

**海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金**  
**2024 年第 3 季度报告**  
**2024 年 9 月 30 日**

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年十月二十五日

## §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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 24 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	海富通富利三个月持有
基金主代码	010850
交易代码	010850
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 7 月 20 日
报告期末基金份额总额	35,487,457.31 份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。
投资策略	<p>本基金通过对宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究，同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素，兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动，结合投资时钟理论，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例。并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，或借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应，以规避或分散市场风险。</p> <p>股票投资方面，本基金将采用量化选股策略、风险估测模型——有效控制预期风险、交易成本模型——控制交</p>

	易成本以保护投资业绩、投资组合的优化及调整、港股通标的股票的投资策略等策略； 债券投资方面，本基金将采用利率策略、信用策略、收益率曲线策略、杠杆策略等策略。	
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
下属两级基金的交易代码	010850	010851
报告期末下属两级基金的份额总额	24,537,114.53 份	10,950,342.78 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 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)	
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
1.本期已实现收益	13,985.31	8,020.62
2.本期利润	745,713.55	169,990.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0292	0.0090
4.期末基金资产净值	24,395,881.40	10,750,982.11
5.期末基金份额净值	0.9942	0.9818

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、海富通富利三个月持有 A：

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	3.22%	0.34%	3.45%	0.25%	-0.23%	0.09%
过去六个月	4.91%	0.28%	4.43%	0.21%	0.48%	0.07%
过去一年	4.83%	0.29%	5.25%	0.20%	-0.42%	0.09%
过去三年	-0.65%	0.29%	2.38%	0.22%	-3.03%	0.07%
自基金合同生效起至今	-0.58%	0.28%	1.33%	0.22%	-1.91%	0.06%

#### 2、海富通富利三个月持有 C：

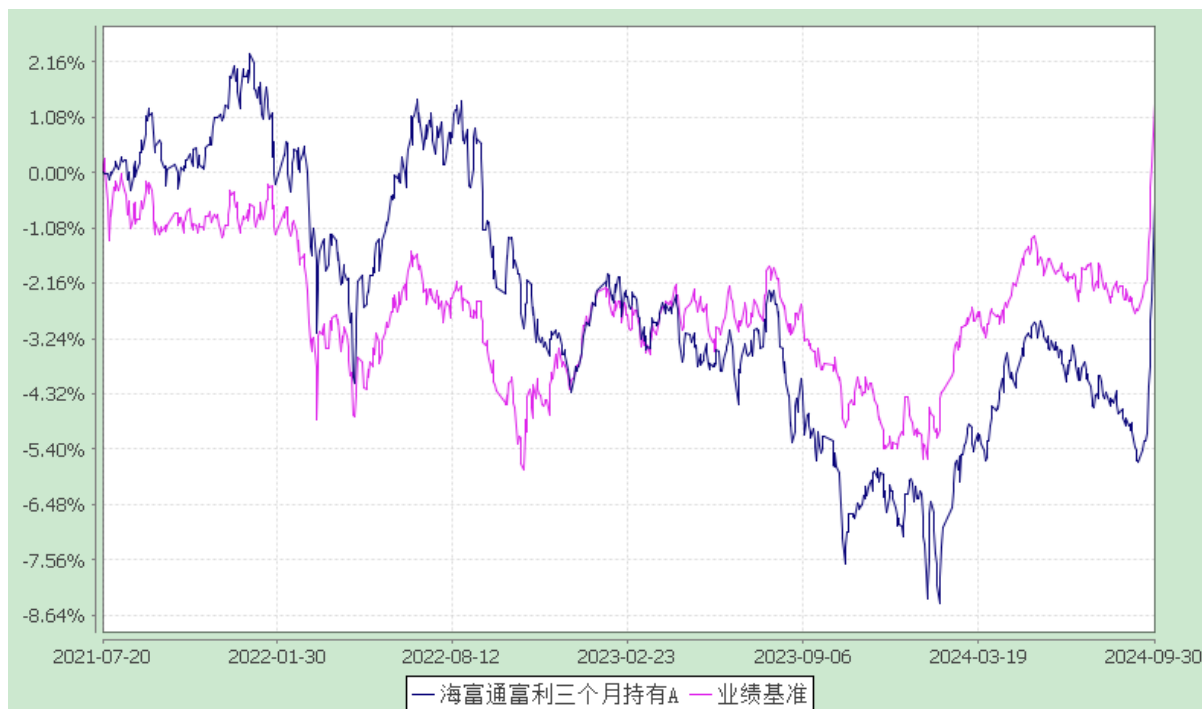
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.15%	0.35%	3.45%	0.25%	-0.30%	0.10%
过去六个月	4.73%	0.28%	4.43%	0.21%	0.30%	0.07%
过去一年	4.44%	0.29%	5.25%	0.20%	-0.81%	0.09%
过去三年	-1.81%	0.29%	2.38%	0.22%	-4.19%	0.07%
自基金合同生效起至今	-1.82%	0.28%	1.33%	0.22%	-3.15%	0.06%

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

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

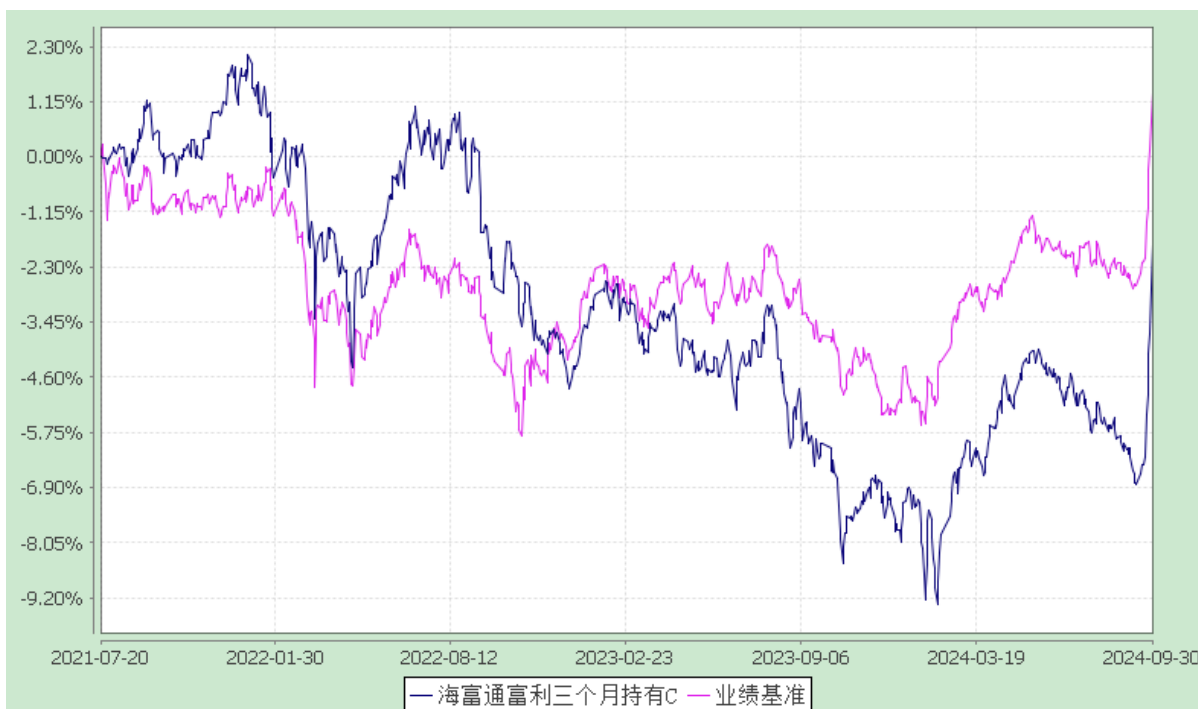
#### 1. 海富通富利三个月持有 A

(2021 年 7 月 20 日至 2024 年 9 月 30 日)



#### 2. 海富通富利三个月持有 C

(2021 年 7 月 20 日至 2024 年 9 月 30 日)



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

## §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		
张靖爽	本基金的基金经理；债券基金部副总监。	2021-07-20	-	14 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中银基金管理有限公司研究员，交银施罗德基金管理有限公司投资经理、基金经理助理、研究员。现任海富通基金管理有限公司债券基金部副总监（主持工作）。2016 年 7 月至 2017 年 10 月任海富通双利债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海

				<p>富通一年定期开放债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 11 月兼任海富通纯债债券基金经理。2017 年 8 月起兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）和海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2018 年 2 月至 2021 年 2 月任海富通融丰定开债券基金经理。2018 年 11 月至 2020 年 10 月任海富通鼎丰定开债券基金经理。2019 年 5 月至 2022 年 12 月兼任海富通新内需混合基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 4 月任海富通聚合纯债基金经理。2019 年 12 月起兼任海富通裕通 30 个月定开债券基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通裕昇三年定开债券基金经理。2020 年 5 月至 2021 年 7 月兼任海富通瑞弘 6 个月定开债券基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。2022 年 8 月至 2024 年 8 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通瑞兴 3 个月定开债券基金经理。</p>	
杜晓海	本基金的基金经理；总经理助理。	2021-07-20	2024-09-26	24 年	<p>硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监、量化投资部总监，现任海富通基金管理有限公司总经理助理。2016 年 6 月起任海富通安颐收益混合（原海富通养老</p>

				<p>收益混合) 基金经理。2016 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 10 月兼任海富通富睿混合(现海富通沪深 300 增强) 基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至 2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月至 2021 年 7 月兼任海富通中证 500 增强(原海富通中证内地低碳指数) 基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月至 2023 年 10 月兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月至 2024 年 9 月兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。2023 年 10 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通 ESG 领先股票基金经理。2024 年 6 月起兼</p>
--	--	--	--	---



					任海富通中证港股通科技ETF发起联接基金经理。
林立禾	本基金的基金经理	2023-11-23	-	6 年	美国密歇根大学定量金融与风险管理硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中欧基金管理有限公司风险管理部量化风控岗。2020 年 8 月加入海富通基金管理有限公司，历任量化研究员、量化投资部基金经理助理。2023 年 11 月起任海富通欣益混合、海富通富利三个月持有、海富通沪深300 增强的基金经理。

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

##### 4.3.2 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

国内经济方面，2024 年三季度国内经济整体维持弱修复状态。从经济领先指标看，三季度社融和 M1 增速仍持续回落，经济内需仍显疲弱。从经济增长动力上看，三季度受益于低基数出口保持较高增长，但国内地产未显著回暖，市场信心不足，内需消费和投资较疲弱，全社会风险偏好较低。从政策思路看，三中全会明确了国内政策坚持高质量发展，长期看依然要保持战略定力；短期看，市场关切得到积极回应，9 月下旬一系列增量政策出台，短期宏观政策有望加码。

海外经济方面，美国经济边际走弱但还难言衰退。三季度美国就业数据开始出现恶化迹象，美联储货币政策关注的重点也从通胀转向了就业，从而在 9 月启动了超预期的 50BP 降息。美国经济主要靠消费拉动，8 月美国零售超预期，美国消费依然有韧性。另外，目前美国大选依旧胶着，未来需继续跟踪相关进展。

从 A 股市场看，三季度市场先跌后涨，三季度上证指数涨幅为 12.4%，沪深 300 为 16.1%，中证 800 为 16.1%，创业板指为 29.2%。行业板块方面，根据中信一级行业分类，表现靠前的板块是非银、综合金融、房地产、消费者服务、计算机，表现靠后的板块是石油石化、煤炭、电力及公用事业、农林牧渔、纺织服装。

从行情主线看，三季度以来市场持续调整。但是，随着 9 月 24 日国新办新闻发布会释放了政策暖意，降低存量房贷利率和首付比例以支持地产，创设新工具支持资本市场发展，9 月 26 日中共中央政治局会议分析研究当前经济形势和经济工作，将宏观政策放在更重要的位置，并提出“加力推出增量政策”、“提振资本市场”等，市场信心显著提振。在此背景下，市场做多情绪被激发，迎来了直线拉涨行情，前期超跌的板块迎来了大幅上涨。

本报告期内，本基金在股票策略上优选具有长期价值增长、红利属性以及良好现金流的上市公司作为核心持仓标的，转债策略上也以具有股性的价值型转债为主。

因子方面，本基金在红利和价值因子上有明显正暴露，小市值因子暴露有所减小，报告期内风格上整体超额为正。另外，本报告期将中小价值的权益配置比例降低，增加了现金流充裕标的及港股红利的配置比例。

固定收益方面，三季度国内经济修复动能走弱，PMI 维持在收缩区间。经济数据方面，生产端略有走弱；投资方面，制造业与基建维持高增，地产投资惯性下滑。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，出口同比维持高增。通胀方面，CPI 总体弹性有限，维持在 0-1% 的区间；PPI 由于需求偏弱仍未转正。货币政策方面较为积极，7 月调降 OMO 利率 10bp、MLF 利率 20bp 以及 LPR 利率 10bp。9 月末国新办举行新闻发布会后，再度调降 OMO 利率 20bp、MLF 利率 30bp。财政政策方面，地方债发行明显提速。流动性方面，由于利率债发行造成一定的“抽水效应”，中长期流动性阶段性短缺，在 7 月末降息落地后，流动性总体维持中性偏紧张的情况，9 月末央行重启 14 天逆回购投放操作后流动性偏紧的情况有所缓解。资金价格方面，三季度 R001 均值为 1.79%，较二季度下行 5.4bp；R007 均值为 1.90%，较二季度下行 4.1bp。

对应债市而言，内需不足，货币政策宽松支撑三季度总体维持牛市行情，但在 8 月与 9 月末出现明显调整。7 月政策利率调降，基本面与政策面双利好债券市场；8 月央行买卖国债操作落地，债券抛盘压力陡增，理财产品预防性赎回放大市场波动，收益率一度回到接近 7 月降息前的水平。9 月降息降准预期再度升温，配合调降存量房贷的预期，收益率下行并突破新低。但月末降准降息落地后，债市演绎利好出尽的行情，收益率大幅波动并有上行。全季度来看，10 年期国债到期收益率累计下行 5.4bp。

信用债方面，走势一波三折。7 月，央行对利率约束加大，在利率波动受限、高息资产供给有限的情况下，市场机构普遍通过下沉、拉久期的方式挖掘绝对票息，信用债收益率全线下行，其中长久期、弱资质主体收益率下行幅度最大；8 月，信用债市场经历大幅调整，究其原因，信用利差过低是关键，“固收+”基金赎回是调整的触发剂，不少理财等机构预防式、止盈式地赎回基金，市场流动性缺乏进一步放大了债市的波动，在持续的“地量”成交下，流动性天然劣势的信用债率先快速调整；9 月以来，由于理财实际规模尚未明显下行，叠加央行放开做市，市场情绪好转，信用债有所修复，但信用债内部仍有分层，中高等级收益率普遍下行，低等级、长品种收益率上行，信用债表现整体不及同期限利率债，信用利差普遍走扩。

报告期内，本基金主要投资于利率债，根据市场情况灵活调整组合久期和杠杆。基于三季度的基本面、资金面和政策面，组合维持一定的债券仓位，并依据利率曲线的变化，针对不同期限的利率债进行积极的交易以增厚收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通富利三个月持有 A 净值增长率为 3.22%，同期业绩比较基准收益率为 3.45%。海富通富利三个月持有 C 净值增长率为 3.15%，同期业绩比较基准收益率为 3.45%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自 2024 年 3 月 11 日至 2024 年 9 月 30 日，连续超过六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人拟持续运作本基金，解决方案已根据法规要求向中国证券监督管理委员会上海监管局进行了报告，报告期内已召开基金份额持有人大会。

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

## §5 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	9,429,588.96	26.73
	其中：股票	9,429,588.96	26.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,549,136.18	69.58
	其中：债券	24,549,136.18	69.58
	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	1,260,614.05	3.57
8	其他资产	43,270.03	0.12
9	合计	35,282,609.22	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696,457.84元，占资产净值比例为1.98%。

## 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	6,363.00	0.02
B	采矿业	788,912.00	2.24
C	制造业	4,257,141.57	12.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	349,766.42	1.00
E	建筑业	374,076.00	1.06
F	批发和零售业	410,520.00	1.17
G	交通运输、仓储和邮政业	649,991.60	1.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	177,848.88	0.51
J	金融业	1,215,305.00	3.46

K	房地产业	182,776.00	0.52
L	租赁和商务服务业	116,412.00	0.33
M	科学研究和技术服务业	16,008.65	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	57,650.00	0.16
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	130,360.00	0.37
S	综合	-	-
	合计	8,733,131.12	24.85

### 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（%）
能源	200,495.87	0.57
原材料	93,069.24	0.26
工业	93,569.73	0.27
金融	170,952.34	0.49
通信服务	40,147.69	0.11
公用事业	44,909.14	0.13
房地产	53,313.83	0.15
合计	696,457.84	1.98

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	000651	格力电器	3,100	148,614.00	0.42
2	000333	美的集团	1,800	136,908.00	0.39
3	601225	陕西煤业	4,700	129,626.00	0.37
4	601939	建设银行	13,800	109,434.00	0.31
4	00939	建设银行	3,000	15,907.58	0.05
5	601668	中国建筑	20,100	124,218.00	0.35
6	601088	中国神华	1,750	76,300.00	0.22
6	01088	中国神华	1,500	47,411.61	0.13
7	600901	江苏金租	20,500	110,290.00	0.31
8	600900	长江电力	3,450	103,672.50	0.29

9	600028	中国石化	10,850	75,516.00	0.21
9	00386	中国石油化工股份	6,000	26,187.98	0.07
10	600064	南京高科	13,200	95,568.00	0.27

注：建设银行、中国神华和中国石化同时在 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	7,166,252.50	20.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,702,424.66	30.45
	其中：政策性金融债	10,702,424.66	30.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,680,459.02	19.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,549,136.18	69.85

#### 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	200205	20 国开 05	100,000	10,702,424.66	30.45
2	019743	24 国债 11	40,000	4,067,290.96	11.57
3	019727	23 国债 24	18,000	1,839,757.81	5.23
4	019729	23 国债 26	12,000	1,259,203.73	3.58
5	113042	上银转债	10,100	1,146,128.91	3.26

#### 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

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

### 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

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

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 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，符合既定投资策略及投资目标。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海银行股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局上海监管局的处罚。

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

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

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	7,340.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	2,698.57
4	应收利息	-
5	应收申购款	9.99
6	其他应收款	33,220.76
7	其他	-
8	合计	43,270.03

#### 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	113042	上银转债	1,146,128.91	3.26
2	110059	浦发转债	1,132,484.64	3.22
3	113052	兴业转债	735,566.60	2.09
4	113037	紫银转债	666,740.73	1.90
5	113056	重银转债	502,262.34	1.43
6	113044	大秦转债	99,756.77	0.28
7	127045	牧原转债	99,477.05	0.28
8	113050	南银转债	95,535.08	0.27
9	110079	杭银转债	85,126.44	0.24
10	123107	温氏转债	76,316.73	0.22
11	118034	晶能转债	60,482.42	0.17
12	127040	国泰转债	55,616.34	0.16
13	113060	浙 22 转债	50,181.74	0.14
14	127049	希望转 2	49,589.91	0.14



15	127084	柳工转 2	47,430.90	0.13
16	110085	通 22 转债	47,369.88	0.13
17	127020	中金转债	46,356.20	0.13
18	127086	恒邦转债	45,351.98	0.13
19	128129	青农转债	44,045.30	0.13
20	127067	恒逸转 2	42,899.39	0.12
21	113641	华友转债	40,609.92	0.12
22	113065	齐鲁转债	39,878.40	0.11
23	127089	晶澳转债	38,311.17	0.11
24	127070	大中转债	37,553.55	0.11
25	118030	睿创转债	33,311.98	0.09
26	113062	常银转债	33,066.47	0.09
27	113055	成银转债	30,939.66	0.09
28	113647	禾丰转债	30,886.87	0.09
29	113068	金铜转债	29,186.19	0.08
30	127102	浙建转债	27,877.91	0.08
31	127032	苏行转债	27,558.41	0.08
32	113064	东材转债	27,124.90	0.08
33	113045	环旭转债	26,565.28	0.08
34	127042	嘉美转债	26,551.06	0.08
35	113631	皖天转债	25,700.01	0.07
36	128136	立讯转债	25,546.73	0.07
37	127085	韵达转债	25,226.78	0.07
38	118022	锂科转债	25,004.76	0.07
39	113549	白电转债	24,470.49	0.07
40	113061	拓普转债	24,406.78	0.07
41	127027	能化转债	23,811.97	0.07
42	113532	海环转债	23,794.64	0.07
43	127035	濮耐转债	23,612.33	0.07
44	127014	北方转债	23,498.97	0.07
45	110048	福能转债	23,392.36	0.07

46	111009	盛泰转债	23,292.36	0.07
47	127039	北港转债	23,008.82	0.07
48	113046	金田转债	22,952.74	0.07
49	123048	应急转债	22,931.36	0.07
50	123240	楚天转债	22,734.55	0.06
51	113616	韦尔转债	22,408.14	0.06
52	123161	强联转债	22,079.78	0.06
53	110090	爱迪转债	21,857.13	0.06
54	127024	盈峰转债	21,457.64	0.06
55	113049	长汽转债	21,433.55	0.06
56	113047	旗滨转债	21,180.71	0.06
57	127016	鲁泰转债	21,129.98	0.06
58	113615	金诚转债	20,853.36	0.06
59	113059	福莱转债	20,542.74	0.06
60	127022	恒逸转债	20,299.21	0.06
61	111010	立昂转债	19,819.24	0.06
62	111014	李子转债	19,678.85	0.06
63	127028	英特转债	19,671.10	0.06
64	127026	超声转债	19,588.76	0.06
65	110077	洪城转债	18,586.23	0.05
66	127064	杭氧转债	17,999.63	0.05
67	110068	龙净转债	17,480.26	0.05
68	128133	奇正转债	17,226.37	0.05
69	127025	冀东转债	16,566.07	0.05
70	113054	绿动转债	15,689.50	0.04
71	113024	核建转债	15,067.01	0.04
72	128081	海亮转债	14,546.84	0.04
73	123216	科顺转债	13,748.50	0.04
74	113051	节能转债	12,737.49	0.04
75	113632	鹤 21 转债	10,709.73	0.03
76	113545	金能转债	10,641.87	0.03

77	127103	东南转债	10,613.70	0.03
78	113638	台 21 转债	10,138.94	0.03
79	113069	博 23 转债	9,888.49	0.03
80	127100	神码转债	9,664.54	0.03
81	127050	麒麟转债	9,650.91	0.03
82	113619	世运转债	8,580.30	0.02
83	123145	药石转债	8,515.46	0.02
84	128109	楚江转债	8,447.56	0.02
85	127052	西子转债	8,250.61	0.02
86	110089	兴发转债	7,764.38	0.02
87	128083	新北转债	7,704.36	0.02
88	123208	孩王转债	7,703.74	0.02
89	123064	万孚转债	7,614.48	0.02
90	127082	亚科转债	7,122.35	0.02
91	128048	张行转债	6,671.75	0.02
92	110095	双良转债	6,556.73	0.02
93	128130	景兴转债	6,529.94	0.02
94	110094	众和转债	6,186.79	0.02
95	128132	交建转债	6,142.16	0.02
96	128141	旺能转债	5,936.84	0.02
97	110084	贵燃转债	5,777.97	0.02
98	113563	柳药转债	5,698.39	0.02
99	113623	凤 21 转债	5,688.43	0.02
100	113673	岱美转债	4,894.09	0.01
101	111002	特纸转债	4,768.84	0.01
102	128128	齐翔转 2	4,759.80	0.01
103	123101	拓斯转债	4,663.76	0.01
104	128144	利民转债	4,426.76	0.01
105	127015	希望转债	4,320.01	0.01
106	113066	平煤转债	4,222.03	0.01
107	118003	华兴转债	3,822.32	0.01

108	113639	华正转债	3,191.96	0.01
109	110074	精达转债	3,108.79	0.01
110	127017	万青转债	2,801.40	0.01
111	110052	贵广转债	2,539.45	0.01
112	123035	利德转债	2,529.93	0.01
113	113651	松霖转债	2,519.40	0.01
114	127054	双箭转债	2,392.97	0.01
115	113039	嘉泽转债	2,360.60	0.01
116	123158	宙邦转债	2,338.02	0.01
117	113674	华设转债	2,321.18	0.01
118	123130	设研转债	2,313.00	0.01
119	110055	伊力转债	1,305.27	0.00
120	128053	尚荣转债	1,123.94	0.00
121	113048	晶科转债	964.09	0.00
122	118031	天 23 转债	856.12	0.00
123	128071	合兴转债	540.01	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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通富利三个月持有A	海富通富利三个月持有C
本报告期期初基金份额总额	26,291,610.90	21,759,882.58
本报告期基金总申购份额	220,163.96	243,678.36
减：本报告期基金总赎回份额	1,974,660.33	11,053,218.16
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	24,537,114.53	10,950,342.78

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 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。

### 7.2 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。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	2024/7/1-2024/8/25	10,000,000.00	-	10,000,000.00	-	-

#### 产品特有风险

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

- 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额；
- 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；
- 4、其他可能的风险。

另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 124 只公募基金。截至 2024 年 9 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1584 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”。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

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

## 9.2 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

## 9.3 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  
二〇二四年十月二十五日