200	8,662.00	0.03
227	603056	德邦股份	600	8,598.00	0.03
228	600123	兰花科创	1,000	8,560.00	0.03
229	605090	九丰能源	300	8,559.00	0.03
230	002540	亚太科技	1,388	8,550.08	0.03

231	600039	四川路桥	1,163	8,466.64	0.03
232	002563	森马服饰	1,200	8,424.00	0.03
233	000932	华菱钢铁	2,000	8,360.00	0.03
234	002315	焦点科技	200	8,336.00	0.03
235	603868	飞科电器	200	8,304.00	0.03
236	000400	许继电气	300	8,259.00	0.03
237	600888	新疆众和	1,163	8,257.30	0.03
238	002960	青鸟消防	700	8,169.00	0.03
239	600737	中粮糖业	800	8,168.00	0.03
240	002831	裕同科技	300	8,130.00	0.03
241	601512	中新集团	988	7,587.84	0.03
242	600755	厦门国贸	1,138	7,556.32	0.03
243	002895	川恒股份	300	7,380.00	0.03
244	300701	森霸传感	700	7,175.00	0.03
245	601229	上海银行	782	7,155.30	0.03
246	600218	全柴动力	900	7,110.00	0.03
247	600761	安徽合力	400	7,060.00	0.03
248	301469	恒达新材	300	7,050.00	0.02
249	600025	华能水电	738	7,018.38	0.02
250	301158	德石股份	500	7,015.00	0.02
251	603966	法兰泰克	900	6,948.00	0.02
252	600377	宁沪高速	450	6,889.50	0.02
253	603565	中谷物流	700	6,860.00	0.02
254	601601	中国太保	200	6,816.00	0.02
255	600035	楚天高速	1,463	6,729.80	0.02
256	002107	沃华医药	1,400	6,692.00	0.02
257	002674	兴业科技	700	6,643.00	0.02
258	603866	桃李面包	1,000	6,600.00	0.02
259	000937	冀中能源	1,000	6,320.00	0.02
260	002372	伟星新材	500	6,315.00	0.02
261	000822	山东海化	1,100	6,248.00	0.02
262	001299	美能能源	500	6,220.00	0.02
263	600033	福建高速	1,600	6,208.00	0.02
264	300512	中亚股份	900	6,129.00	0.02
265	300441	鲍斯股份	700	6,104.00	0.02
266	600461	洪城环境	600	5,970.00	0.02
267	605058	澳弘电子	300	5,949.00	0.02
268	002867	周大生	400	5,812.00	0.02
269	002818	富森美	388	5,796.72	0.02
270	601216	君正集团	1,100	5,786.00	0.02
271	603688	石英股份	200	5,746.00	0.02
272	002809	红墙股份	700	5,551.00	0.02
273	603816	顾家家居	200	5,516.00	0.02
274	600612	老凤祥	100	5,427.00	0.02

275	002327	富安娜	600	5,304.00	0.02
276	601997	贵阳银行	875	5,250.00	0.02
277	600825	新华传媒	800	5,240.00	0.02
278	603517	绝味食品	300	4,932.00	0.02
279	002136	安纳达	500	4,875.00	0.02
280	002441	众业达	600	4,668.00	0.02
281	603811	诚意药业	600	4,632.00	0.02
282	000928	中钢国际	663	4,223.31	0.01
283	002487	大金重工	200	4,098.00	0.01
284	002737	葵花药业	200	4,098.00	0.01
285	600757	长江传媒	413	3,952.41	0.01
286	600674	川投能源	225	3,881.25	0.01
287	603967	中创物流	363	3,561.03	0.01
288	002839	张家港行	800	3,496.00	0.01
289	600167	联美控股	600	3,438.00	0.01
290	002607	中公教育	1,000	3,400.00	0.01
291	002048	宁波华翔	263	3,319.06	0.01
292	000970	中科三环	300	3,111.00	0.01
293	000823	超声电子	300	3,096.00	0.01
294	600016	民生银行	700	2,891.00	0.01
295	002030	达安基因	500	2,840.00	0.01
296	002462	嘉事堂	207	2,674.44	0.01
297	600000	浦发银行	250	2,572.50	0.01
298	600801	华新水泥	200	2,420.00	0.01
299	600098	广州发展	375	2,407.50	0.01
300	600546	山煤国际	200	2,366.00	0.01
301	600325	华发股份	400	2,304.00	0.01
302	601928	凤凰传媒	188	2,169.52	0.01
303	601390	中国中铁	338	2,159.82	0.01
304	600985	淮北矿业	150	2,110.50	0.01
305	603367	辰欣药业	150	2,061.00	0.01
306	300017	网宿科技	188	1,987.16	0.01
307	300446	航天智造	113	1,865.63	0.01
308	603113	金能科技	319	1,795.97	0.01
309	003008	开普检测	100	1,792.00	0.01
310	600642	申能股份	188	1,784.12	0.01
311	600125	铁龙物流	300	1,779.00	0.01
312	600180	瑞茂通	413	1,775.90	0.01
313	002701	奥瑞金	300	1,701.00	0.01
314	000905	厦门港务	225	1,611.00	0.01
315	688561	奇安信	1	26.83	0.00

注：建设银行、中国神华、中国石油、中国石化、交通银行、中国银行、工商银行、农业银行、中国联通、中国人保、兖矿能源和中国电信同时在 A+H 股上市，合并计算其

公允价值参与排序。

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	000333	美的集团	606,202.00	1.20
2	002327	富安娜	601,937.00	1.19
3	603357	设计总院	592,219.00	1.17
4	002027	分众传媒	571,253.00	1.13
5	601939	建设银行	564,316.00	1.12
6	603757	大元泵业	539,610.00	1.07
7	600887	伊利股份	538,797.00	1.07
8	601126	四方股份	524,891.00	1.04
9	600323	瀚蓝环境	514,108.00	1.02
10	002091	江苏国泰	488,383.00	0.97
11	000848	承德露露	487,741.00	0.96
12	300770	新媒股份	486,727.00	0.96
13	002128	电投能源	485,069.00	0.96
14	600036	招商银行	483,526.00	0.96
15	002687	乔治白	464,463.54	0.92
16	000498	山东路桥	463,750.00	0.92
17	002032	苏泊尔	461,593.00	0.91
18	603228	景旺电子	449,675.00	0.89
19	000895	双汇发展	449,122.00	0.89
20	601677	明泰铝业	445,317.00	0.88

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	603283	赛腾股份	594,094.00	1.18
2	002327	富安娜	594,092.00	1.18
3	603357	设计总院	573,238.00	1.13

4	600479	千金药业	570,140.50	1.13
5	601939	建设银行	569,415.00	1.13
6	601668	中国建筑	569,019.00	1.13
7	000333	美的集团	542,300.00	1.07
8	002027	分众传媒	531,892.00	1.05
9	002064	华峰化学	524,166.00	1.04
10	601088	中国神华	511,487.67	1.01
11	603757	大元泵业	510,314.00	1.01
12	601126	四方股份	507,967.00	1.00
13	002911	佛燃能源	496,320.00	0.98
14	600323	瀚蓝环境	495,251.00	0.98
15	603013	亚普股份	493,966.00	0.98
16	600007	中国国贸	486,595.00	0.96
17	000090	天健集团	484,267.60	0.96
18	002788	鹭燕医药	478,143.73	0.95
19	600887	伊利股份	476,336.00	0.94
20	601666	平煤股份	473,686.34	0.94

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	44,212,893.39
卖出股票的收入（成交）总额	55,615,386.70

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	4,880,442.03	17.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,003,805.48	39.01
	其中：政策性金融债	11,003,805.48	39.01
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）	4,006,362.00	14.20

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,890,609.51	70.52

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	200205	20 国开 05	100,000	11,003,805.48	39.01
2	019743	24 国债 11	31,000	3,268,023.40	11.59
3	019749	24 国债 15	16,000	1,612,418.63	5.72
4	113042	上银转债	6,020	722,717.33	2.56
5	110059	浦发转债	6,100	664,899.16	2.36

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

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

8.11.2 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险，符合既定投资政策及投资目标。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局北京监管局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

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	146,001.11
2	应收清算款	602,332.16
3	应收股利	1,273.60
4	应收利息	-
5	应收申购款	19.98
6	其他应收款	66,441.54
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	816,068.39

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产
----	------	------	------	-------

				净值比例 (%)
1	113042	上银转债	722,717.33	2.56
2	110059	浦发转债	664,899.16	2.36
3	113052	兴业转债	451,425.75	1.60
4	113037	紫银转债	405,552.00	1.44
5	113056	重银转债	329,115.28	1.17
6	127045	牧原转债	59,605.37	0.21
7	128129	青农转债	55,820.72	0.20
8	110079	杭银转债	52,927.38	0.19
9	123107	温氏转债	51,472.71	0.18
10	113050	南银转债	42,875.59	0.15
11	110081	闻泰转债	40,981.02	0.15
12	113045	环旭转债	34,789.00	0.12
13	127040	国泰转债	33,415.31	0.12
14	127049	希望转 2	29,287.39	0.10
15	127020	中金转债	28,920.59	0.10
16	113641	华友转债	27,345.36	0.10
17	113065	齐鲁转债	24,730.47	0.09
18	118034	晶能转债	24,339.47	0.09
19	127089	晶澳转债	22,953.17	0.08
20	113062	常银转债	22,619.83	0.08
21	127027	能化转债	21,268.22	0.08
22	113647	禾丰转债	21,243.28	0.08
23	127018	本钢转债	20,420.26	0.07
24	111010	立昂转债	20,272.54	0.07
25	127084	柳工转 2	19,894.26	0.07
26	127086	恒邦转债	18,826.88	0.07
27	110085	通 22 转债	18,798.43	0.07
28	127024	盈峰转债	18,417.60	0.07
29	113068	金铜转债	18,249.22	0.06
30	113049	长汽转债	18,046.31	0.06
31	113631	皖天转债	17,888.85	0.06
32	127085	韵达转债	17,709.17	0.06
33	128134	鸿路转债	17,552.22	0.06
34	123240	楚天转债	16,950.04	0.06
35	113051	节能转债	16,670.89	0.06
36	118022	锂科转债	16,447.96	0.06
37	113054	绿动转债	16,432.15	0.06
38	127042	嘉美转债	16,334.51	0.06
39	127039	北港转债	16,250.20	0.06
40	127028	英特转债	16,202.79	0.06
41	127022	恒逸转债	15,925.19	0.06

42	127032	苏行转债	15,700.55	0.06
43	113064	东材转债	15,408.52	0.05
44	113046	金田转债	15,015.98	0.05
45	113532	海环转债	14,699.24	0.05
46	123048	应急转债	14,574.94	0.05
47	113024	核建转债	14,272.02	0.05
48	127016	鲁泰转债	13,498.00	0.05
49	111009	盛泰转债	13,357.57	0.05
50	111014	李子转债	13,217.24	0.05
51	110062	烽火转债	12,634.77	0.04
52	128133	奇正转债	12,180.85	0.04
53	113061	拓普转债	11,299.94	0.04
54	127067	恒逸转 2	10,967.65	0.04
55	110093	神马转债	10,624.06	0.04
56	127026	超声转债	10,458.42	0.04
57	110089	兴发转债	10,262.82	0.04
58	127102	浙建转债	10,147.15	0.04
59	110084	贵燃转债	9,799.72	0.03
60	127014	北方转债	9,573.37	0.03
61	128081	海亮转债	9,495.18	0.03
62	110095	双良转债	9,116.10	0.03
63	127050	麒麟转债	8,039.86	0.03
64	113623	凤 21 转债	7,960.48	0.03
65	113655	欧 22 转债	7,841.16	0.03
66	113549	白电转债	7,601.76	0.03
67	113666	爱玛转债	7,586.52	0.03
68	123119	康泰转 2	7,559.43	0.03
69	113053	隆 22 转债	7,427.21	0.03
70	127025	冀东转债	7,363.82	0.03
71	123216	科顺转债	7,356.61	0.03
72	113632	鹤 21 转债	7,355.88	0.03
73	127017	万青转债	7,312.46	0.03
74	127103	东南转债	7,198.71	0.03
75	113069	博 23 转债	6,782.05	0.02
76	113545	金能转债	6,479.18	0.02
77	127091	科数转债	6,290.18	0.02
78	127070	大中转债	5,545.51	0.02
79	123210	信服转债	5,404.93	0.02
80	118030	睿创转债	5,274.18	0.02
81	118013	道通转债	5,208.32	0.02
82	128131	崇达转 2	4,863.91	0.02
83	128141	旺能转债	4,821.57	0.02
84	123149	通裕转债	4,711.10	0.02
85	123161	强联转债	4,659.99	0.02

86	113616	韦尔转债	4,655.83	0.02
87	113638	台 21 转债	4,515.59	0.02
88	110064	建工转债	4,438.19	0.02
89	127082	亚科转债	3,752.90	0.01
90	110094	众和转债	3,713.29	0.01
91	128130	景兴转债	3,701.86	0.01
92	123145	药石转债	3,666.03	0.01
93	127064	杭氧转债	3,653.96	0.01
94	127052	西子转债	3,578.59	0.01
95	128144	利民转债	3,507.02	0.01
96	127015	希望转债	3,228.09	0.01
97	127035	濮耐转债	2,550.53	0.01
98	128132	交建转债	2,534.72	0.01
99	118003	华兴转债	2,482.37	0.01
100	127054	双箭转债	2,350.00	0.01
101	111002	特纸转债	2,348.78	0.01
102	113584	家悦转债	2,342.97	0.01
103	128128	齐翔转 2	2,322.16	0.01
104	113030	东风转债	1,324.65	0.00
105	113651	松霖转债	1,291.62	0.00
106	110055	伊力转债	1,286.00	0.00
107	123022	长信转债	1,269.97	0.00
108	113039	嘉泽转债	1,233.53	0.00
109	123130	设研转债	1,153.88	0.00
110	113639	华正转债	1,080.50	0.00
111	113048	晶科转债	1,060.62	0.00
112	118031	天 23 转债	1,026.03	0.00
113	128071	合兴转债	578.17	0.00

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。

89 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	户均持有的	持有人结构
------	----	-------	-------

	人户数(户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通富利三个月持有 A	733	25,399.86	9,942.61	0.05%	18,608,157.30	99.95%
海富通富利三个月持有 C	234	40,602.63	-	-	9,501,016.04	100.00%
合计	967	29,078.71	9,942.61	0.04%	28,109,173.34	99.96%

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	海富通富利三个月持有 A	500,827.44	2.6900%
	海富通富利三个月持有 C	60.96	0.0006%
	合计	500,888.40	1.7813%

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	海富通富利三个月持有 A	10~50
	海富通富利三个月持有 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通富利三个月持有 A	10~50
	海富通富利三个月持有 C	0
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
基金合同生效日（2021 年 7 月 20 日）基金份额总额	120,616,157.58	157,024,982.53
本报告期期初基金份额总额	28,219,622.95	25,964,357.72
本报告期基金总申购份额	637,446.18	373,790.38
减：本报告期基金总赎回份额	10,238,969.22	16,837,132.06
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	18,618,099.91	9,501,016.04

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2024 年 8 月 13 日至 2024 年 9 月 13 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于持续运作海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金的议案》。根据计票结果，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一），未达到法定的基金份额持有人大会召开条件。详情请参考本基金管理人发布的相关公告。

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 30,000.00 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

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	佣金	占当期 佣金总 量的比 例	
海通证券	2	99,828,280.09	100.00%	67,562.07	100.00%	-

注：1、报告期内本基金退租湘财证券两个交易单元。

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
海通证券	97,616,614.81	100.00%	285,527,000.00	100.00%	-	-

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旗下部分基金新增贵州省贵文文化基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-12
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增京东肯特瑞基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-17
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-07
4	海富通基金管理有限公司关于以通讯方式召开海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-08-12
5	海富通基金管理有限公司关于以通讯方式召开海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-08-13
6	海富通基金管理有限公司关于以通讯方式召开海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-08-14
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泛华普益基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-08-26

	公告	站	
8	海富通基金管理有限公司关于董事长变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-09-04
9	海富通基金管理有限公司关于海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-09-19
10	海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-09-27
11	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-09-30
12	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-11-22
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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-12-11

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
个人	1	2024/3/29-2024/8/25	10,000,000.00	-	10,000,000.00	-	-
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 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富利三个月持有期混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

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