

**海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金**  
**2023 年年度报告**  
**2023 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：二〇二四年三月二十九日

## §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 2024 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 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	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
<b>§4 管理人报告</b>	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	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	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	21
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	22
<b>§5 托管人报告</b>	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	22
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	22
<b>§6 审计报告</b>	22
6.1 审计意见	22
6.2 形成审计意见的基础	23
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	23
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	23
<b>§7 年度财务报表</b>	24
7.1 资产负债表	25
7.2 利润表	26
7.3 净资产变动表	27
7.4 报表附注	29
<b>§8 投资组合报告</b>	59
8.1 期末基金资产组合情况	59
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	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67

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 .....	68
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 .....	68
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 .....	68
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 .....	68
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	68
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	69
8.12	投资组合报告附注 .....	69
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>72</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	72
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	72
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 .....	72
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>73</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>73</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	73
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 .....	73
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	73
11.4	基金投资策略的改变 .....	74
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	74
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 .....	74
11.6.1	管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	74
11.6.2	托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	74
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	74
11.8	其他重大事件 .....	75
<b>12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>76</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>77</b>
13.1	备查文件目录 .....	77
13.2	存放地点 .....	77
13.3	查阅方式 .....	77

## §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	54,183,980.67 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	28,219,622.95 份	25,964,357.72 份

### 2.2 基金产品说明

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

	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	姜敏
	联系电话	021-38650788	4006800000
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		40088-40099	95558
传真		021-33830166	010-85230024
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京市朝阳区光华路10号院 1号楼6-30层、32-42层
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京市朝阳区光华路10号院 1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		200120	100020
法定代表人		杨仓兵	方合英

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金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	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号 前滩中心 42 楼
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	2023 年		2022 年		2021 年 7 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	
	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	-913,911.74	-885,184.88	-1,307,574.25	-1,784,500.05	761,883.26	729,280.80
本期利润	-716,218.33	-684,857.56	-3,161,292.74	-4,311,558.52	2,401,722.84	2,836,084.75
加权平均基金份额本期利润	-0.0225	-0.0254	-0.0609	-0.0708	0.0212	0.0193
本期加	-2.34%	-2.67%	-6.14%	-7.15%	2.11%	1.92%

权平均 净值利 润率						
本期基 金份额 净值增 长率	-2.58%	-2.96%	-5.99%	-6.37%	2.33%	2.14%
<b>3.1.2 期 末数据 和指标</b>	<b>2023 年末</b>		<b>2022 年末</b>		<b>2021 年末</b>	
	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	-1,771,383 .42	-1,868,551 .90	-1,410,563. 68	-1,317,296. 18	716,338.19	723,774.13
期末可 供分配 基金份 额利润	-0.0628	-0.0720	-0.0380	-0.0437	0.0080	0.0061
期末基 金资产 净值	26,448,23 9.53	24,095,80 5.82	35,672,231. 86	28,859,823. 77	91,893,617. 07	120,295,803. 24
期末基 金份额 净值	0.9372	0.9280	0.9620	0.9563	1.0233	1.0214
<b>3.1.3 累 计期末 指标</b>	<b>2023 年末</b>		<b>2022 年末</b>		<b>2021 年末</b>	
	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	-6.28%	-7.20%	-3.80%	-4.37%	2.33%	2.14%



净值增长率						
-------	--	--	--	--	--	--

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）。

4、本基金合同生效日为 2021 年 7 月 20 日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

### 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	-1.18%	0.24%	-0.66%	0.17%	-0.52%	0.07%
过去六个月	-2.79%	0.26%	-1.52%	0.18%	-1.27%	0.08%
过去一年	-2.58%	0.24%	-0.64%	0.18%	-1.94%	0.06%
自基金合同生效起至今	-6.28%	0.27%	-4.37%	0.22%	-1.91%	0.05%

##### 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	-1.29%	0.24%	-0.66%	0.17%	-0.63%	0.07%

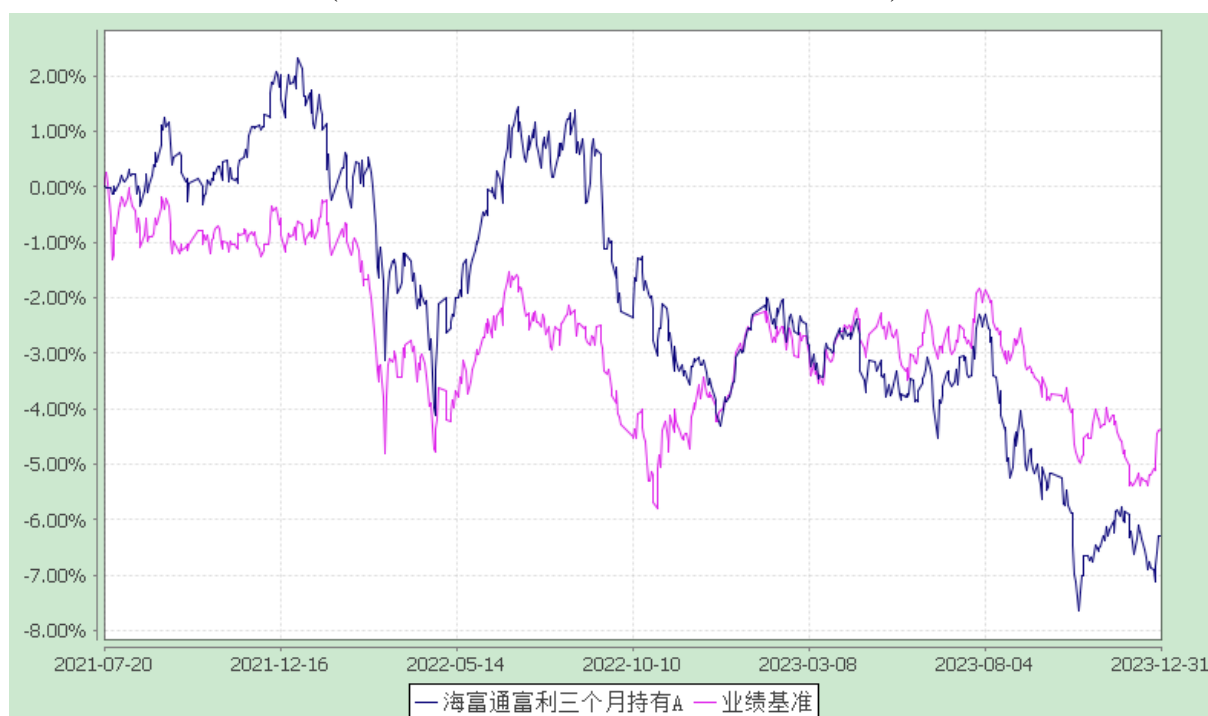
过去六个月	-2.99%	0.26%	-1.52%	0.18%	-1.47%	0.08%
过去一年	-2.96%	0.24%	-0.64%	0.18%	-2.32%	0.06%
自基金合同生效起至今	-7.20%	0.28%	-4.37%	0.22%	-2.83%	0.06%

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

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

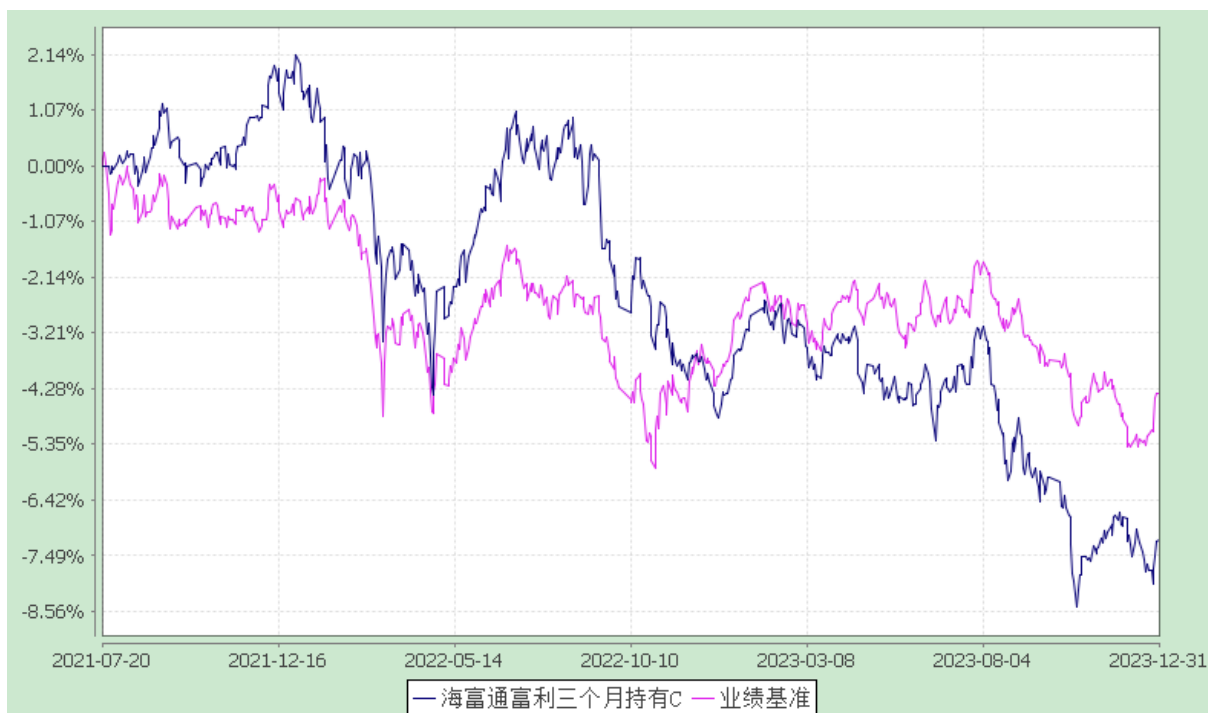
#### 1. 海富通富利三个月持有 A

(2021 年 7 月 20 日至 2023 年 12 月 31 日)



#### 2. 海富通富利三个月持有 C

(2021 年 7 月 20 日至 2023 年 12 月 31 日)



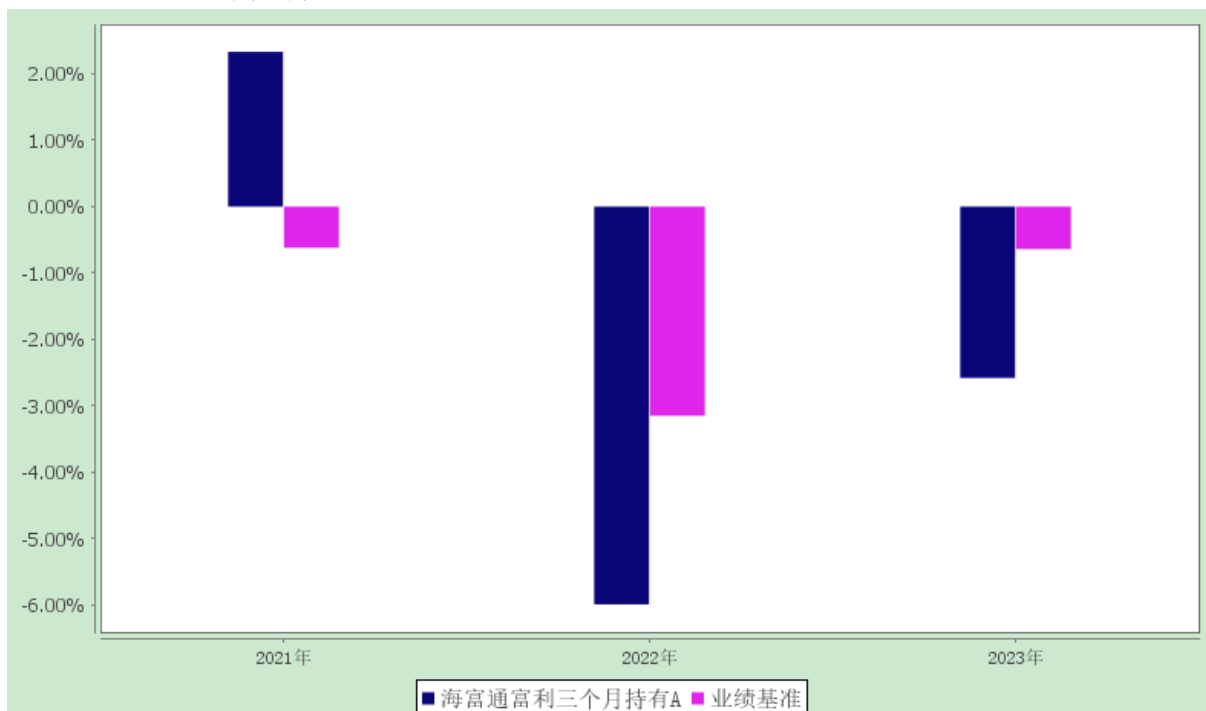
注：本基金合同于 2021 年 7 月 20 日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

### 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

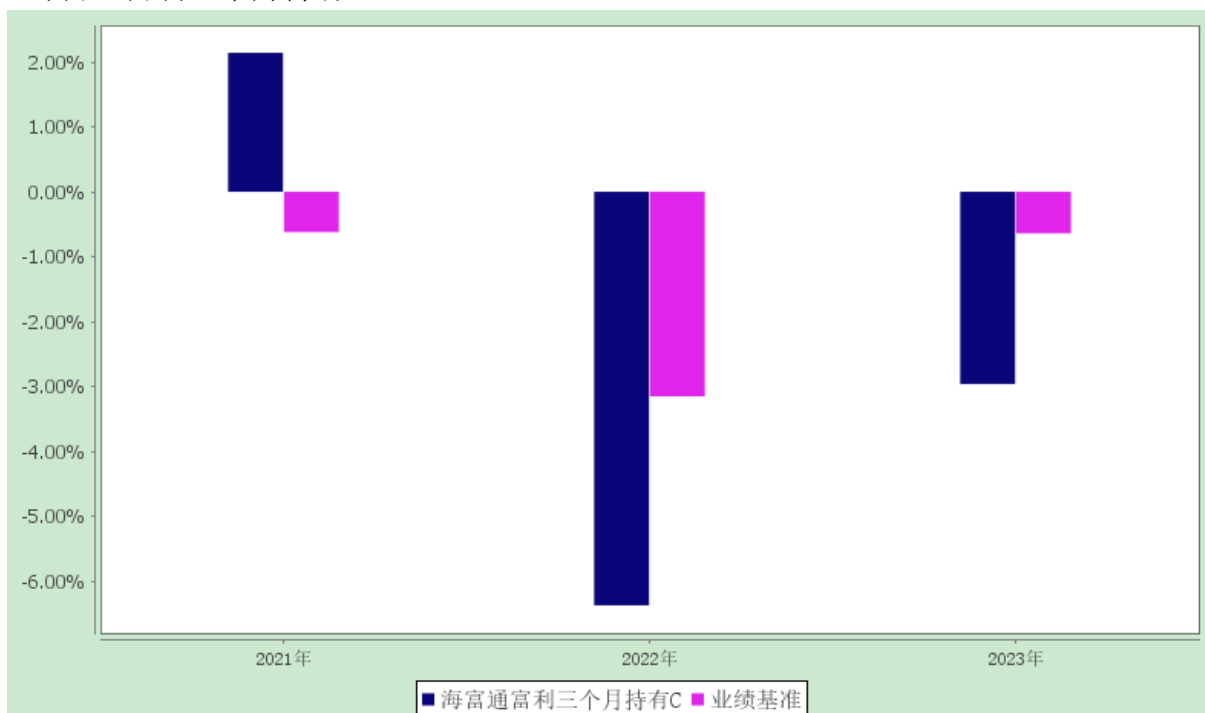
#### 海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金

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
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 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 份基金份额分	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

	红数				
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金自基金合同生效日（2021 年 7 月 20 日）至本报告期末未发生利润分配。

## §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 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 88 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开

放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张靖爽	本基金的基金经理；债券基金部副总监。	2021-07-20	-	13 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中银基金管理有限公司研究员，交银施罗德基金管理有限公司投资经理、基金经理助理、研究员。2016 年 7 月至 2017 年 10 月任海富通双利债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2016 年 11

					<p>月至 2019 年 11 月兼任海富通纯债债券基金经理。2017 年 8 月起兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）和海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2018 年 2 月至 2021 年 2 月任海富通融丰定开债券基金经理。2018 年 11 月至 2020 年 10 月任海富通鼎丰定开债券基金经理。2019 年 5 月至 2022 年 12 月兼任海富通新内需混合基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 4 月任海富通聚合纯债基金经理。2019 年 12 月起兼任海富通裕通 30 个月定开债券基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通裕昇三年定开债券基金经理。2020 年 5 月至 2021 年 7 月兼任海富通瑞弘 6 个月定开债券基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。2022 年 8 月起兼任海富通添鑫收益债券基金经理。</p>
杜晓海	本基金的基金经理；总经理助理兼量化投资部总监。	2021-07-20	-	23 年	<p>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，现任海富通基金管理有限公司总经理助理兼量化投资部总监。2016 年 6 月起任海富通安颐收益混合（原海富</p>

				<p>通养老收益混合) 基金经理。2016 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 10 月兼任海富通富睿混合(现海富通沪深 300 增强) 基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至 2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月至 2021 年 7 月兼任海富通中证 500 增强(原海富通中证内地低碳指数) 基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月至 2023 年 10 月兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金</p>
--	--	--	--	--



					经理。2023 年 10 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。
林立禾	本基金的基金经理	2023-11-23	-	5 年	美国密歇根大学定量金融与风险管理硕士。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。
林立禾	本基金的基金经理助理	2023-03-22	2023-11-23	5 年	美国密歇根大学定量金融与风险管理硕士。历任中欧基金管理有限公司风险管理部量化风控岗。2020 年 8 月加入海富通基金管理有限公司，历任量化研究员、量化投资部基金经理助理。2023 年 11 月起任海富通欣益混合、海富通富利三个月持有、海富通沪深 300 增强的基金经理。

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

2023 年，国内宏观经济逐步修复，全年实现 GDP 增速 5.2%，总体平稳向好；物价也相对平稳，全年居民消费价格（CPI）比上年上涨 0.2%。从节奏上看，上半年恢复效应较为显著，经济相对较好；下半年，房地产市场持续走弱，对整体经济、地方财政的负面影响逐步显现，市场对经济的信心也在不断降低。

海外方面，2023 年美国在超预期的财政扩张支撑下继续维持强势，美国通胀也一直在 3% 以上运行和波动。受此影响，美国十年期国债收益率逐步上行，在 2023 年 10 月最高点超过 5%；随后两个月虽然有所回落，但依然保持在 4% 左右的高位。这对全球金融市场、资产价格均产生了较为显著的影响。

从 A 股市场看，全年主要指数均以下跌为主，上证指数为-3.70%，沪深 300 为-11.38%，中证 800 为-10.37%，创业板指为-19.41%。行业板块方面，根据中信一级行业分类，通信、传媒、煤炭、家电、石油石化排名前五，涨幅分别为 24.78%、19.84%、13.39%、9.13%、9.03%；消费者服务、房地产、电力设备及新能源、建材、基础化工排名后五，分别下跌 41.18%、24.80%、24.65%、20.47%、17.50%。节奏方面，上半年市场以平稳分化为主，结构性机会较多，科技成长行业的超额收益更为显著；下半年市场以单边下跌为主，低估值、高分红板块较为抗跌，而上半年大幅上涨的科技板块出现了显著回调。从驱动因素看，国内外经济和政策的运行及变化，对 A 股市场有较显著的影响，而 AI

技术的变更，是 TMT 等科技成长行业在上半年出现显著结构性机会的核心驱动力。

本报告期内，本基金在股票策略上逐渐由以核心资产为主的策略过渡到以具有长期价值增长及红利属性的公司作为核心持仓标的的价值类策略，转债策略也逐渐得到重视，占比在报告期内逐步上升。另外，本基金也增加了股指期货在套保上的应用。

回顾本报告期的投资操作，净值损失主要来源于高仓位运作叠加市场整体表现不佳。

固定收益方面，2023 年国内经济总体维持修复的状态，全年实现 5.2% 的实际 GDP 增速。具体来看，投资端表现偏弱，基建与制造业的高增被地产投资拖累；消费受到 2022 年积压需求集中释放的影响，出行链相关消费总体呈现超季节性修复的特征，总体带动第三产业修复；出口受到美国加息、欧洲经济磨底、逆全球化背景下需求转移等不利因素的影响，总体承压，但结构上仍有一定亮点。通胀方面，由于需求端弹性不足，无论是 CPI 还是 PPI 均面临负增的压力。货币政策方面总体维持适量宽松的操作，全年 2 次降准，2 次降息。财政发力更为主动，除了 2023 年初预算内额度外，年末增发万亿国债用于灾后重建和防灾减灾；增发约 1.4 万亿特殊再融资债用于化解地方政府债务问题。

债券市场方面，2023 年总体演绎牛市行情。开年 1-2 月债券市场空头情绪浓重，主要反映的是对稳增长政策的期待和经济强劲复苏的预期，利率整体上行。3-4 月市场对政策的预期回归中性，叠加配置需求较强，利率逐渐向下行趋势切换。5-8 月，在经济环比偏弱、央行 2 次降息的背景下，利率迅速下探至年内低点。9-12 月债市在宽财政与宽货币的碰撞下收益率总体呈现先上后下的行情。

本组合在 2023 年积极参与了利率债的投资，同时灵活调整仓位应对市场的风险。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通富利三个月持有 A 净值增长率为-2.58%，同期业绩比较基准收益率为-0.64%，基金净值跑输业绩比较基准 1.94 个百分点。海富通富利三个月持有 C 净值增长率为-2.96%，同期业绩比较基准收益率为-0.64%，基金净值跑输业绩比较基准 2.32 个百分点。报告期内，股票市场波动较大，主流指数大多下跌，组合整体仓位还是偏高，导致基金跑输基准。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从全球经济看，由于美国财政高杠杆、货币高利率的制约，2024 年美国财政刺激力度将边际走弱，美国经济、通胀也将逐步下行，具体的下行速度、幅度需要具体跟踪。在这个背景下，美联储的具体降息操作将成为全球市场关注的一个焦点。这对全球金融市场、各类资产都将产生较为显著的影响，我们面临的外部金融环境有望缓解。

中国经济暂时仍面临着总需求不足、结构调整阵痛的冲击，在这过程中市场信心的脆弱和不足可能短期加剧经济的疲弱。不过，目前市场信心已在相对低位，监管层也在积极呵护市场，对经济的托底力度也有望进一步加强。我们对此依然怀着积极心态，积极跟踪国内政策和经济的变化。

量化策略上，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，国内经济方面，2024 年仍然处于新旧动能切换期，向上的修复需要政策的加持。旧动能方面，地产作为过去经济的核心驱动因素之一，面临需求下滑的情况没有改变，政策端希望通过城中村改造、保障房等方式直接拉动投资端，减缓地产对经济的拖累。地方化债背景下，城投平台作为地方政府的融资手段受限，地方加杠杆空间被压缩，要维持偏强的基建投资增速就需要中央财政更加积极有为。货币政策方面，2024 年大基调可能还是以稳为主，在宣布 2 月初年内第一次降准后，预计年内仍有降息空间。2023 年年底金融工作会议提出“融资成本持续下降”，目前商业银行的净息差已基本降至历史最低，广谱利率的下调并未结束，政策利率也有下行空间，节奏上取决于 2024 年经济的复苏情况和美联储的货币政策操作。对于债券市场而言，2024 年财政端地方债务化解、中央加杠杆，和货币政策端的宽松或成为主导债券市场的关键因素。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 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、专项稽核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，健全内控体系，落实内控责任。

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，新增和修订了多项内部制度和流程，并持续倡导合规文化建设，提升了公司内部控制环境建设。

二、客观开展内外部内控评估，进一步完善内控措施。

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。针对上述内外部评估检查中发现的问题，公司相关业务部门均认真进行整改。通过及时跟踪落实各项问题的整改情况，严格控制了各部门的主要风险，加强并完善了公司的内部控制状况。

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及流程，组织多场反

洗钱专项培训和宣传活动；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，全面升级反洗钱系统，持续优化监测模型，强化对大额交易和可疑交易方面的监控，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 2022 年度洗钱固有风险评估工作，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，提升反洗钱工作质效。

四、强化法规学习，组织开展内外部培训，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。另外，通过考试等方式检验培训效果，将法规落实到具体的业务、工作中。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

- 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

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 2023 年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

#### 5.3 托管人对本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 2023 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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### §6 审计报告

普华永道中天审字(2024)第 20558 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

(一)我们审计的内容

我们审计了海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“海富通富利三个月持有混合基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。

## (二)我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了海富通富利三个月持有混合基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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。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。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于海富通富利三个月持有混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

## 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

海富通富利三个月持有混合基金的基金管理人海富通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估海富通富利三个月持有混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算海富通富利三个月持有混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督海富通富利三个月持有混合基金的财务报告过程。

## 6.4 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：

(一) 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。

(二) 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。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对海富通富利三个月持有混合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海富通富利三个月持有混合基金不能持续经营。

(五) 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

朱宏宇 胡莲莲

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2024 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：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	135,763.80	2,974,578.07
结算备付金		1,313,384.44	4,751,046.31
存出保证金		18,728.13	17,575.30
交易性金融资产	7.4.7.2	48,421,681.79	41,109,442.82
其中：股票投资		18,122,091.59	13,374,692.55
基金投资		-	-
债券投资		30,299,590.20	27,734,750.27
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	979,854.64	15,995,186.86
应收清算款		80,591.93	1,939.15
应收股利		-	-
应收申购款		10,011.99	469.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		50,960,016.72	64,850,238.42
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<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		122,954.77	57,768.31
应付赎回款		23,254.62	10,457.97
应付管理人报酬		34,563.83	44,648.32
应付托管费		6,480.74	8,371.59
应付销售服务费		8,194.62	10,063.41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		222.43	1,048.29
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	220,300.36	185,824.90
负债合计		415,971.37	318,182.79
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	54,183,980.67	67,259,915.49
未分配利润	7.4.7.8	-3,639,935.32	-2,727,859.86
净资产合计		50,544,045.35	64,532,055.63
负债和净资产总计		50,960,016.72	64,850,238.42

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 0.9372 元，C 类基金份额净值 0.9280 元。基金份额总额 54,183,980.67 份，其中 A 类基金份额 28,219,622.95 份，C 类基金份额 25,964,357.72 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-591,664.76	-5,924,954.84
1.利息收入		184,103.34	359,524.10
其中：存款利息收入	7.4.7.9	46,783.51	223,731.21
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		137,319.83	135,792.89
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,173,799.10	-1,957,780.83
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-2,107,988.29	-6,351,713.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	593,311.97	1,809,829.69
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	11,083.23	2,054,228.31
股利收益	7.4.7.14	329,793.99	529,874.80
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	398,020.73	-4,380,776.96
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	10.27	54,078.85
<b>减：二、营业总支出</b>		809,411.13	1,547,896.42
1. 管理人报酬		451,162.48	905,508.16
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		84,592.98	169,782.76
3. 销售服务费		102,714.71	244,893.68
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		16.92	15,395.60
其中：卖出回购金融资产支出		16.92	15,395.60
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		914.10	8,488.93
8. 其他费用	7.4.7.17	170,009.94	203,827.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-1,401,075.89</b>	<b>-7,472,851.26</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-1,401,075.89</b>	<b>-7,472,851.26</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-1,401,075.89</b>	<b>-7,472,851.26</b>

### 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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	-13,075,934.82	-	489,000.43	-12,586,934.39

金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				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
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	207,575,568.82	-	4,613,851.49	212,189,420.31
二、本期期初净资产	207,575,568.82	-	4,613,851.49	212,189,420.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-140,315,653.33	-	-7,341,711.35	-147,657,364.68
（一）、综合收益总额	-	-	-7,472,851.26	-7,472,851.26
（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）	-140,315,653.33	-	131,139.91	-140,184,513.42
其中：1. 基金申购款	8,954,469.43	-	109,438.40	9,063,907.83
2. 基金赎回款	-149,270,122.76	-	21,701.51	-149,248,421.25
（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	67,259,915.49	-	-2,727,859.86	64,532,055.63

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

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通富利三个月持有期混合型证券

投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、股指期货、股票期权、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

本基金业绩比较基准为：中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 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。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产

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

##### 债务工具

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

##### 以摊余成本计量：

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

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

##### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

##### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。



#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 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。

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：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税

率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

#### 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	135,763.80	2,974,578.07
等于：本金	135,750.65	2,974,350.77
加：应计利息	13.15	227.30
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	135,763.80	2,974,578.07

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		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
项目		上年度末			
		2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		13,913,091.90	-	13,374,692.55	-538,399.35
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	6,753,667.21	66,599.24	6,804,679.04	-15,587.41
	银行间市场	20,380,146.67	630,071.23	20,930,071.23	-80,146.67
	合计	27,133,813.88	696,670.47	27,734,750.27	-95,734.08
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		41,046,905.78	696,670.47	41,109,442.82	-634,133.43

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产 / 负债。

**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 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	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	15,995,186.86	-
银行间市场	-	-
合计	15,995,186.86	-

**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**

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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	90,300.36	25,824.90
其中：交易所市场	90,300.36	24,949.90
银行间市场	-	875.00

应付利息	-	-
预提费用	130,000.00	160,000.00
合计	220,300.36	185,824.90

#### 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 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,082,795.54	37,082,795.54
本期申购	265,027.84	265,027.84
本期赎回（以“-”号填列）	-9,128,200.43	-9,128,200.43
本期末	28,219,622.95	28,219,622.95

##### 海富通富利三个月持有 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,177,119.95	30,177,119.95
本期申购	1,313,130.40	1,313,130.40
本期赎回（以“-”号填列）	-5,525,892.63	-5,525,892.63
本期末	25,964,357.72	25,964,357.72

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	-636,480.51	-774,083.17	-1,410,563.68
本期期初	-636,480.51	-774,083.17	-1,410,563.68
本期利润	-913,911.74	197,693.41	-716,218.33



本期基金份额交易产生的变动数	204,236.95	151,161.64	355,398.59
其中：基金申购款	-9,392.73	-5,747.04	-15,139.77
基金赎回款	213,629.68	156,908.68	370,538.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,346,155.30	-425,228.12	-1,771,383.42

### 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	-690,734.28	-626,561.90	-1,317,296.18
本期期初	-690,734.28	-626,561.90	-1,317,296.18
本期利润	-885,184.88	200,327.32	-684,857.56
本期基金份额交易产生的变动数	96,836.99	36,764.85	133,601.84
其中：基金申购款	-39,801.99	-27,410.37	-67,212.36
基金赎回款	136,638.98	64,175.22	200,814.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,479,082.17	-389,469.73	-1,868,551.90

### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
活期存款利息收入	4,338.47	6,424.43
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	42,180.89	216,254.14
其他	264.15	1,052.64
合计	46,783.51	223,731.21

### 7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	203,257,863.70	131,691,219.52
减：卖出股票成本总额	204,873,587.77	137,739,880.11
减：交易费用	492,264.22	303,053.04
买卖股票差价收入	-2,107,988.29	-6,351,713.63

#### 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 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	769,451.82	1,591,684.67
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-176,139.85	218,145.02
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	593,311.97	1,809,829.69

##### 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 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	65,130,158.19	139,720,199.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	64,640,642.09	137,468,314.55
减：应计利息总额	662,020.10	2,030,906.55
减：交易费用	3,635.85	2,833.64
买卖债券差价收入	-176,139.85	218,145.02

#### 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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股指期货投资收益（税前）	38,280.00	2,118,040.00
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	2,896.31	61,690.49
减：股指期货交易费用	21,377.02	2,121.20
国债期货投资收益（税前）	-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	73.44	-
合计	11,083.23	2,054,228.31

## 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	329,793.99	529,874.80
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	329,793.99	529,874.80

## 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	398,020.73	-4,487,696.96
——股票投资	292,932.67	-4,250,183.97
——债券投资	105,088.06	-237,512.99
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-

——其他	-	-
2.衍生工具	-	106,920.00
——权证投资	-	-
——股指期货	-	106,920.00
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	398,020.73	-4,380,776.96

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	10.25	54,078.85
基金转换费收入	0.02	-
合计	10.27	54,078.85

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	110,000.00
证券出借违约金	-	-
证券组合费	30.73	4.00
银行划款手续费	2,779.21	6,623.29
其他费用	1,200.00	1,200.00
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
合计	170,009.94	203,827.29

#### 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

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	307,116,449.71	74.44%	177,306,776.81	85.21%

##### 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

	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%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	129,034.94	85.23%	14,654.47	58.74%

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

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

#### 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 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	451,162.48	905,508.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	195,369.81	323,465.56
应支付基金管理人的净管理费	255,792.67	582,042.60

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 x 0.80% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年 12月31日	2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	84,592.98	169,782.76

注：支付基金托管人中信银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 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 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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	-	125,620.31	125,620.31
海通证券	-	640.93	640.93
海富通基金	-	82,171.10	82,171.10
合计	-	208,432.34	208,432.34

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 x0.40%/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 2023年1月1日至2023年12月31 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	135,763.80	4,338.47	2,974,578.07

**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（2023 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 2023 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 12.79%（2022 年 12 月 31 日：0.08%）。

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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	6,755,511.76
合计	-	6,755,511.76

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债。

#### 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	3,528,138.83	49,167.28
AAA 以下	2,936,311.22	-
未评级	23,835,140.15	20,930,071.23

合计	30,299,590.20	20,979,238.51
----	---------------	---------------

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债、政策性金融债。

### 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 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	135,763.80	-	-	-	135,763.80

结算备付金	1,313,384.44	-	-	-	1,313,384.44
存出保证金	18,728.13	-	-	-	18,728.13
交易性金融资产	3,540,030.60	5,510,839.84	21,248,719.76	18,122,091.59	48,421,681.79
买入返售金融资产	979,854.64	-	-	-	979,854.64
应收清算款	-	-	-	80,591.93	80,591.93
应收申购款	-	-	-	10,011.99	10,011.99
资产总计	5,987,761.61	5,510,839.84	21,248,719.76	18,212,695.51	50,960,016.72
负债					
应付清算款	-	-	-	122,954.77	122,954.77
应付赎回款	-	-	-	23,254.62	23,254.62
应付管理人报酬	-	-	-	34,563.83	34,563.83
应付托管费	-	-	-	6,480.74	6,480.74
应付销售服务费	-	-	-	8,194.62	8,194.62
应交税费	-	-	-	222.43	222.43
其他负债	-	-	-	220,300.36	220,300.36
负债总计	-	-	-	415,971.37	415,971.37
利率敏感度缺口	5,987,761.61	5,510,839.84	21,248,719.76	17,796,724.14	50,544,045.35
<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
货币资金	2,974,578.07	-	-	-	2,974,578.07
结算备付金	4,751,046.31	-	-	-	4,751,046.31
存出保证金	17,575.30	-	-	-	17,575.30
交易性金融资产	6,804,679.04	20,930,071.23	-	13,374,692.55	41,109,442.82
买入返售金融资产	15,995,186.86	-	-	-	15,995,186.86
应收清算款	-	-	-	1,939.15	1,939.15
应收申购款	-	-	-	469.91	469.91
资产总计	30,543,065.58	20,930,071.23	-	13,377,101.61	64,850,238.42
负债					
应付清算款	-	-	-	57,768.31	57,768.31
应付赎回款	-	-	-	10,457.97	10,457.97
应付管理人报	-	-	-	44,648.32	44,648.32

酬					
应付托管费	-	-	-	8,371.59	8,371.59
应付销售服务费	-	-	-	10,063.41	10,063.41
应交税费	-	-	-	1,048.29	1,048.29
其他负债	-	-	-	185,824.90	185,824.90
负债总计	-	-	-	318,182.79	318,182.79
利率敏感度缺口	30,543,065.58	20,930,071.23	-	13,058,918.82	64,532,055.63

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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-322,418.42	-103,765.79
	市场利率下降 25 个基点	327,641.01	104,502.61

#### 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 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	-	-	-
项目	上年度末 2022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	-	392,833.37	392,833.37
资产合计	-	392,833.37	392,833.37
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	-	392,833.37	392,833.37

#### 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	-	19,641.67
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-	-19,641.67

#### 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 2023年12月31日		上年度末 2022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	18,122,091.59	35.85	13,374,692.55	20.73
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	18,122,091.59	35.85	13,374,692.55	20.73

#### 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	608,211.69	671,806.04
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-608,211.69	-671,806.04

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值



所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	24,586,541.64	13,423,859.83
第二层次	23,835,140.15	27,685,582.99
第三层次	-	-
合计	48,421,681.79	41,109,442.82

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

##### 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 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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,039,348.98	1,039,348.98
转出第三层次	-	1,453,574.26	1,453,574.26
当期利得或损失总额	-	414,225.28	414,225.28
其中：计入损益的利得或损失	-	414,225.28	414,225.28
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	-	-	-

注：于2023年12月31日，本基金未持有第三层次的交易性金融资产（2022年12月31日：同）。于2023年度，本基金无公允价值所属层次间的重大变动（2022年度：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）。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。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023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（2022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资产和负债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	18,122,091.59	35.56
	其中：股票	18,122,091.59	35.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,299,590.20	59.46
	其中：债券	30,299,590.20	59.46
	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	979,854.64	1.92
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,449,148.24	2.84
8	其他各项资产	109,332.05	0.21
9	合计	50,960,016.72	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	-	-
B	采矿业	1,531,041.00	3.03
C	制造业	9,328,312.11	18.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	997,240.00	1.97
E	建筑业	863,029.00	1.71
F	批发和零售业	1,683,875.00	3.33
G	交通运输、仓储和邮政业	727,351.50	1.44

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,170.73	0.05
J	金融业	1,775,339.00	3.51
K	房地产业	537,007.00	1.06
L	租赁和商务服务业	97,103.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	247,389.25	0.49
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	307,234.00	0.61
S	综合	-	-
	合计	18,122,091.59	35.85

### 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	601088	中国神华	13,100	410,685.00	0.81
2	000090	天健集团	73,300	337,180.00	0.67
3	600177	雅戈尔	51,400	336,670.00	0.67
4	300639	凯普生物	33,600	313,824.00	0.62
5	601717	郑煤机	24,700	312,455.00	0.62
6	002938	鹏鼎控股	13,500	301,320.00	0.60
7	002911	佛燃能源	25,800	295,668.00	0.58
8	600479	千金药业	26,900	289,713.00	0.57
9	002788	鹭燕医药	31,800	285,882.00	0.57
10	601668	中国建筑	56,800	273,208.00	0.54
11	002088	鲁阳节能	18,800	267,900.00	0.53
12	002142	宁波银行	13,200	265,452.00	0.53
13	300519	新光药业	16,000	265,120.00	0.52
14	603283	赛腾股份	3,600	261,216.00	0.52
15	300765	新诺威	7,000	256,340.00	0.51

16	000983	山西焦煤	25,700	253,916.00	0.50
17	600007	中国国贸	13,000	251,940.00	0.50
18	603639	海利尔	15,800	248,060.00	0.49
19	601877	正泰电器	10,900	234,459.00	0.46
20	603368	柳药集团	12,200	230,824.00	0.46
21	603018	华设集团	30,200	229,520.00	0.45
22	300196	长海股份	20,400	221,952.00	0.44
23	000906	浙商中拓	30,100	220,031.00	0.44
24	600740	山西焦化	41,500	209,160.00	0.41
25	601138	工业富联	13,300	201,096.00	0.40
26	601288	农业银行	54,750	199,290.00	0.39
27	603113	金能科技	24,650	198,925.50	0.39
28	601211	国泰君安	13,100	194,928.00	0.39
29	600900	长江电力	8,350	194,889.00	0.39
30	600548	深高速	21,000	188,790.00	0.37
31	000680	山推股份	37,400	184,756.00	0.37
32	002462	嘉事堂	12,600	179,046.00	0.35
33	600623	华谊集团	27,500	177,100.00	0.35
34	600999	招商证券	12,400	169,136.00	0.33
35	002958	青农商行	64,100	167,942.00	0.33
36	000800	一汽解放	19,200	163,200.00	0.32
37	600809	山西汾酒	700	161,511.00	0.32
38	300259	新天科技	44,100	160,083.00	0.32
39	600681	百川能源	40,700	159,951.00	0.32
40	002391	长青股份	25,300	159,390.00	0.32
41	002064	华峰化学	23,400	157,014.00	0.31
42	600758	辽宁能源	43,200	156,384.00	0.31
43	300040	九洲集团	27,300	152,880.00	0.30
44	601956	东贝集团	25,100	149,847.00	0.30
45	600101	明星电力	17,800	149,698.00	0.30
46	600300	维维股份	48,000	149,280.00	0.30
47	300412	迦南科技	26,200	149,078.00	0.29
48	000059	华锦股份	25,200	138,348.00	0.27
49	000554	泰山石油	23,500	135,595.00	0.27
50	603181	皇马科技	12,400	135,532.00	0.27
51	600403	大有能源	34,500	131,100.00	0.26
52	000062	深圳华强	11,600	130,732.00	0.26
53	600325	华发股份	18,000	129,780.00	0.26
54	000719	中原传媒	13,300	129,409.00	0.26
55	300117	嘉寓股份	44,100	127,890.00	0.25
56	600843	上工申贝	21,800	124,696.00	0.25
57	000153	丰原药业	13,300	124,621.00	0.25
58	600115	中国东航	31,100	120,668.00	0.24
59	001965	招商公路	12,200	119,194.00	0.24

60	603071	物产环能	7,800	118,560.00	0.23
61	000568	泸州老窖	600	107,652.00	0.21
62	600901	江苏金租	22,100	106,964.00	0.21
63	600575	淮河能源	42,700	102,907.00	0.20
64	601699	潞安环能	4,600	100,786.00	0.20
65	601388	怡球资源	38,000	99,560.00	0.20
66	603013	亚普股份	5,500	95,040.00	0.19
67	600725	云维股份	32,100	93,090.00	0.18
68	603012	创力集团	14,700	86,877.00	0.17
69	601328	交通银行	14,550	83,517.00	0.17
70	601666	平煤股份	7,200	83,232.00	0.16
71	002110	三钢闽光	19,400	78,570.00	0.16
72	601398	工商银行	16,400	78,392.00	0.16
73	300381	溢多利	10,300	75,911.00	0.15
74	603311	金海高科	7,300	75,482.00	0.15
75	601900	南方传媒	5,600	72,744.00	0.14
76	002367	康力电梯	9,200	69,184.00	0.14
77	002873	新天药业	5,500	68,530.00	0.14
78	600674	川投能源	4,500	68,040.00	0.13
79	600774	汉商集团	6,800	67,048.00	0.13
80	603886	元祖股份	3,650	66,539.50	0.13
81	601128	常熟银行	10,250	65,497.50	0.13
82	600188	兖矿能源	3,300	65,373.00	0.13
83	600985	淮北矿业	3,900	64,857.00	0.13
84	002930	宏川智慧	3,300	63,987.00	0.13
85	600741	华域汽车	3,800	61,864.00	0.12
86	600810	神马股份	8,200	61,008.00	0.12
87	600273	嘉化能源	7,100	60,989.00	0.12
88	002003	伟星股份	5,600	60,760.00	0.12
89	601577	长沙银行	8,600	58,652.00	0.12
90	601928	凤凰传媒	6,600	58,146.00	0.12
91	000559	万向钱潮	10,700	55,533.00	0.11
92	600997	开滦股份	7,250	55,317.50	0.11
93	002004	华邦健康	11,700	54,522.00	0.11
94	600546	山煤国际	3,100	54,281.00	0.11
95	000930	中粮科技	8,000	53,120.00	0.11
96	301126	达嘉维康	3,900	50,817.00	0.10
97	000159	国际实业	7,700	49,973.00	0.10
98	601992	金隅集团	26,000	49,660.00	0.10
99	600285	羚锐制药	2,900	49,619.00	0.10
100	002091	江苏国泰	6,300	49,329.00	0.10
101	000717	中南股份	19,400	49,276.00	0.10
102	600019	宝钢股份	8,200	48,626.00	0.10
103	600989	宝丰能源	3,200	47,264.00	0.09

104	600757	长江传媒	6,300	46,935.00	0.09
105	600710	苏美达	6,600	46,794.00	0.09
106	601939	建设银行	7,100	46,221.00	0.09
107	601838	成都银行	4,100	46,166.00	0.09
108	600284	浦东建设	7,300	45,990.00	0.09
109	600971	恒源煤电	4,100	45,715.00	0.09
110	002180	纳思达	2,000	45,260.00	0.09
111	601898	中煤能源	4,600	44,574.00	0.09
112	000885	城发环境	3,900	44,226.00	0.09
113	301290	东星医疗	1,600	44,144.00	0.09
114	601952	苏垦农发	4,200	43,008.00	0.09
115	300453	三鑫医疗	5,600	42,728.00	0.08
116	601860	紫金银行	16,850	42,630.50	0.08
117	600261	阳光照明	12,500	40,875.00	0.08
118	600383	金地集团	8,900	38,804.00	0.08
119	002807	江阴银行	10,800	38,340.00	0.08
120	000725	京东方 A	9,800	38,220.00	0.08
121	603993	洛阳钼业	7,300	37,960.00	0.08
122	002112	三变科技	3,600	37,728.00	0.07
123	603393	新天然气	1,200	36,684.00	0.07
124	002546	新联电子	7,100	35,500.00	0.07
125	000850	华茂股份	9,200	35,052.00	0.07
126	603298	杭叉集团	1,400	34,832.00	0.07
127	601963	重庆银行	5,000	34,800.00	0.07
128	301132	满坤科技	1,200	34,452.00	0.07
129	002479	富春环保	7,200	34,344.00	0.07
130	600528	中铁工业	4,600	34,224.00	0.07
131	000627	天茂集团	11,750	33,370.00	0.07
132	600808	马钢股份	12,100	32,912.00	0.07
133	600028	中国石化	5,850	32,643.00	0.06
134	601006	大秦铁路	4,450	32,084.50	0.06
135	601187	厦门银行	6,200	31,434.00	0.06
136	600783	鲁信创投	2,700	31,266.00	0.06
137	603166	福达股份	4,400	30,404.00	0.06
138	000402	金融街	8,300	30,129.00	0.06
139	000932	华菱钢铁	5,800	29,870.00	0.06
140	000895	双汇发展	1,100	29,381.00	0.06
141	601225	陕西煤业	1,400	29,246.00	0.06
142	603937	丽岛新材	2,200	27,874.00	0.06
143	002318	久立特材	1,400	27,832.00	0.06
144	002027	分众传媒	4,400	27,808.00	0.06
145	001256	炜冈科技	1,500	27,765.00	0.05
146	600282	南钢股份	7,400	27,380.00	0.05
147	601390	中国中铁	4,800	27,264.00	0.05

148	002202	金风科技	3,400	27,200.00	0.05
149	600469	风神股份	4,400	27,148.00	0.05
150	601728	中国电信	5,000	27,050.00	0.05
151	600153	建发股份	2,800	26,964.00	0.05
152	300865	大宏立	1,200	26,940.00	0.05
153	603618	杭电股份	4,200	26,880.00	0.05
154	300120	经纬辉开	3,700	26,862.00	0.05
155	300239	东宝生物	4,300	26,789.00	0.05
156	000789	万年青	3,900	26,754.00	0.05
157	002129	TCL 中环	1,700	26,588.00	0.05
158	002757	南兴股份	1,700	26,588.00	0.05
159	603176	汇通集团	4,300	26,574.00	0.05
160	600987	航民股份	3,000	26,280.00	0.05
161	600795	国电电力	6,300	26,208.00	0.05
162	000552	甘肃能化	8,400	25,620.00	0.05
163	600057	厦门象屿	3,800	25,498.00	0.05
164	600348	华阳股份	2,600	25,376.00	0.05
165	301223	中荣股份	1,400	25,368.00	0.05
166	002249	大洋电机	5,100	25,347.00	0.05
167	600935	华塑股份	7,500	25,275.00	0.05
168	002763	汇洁股份	3,000	25,230.00	0.05
169	300787	海能实业	1,500	25,230.00	0.05
170	601888	中国中免	300	25,107.00	0.05
171	002206	海利得	5,000	25,100.00	0.05
172	601607	上海医药	1,500	25,095.00	0.05
173	603511	爱慕股份	1,600	24,768.00	0.05
174	601618	中国中冶	8,000	24,480.00	0.05
175	002314	南山控股	8,300	24,070.00	0.05
176	600309	万华化学	300	23,046.00	0.05
177	601113	华鼎股份	6,400	21,952.00	0.04
178	002078	太阳纸业	1,800	21,906.00	0.04
179	601231	环旭电子	1,400	21,154.00	0.04
180	600279	重庆港	4,600	20,470.00	0.04
181	600123	兰花科创	1,800	19,872.00	0.04
182	600379	宝光股份	1,950	19,597.50	0.04
183	601598	中国外运	3,700	19,388.00	0.04
184	601512	中新集团	2,500	19,275.00	0.04
185	300922	天秦装备	1,100	18,777.00	0.04
186	002818	富森美	1,500	18,690.00	0.04
187	300281	金明精机	3,100	18,569.00	0.04
188	600848	上海临港	1,800	18,090.00	0.04
189	002563	森马服饰	3,100	17,887.00	0.04
190	300732	设研院	2,000	17,660.00	0.03
191	603898	好莱客	1,600	17,552.00	0.03



192	300509	新美星	2,400	17,352.00	0.03
193	600835	上海机电	1,400	16,618.00	0.03
194	002948	青岛银行	5,250	16,012.50	0.03
195	600644	乐山电力	2,300	16,008.00	0.03
196	002032	苏泊尔	300	15,903.00	0.03
197	601985	中国核电	2,100	15,750.00	0.03
198	603565	中谷物流	1,900	15,637.00	0.03
199	600510	黑牡丹	2,700	15,255.00	0.03
200	601988	中国银行	3,700	14,763.00	0.03
201	600612	老凤祥	200	13,800.00	0.03
202	600104	上汽集团	1,000	13,530.00	0.03
203	600873	梅花生物	1,400	13,370.00	0.03
204	601169	北京银行	2,850	12,910.50	0.03
205	601568	北元集团	2,600	12,324.00	0.02
206	600928	西安银行	3,550	11,821.50	0.02
207	600064	南京高科	1,600	9,664.00	0.02
208	300099	尤洛卡	1,500	9,285.00	0.02
209	601229	上海银行	1,550	9,253.50	0.02
210	600581	八一钢铁	2,500	8,975.00	0.02
211	002030	达安基因	900	8,712.00	0.02
212	300319	麦捷科技	900	8,676.00	0.02
213	600327	大东方	1,600	8,032.00	0.02
214	601077	渝农商行	1,900	7,752.00	0.02
215	605339	南侨食品	400	7,532.00	0.01
216	600782	新钢股份	2,100	7,329.00	0.01
217	002516	旷达科技	1,100	5,423.00	0.01
218	600015	华夏银行	900	5,058.00	0.01
219	600180	瑞茂通	800	4,872.00	0.01
220	600231	凌钢股份	2,000	4,300.00	0.01
221	601818	光大银行	1,300	3,770.00	0.01
222	600395	盘江股份	600	3,702.00	0.01
223	000651	格力电器	100	3,217.00	0.01
224	002233	塔牌集团	250	1,770.00	0.00
225	688329	艾隆科技	49	1,218.14	0.00
226	688389	普门科技	36	810.36	0.00
227	688678	福立旺	40	736.40	0.00
228	002312	川发龙蟒	100	715.00	0.00
229	688128	中国电研	31	636.12	0.00
230	688033	天宜上佳	36	608.40	0.00
231	688332	中科蓝讯	8	603.36	0.00
232	688388	嘉元科技	24	486.72	0.00
233	002062	宏润建设	100	443.00	0.00
234	688223	晶科能源	38	336.68	0.00
235	688226	威腾电气	12	225.60	0.00

236	688621	阳光诺和	3	209.25	0.00
237	688078	龙软科技	2	80.64	0.00
238	688561	奇安信	1	40.09	0.00
239	688819	天能股份	1	27.92	0.00
240	688079	美迪凯	1	13.31	0.00
241	688597	煜邦电力	1	9.10	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	600325	华发股份	1,345,809.00	2.09
2	300765	新诺威	1,033,215.56	1.60
3	000906	浙商中拓	1,018,191.00	1.58
4	600048	保利发展	916,351.00	1.42
5	601728	中国电信	880,839.00	1.36
6	601166	兴业银行	861,380.00	1.33
7	300760	迈瑞医疗	856,924.00	1.33
8	000858	五粮液	798,008.00	1.24
9	300750	宁德时代	784,545.00	1.22
10	601088	中国神华	779,698.00	1.21
11	600028	中国石化	775,936.00	1.20
12	002938	鹏鼎控股	746,372.00	1.16
13	000983	山西焦煤	716,260.00	1.11
14	000002	万科 A	714,329.00	1.11
15	600519	贵州茅台	711,601.00	1.10
16	300519	新光药业	705,607.00	1.09
17	600383	金地集团	689,350.00	1.07
18	601186	中国铁建	661,698.00	1.03
19	002410	广联达	655,489.00	1.02
20	600479	千金药业	653,230.00	1.01

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	600325	华发股份	1,280,885.00	1.98
2	000858	五 粮 液	1,092,672.00	1.69
3	600048	保利发展	1,091,096.00	1.69
4	600519	贵州茅台	1,045,765.00	1.62
5	300750	宁德时代	973,854.00	1.51
6	601166	兴业银行	877,148.00	1.36
7	601728	中国电信	854,270.00	1.32
8	300765	新诺威	843,852.41	1.31
9	300760	迈瑞医疗	838,250.00	1.30
10	000002	万 科 A	804,739.00	1.25
11	000906	浙商中拓	778,252.00	1.21
12	600028	中国石化	714,697.50	1.11
13	600887	伊利股份	664,934.00	1.03
14	600383	金地集团	660,341.00	1.02
15	603605	珀莱雅	653,265.20	1.01
16	600941	中国移动	647,334.00	1.00
17	601186	中国铁建	646,595.00	1.00
18	601318	中国平安	631,008.00	0.98
19	600282	南钢股份	625,964.00	0.97
20	002555	三七互娱	592,773.00	0.92

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	209,328,054.14
卖出股票的收入（成交）总额	203,257,863.70

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	2,832,894.25	5.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	21,002,245.90	41.55
	其中：政策性金融债	21,002,245.90	41.55

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）	6,464,450.05	12.79
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,299,590.20	59.95

### 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	200,000	21,002,245.90	41.55
2	019678	22 国债 13	28,000	2,832,894.25	5.60
3	110059	浦发转债	13,300	1,431,956.34	2.83
4	113042	上银转债	7,520	828,035.44	1.64
5	113044	大秦转债	1,410	164,026.73	0.32

### 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，上海银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局上海监管局的处罚。

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

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

**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	18,728.13
2	应收清算款	80,591.93
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,011.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	109,332.05

## 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	110059	浦发转债	1,431,956.34	2.83
2	113042	上银转债	828,035.44	1.64
3	113044	大秦转债	164,026.73	0.32
4	110063	鹰 19 转债	133,539.68	0.26
5	127020	中金转债	124,941.23	0.25
6	113631	皖天转债	121,386.78	0.24
7	128048	张行转债	121,183.08	0.24
8	127012	招路转债	120,870.71	0.24
9	110047	山鹰转债	119,648.85	0.24
10	113516	苏农转债	118,337.27	0.23
11	113532	海环转债	117,939.68	0.23
12	110079	杭银转债	116,918.05	0.23
13	110045	海澜转债	107,024.35	0.21
14	127018	本钢转债	106,632.90	0.21
15	113056	重银转债	87,977.13	0.17
16	123149	通裕转债	87,250.81	0.17
17	127006	敖东转债	86,290.73	0.17
18	128129	青农转债	84,024.82	0.17
19	127040	国泰转债	83,522.28	0.17
20	123107	温氏转债	82,276.55	0.16
21	110093	神马转债	79,624.32	0.16
22	128081	海亮转债	77,921.12	0.15
23	110062	烽火转债	74,871.40	0.15
24	113033	利群转债	74,053.64	0.15
25	128144	利民转债	72,393.12	0.14
26	127019	国城转债	71,546.50	0.14
27	118031	天 23 转债	70,201.79	0.14
28	113037	紫银转债	67,621.84	0.13
29	110068	龙净转债	67,267.40	0.13
30	127035	濮耐转债	67,020.91	0.13
31	113051	节能转债	64,868.92	0.13
32	127045	牧原转债	64,650.52	0.13
33	127027	能化转债	64,246.78	0.13
34	110077	洪城转债	61,477.12	0.12
35	110081	闻泰转债	60,399.04	0.12
36	127032	苏行转债	56,942.23	0.11

37	127058	科伦转债	56,142.04	0.11
38	127022	恒逸转债	55,881.39	0.11
39	127016	鲁泰转债	54,928.90	0.11
40	110064	建工转债	54,372.44	0.11
41	113046	金田转债	50,003.17	0.10
42	113052	兴业转债	48,917.26	0.10
43	113045	环旭转债	44,315.10	0.09
44	113055	成银转债	42,661.28	0.08
45	113062	常银转债	42,433.83	0.08
46	110083	苏租转债	42,182.55	0.08
47	110088	淮 22 转债	40,483.02	0.08
48	113066	平煤转债	40,181.44	0.08
49	110092	三房转债	38,556.48	0.08
50	128134	鸿路转债	36,427.43	0.07
51	113050	南银转债	36,045.73	0.07
52	110090	爱迪转债	31,605.50	0.06
53	127063	贵轮转债	19,769.17	0.04
54	113530	大丰转债	19,503.64	0.04
55	113527	维格转债	19,426.38	0.04
56	113063	赛轮转债	18,891.01	0.04
57	128109	楚江转债	18,832.59	0.04
58	128130	景兴转债	18,747.90	0.04
59	127070	大中转债	18,745.62	0.04
60	113058	友发转债	18,702.97	0.04
61	110084	贵燃转债	18,600.14	0.04
62	113619	世运转债	18,514.25	0.04
63	123130	设研转债	18,513.27	0.04
64	111002	特纸转债	18,508.89	0.04
65	113602	景 20 转债	18,485.61	0.04
66	127042	嘉美转债	17,937.25	0.04
67	113651	松霖转债	17,910.32	0.04
68	113669	景 23 转债	17,909.83	0.04
69	128128	齐翔转 2	17,905.58	0.04
70	118025	奕瑞转债	17,086.86	0.03
71	113623	凤 21 转债	16,325.04	0.03
72	113647	禾丰转债	16,026.97	0.03
73	113545	金能转债	15,772.63	0.03
74	113549	白电转债	13,860.60	0.03
75	128037	岩土转债	12,301.30	0.02
76	113049	长汽转债	1,077.10	0.00
77	127024	盈峰转债	1,067.51	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。

## §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
海富通富利三个月持有 A	945	29,862.03	9,942.61	0.04%	28,209,680.34	99.96%
海富通富利三个月持有 C	285	91,103.01	3,000,540.00	11.56%	22,963,817.72	88.44%
合计	1,230	44,052.02	3,010,482.61	5.56%	51,173,498.06	94.44%

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	397,496.67	1.4086%
	海富通富利三个月持有 C	81.00	0.0003%
	合计	397,577.67	0.7338%

### 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	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



有本开放式基金	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	37,082,795.54	30,177,119.95
本报告期基金总申购份额	265,027.84	1,313,130.40
减：本报告期基金总赎回份额	9,128,200.43	5,525,892.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	28,219,622.95	25,964,357.72

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

2023 年 12 月 13 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第七届董事会第二十一一次临时会议审议通过，何树方先生不再担任公司副总经理职务。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是 50,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 3 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，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

## 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	307,116,449.71	74.44%	225,242.41	74.38%	-
湘财证券	2	105,469,468.13	25.56%	77,583.81	25.62%	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

#### 2、(1)交易单元的选择标准

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

#### (2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

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

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

## 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	61,964,498.49	73.08%	1,219,711,000.00	96.86%	-	-
湘财证券	22,827,091.87	26.92%	39,540,000.00	3.14%	-	-

## 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公司住所变更的公告	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	2023-02-22
2	海富通基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告	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	2023-03-22
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海长量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	2023-06-26
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-07-14
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增麦高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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-29
6	海富通基金管理有限公司关于调整基金经理助理的公告	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	2023-11-24
7	海富通富利三个月持有期混合型证券投资	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	2023-11-24

	资基金基金经理变更公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
8	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	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	2023-12-13

## 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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 113 只公募基金。截至 2023 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1510 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“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“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“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”。

## §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

二〇二四年三月二十九日