

海富通稳固收益债券型证券投资基金
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

§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	6
§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	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	23
§5 托管人报告	23
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	23
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	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	24
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	25
§7 年度财务报表	26
7.1 资产负债表	26
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	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	60
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	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65

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	67
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	67
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	67
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	68
8.12 投资组合报告附注	68
§9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
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	75
§10 开放式基金份额变动	76
§11 重大事件揭示	76
11.1 基金份额持有人大会决议	76
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	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
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	77
11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	77
11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8 其他重大事件	79
12 影响投资者决策的其他重要信息	81
§13 备查文件目录	82
13.1 备查文件目录	82
13.2 存放地点	83
13.3 查阅方式	83

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通稳固收益债券型证券投资基金	
基金简称	海富通稳固收益债券	
基金主代码	519030	
交易代码	519030	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 11 月 23 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,421,862,014.14 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通稳固收益债券 A	海富通稳固收益债券 C
下属分级基金的交易代码	018042	519030
报告期末下属分级基金的份 额总额	918,561,680.60 份	1,503,300,333.54 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过合理运用投资组合优化策略,力争实现基金收益随着时间增长的逐步提升。
投资策略	本基金的整体投资策略分为三个层次:第一层次,即资产配置策略,将以优化投资组合保险策略为核心,实现基金投资目标;第二层次,即债券投资策略,将采用自上而下的策略,以久期管理为核心;第三层次,即股票投资策略,包括新股申购策略和积极的精选个股策略。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于中低风险品种。其预期收益和风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	郭明
	联系电话	021-38650788	010-66105799
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588
传真		021-33830166	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京市西城区复兴门内大街 55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		杨仓兵	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年	
	海富通稳固收益债券 A	海富通稳固收益债券 C	海富通稳固收益债券 A	海富通稳固收益债券 C	海富通稳固收益债券 A	海富通稳固收益债券 C
本期已实现收益	-16,780,76 0.96	2,532,507. 70	-	-124,401,13 0.59	-	84,430,899.6 9
本期利润	-38,439,79 6.75	37,021,92 7.27	-	-234,115,03 2.51	-	112,814,863. 25
加权平均基金份额本期利润	-0.0405	0.0146	-	-0.0510	-	0.1126
本期加权平均净值利润率	-3.35%	1.11%	-	-4.26%	-	8.93%
本期基金份额净值增长率	-0.88%	0.64%	-	-3.27%	-	8.53%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	海富通稳固收益债券 A	海富通稳固收益债券 C	海富通稳固收益债券 A	海富通稳固收益债券 C	海富通稳固收益债券 A	海富通稳固收益债券 C
期末可	11,911,530	15,427,82	-	50,771,872.	-	135,953,515.

供分配利润	.19	2.65		61		70
期末可供分配基金份额利润	0.0130	0.0103	-	0.0178	-	0.0429
期末基金资产净值	1,095,693,010.00	1,788,160,003.53	-	3,367,401,854.22	-	3,868,964,603.58
期末基金份额净值	1.1928	1.1895	-	1.1819	-	1.2219
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	海富通稳固收益债券 A	海富通稳固收益债券 C	海富通稳固收益债券 A	海富通稳固收益债券 C	海富通稳固收益债券 A	海富通稳固收益债券 C
基金份额累计净值增长率	-0.88%	92.98%	-	91.75%	-	98.24%

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、本基金管理人于 2021 年 12 月 7 日发布公告，自 2021 年 12 月 7 日起提高本基金份额净值精确位数至小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

5、自 2023 年 3 月 15 日起增加 A 类基金份额，该类别仅开通场外申购赎回业务，

收取申购费，不收取销售服务费。原有基金份额全部转换为本基金 C 类基金份额。

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. 海富通稳固收益债券 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.22%	0.23%	0.69%	0.01%	-1.91%	0.22%
过去六个月	-1.98%	0.21%	1.38%	0.01%	-3.36%	0.20%
自基金合同生效起至今	-0.88%	0.20%	2.19%	0.01%	-3.07%	0.19%

2. 海富通稳固收益债券 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.32%	0.23%	0.69%	0.01%	-2.01%	0.22%
过去六个月	-2.17%	0.21%	1.38%	0.01%	-3.55%	0.20%
过去一年	0.64%	0.20%	2.75%	0.01%	-2.11%	0.19%
过去三年	5.65%	0.24%	8.48%	0.01%	-2.83%	0.23%
过去五年	26.19%	0.26%	14.54%	0.01%	11.65%	0.25%
自基金合同生效起至今	92.98%	0.48%	53.59%	0.01%	39.39%	0.47%

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

海富通稳固收益债券型证券投资基金

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. 海富通稳固收益债券 A

(2023 年 3 月 15 日至 2023 年 12 月 31 日)



2. 海富通稳固收益债券 C

(2010 年 11 月 23 日至 2023 年 12 月 31 日)



注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分（二）投资范围、（五）投资限制中规定的各项比例。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

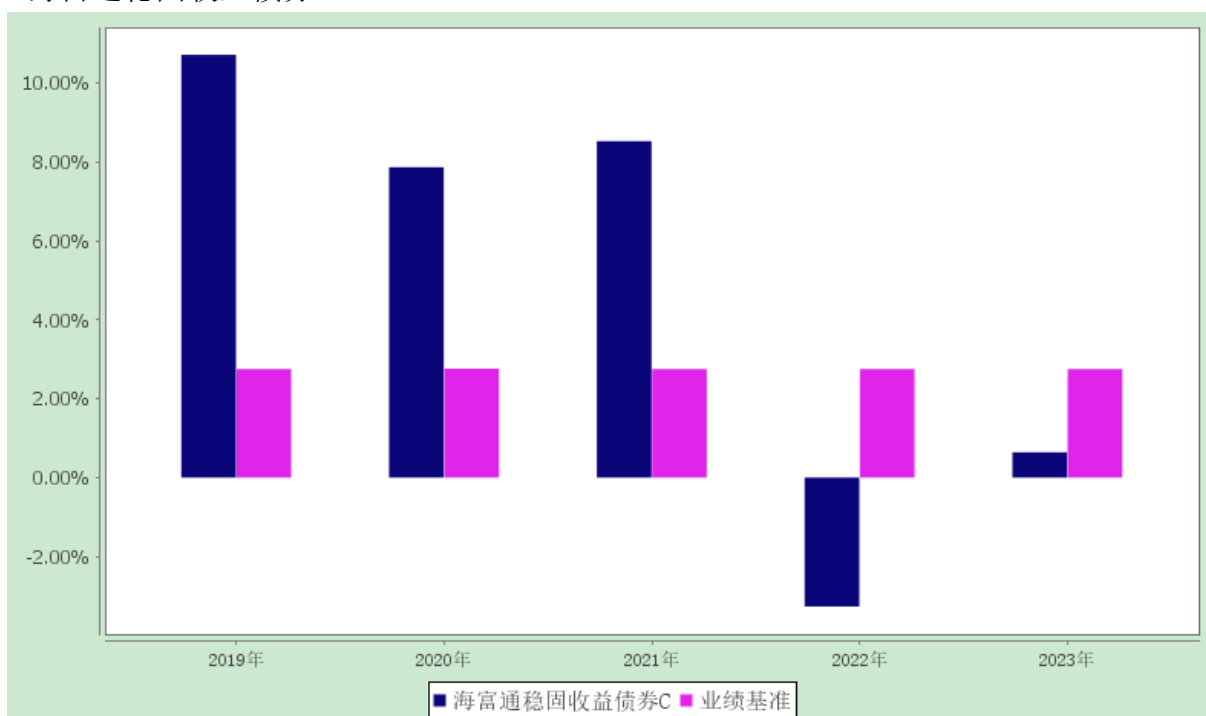
海富通稳固收益债券型证券投资基金
过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1. 海富通稳固收益债券 A



注：图中列示的 2023 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 3 月 15 日（新增份额日）起至 12 月 31 日止计算。

2. 海富通稳固收益债券 C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、海富通稳固收益债券 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	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

2、海富通稳固收益债券 C:

单位：人民币元

年度	每 10 份基 金份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发放 总额	年度利润分配 合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	1.160	176,614,081.35	19,469,414.91	196,083,496.26	-
合计	1.160	176,614,081.35	19,469,414.91	196,083,496.26	-

注：自 2023 年 3 月 15 日起增加 A 类基金份额，原有基金份额全部转换为本基金 C 类基金份额。2023 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 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		
江勇	本基金的基金经理；混合资产投资部总经理。	2020-10-29	-	12 年	经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师，资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2018 年 7 月至 2023 年 7 月任海富通上证非周期 ETF 联接基金经理。2018 年 7 月至 2022 年 5 月任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF、海富通中证 100 指数(LOF) 基金经理。2018 年 7 月至 2020 年 3 月任海富通中证内地低碳指数（现海富通中证 500 增强）基金经理。2020 年 8 月至 2022 年 5 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 联接基金经理。2020 年 8 月至 2023 年 3 月兼任海富通中证长三角领先 ETF 基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通稳固收益债券的基金经理。2021 年 2 月起兼任海富通欣睿混合基金经理。2021 年 6 月起兼任海富通策略收益债券基金经理。2021 年 6 月至 2023 年 10 月兼任海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。2021 年 9 月起兼任海富通欣利混合

					基金经理。2023 年 1 月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2023 年 11 月起兼任海富通添利收益一年持有期债券基金经理。2023 年 12 月起兼任海富通悦享一年持有期混合基金经理。
陈轶平	本基金的基金经理；固定收益投资总监兼债券基金部总监。	2015-12-18	-	14 年	博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011 年 10 月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固定收益投资总监兼债券基金部总监。2013 年 8 月至 2020 年 7 月任海富通货币基金经理。2014 年 8 月至 2019 年 9 月兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014 年 11 月起兼任海富通上证可质押城投债 ETF（现为海富通上证城投债 ETF）基金经理。2015 年 12 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 7 月兼任海富通稳进增利债券（LOF）基金经理。2016 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定开债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2016 年 8 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞丰一年定开债券（现为海富通瑞丰债券）基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 11 月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016

				<p>年 11 月至 2019 年 10 月兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2017 年 1 月至 2021 年 3 月兼任海富通上证周期产业债 ETF 基金经理。2017 年 2 月至 2023 年 7 月兼任海富通瑞利债券基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 6 月兼任海富通富源债券基金经理。2017 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 9 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 指数增强）基金经理。2017 年 7 月至 2019 年 9 月兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2017 年 7 月至 2018 年 12 月兼任海富通欣悦混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018 年 10 月至 2023 年 12 月兼任海富通上证 10 年期地方政府债 ETF 基金经理。2018 年 11 月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。2019 年 1 月至 2023 年 12 月兼任海富通上清所短融债券基金经理。2019 年 11 月起兼任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金经理。2020 年 4 月至 2022 年 08 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 7 月起兼任海富通上证投资级可转债 ETF 基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通利率债债券基金经理。2022 年 3 月起兼任海富通恒益一年定开债券发起式基金经理。</p>
--	--	--	--	--

					2022 年 7 月起兼任海富通中证短融 ETF 基金经理。2023 年 8 月起兼任海富通盈丰一年定开债券发起式基金经理。2023 年 11 月起兼任海富通添利收益一年持有期债券基金经理。
赵莹洲	本基金的基金经理助理	2023-08-15	-	5 年	东北财经大学工商管理硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中钢集团辽宁有限公司大宗原材料进出口市场分析师、上海钢联电子商务股份有限公司分析师、天风证券股份有限公司研究所钢铁行业研究员。2020 年 11 月加入海富通基金管理有限公司，任固定收益分析师。2022 年 5 月起兼任海富通稳健添利债券和海富通纯债债券基金经理助理。2023 年 8 月起兼任海富通强化回报混合、海富通欣利混合、海富通策略收益债券、海富通欣睿混合、海富通稳固收益债券的基金经理助理。

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

权益方面，2023 年，国内宏观经济逐步修复，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。

报告期间，本基金权益仓位有所提升，整体运作期间大部分时间靠近上限，高仓位在弱势环境下对组合形成了明显拖累，尤其下半年市场的弱势超出预期。结构上，组合整体延续价值风格，持仓个股分散，行业均衡，运作期间具体根据公司盈利与估值的匹配度有所调整。

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，经济增长环比动能略显不足，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。

信用债走强中有分化。上半年，“大行放贷、小行买债”使得信用债供不应求，“资产荒”行情持续演绎，高等级短久期-高等级中长久期-低等级短久期信用债利差依次下行。下半年，政策面与资金面扰动增加，7 月政治局会议提到“要有效防范化解地方债务风险，制定实施一揽子化债方案”，化债预期带动城投债明显走强；9 月受地产政策出台、地方债供给上量、机构止盈等因素影响，市场调整明显；进入 10 月后，特殊再融资债重启发行，截至 12 月末发行规模约 1.4 万亿元，本轮特殊再融资债规模、范围和用途均超预期，同时表内信贷用于地方化债方案持续推进，化债行情下城投债持续走强。二永债受政策、资金面、信用风险等多重因素扰动，上半年在一波三折中走强，下半年随利率反复震荡，利差明显走扩，二永债仍是利率波动的放大器。地产国企、民企走势分化，一方面，地产政策利好频出，陆续推出一线城市认房不认贷、二套贷款利率下限调整等政策，国企地产债整体震荡修复；另一方面，个别标杆性龙头民营房企偿债风险持续发酵，连带部分地产民企债剧烈调整。

可转债方面，中证转债指数下跌 0.47%，表现出良好防御性。转债走势相对正股更平缓。

报告期内，本基金根据组合规模情况以信用债为底仓，全年维持一定基础久期，同时择机调整利率债久期，积极参与波段机会。可转债方面，本管理人根据权益市场情况，对可转债资产采取了分散投资，动态调整总体仓位的策略，以在控制波动的前提下努力获取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通稳固收益债券 A 净值增长率为-0.88%，同期业绩比较基准收益率为 2.19%，基金净值跑输业绩比较基准 3.07 个百分点。海富通稳固收益债券 C 净值增长率为 0.64%，同期业绩比较基准收益率为 2.75%，基金净值跑输业绩比较基准 2.11 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益方面，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。

未来，本基金将继续在控制风险的基础上，积极寻找市场的结构性机会，力争跑赢市场。就目前的宏观经济、政策、上市公司本身以及目前的估值水位等多维度而言，机会大于风险，因而在仓位方面，将继续维持在较高的位置；个券层面，在注重安全边际的前提下将着力挖掘具备收益弹性的标的；行业上，将继续维持相对均衡的配置，不押注于单一行业。

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。新动能方面，高技术产业投资维持高增，新能源和汽车的产业优势也会支撑相关出口需求。随着居民消费倾向的修复和收入的改善，消费的修复进程也不会结束。总体来说，2024 年经济数据将面临正常的基数。财政政策方面，2024 年将延续地方去杠杆、中央加杠杆的局面。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。

信用债方面，城投化债叠加资本新规成为核心关注点，银行支持化债或带来城投债供给减少、二永债供给增加。城投方面，化债政策相继落地，短期风险降低，叠加 2024

年高息资产收缩，短期下沉票息思路未变，合适层级个券可适度拉长久期；当前行情从前期纯化债情绪带动走向中期的化债预期落地验证阶段，需关注区域化债推进落地的预期差可能带来的估值波动。地产方面，关注基本面修复情况，且房企现金流恢复滞后于行业，地产债估值风险仍存，重点关注大中型央企和优质地方国企债券的中短久期债券。金融债方面，资本新规从 2024 年初开始执行，不同资产风险权重调整可能影响银行配置需求。二永债需求有扰动，但无需过于担心，城投收缩加剧非银资产荒。金融次级债有一定溢价，或为合意的下沉方向。

可转债方面，转债估值连续两年压缩，当前已经处在较低的位置。债底的强支撑同样值得关注，纯债溢价率处于历史较低位置，到期收益率为正的转债数量占比也达到近 50%，即使股市下跌，转债回撤亦较为可控。

纯债方面，本组合将继续以信用债为底仓，利率债波段操作作为主要策略。可转债方面，本管理人将继续努力抓住潜在市场机会，对组合收益进行增厚。

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

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

毕马威华振审字第 2400377 号

海富通稳固收益债券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稳固收益债券型证券投资基金（以下简称“该基金”）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、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 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（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 2023 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 倪益

北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2024 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通稳固收益债券型证券投资基金

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
资产：			
货币资金	7.4.7.1	25,942,073.91	5,409,489.10
结算备付金		105,524,019.87	113,826,128.35
存出保证金		207,357.76	287,657.52
交易性金融资产	7.4.7.2	3,802,589,465.71	4,270,818,958.28
其中：股票投资		570,189,876.70	642,265,120.41
基金投资		-	-
债券投资		3,232,399,589.01	3,628,553,837.87
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		65,399,833.17	4,409,940.60
应收股利		-	-
应收申购款		50,160.75	52,550.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		3,999,712,911.17	4,394,804,723.97
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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		1,049,677,613.31	944,434,435.03
应付清算款		56,605,443.74	-
应付赎回款		5,839,894.41	77,577,014.31
应付管理人报酬		1,884,492.07	2,153,094.45

应付托管费		538,426.32	615,169.84
应付销售服务费		638,662.40	1,230,339.71
应付投资顾问费		-	-
应交税费		163,271.41	156,183.93
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	512,093.98	1,236,632.48
负债合计		1,115,859,897.64	1,027,402,869.75
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	2,421,862,014.14	2,849,050,628.18
未分配利润	7.4.7.8	461,990,999.39	518,351,226.04
净资产合计		2,883,853,013.53	3,367,401,854.22
负债和净资产总计		3,999,712,911.17	4,394,804,723.97

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.1928 元，C 类基金份额净值 1.1895 元。基金份额总额 2,421,862,014.14 份，其中 A 类基金份额 918,561,680.60 份，C 类基金份额 1,503,300,333.54 份。

7.2 利润表

会计主体：海富通稳固收益债券型证券投资基金

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
一、营业总收入		69,128,302.48	-135,644,384.65
1.利息收入		1,862,433.48	2,897,202.83
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,841,318.16	2,365,025.47
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		21,115.32	532,177.36
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		54,337,662.07	-29,345,881.89
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-43,514,636.97	-171,425,236.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	82,484,362.65	119,263,098.25
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	-	-

股利收益	7.4.7.14	15,367,936.39	22,816,256.63
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	12,830,383.78	-109,713,901.92
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	97,823.15	518,196.33
减：二、营业总支出		70,546,171.96	98,470,647.86
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	27,837,551.50	38,672,776.14
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	7,953,586.14	11,049,364.58
3. 销售服务费		12,250,214.11	22,098,729.32
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		22,170,930.86	26,318,428.84
其中：卖出回购金融资产支出		22,170,930.86	26,318,428.84
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		98,944.74	85,755.92
8. 其他费用	7.4.7.17	234,944.61	245,593.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,417,869.48	-234,115,032.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,417,869.48	-234,115,032.51
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,417,869.48	-234,115,032.51

7.3 净资产变动表

会计主体：海富通稳固收益债券型证券投资基金

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	2,849,050,628.18	-	518,351,226.04	3,367,401,854.22
二、本期期初净	2,849,050,628.18	-	518,351,226.04	3,367,401,854.22

资产				4.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-427,188,614.04	-	-56,360,226.65	-483,548,840.69
（一）、综合收益总额	-	-	-1,417,869.48	-1,417,869.48
（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）	-427,188,614.04	-	-54,942,357.17	-482,130,971.21
其中：1. 基金申购款	3,166,612,865.57	-	671,676,866.82	3,838,289,732.39
2. 基金赎回款	-3,593,801,479.61	-	-726,619,223.99	-4,320,420,703.60
（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	2,421,862,014.14	-	461,990,999.39	2,883,853,013.53
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	3,166,302,227.04	-	702,662,376.54	3,868,964,603.58
二、本期期初净资产	3,166,302,227.04	-	702,662,376.54	3,868,964,603.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-317,251,598.86	-	-184,311,150.50	-501,562,749.36
（一）、综合收益总额	-	-	-234,115,032.51	-234,115,032.51
（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	-317,251,598.86	-	49,803,882.01	-267,447,716.85

列)				
其中：1. 基金申购款	6,201,810,530.07	-	1,299,634,167.41	7,501,444,697.48
2. 基金赎回款	-6,519,062,128.93	-	-1,249,830,285.40	-7,768,892,414.33
(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	2,849,050,628.18	-	518,351,226.04	3,367,401,854.22

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

海富通稳固收益债券型证券投资基金（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”）证监基金字 [2010] 983 号文核准募集。本基金为契约型开放式，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 2,695,857,578.55 元。经向中国证监会备案，《海富通稳固收益债券型证券投资基金基金合同》于 2010 年 11 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,696,872,897.89 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,015,319.34 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金管理人海富通基金管理有限公司 2023 年 3 月 11 日披露的《关于海富通稳固收益债券型证券投资基金增加基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2023 年 3 月 15 日起本基金增加不收取销售服务费的 A 类基金份额，并相应修改基金合同、招募说明书等法律文件。本基金原有基金份额全部转换为本基金 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通稳固收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于国内依法发行上市的固定收益类品种，包括公司债券、企业债券、可转换债券、短期融资券、金融债、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购等，同时投资于股票、存托凭证、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金投资于债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，本基金可以参

与一级市场新股及存托凭证申购以及在二级市场上投资股票、存托凭证、权证等权益类证券，投资于股票及存托凭证等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%，现金（不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后）。

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

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况、2023 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、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、债券投资收益和资产支持证券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

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

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

公允价值变动收益

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；投资者可以在不同销售机构对本基金设置为相同的分红方式，亦可设置为不同的分红方式，即同一基金账户对本基金在各销售机构设置的分红方式相互独立、互不影响；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据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》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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[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] 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：

(a) 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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 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。

(c) 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。

(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。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。

(e) 本基金城市维护建设税、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	25,942,073.91	5,409,489.10
等于：本金	25,933,575.94	5,407,922.67
加：应计利息	8,497.97	1,566.43

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	25,942,073.91	5,409,489.10

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	635,481,605.87	-	570,189,876.7 0	-65,291,729.1 7	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,250,212,455.5 1	20,851,774.11	2,288,200,854. 42	17,136,624.8 0
	银行间市场	929,208,394.73	9,922,734.59	944,198,734.5 9	5,067,605.27
	合计	3,179,420,850.2 4	30,774,508.70	3,232,399,589. 01	22,204,230.0 7
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	3,814,902,456.1 1	30,774,508.70	3,802,589,465. 71	-43,087,499.1 0	
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	683,187,684.33	-	642,265,120.4 1	-40,922,563.9 2	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,830,258,857.8 7	16,939,052.49	1,828,444,211. 58	-18,753,698.7 8
	银行间市场	1,768,861,620.1 8	27,489,626.29	1,800,109,626. 29	3,758,379.82
	合计	3,599,120,478.0 5	44,428,678.78	3,628,553,837. 87	-14,995,318.9 6
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	4,282,308,162.3 8	44,428,678.78	4,270,818,958. 28	-55,917,882.8 8	

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

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末其他资产无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	327,093.98	926,632.48
其中：交易所市场	310,677.97	903,745.96
银行间市场	16,416.01	22,886.52
应付利息	-	-
预提费用	185,000.00	310,000.00
合计	512,093.98	1,236,632.48

7.4.7.7 实收基金

海富通稳固收益债券 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
本期申购	1,944,109,620.40	1,944,109,620.40
本期赎回（以“-”号填列）	-1,025,547,939.80	-1,025,547,939.80
本期末	918,561,680.60	918,561,680.60

海富通稳固收益债券 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	2,849,050,628.18	2,849,050,628.18
本期申购	1,222,503,245.17	1,222,503,245.17
本期赎回（以“-”号填列）	-2,568,253,539.81	-2,568,253,539.81
本期末	1,503,300,333.54	1,503,300,333.54

注：1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2、根据本基金管理人海富通基金管理有限公司 2023 年 3 月 11 日披露的《关于海富通稳固收益债券型证券投资基金增加基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2023 年 3 月 15 日起本基金增加不收取销售服务费的 A 类基金份额，并相应修改基金合同、招募说明书等法律文件。本基金原有基金份额全部转换为本基金 C 类基金份额。

7.4.7.8 未分配利润

海富通稳固收益债券 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
本期期初	-	-	-
本期利润	-16,780,760.96	-21,659,035.79	-38,439,796.75
本期基金份额交易产生的变动数	28,692,291.15	186,878,835.00	215,571,126.15
其中：基金申购款	54,546,287.50	361,763,409.08	416,309,696.58
基金赎回款	-25,853,996.35	-174,884,574.08	-200,738,570.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,911,530.19	165,219,799.21	177,131,329.40

海富通稳固收益债券 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	50,771,872.61	467,579,353.43	518,351,226.04
本期期初	50,771,872.61	467,579,353.43	518,351,226.04
本期利润	2,532,507.70	34,489,419.57	37,021,927.27
本期基金份额交易产生的变动数	-37,876,557.66	-232,636,925.66	-270,513,483.32
其中：基金申购款	27,623,476.47	227,743,693.77	255,367,170.24

基金赎回款	-65,500,034.13	-460,380,619.43	-525,880,653.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,427,822.65	269,431,847.34	284,859,669.99

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	192,217.33	355,958.25
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	1,508,992.47	1,705,696.45
其他	140,108.36	303,370.77
合计	1,841,318.16	2,365,025.47

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	1,624,768,674.67	2,694,035,323.53
减：卖出股票成本总额	1,664,292,374.92	2,858,336,869.79
减：交易费用	3,990,936.72	7,123,690.51
买卖股票差价收入	-43,514,636.97	-171,425,236.77

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	98,871,052.50	143,490,111.39
债券投资收益——买卖债券(债转股及	-16,386,689.85	-24,227,013.14

债券到期兑付) 差价收入		
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	82,484,362.65	119,263,098.25

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	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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,302,713,876.15	14,584,822,079.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,249,700,567.22	14,422,800,271.39
减：应计利息总额	69,083,224.27	186,056,752.59
减：交易费用	316,774.51	192,068.97
买卖债券差价收入	-16,386,689.85	-24,227,013.14

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

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	15,367,936.39	22,816,256.63
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	15,367,936.39	22,816,256.63

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1.交易性金融资产	12,830,383.78	-109,713,901.92
——股票投资	-24,369,165.25	-57,457,641.66
——债券投资	37,199,549.03	-52,256,260.26
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	12,830,383.78	-109,713,901.92

7.4.7.16 其他收入

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
基金赎回费收入	97,815.69	518,034.04
基金转换费收入	7.46	162.29
合计	97,823.15	518,196.33

7.4.7.17 其他费用

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
----	---------------------------------	--------------------------------------

审计费用	65,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	12,744.61	18,393.06
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	234,944.61	245,593.06

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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	3,230,632,450.63	100.00%	1,933,067,811.75	33.98%
------	------------------	---------	------------------	--------

7.4.10.1.2 权证交易

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

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	2,357,903.71	100.00%	310,677.97	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	1,393,904.07	35.21%	898,605.57	99.43%

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	27,837,551.50	38,672,776.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,496,735.65	5,734,115.16

应支付基金管理人的净管理费	23,340,815.85	32,938,660.98
---------------	---------------	---------------

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 0.70% 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 x0.70%/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	7,953,586.14	11,049,364.58

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 x0.20%/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		
	海富通稳固收益债券A	海富通稳固收益债券C	合计
中国工商银行	-	196,463.74	196,463.74
海通证券	-	848.22	848.22
海富通	-	4,962,789.07	4,962,789.07
合计	-	5,160,101.03	5,160,101.03
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		
	海富通稳固收益债券A	海富通稳固收益债券C	合计
中国工商银行	-	266,089.93	266,089.93
海通证券	-	1,268.80	1,268.80
海富通	-	11,963,498.11	11,963,498.11
合计	-	12,230,856.84	12,230,856.84

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.4% 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：

日销售服务费=前一日基金资产净值 x0.4%/ 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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	
	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	25,942,073.91	192,217.33	5,409,489.10	355,958.25

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113069	博 23 转债	2023-12-25	1 个月内(含)	老股东配债	100.00	100.01	5,900	590,000.00	590,038.79	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2023 年 12 月 31 日，本基金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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 1,049,677,613.31 元，于 2024 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型证券投资基金，属于中低风险品种。本基金投资的金融工具主要为股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人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 95.46%（2022 年 12 月 31 日：65.28%）。

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	150,845,086.86	412,417,318.36
合计	150,845,086.86	412,417,318.36

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、短期融资券及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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	2,079,768,308.59	1,665,691,457.95
AAA 以下	420,667,543.39	332,137,561.01
未评级	581,118,650.17	1,218,307,500.55
合计	3,081,554,502.15	3,216,136,519.51

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、中期票据及无第三方评级机构评级的债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均能及时变现。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	25,942,073.91	-	-	-	25,942,073.91
结算备付金	105,524,019.87	-	-	-	105,524,019.87
存出保证金	207,357.76	-	-	-	207,357.76
交易性金融资产	642,330,734.27	2,294,942,088.84	295,126,765.90	570,189,876.70	3,802,589,465.71
应收清算款	-	-	-	65,399,833.17	65,399,833.17
应收申购款	-	-	-	50,160.75	50,160.75
资产总计	774,004,185.81	2,294,942,088.84	295,126,765.90	635,639,870.62	3,999,712,911.17
负债					
卖出回购金融资产款	1,049,677,613.31	-	-	-	1,049,677,613.31
应付清算款	-	-	-	56,605,443.74	56,605,443.74
应付赎回款	-	-	-	5,839,894.41	5,839,894.41
应付管理人报酬	-	-	-	1,884,492.07	1,884,492.07
应付托管费	-	-	-	538,426.32	538,426.32
应付销售服务费	-	-	-	638,662.40	638,662.40
应交税费	-	-	-	163,271.41	163,271.41
其他负债	-	-	-	512,093.98	512,093.98
负债总计	1,049,677,613.31	-	-	66,182,284.33	1,115,859,897.64
利率敏感度缺	-275,673,427.5	2,294,942,088.84	295,126,765.90	569,457,586.2	2,883,853,013.17

口	0	84	0	9	53
上年度末 2022 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	5,409,489.10	-	-	-	5,409,489.10
结算备付金	113,826,128.35	-	-	-	113,826,128.35
存出保证金	287,657.52	-	-	-	287,657.52
交易性金融资产	431,846,256.32	3,061,540,843.81	135,166,737.74	642,265,120.41	4,270,818,958.28
应收清算款	-	-	-	4,409,940.60	4,409,940.60
应收申购款	-	-	-	52,550.12	52,550.12
资产总计	551,369,531.29	3,061,540,843.81	135,166,737.74	646,727,611.13	4,394,804,723.97
负债					
卖出回购金融资产款	944,434,435.03	-	-	-	944,434,435.03
应付赎回款	-	-	-	77,577,014.31	77,577,014.31
应付管理人报酬	-	-	-	2,153,094.45	2,153,094.45
应付托管费	-	-	-	615,169.84	615,169.84
应付销售服务费	-	-	-	1,230,339.71	1,230,339.71
应交税费	-	-	-	156,183.93	156,183.93
其他负债	-	-	-	1,236,632.48	1,236,632.48
负债总计	944,434,435.03	-	-	82,968,434.72	1,027,402,869.75
利率敏感度缺口	-393,064,903.74	3,061,540,843.81	135,166,737.74	563,759,176.41	3,367,401,854.22

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	上年度末

		2023年12月31日	2022年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-21,574,294.43	-25,636,840.64
	市场利率下降 25 个基点	21,878,436.54	25,985,174.06

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，本基金通过价值分析，采用自上而下确定投资策略，采取久期管理、类属配置和现金流管理策略等积极投资策略，发现、确认并利用细分市场失衡，实现组合增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，本基金可以参与一级市场新股申购以及在二级市场上投资股票、存托凭证、权证等权益类证券，投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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	570,189,876.70	19.77	642,265,120.41	19.07
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	570,189,876.70	19.77	642,265,120.41	19.07

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%	25,780,903.50	32,500,639.94
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-25,780,903.50	-32,500,639.94

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,202,615,298.59	1,045,224,939.84
第二层次	2,599,974,167.12	3,220,589,079.18
第三层次	-	5,004,939.26
合计	3,802,589,465.71	4,270,818,958.28

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可转换债券等，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可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 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	-	5,004,939.26	5,004,939.26
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	4,488,385.82	4,488,385.82
当期利得或损失总额	-	-516,553.44	-516,553.44
其中：计入损益的利得或损失	-	-516,553.44	-516,553.44
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	-	3,999,977.92	3,999,977.92
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	-	1,004,961.34	1,004,961.34
其中：计入损益的利得或损失	-	1,004,961.34	1,004,961.34
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	5,004,939.26	5,004,939.26
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	-	1,004,961.34	1,004,961.34

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：持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资）。于2023年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资（2022年度：同）。

计入损益的利得或损失计入利润表中的投资收益及公允价值变动损益项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	5,004,939.26	亚式期权模型	预期年化波动率	39.80%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	570,189,876.70	14.26
	其中：股票	570,189,876.70	14.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,232,399,589.01	80.82
	其中：债券	3,232,399,589.01	80.82

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	131,466,093.78	3.29
8	其他各项资产	65,657,351.68	1.64
9	合计	3,999,712,911.17	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	19,588,895.00	0.68
C	制造业	337,565,809.86	11.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,040,432.60	0.83
E	建筑业	22,921,252.62	0.79
F	批发和零售业	9,111,848.00	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	33,985,817.20	1.18
H	住宿和餐饮业	4,301,748.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,152,765.52	0.80
J	金融业	64,934,577.90	2.25
K	房地产业	18,783,419.00	0.65
L	租赁和商务服务业	677,952.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	7,196,302.00	0.25
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	2,435,763.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	1,493,294.00	0.05

S	综合	-	-
	合计	570,189,876.70	19.77

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	600519	贵州茅台	7,000	12,082,000.00	0.42
2	000333	美的集团	213,639	11,671,098.57	0.40
3	000400	许继电气	456,500	10,024,740.00	0.35
4	600030	中信证券	441,600	8,995,392.00	0.31
5	601668	中国建筑	1,822,900	8,768,149.00	0.30
6	002142	宁波银行	406,790	8,180,546.90	0.28
7	002352	顺丰控股	189,200	7,643,680.00	0.27
8	002984	森麒麟	264,200	7,622,170.00	0.26
9	600036	招商银行	266,000	7,400,120.00	0.26
10	601601	中国太保	306,200	7,281,436.00	0.25
11	603885	吉祥航空	595,200	7,142,400.00	0.25
12	600887	伊利股份	257,700	6,893,475.00	0.24
13	601021	春秋航空	130,381	6,545,126.20	0.23
14	600325	华发股份	890,200	6,418,342.00	0.22
15	002126	银轮股份	340,800	6,362,736.00	0.22
16	600803	新奥股份	377,500	6,349,550.00	0.22
17	002475	立讯精密	181,600	6,256,120.00	0.22
18	002353	杰瑞股份	210,700	5,922,777.00	0.21
19	600061	国投资本	875,900	5,903,566.00	0.20
20	600970	中材国际	626,543	5,851,911.62	0.20
21	601916	浙商银行	2,287,100	5,763,492.00	0.20
22	603816	顾家家居	163,400	5,719,000.00	0.20
23	600346	恒力石化	429,400	5,655,198.00	0.20
24	300443	金雷股份	199,900	5,515,241.00	0.19
25	688016	心脉医疗	27,544	5,360,888.72	0.19
26	002043	兔宝宝	604,200	5,353,212.00	0.19
27	601318	中国平安	131,000	5,279,300.00	0.18
28	600153	建发股份	545,200	5,250,276.00	0.18
29	000902	新洋丰	457,700	5,213,203.00	0.18
30	601838	成都银行	452,100	5,090,646.00	0.18

31	000960	锡业股份	333,500	4,775,720.00	0.17
32	601872	招商轮船	793,700	4,666,956.00	0.16
33	601211	国泰君安	312,300	4,647,024.00	0.16
34	002444	巨星科技	205,900	4,636,868.00	0.16
35	688332	中科蓝讯	60,660	4,574,977.20	0.16
36	600309	万华化学	59,100	4,540,062.00	0.16
37	600820	隧道股份	785,900	4,526,784.00	0.16
38	600522	中天科技	352,900	4,407,721.00	0.15
39	601717	郑煤机	347,500	4,395,875.00	0.15
40	600497	驰宏锌锗	870,400	4,395,520.00	0.15
41	600195	中牧股份	368,100	4,365,666.00	0.15
42	600258	首旅酒店	275,400	4,301,748.00	0.15
43	601126	四方股份	298,900	4,232,424.00	0.15
44	601137	博威合金	270,700	4,203,971.00	0.15
45	300415	伊之密	236,000	4,160,680.00	0.14
46	002402	和而泰	289,700	4,139,813.00	0.14
47	600131	国网信通	272,500	4,128,375.00	0.14
48	600004	白云机场	416,600	4,074,348.00	0.14
49	000921	海信家电	199,000	4,059,600.00	0.14
50	000933	神火股份	239,100	4,016,880.00	0.14
51	688257	新锐股份	159,993	4,006,224.72	0.14
52	600048	保利发展	403,800	3,997,620.00	0.14
53	002541	鸿路钢构	183,800	3,993,974.00	0.14
54	002987	京北方	214,740	3,989,869.20	0.14
55	603611	诺力股份	209,000	3,956,370.00	0.14
56	603368	柳药集团	204,100	3,861,572.00	0.13
57	600580	卧龙电驱	322,200	3,779,406.00	0.13
58	000065	北方国际	336,400	3,774,408.00	0.13
59	600409	三友化工	686,600	3,769,434.00	0.13
60	002483	润邦股份	722,100	3,769,362.00	0.13
61	600795	国电电力	881,800	3,668,288.00	0.13
62	002039	黔源电力	262,340	3,617,668.60	0.13
63	601001	晋控煤业	293,300	3,616,389.00	0.13
64	000708	中信特钢	256,600	3,602,664.00	0.12
65	300601	康泰生物	131,400	3,567,510.00	0.12
66	600064	南京高科	589,200	3,558,768.00	0.12
67	603305	旭升集团	176,400	3,480,372.00	0.12
68	300682	朗新科技	212,088	3,476,122.32	0.12
69	300130	新国都	141,700	3,429,140.00	0.12
70	000923	河钢资源	203,200	3,413,760.00	0.12
71	000603	盛达资源	308,900	3,413,345.00	0.12
72	601233	桐昆股份	221,600	3,352,808.00	0.12
73	002345	潮宏基	486,700	3,314,427.00	0.11
74	002533	金杯电工	404,100	3,265,128.00	0.11

75	600642	申能股份	507,400	3,257,508.00	0.11
76	002439	启明星辰	119,200	3,218,400.00	0.11
77	603228	景旺电子	142,600	3,217,056.00	0.11
78	601058	赛轮轮胎	263,500	3,096,125.00	0.11
79	603324	盛剑环境	101,200	3,073,444.00	0.11
80	600399	抚顺特钢	315,200	3,063,744.00	0.11
81	688093	世华科技	165,037	3,005,323.77	0.10
82	002073	软控股份	454,900	2,988,693.00	0.10
83	002539	云图控股	359,300	2,964,225.00	0.10
84	600528	中铁工业	394,600	2,935,824.00	0.10
85	603658	安图生物	51,400	2,930,314.00	0.10
86	002035	华帝股份	471,300	2,926,773.00	0.10
87	000543	皖能电力	466,600	2,920,916.00	0.10
88	300569	天能重工	408,200	2,918,630.00	0.10
89	603987	康德莱	305,500	2,914,470.00	0.10
90	600486	扬农化工	46,162	2,913,745.44	0.10
91	000937	冀中能源	403,700	2,882,418.00	0.10
92	600587	新华医疗	106,600	2,749,214.00	0.10
93	002025	航天电器	56,400	2,708,328.00	0.09
94	688443	智翔金泰	66,020	2,637,499.00	0.09
95	601688	华泰证券	186,300	2,598,885.00	0.09
96	002508	老板电器	118,616	2,583,456.48	0.09
97	002851	麦格米特	105,000	2,583,000.00	0.09
98	600063	皖维高新	590,800	2,540,440.00	0.09
99	002555	三七互娱	132,900	2,499,849.00	0.09
100	002015	协鑫能科	201,400	2,493,332.00	0.09
101	300244	迪安诊断	102,300	2,435,763.00	0.08
102	603599	广信股份	165,100	2,393,950.00	0.08
103	002014	永新股份	286,200	2,389,770.00	0.08
104	688621	阳光诺和	34,234	2,387,821.50	0.08
105	301026	浩通科技	77,800	2,369,010.00	0.08
106	300476	胜宏科技	128,300	2,367,135.00	0.08
107	601567	三星医疗	112,600	2,308,300.00	0.08
108	000733	振华科技	39,000	2,294,760.00	0.08
109	002276	万马股份	222,600	2,274,972.00	0.08
110	600919	江苏银行	324,600	2,171,574.00	0.08
111	300938	信测标准	59,100	2,121,099.00	0.07
112	000630	铜陵有色	645,200	2,116,256.00	0.07
113	600223	福瑞达	218,800	2,107,044.00	0.07
114	300996	普联软件	91,800	2,102,220.00	0.07
115	600941	中国移动	21,100	2,099,028.00	0.07
116	000672	上峰水泥	259,200	2,089,152.00	0.07
117	300396	迪瑞医疗	68,500	2,017,325.00	0.07
118	000807	云铝股份	164,600	2,011,412.00	0.07

119	603508	思维列控	127,200	1,997,040.00	0.07
120	688357	建龙微纳	38,263	1,977,814.47	0.07
121	300286	安科瑞	76,200	1,975,866.00	0.07
122	600269	赣粤高速	476,300	1,957,593.00	0.07
123	603738	泰晶科技	117,400	1,919,490.00	0.07
124	600079	人福医药	76,500	1,901,790.00	0.07
125	603155	新亚强	78,200	1,885,402.00	0.07
126	688439	振华风光	20,924	1,864,537.64	0.06
127	603112	华翔股份	153,000	1,858,950.00	0.06
128	600456	宝钛股份	57,200	1,795,508.00	0.06
129	688401	路维光电	57,739	1,773,742.08	0.06
130	001979	招商蛇口	182,900	1,743,037.00	0.06
131	603296	华勤技术	21,700	1,733,613.00	0.06
132	600886	国投电力	131,500	1,733,170.00	0.06
133	603416	信捷电气	45,400	1,705,224.00	0.06
134	002469	三维化学	279,000	1,690,740.00	0.06
135	002373	千方科技	146,200	1,638,902.00	0.06
136	600109	国金证券	178,700	1,622,596.00	0.06
137	605183	确成股份	107,300	1,569,799.00	0.05
138	002705	新宝股份	107,300	1,563,361.00	0.05
139	300129	泰胜风能	144,500	1,556,265.00	0.05
140	603057	紫燕食品	71,100	1,534,338.00	0.05
141	600035	楚天高速	395,000	1,508,900.00	0.05
142	600373	中文传媒	113,300	1,493,294.00	0.05
143	002011	盾安环境	103,200	1,419,000.00	0.05
144	002078	太阳纸业	115,400	1,404,418.00	0.05
145	002478	常宝股份	257,300	1,402,285.00	0.05
146	300019	硅宝科技	84,800	1,400,048.00	0.05
147	688626	翔宇医疗	26,141	1,393,053.89	0.05
148	603357	设计总院	156,200	1,390,180.00	0.05
149	603989	艾华集团	60,900	1,310,568.00	0.05
150	688073	毕得医药	23,373	1,297,201.50	0.04
151	603187	海容冷链	85,540	1,296,786.40	0.04
152	000811	冰轮环境	95,300	1,293,221.00	0.04
153	601989	中国重工	297,200	1,227,436.00	0.04
154	002557	洽洽食品	30,900	1,075,938.00	0.04
155	688520	神州细胞	19,478	1,049,279.86	0.04
156	603050	科林电气	57,300	1,028,535.00	0.04
157	600521	华海药业	67,700	993,159.00	0.03
158	600745	闻泰科技	23,300	985,823.00	0.03
159	600665	天地源	253,600	958,608.00	0.03
160	600988	赤峰黄金	67,100	940,071.00	0.03
161	002088	鲁阳节能	62,500	890,625.00	0.03
162	603993	洛阳钼业	159,200	827,840.00	0.03

163	300791	仙乐健康	21,500	745,190.00	0.03
164	605168	三人行	10,700	677,952.00	0.02
165	002595	豪迈科技	22,300	663,871.00	0.02
166	002648	卫星化学	41,500	612,125.00	0.02
167	600835	上海机电	49,400	586,378.00	0.02
168	603035	常熟汽饰	30,200	569,874.00	0.02
169	002237	恒邦股份	52,300	563,794.00	0.02
170	002810	山东赫达	25,400	538,226.00	0.02
171	002938	鹏鼎控股	24,100	537,912.00	0.02
172	300037	新宙邦	10,400	491,920.00	0.02
173	601298	青岛港	72,300	446,814.00	0.02
174	603062	麦加芯彩	6,400	399,616.00	0.01
175	688389	普门科技	15,562	350,300.62	0.01
176	603712	七一二	6,400	201,664.00	0.01
177	600348	华阳股份	10,200	99,552.00	0.00

注：根据朗新科技集团股份有限公司于 2023 年 12 月 29 日发布的《关于变更证券简称的公告》，自 2024 年 1 月 2 日起，公司的证券简称由“朗新科技”变更为“朗新集团”，证券代码“300682”保持不变。

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	601318	中国平安	13,265,736.16	0.39
2	601377	兴业证券	13,133,446.28	0.39
3	600325	华发股份	11,047,391.80	0.33
4	601601	中国太保	10,569,116.00	0.31
5	600048	保利发展	10,283,508.03	0.31
6	600665	天地源	10,273,675.40	0.31
7	600887	伊利股份	9,680,715.00	0.29
8	601677	明泰铝业	9,554,102.50	0.28
9	603885	吉祥航空	9,419,953.68	0.28
10	600970	中材国际	9,234,274.11	0.27
11	601838	成都银行	9,192,175.00	0.27
12	300682	朗新科技	8,676,081.70	0.26
13	601126	四方股份	8,333,054.00	0.25
14	600030	中信证券	8,282,779.25	0.25
15	603486	科沃斯	8,202,266.00	0.24

16	603658	安图生物	8,043,637.80	0.24
17	600985	淮北矿业	7,916,606.00	0.24
18	603816	顾家家居	7,911,976.80	0.23
19	002142	宁波银行	7,838,156.67	0.23
20	601577	长沙银行	7,820,681.00	0.23

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	601318	中国平安	15,737,122.00	0.47
2	000002	万科A	13,254,781.00	0.39
3	601377	兴业证券	12,989,419.00	0.39
4	002236	大华股份	11,547,940.64	0.34
5	600919	江苏银行	11,312,427.00	0.34
6	000858	五粮液	11,295,291.24	0.34
7	601567	三星医疗	11,197,823.78	0.33
8	000001	平安银行	10,458,057.00	0.31
9	002867	周大生	10,367,040.16	0.31
10	300146	汤臣倍健	9,845,700.60	0.29
11	600079	人福医药	9,824,226.00	0.29
12	600665	天地源	9,759,261.12	0.29
13	000937	冀中能源	9,651,526.96	0.29
14	600036	招商银行	9,646,938.00	0.29
15	600415	小商品城	9,544,829.28	0.28
16	300982	苏文电能	9,394,239.60	0.28
17	300601	康泰生物	9,057,156.22	0.27
18	000063	中兴通讯	8,927,544.00	0.27
19	002777	久远银海	8,849,669.90	0.26
20	000932	华菱钢铁	8,810,075.00	0.26

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	1,616,586,296.46
卖出股票的收入(成交)总额	1,624,768,674.67

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	70,316,342.31	2.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	844,557,731.93	29.29
	其中：政策性金融债	409,177,923.43	14.19
4	企业债券	1,562,130,588.42	54.17
5	企业短期融资券	10,061,980.33	0.35
6	中期票据	112,907,524.13	3.92
7	可转债（可交换债）	632,425,421.89	21.93
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,232,399,589.01	112.09

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	110059	浦发转债	1,024,070	110,257,408.39	3.82
2	185364	22 华泰 G1	1,000,000	102,192,936.99	3.54
3	149805	22 广开 01	1,000,000	102,120,246.58	3.54
4	185768	22 华安 G1	1,000,000	101,787,041.10	3.53
5	137547	22 东证 01	1,000,000	101,182,871.23	3.51

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

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

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**

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 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	207,357.76
2	应收清算款	65,399,833.17
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	50,160.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,657,351.68

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	110,257,408.39	3.82
2	113042	上银转债	57,716,933.13	2.00
3	113056	重银转债	11,864,636.43	0.41
4	113037	紫银转债	11,861,293.18	0.41
5	113065	齐鲁转债	4,976,811.00	0.17
6	118025	奕瑞转债	3,524,164.71	0.12
7	110068	龙净转债	3,430,637.47	0.12
8	127053	豪美转债	3,381,174.09	0.12
9	113524	奇精转债	3,365,618.08	0.12
10	128042	凯中转债	3,360,763.47	0.12
11	127078	优彩转债	3,357,948.98	0.12
12	128066	亚泰转债	3,350,322.81	0.12
13	127063	贵轮转债	3,342,401.79	0.12
14	128121	宏川转债	3,331,951.09	0.12
15	118028	会通转债	3,327,884.43	0.12
16	127045	牧原转债	3,327,800.68	0.12
17	128081	海亮转债	3,327,231.92	0.12
18	111011	冠盛转债	3,320,134.42	0.12
19	127020	中金转债	3,315,226.19	0.11
20	128049	华源转债	3,314,644.67	0.11
21	128039	三力转债	3,312,989.03	0.11
22	123147	中辰转债	3,310,858.68	0.11
23	113058	友发转债	3,309,256.73	0.11
24	123194	百洋转债	3,308,254.12	0.11
25	113649	丰山转债	3,305,465.33	0.11
26	113055	成银转债	3,304,003.70	0.11
27	123107	温氏转债	3,302,454.33	0.11
28	113062	常银转债	3,302,222.19	0.11
29	128083	新北转债	3,302,133.57	0.11
30	127040	国泰转债	3,300,731.86	0.11
31	110093	神马转债	3,292,292.43	0.11
32	128087	孚日转债	3,289,858.25	0.11
33	111005	富春转债	3,288,267.05	0.11
34	123063	大禹转债	3,287,883.76	0.11
35	128141	旺能转债	3,287,170.60	0.11
36	110084	贵燃转债	3,279,825.36	0.11
37	110092	三房转债	3,279,385.24	0.11
38	113063	赛轮转债	3,277,589.45	0.11

39	128130	景兴转债	3,277,367.51	0.11
40	127032	苏行转债	3,273,364.69	0.11
41	110063	鹰 19 转债	3,272,799.01	0.11
42	110088	淮 22 转债	3,271,534.43	0.11
43	113631	皖天转债	3,269,934.69	0.11
44	113050	南银转债	3,252,596.94	0.11
45	128048	张行转债	3,247,057.33	0.11
46	127027	能化转债	3,244,111.99	0.11
47	113066	平煤转债	3,243,031.39	0.11
48	127012	招路转债	3,229,514.20	0.11
49	110045	海澜转债	3,227,756.99	0.11
50	123198	金埔转债	3,213,903.77	0.11
51	113044	大秦转债	3,210,735.98	0.11
52	113532	海环转债	2,987,805.14	0.10
53	113633	科沃转债	2,963,565.93	0.10
54	128105	长集转债	1,617,958.06	0.06
55	123106	正丹转债	1,490,548.55	0.05
56	128125	华阳转债	1,412,707.25	0.05
57	113530	大丰转债	1,391,259.44	0.05
58	127037	银轮转债	1,366,136.53	0.05
59	113588	润达转债	1,365,577.04	0.05
60	123085	万顺转 2	1,355,283.32	0.05
61	123050	聚飞转债	1,353,801.07	0.05
62	113534	鼎胜转债	1,353,568.64	0.05
63	123112	万讯转债	1,350,949.87	0.05
64	113619	世运转债	1,350,306.22	0.05
65	111000	起帆转债	1,349,426.41	0.05
66	113615	金诚转债	1,348,257.28	0.05
67	123121	帝尔转债	1,347,419.76	0.05
68	127043	川恒转债	1,347,107.50	0.05
69	123067	斯莱转债	1,346,083.09	0.05
70	113602	景 20 转债	1,345,752.38	0.05
71	110052	贵广转债	1,345,189.22	0.05
72	113632	鹤 21 转债	1,344,297.38	0.05
73	123099	普利转债	1,344,007.38	0.05
74	127030	盛虹转债	1,343,632.77	0.05
75	123120	隆华转债	1,343,168.40	0.05
76	128134	鸿路转债	1,342,295.76	0.05
77	123100	朗科转债	1,342,106.81	0.05
78	123035	利德转债	1,341,198.03	0.05
79	127066	科利转债	1,340,914.46	0.05
80	113598	法兰转债	1,340,131.54	0.05
81	128109	楚江转债	1,338,997.28	0.05
82	123071	天能转债	1,337,855.47	0.05

83	127073	天赐转债	1,337,422.30	0.05
84	113639	华正转债	1,337,405.73	0.05
85	123089	九洲转 2	1,337,243.58	0.05
86	127084	柳工转 2	1,337,190.53	0.05
87	128123	国光转债	1,336,766.29	0.05
88	113648	巨星转债	1,336,616.23	0.05
89	113638	台 21 转债	1,336,347.48	0.05
90	113663	新化转债	1,334,937.91	0.05
91	110060	天路转债	1,334,244.23	0.05
92	127054	双箭转债	1,334,219.53	0.05
93	113048	晶科转债	1,334,112.64	0.05
94	113045	环旭转债	1,333,998.19	0.05
95	127070	大中转债	1,333,282.36	0.05
96	113549	白电转债	1,333,137.39	0.05
97	128101	联创转债	1,333,063.38	0.05
98	123048	应急转债	1,332,308.12	0.05
99	127075	百川转 2	1,332,269.47	0.05
100	110081	闻泰转债	1,331,957.84	0.05
101	127015	希望转债	1,331,850.39	0.05
102	128095	恩捷转债	1,331,636.48	0.05
103	123168	惠云转债	1,331,015.71	0.05
104	127052	西子转债	1,330,630.26	0.05
105	123059	银信转债	1,329,488.57	0.05
106	127050	麒麟转债	1,329,323.52	0.05
107	110062	烽火转债	1,328,687.95	0.05
108	127071	天箭转债	1,328,666.77	0.05
109	127085	韵达转债	1,328,247.24	0.05
110	123108	乐普转 2	1,328,005.99	0.05
111	123092	天壕转债	1,327,898.31	0.05
112	118003	华兴转债	1,327,285.13	0.05
113	113627	太平转债	1,327,281.40	0.05
114	123087	明电转债	1,327,043.32	0.05
115	123119	康泰转 2	1,326,126.94	0.05
116	127068	顺博转债	1,326,066.97	0.05
117	123130	设研转债	1,325,549.93	0.05
118	110074	精达转债	1,325,262.29	0.05
119	123133	佩蒂转债	1,325,235.20	0.05
120	118013	道通转债	1,325,231.06	0.05
121	123101	拓斯转债	1,325,191.64	0.05
122	127049	希望转 2	1,325,155.86	0.05
123	127046	百润转债	1,325,104.89	0.05
124	111007	永和转债	1,325,005.58	0.05
125	123190	道氏转 02	1,324,782.44	0.05
126	113051	节能转债	1,324,691.64	0.05

127	113597	佳力转债	1,324,281.37	0.05
128	123149	通裕转债	1,324,145.86	0.05
129	110055	伊力转债	1,323,738.64	0.05
130	128144	利民转债	1,322,600.40	0.05
131	128137	洁美转债	1,321,827.66	0.05
132	113637	华翔转债	1,321,740.18	0.05
133	110070	凌钢转债	1,321,660.11	0.05
134	113579	健友转债	1,321,626.33	0.05
135	113582	火炬转债	1,320,983.50	0.05
136	110085	通 22 转债	1,320,587.97	0.05
137	111002	特纸转债	1,320,300.85	0.05
138	127058	科伦转债	1,320,243.57	0.05
139	123146	中环转 2	1,320,143.48	0.05
140	113605	大参转债	1,319,946.56	0.05
141	127038	国微转债	1,319,940.34	0.05
142	127074	麦米转 2	1,319,676.10	0.05
143	127042	嘉美转债	1,319,508.90	0.05
144	113669	景 23 转债	1,319,357.28	0.05
145	127017	万青转债	1,319,318.03	0.05
146	113545	金能转债	1,319,268.17	0.05
147	128136	立讯转债	1,318,847.67	0.05
148	113526	联泰转债	1,318,713.32	0.05
149	113618	美诺转债	1,317,890.72	0.05
150	123056	雪榕转债	1,317,380.58	0.05
151	110073	国投转债	1,317,312.69	0.05
152	123144	裕兴转债	1,316,847.97	0.05
153	113641	华友转债	1,316,826.77	0.05
154	113053	隆 22 转债	1,316,819.11	0.05
155	118019	金盘转债	1,316,682.04	0.05
156	128132	交建转债	1,316,666.95	0.05
157	113653	永 22 转债	1,316,558.24	0.05
158	113623	凤 21 转债	1,316,497.52	0.05
159	123154	火星转债	1,316,055.25	0.05
160	128063	未来转债	1,315,876.08	0.05
161	110079	杭银转债	1,315,328.04	0.05
162	127082	亚科转债	1,315,304.13	0.05
163	128091	新天转债	1,314,792.67	0.05
164	123114	三角转债	1,314,637.93	0.05
165	127041	弘亚转债	1,314,405.53	0.05
166	127083	山路转债	1,314,187.66	0.05
167	127047	帝欧转债	1,314,069.51	0.05
168	123109	昌红转债	1,313,965.98	0.05
169	127022	恒逸转债	1,312,704.57	0.05
170	118034	晶能转债	1,312,640.79	0.05

171	123165	回天转债	1,312,362.27	0.05
172	128119	龙大转债	1,312,332.80	0.05
173	113054	绿动转债	1,312,330.38	0.05
174	113661	福 22 转债	1,312,241.12	0.05
175	123076	强力转债	1,311,493.86	0.05
176	111003	聚合转债	1,311,290.40	0.05
177	113629	泉峰转债	1,311,283.85	0.05
178	113640	苏利转债	1,310,581.30	0.05
179	128124	科华转债	1,310,267.42	0.05
180	113021	中信转债	1,310,017.61	0.05
181	111010	立昂转债	1,309,900.19	0.05
182	127031	洋丰转债	1,309,539.01	0.05
183	127026	超声转债	1,309,485.76	0.05
184	127019	国城转债	1,309,398.96	0.05
185	127055	精装转债	1,309,370.21	0.05
186	113655	欧 22 转债	1,308,671.27	0.05
187	113584	家悦转债	1,308,370.43	0.05
188	127061	美锦转债	1,308,292.12	0.05
189	128142	新乳转债	1,308,288.21	0.05
190	113024	核建转债	1,307,843.36	0.05
191	118032	建龙转债	1,307,768.38	0.05
192	110082	宏发转债	1,307,574.81	0.05
193	113519	长久转债	1,307,446.81	0.05
194	128131	崇达转 2	1,307,127.71	0.05
195	118024	冠宇转债	1,307,097.81	0.05
196	127025	冀东转债	1,306,984.01	0.05
197	123113	仙乐转债	1,306,968.75	0.05
198	111001	山玻转债	1,306,784.22	0.05
199	113665	汇通转债	1,306,594.36	0.05
200	118023	广大转债	1,306,169.93	0.05
201	118005	天奈转债	1,305,735.28	0.05
202	127056	中特转债	1,305,734.51	0.05
203	118008	海优转债	1,305,711.16	0.05
204	113043	财通转债	1,305,409.95	0.05
205	118030	睿创转债	1,305,125.70	0.05
206	118000	嘉元转债	1,304,814.64	0.05
207	123104	卫宁转债	1,304,810.48	0.05
208	110075	南航转债	1,304,473.56	0.05
209	113046	金田转债	1,304,338.04	0.05
210	118031	天 23 转债	1,304,328.93	0.05
211	110076	华海转债	1,304,135.36	0.05
212	127016	鲁泰转债	1,304,012.18	0.05
213	113606	荣泰转债	1,302,922.05	0.05
214	128135	洽洽转债	1,302,547.20	0.05

215	123128	首华转债	1,302,522.86	0.05
216	110061	川投转债	1,302,495.19	0.05
217	110086	精工转债	1,302,025.62	0.05
218	110083	苏租转债	1,301,840.76	0.05
219	127024	盈峰转债	1,301,290.85	0.05
220	128116	瑞达转债	1,300,736.87	0.05
221	127018	本钢转债	1,300,202.50	0.05
222	113657	再 22 转债	1,299,995.08	0.05
223	113634	珀莱转债	1,299,595.40	0.05
224	113047	旗滨转债	1,298,995.86	0.05
225	123115	捷捷转债	1,298,870.24	0.05
226	123132	回盛转债	1,297,964.81	0.05
227	113636	甬金转债	1,297,507.66	0.04
228	118022	锂科转债	1,297,435.00	0.04
229	110087	天业转债	1,296,880.03	0.04
230	113616	韦尔转债	1,296,702.17	0.04
231	113644	艾迪转债	1,295,746.28	0.04
232	123150	九强转债	1,295,617.10	0.04
233	113049	长汽转债	1,294,669.26	0.04
234	123158	宙邦转债	1,293,668.05	0.04
235	113516	苏农转债	1,293,024.65	0.04
236	113650	博 22 转债	1,292,367.39	0.04
237	123064	万孚转债	1,292,230.77	0.04
238	113033	利群转债	1,291,109.04	0.04
239	110064	建工转债	1,288,293.95	0.04
240	110047	山鹰转债	1,287,597.28	0.04
241	128129	青农转债	1,284,964.87	0.04
242	113052	兴业转债	1,282,039.86	0.04
243	113537	文灿转债	1,275,904.95	0.04
244	110048	福能转债	1,270,916.55	0.04
245	110077	洪城转债	1,262,645.49	0.04
246	127051	博杰转债	1,260,134.26	0.04
247	127044	蒙娜转债	1,104,388.21	0.04
248	123025	精测转债	975,995.13	0.03
249	123091	长海转债	938,428.47	0.03
250	113660	寿 22 转债	3,664.17	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。

§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
海富通稳固收益债券 A	56	16,402,887.15	918,394,429.36	99.98%	167,251.24	0.02%
海富通稳固收益债券 C	19,098	78,715.07	1,339,282,102.78	89.09%	164,018,230.76	10.91%
合计	19,154	126,441.58	2,257,676,532.14	93.22%	164,185,482.00	6.78%

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	海富通稳固收益债券 A	163,952.19	0.0178%
	海富通稳固收益债券 C	669,651.02	0.0445%
	合计	833,603.21	0.0344%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	海富通稳固收益债券 A	10~50
	海富通稳固收益债券 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通稳固收益债券 A	10~50
	海富通稳固收益债券 C	0~10

	合计	10~50
--	----	-------

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通稳固收益债券 A	海富通稳固收益债券 C
基金合同生效日（2010 年 11 月 23 日）基金份额总额	-	2,696,872,897.89
本报告期期初基金份额总额	-	2,849,050,628.18
本报告期基金总申购份额	1,944,109,620.40	1,222,503,245.17
减：本报告期基金总赎回份额	1,025,547,939.80	2,568,253,539.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	918,561,680.60	1,503,300,333.54

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。报告期内本基金应支付给所聘任会计师事务所的报酬为 65,000.00 元,该审计机构已为本基金提供审计服务的连续年限为 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	3,230,632,450.63	100.00%	2,357,903.71	100.00%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期新增国海证券 2 个交易单元。

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	7,620,037,095.75	100.00%	214,966,156,000.00	100.00%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于海富通稳固收益债券型证券投资基金新增泰信财富基金销售有限公司为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-13
2	海富通基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-22
3	关于开通海富通稳固收益债券型证券投资基金不同类别基金份额相互转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-11
4	关于海富通稳固收益债券型证券投资基金增加基金份额并修改基金合同和托管协议的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-11
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增新华信通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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
7	海富通基金管理有限公司关于海富通稳固收益债券型证券投资基金 A 类份额新增销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-03
8	海富通基金管理有限公司关于海富通稳固收益债券型证券投资基金 A 类份额新增泰信财富基金销售有限公司为销售机	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露	2023-04-07

	构的公告	网站	
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海好买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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-17
10	海富通基金管理有限公司关于海富通稳固收益债券型证券投资基金 A 类份额新增销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-21
11	海富通基金管理有限公司关于海富通稳固收益债券型证券投资基金 A 类份额新增销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-04
12	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-10
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华西证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-17
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-02
15	海富通基金管理有限公司关于海富通稳固收益债券型证券投资基金 A 类份额新增销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-12
16	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-14
17	海富通基金管理有限公司关于海富通稳固收益债券型证券投资基金 A 类份额新增浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
18	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳众禄基金销售股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-28
19	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-07-14

20	关于海富通稳固收益债券型证券投资基金不同类别基金份额在上海天天基金销售有限公司开通相互转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-07-26
21	海富通基金管理有限公司关于海富通稳固收益债券型证券投资基金 A 类份额新增销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-07-27
22	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信建投证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-14
23	海富通基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-15
24	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-17
25	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-11-09
26	海富通基金管理有限公司关于海富通稳固收益债券型证券投资基金 A 类份额新增深圳前海微众银行股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-11-30
27	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-12-13
28	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-12-14

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稳固收益债券型证券投资基金的文件

- (二)海富通稳固收益债券型证券投资基金基金合同
- (三)海富通稳固收益债券型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通稳固收益债券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