

海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年七月十九日

§1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通添利收益一年持有期债券
基金主代码	019038
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 7 日
报告期末基金份额总额	398,937,804.58 份
投资目标	本基金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	<p>1、资产配置策略：在投资比例限制的约束下，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对不同大类资产的预期收益和风险进行动态跟踪，从而决定具体资产配置比例。</p> <p>2、债券投资组合策略：主要采取利率策略、信用债和资产支持证券投资策略、收益率曲线策略以及杠杆策略。</p> <p>3、股票投资策略：本基金将适度参与股票资产投资。在大类资产配置框架下，本基金通过定量和定性分析相结合、基本面与模型相结合、基金经理和研究团队相结合的研究方法，甄选优质上市公司构建投资组合，以获得长期持续稳健的投资收益。</p> <p>另外，本基金的投资策略还包括存托凭证投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、国债期货投资策略、基金的投资策略等。</p>

业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*8%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*2%+银行活期存款利率(税后)*5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，还将面临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。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通添利收益一年持有期债券 A	海富通添利收益一年持有期债券 C
下属两级基金的交易代码	019038	019039
报告期末下属两级基金的份额总额	267,089,852.45 份	131,847,952.13 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	海富通添利收益一年持有期债券 A	海富通添利收益一年持有期债券 C
1.本期已实现收益	3,238,875.43	1,459,790.73
2.本期利润	4,604,574.13	2,130,526.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0173	0.0162
4.期末基金资产净值	276,246,471.96	136,016,647.09
5.期末基金份额净值	1.0343	1.0316

注：（1）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。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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、海富通添利收益一年持有期债券 A：

阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	1.70%	0.12%	1.48%	0.08%	0.22%	0.04%
过去六个月	3.09%	0.13%	3.43%	0.09%	-0.34%	0.04%
自基金合同 生效起至今	3.43%	0.12%	3.97%	0.09%	-0.54%	0.03%

2、海富通添利收益一年持有期债券 C:

阶段	净值增长 率①	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	1.60%	0.12%	1.48%	0.08%	0.12%	0.04%
过去六个月	2.88%	0.13%	3.43%	0.09%	-0.55%	0.04%
自基金合同 生效起至今	3.16%	0.12%	3.97%	0.09%	-0.81%	0.03%

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

海富通添利收益一年持有期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历史走势对比图

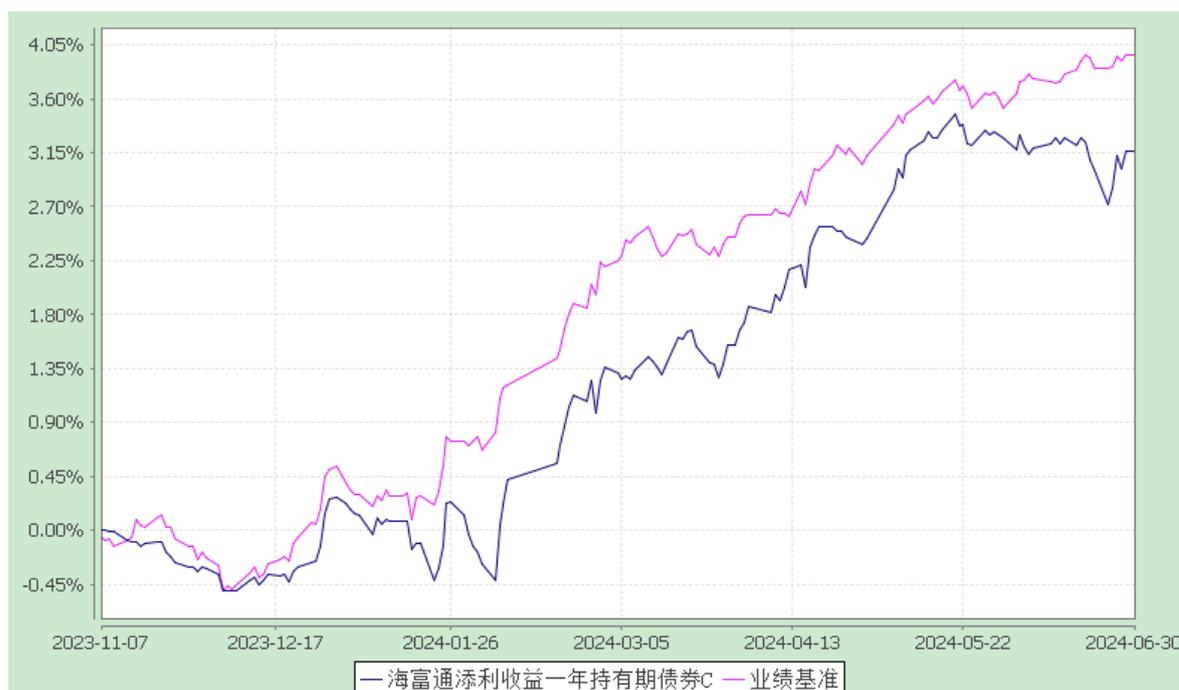
1. 海富通添利收益一年持有期债券 A:

(2023 年 11 月 7 日至 2024 年 6 月 30 日)



2. 海富通添利收益一年持有期债券 C:

(2023 年 11 月 7 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于2023年11月7日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2、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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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。	2023-11-07	-	13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，现任混合资产投资部总经理。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。

				<p>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。2024 年 3</p>
--	--	--	--	--

					月起兼任海富通欣盈 6 个月持有期混合基金经理。2024 年 6 月起兼任海富通红利优选混合基金经理。
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。	2023-11-07	-	15 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

					<p>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 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</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>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。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。</p>
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

固定收益方面，二季度国内经济企稳。PMI 重回扩张区间但持续性略有不足。经济数据方面，生产端表现好于需求端；投资方面，制造业与基建维持高增，地产投资跌幅走扩。消费需求偏弱，可选消费与地产后周期消费拖累。出口方面，海外需求旺盛，出口同比增速与贸易顺差回升。通胀方面，CPI 总体弹性有限，维持在 0-1% 的区间窄幅震荡；PPI 在基数效应下跌幅收窄但仍未转正。货币政策方面，由于汇率方面压力较大，“资金空转”的问题依然存在，因此总量型货币政策的出台较为谨慎，但月末央行大额投放，呵护关键时点的流动性。财政政策方面，地方债发行略有提速，特别国债稳步发行。流动性方面，除跨月跨季关键节点外，流动性总体维持相对宽松的状态。资金价格方面，二季度 R001 均值为 1.84%，与一季度基本持平；R007 均值为 1.94%，较一季度下行 19bp。对应债市而言，二季度维持牛市行情。4 月，财政部表示支持央行增加国债买卖，提振了市场做多的情绪，各期限收益率均持续下行。但随着央行提示长端利率风险及地产政策陆续出台，10 年期国债收益率有所调整。5-6 月基本面与金融数据偏弱，同时特别国债发行节奏平滑，地方债发行压力不大。在各方

利好下债券市场走出牛市行情。全季度来看，10 年期国债到期收益率累计下行 8bp。

信用债方面，债市在震荡中依然维持牛市的逻辑。需求端，手工补息叫停后出现“存款搬家”效应，大行存款存在一定程度流失而理财规模快速增长，市场定价权一定程度向非银倾斜，非银主导的中短端信用债表现较强；供给端，信用债供给总量并不少，主要是收益率低位，超长信用债供给放量，以高等级央国企产业债为主，城投债净融资额持续低位徘徊。整体而言，随着资产荒持续演绎，信用债收益率进一步走低，等级利差、期限利差多数创历史新低，信用债面临资产荒持续和收益率低的两难。

本管理人在二季度根据组合规模情况维持了整体信用债配置底仓，同时积极使用利率债和国债期货等工具，参与波段机会。

权益方面，二季度 A 股市场高位震荡后下跌。沪深 300 指数下跌了 2.14%、中证 500 指数下跌 6.50%、科创 50 指数下跌 6.64%、创业板综指下跌 8.50%、中小综指下跌 6.45%。分行业看，中信一级行业表现靠前的板块是银行、电力及公用事业、交通运输、煤炭、电子，跌幅较大的板块是消费者服务、传媒、商贸零售、计算机、轻工制造。当前市场风险偏好降低，类债策略依然是市场的主流预期，高股息率国企密集的行业更受到市场偏爱。

可转债方面，二季度中证转债指数上涨 0.75%。二季度行情大概分为三个阶段：4-5 月中旬，在正股行情修复、流动性宽松、纯债资金回归的支撑下，转债平稳上涨。5 月中旬-6 月中旬，权益市场迎来调整，转债跟随权益市场回调逐渐走弱。6 月中旬-6 月底，小微盘风格担忧、信用评级下调、到期券兑付、资金踩踏的担忧等问题叠加引发中低价转债巨震，转债的债底保护暂时失效；后来随着转债信用评级报告的陆续披露，转债市场逐渐企稳。

报告期间，本基金秉承绝对收益的投资思路投资。权益仓位上，保持相对低位；权益配置上，组合整体偏价值风格，行业分布较为均衡，持仓个股较为分散。风格上，与一季度类似，组合偏红利、价值的风格在二季度有所获益，但组合全市场选股偏小市值的风格在二季度有所受损。在权益市场风险偏好较低背景下，从波动和潜在收益来看价值风格仍是较优选择，预计组合权益部分的投资未来仍偏向于价值风格。同时，在 6 月转债的调整中组合增配了部分低价且信用风险较低的可转债。目前来看，整体转债市场的纯债溢价率水平跌到了相对历史低位，部分信用风险较低的转债自身未来的票息收入提供了较为充分的安全垫，在下行风险有限的背景下提供了一定的权

益市场潜在弹性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通添利收益一年持有期债券 A 净值增长率为 1.70%，同期业绩比较基准收益率为 1.48%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.22 个百分点。海富通添利收益一年持有期债券 C 净值增长率为 1.60%，同期业绩比较基准收益率为 1.48%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.12 个百分点。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	23,802,841.27	4.30
	其中：股票	23,802,841.27	4.30
2	基金投资	4,989,405.23	0.90
3	固定收益投资	511,220,326.87	92.33
	其中：债券	511,220,326.87	92.33
	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	12,320,545.31	2.23
8	其他资产	1,329,959.10	0.24
9	合计	553,663,077.78	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为2,634,077.53元，占资产净值比例为0.64%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	285,366.00	0.07

C	制造业	12,412,045.04	3.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,959,428.00	0.48
E	建筑业	1,827,030.00	0.44
F	批发和零售业	340,098.40	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	337,854.00	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,641,521.70	0.40
J	金融业	1,275,979.00	0.31
K	房地产业	51,684.00	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	445,161.60	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	592,596.00	0.14
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	21,168,763.74	5.13

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	198,453.14	0.05
非日常生活消费品	149,971.58	0.04
能源	68,998.61	0.02
金融	884,022.75	0.21
工业	1,054,729.52	0.26
通信服务	105,414.54	0.03
公用事业	43,169.76	0.01
房地产	129,317.63	0.03
合计	2,634,077.53	0.64

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002353	杰瑞股份	26,500	929,620.00	0.23
2	000333	美的集团	11,200	722,400.00	0.18
3	600803	新奥股份	33,000	686,400.00	0.17

4	00390	中国中铁	111,000	436,635.24	0.11
4	601390	中国中铁	36,300	236,676.00	0.06
5	600941	中国移动	4,900	526,750.00	0.13
5	00941	中国移动	1,500	105,414.54	0.03
6	600522	中天科技	35,700	565,845.00	0.14
7	600795	国电电力	88,600	530,714.00	0.13
8	600323	瀚蓝环境	25,300	528,770.00	0.13
9	000090	天健集团	131,000	526,620.00	0.13
10	002142	宁波银行	19,800	436,788.00	0.11

注：中国中铁、中国移动同时在 A+H 股上市，合并计算其公允价值参与排序。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	23,663,831.10	5.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	298,921,628.21	72.51
	其中：政策性金融债	61,073,424.66	14.81
4	企业债券	114,507,232.34	27.78
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,362,989.59	4.94
7	可转债（可交换债）	53,764,645.63	13.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	511,220,326.87	124.00

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	240410	24 农发 10	600,000	61,073,424.66	14.81
2	2128002	21 工商银行二级 01	300,000	31,517,852.46	7.65
3	184108	21 福能 01	300,000	31,423,366.03	7.62
4	2128022	21 交通银行永续债	300,000	31,184,061.37	7.56
5	240119	23 华电 K1	300,000	30,967,989.04	7.51

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。国债期货相关投资严格遵循法律法规及中国证监会的规定。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变 动(元)	风险指标说 明
T2409	T2409	13.00	13,696,800. 00	147,550.00	-
公允价值变动总额合计(元)					147,550.00
国债期货投资本期收益(元)					253,288.60
国债期货投资本期公允价值变动(元)					29,300.00

注：国债期货投资本期收益中已扣除本期国债期货差价收入应缴纳增值税额。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	285,317.83
2	应收证券清算款	1,004,378.18
3	应收股利	40,262.09
4	应收利息	-
5	应收申购款	1.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,329,959.10

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113633	科沃转债	2,379,387.27	0.58
2	110079	杭银转债	2,354,961.04	0.57
3	113644	艾迪转债	2,087,503.49	0.51
4	128134	鸿路转债	2,051,868.02	0.50
5	113584	家悦转债	1,803,319.73	0.44
6	113056	重银转债	1,742,938.99	0.42
7	123071	天能转债	1,376,621.74	0.33
8	128131	崇达转 2	1,374,247.84	0.33
9	128116	瑞达转债	1,324,982.69	0.32
10	110076	华海转债	1,278,249.41	0.31
11	128071	合兴转债	1,270,955.03	0.31
12	127024	盈峰转债	1,260,789.21	0.31
13	113625	江山转债	1,192,588.13	0.29
14	113657	再 22 转债	1,160,479.89	0.28
15	128125	华阳转债	1,158,982.60	0.28
16	113050	南银转债	1,141,249.95	0.28
17	113052	兴业转债	1,114,642.01	0.27
18	127088	赫达转债	1,090,143.41	0.26
19	113653	永 22 转债	1,081,967.18	0.26
20	128117	道恩转债	1,066,774.51	0.26
21	128142	新乳转债	1,066,152.84	0.26
22	123115	捷捷转债	1,035,710.22	0.25
23	127041	弘亚转债	972,337.72	0.24
24	123169	正海转债	902,659.02	0.22
25	128121	宏川转债	762,410.40	0.18
26	123121	帝尔转债	736,636.34	0.18
27	113606	荣泰转债	722,015.80	0.18

28	123104	卫宁转债	711,647.04	0.17
29	113605	大参转债	679,579.26	0.16
30	110081	闻泰转债	677,859.37	0.16
31	123113	仙乐转债	671,000.00	0.16
32	127052	西子转债	627,229.07	0.15
33	113640	苏利转债	609,746.88	0.15
34	113650	博 22 转债	592,416.00	0.14
35	123126	瑞丰转债	575,243.43	0.14
36	113636	甬金转债	522,804.14	0.13
37	127025	冀东转债	517,429.86	0.13
38	123063	大禹转债	501,191.95	0.12
39	123178	花园转债	486,403.20	0.12
40	123213	天源转债	486,338.76	0.12
41	123109	昌红转债	458,663.63	0.11
42	123165	回天转债	453,643.01	0.11
43	127070	大中转债	420,897.62	0.10
44	128109	楚江转债	410,168.95	0.10
45	123146	中环转 2	383,115.23	0.09
46	128066	亚泰转债	350,122.08	0.08
47	123120	隆华转债	322,846.67	0.08
48	127018	本钢转债	318,806.98	0.08
49	123154	火星转债	318,634.93	0.08
50	118032	建龙转债	295,721.84	0.07
51	123103	震安转债	288,899.89	0.07
52	118005	天奈转债	279,691.23	0.07
53	127034	绿茵转债	275,242.82	0.07
54	127062	垒知转债	273,014.60	0.07
55	123133	佩蒂转债	271,196.71	0.07
56	113676	荣 23 转债	244,836.81	0.06
57	113624	正川转债	229,993.48	0.06
58	123124	晶瑞转 2	225,169.28	0.05
59	113647	禾丰转债	218,911.19	0.05
60	113046	金田转债	217,635.99	0.05
61	123100	朗科转债	214,202.22	0.05
62	111014	李子转债	212,264.11	0.05
63	123180	浙矿转债	198,188.84	0.05
64	113048	晶科转债	189,013.70	0.05
65	127051	博杰转债	188,925.24	0.05
66	127099	盛航转债	171,009.16	0.04
67	128105	长集转债	164,331.92	0.04
68	127016	鲁泰转债	160,825.58	0.04
69	118038	金宏转债	156,141.27	0.04
70	127017	万青转债	154,997.84	0.04

71	111009	盛泰转债	152,733.81	0.04
72	113655	欧 22 转债	149,056.07	0.04
73	127077	华宏转债	138,109.94	0.03
74	127076	中宠转 2	135,957.96	0.03
75	123093	金陵转债	126,732.96	0.03
76	123091	长海转债	123,304.12	0.03
77	128063	未来转债	116,020.27	0.03
78	110093	神马转债	110,503.81	0.03
79	127022	恒逸转债	109,363.18	0.03
80	113054	绿动转债	105,635.70	0.03
81	111010	立昂转债	100,710.57	0.02
82	113632	鹤 21 转债	95,584.33	0.02
83	118009	华锐转债	86,212.27	0.02
84	127059	永东转 2	85,131.29	0.02
85	118010	洁特转债	76,861.26	0.02
86	113542	好客转债	76,039.39	0.02
87	113643	风语转债	75,078.36	0.02
88	118028	会通转债	69,166.11	0.02
89	123149	通裕转债	60,590.47	0.01
90	113652	伟 22 转债	56,555.79	0.01
91	123211	阳谷转债	55,376.45	0.01
92	128081	海亮转债	54,252.92	0.01
93	127046	百润转债	54,101.37	0.01
94	127030	盛虹转债	53,651.03	0.01
95	128087	孚日转债	46,577.30	0.01
96	118033	华特转债	34,649.25	0.01
97	127026	超声转债	22,362.79	0.01
98	118035	国力转债	21,166.16	0.01
99	123214	东宝转债	21,020.05	0.01
100	123179	立高转债	20,440.34	0.00
101	113053	隆 22 转债	20,350.07	0.00
102	123212	立中转债	11,750.29	0.00
103	123119	康泰转 2	11,550.93	0.00
104	123158	宙邦转债	11,371.47	0.00
105	113064	东材转债	11,244.88	0.00
106	113641	华友转债	10,146.70	0.00
107	127044	蒙娜转债	9,810.92	0.00
108	118018	瑞科转债	8,898.79	0.00

5.11.5 报告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。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	515100	景顺长城中证红利低波动100ETF	交易型开放式	1,814,801.00	2,410,055.73	0.58%	否
2	510310	易方达沪深300ETF发起式	交易型开放式	1,148,700.00	1,958,533.50	0.48%	否
3	512120	华安中证细分医药ETF	交易型开放式	1,687,000.00	620,816.00	0.15%	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费(元)	-	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	-	-
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	2,443.84	-
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	560.48	-
当期交易基金产生的交易	281.32	-

费（元）		
当期交易基金产生的转换费（元）	-	-

注：当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况，根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通添利收益一年持有期债券A	海富通添利收益一年持有期债券C
本报告期期初基金份额总额	266,810,781.76	131,497,174.90
本报告期基金总申购份额	279,070.69	350,777.23
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	267,089,852.45	131,847,952.13

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

机构	1	2024/4/1-2024/6/30	100,003,500.00	-	-	100,003,500.00	25.07%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；</p> <p>2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额；</p> <p>3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现五十个工作日低于5000万元的风险，本基金可能会面临终止基金合同的情形；</p> <p>4、其他可能的风险。</p> <p>另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。</p>							

9.2 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 123 只公募基金。截至 2024 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1613 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联《上海证券报》颁发的“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混

合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获中国保险资产管理业协会颁发的“IAMAC 推介·2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《上海证券报》颁发的“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。2023 年 8 月，海富通荣获《上海证券报》颁发的“上证·中国基金投教创新案例奖”。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金的文件
- (二)海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金基金合同
- (三)海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通添利收益一年持有期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

10.2 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

10.3 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

二〇二四年七月十九日