

海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 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.....	42
7.7 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.....	42
7.8 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.....	42
7.9 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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
8.3 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	44
§9 开放式基金份额变动	44
§10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
10.2 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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息	48
§12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	海富通沪港深混合
基金主代码	519139
交易代码	519139
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 11 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	124,267,298.85 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金以投资目标为中心，将定性和定量的分析方法运用于资产配置，根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段，包括大类资产的历史回报、历史波动率等制定本基金在股票、债券、现金、衍生品等资产之间的初步配置；其次结合证券市场趋势指标，判断证券市场指数的大致风险收益比，再根据基本面、资金面、估值等具体因素，持续、动态、优化投资组合的资产配置比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40% +恒生指数收益率×40% +中债综合财富指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	陆志俊
	联系电话	021-38650788	95559
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559
传真		021-33830166	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石	中国（上海）自由贸易试验区

	桥路66号东亚银行金融大厦 36-37层	银城中路188号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦 36-37层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	杨仓兵	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2020年1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	10,338,914.60
本期利润	13,353,251.05
加权平均基金份额本期利润	0.1075
本期加权平均净值利润率	8.05%
本期基金份额净值增长率	7.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	48,004,438.50
期末可供分配基金份额利润	0.3863
期末基金资产净值	182,759,939.33
期末基金份额净值	1.4707
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	47.07%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	6.36%	1.17%	5.47%	0.91%	0.89%	0.26%
过去三个月	19.52%	1.26%	6.50%	0.92%	13.02%	0.34%
过去六个月	7.90%	1.78%	-4.35%	1.27%	12.25%	0.51%
过去一年	21.27%	1.36%	-1.54%	1.00%	22.81%	0.36%
过去三年	36.04%	1.30%	7.29%	0.91%	28.75%	0.39%
自基金合同生效起至今	47.07%	1.19%	16.43%	0.85%	30.64%	0.34%

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

海富通沪港深灵活配置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历史走势对比图
 （2016年11月11日至2020年6月30日）



注：本基金合同于 2016 年 11 月 11 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 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 74 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、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、海富通可转债优选债券型证券投资基金、海富通季季增利理财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、海富通富祥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、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、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、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、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、海富通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、海富通富泽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		
高崢	本基金的基金经理；海富通大中华混合(QDII)基金经理；海富通中国海外混合(QDII)基金经理。	2017-08-28	-	12 年	经济学硕士。持有基金从业人员资格证书。历任德勤华永会计师事务所审计部职员，光大证券股份有限公司行业研究员，中金公司研究部执行总经理、化工行业研究团队负责人。2017 年 3 月加入海富通基金管理有限公司，历任权益投资部基金经理助理。2017 年 8 月起任海富通沪港深混合的基金经理。2018 年 9 月起兼任海富通大中华混合(QDII)、海富通中国海外混合(QDII)的基金经理。
王智慧	本基金的基金经理；海富通精选贰号混合基金经理；海富通精选混合基金经理；副	2016-11-30	-	17 年	管理学博士。持有基金从业人员资格证书。历任国元证券股份有限公司投资银行部高级经理、浙江龙盛集团股份有限公司投资管理部经理、上海申银万国证券研究所首席分析师、中国国际金融股份有限公

	总经理。				司研究部副总经理、华宝基金管理有限公司助理投资总监、基金经理、研究部总经理。2012 年 1 月至 2015 年 11 月任华宝大盘精选混合基金经理，2012 年 2 月至 2015 年 11 月任华宝医药生物混合型基金经理，2013 年 2 月至 2015 年 11 月任华宝兴业多策略股票基金经理。2015 年 11 月加入海富通基金管理有限公司，历任总经理助理，现任副总经理。2016 年 4 月起兼任海富通精选混合和海富通精选贰号混合基金经理。2016 年 11 月起兼任海富通沪港深混合基金经理。
周雪军	本基金的基金经理；海富通改革驱动混合基金经理；海富通收益增长混合基金经理；公募权益投资部总监。	2018-12-14	-	12 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任北京金融街控股股份有限公司职员、天治基金管理有限公司研究员，2012 年 6 月至 2015 年 2 月任天治财富增长混合基金经理，2014 年 1 月至 2015 年 2 月兼任天治趋势精选混合基金经理。2015 年 2 月加入海富通基金管理有限公司，历任公募权益投资部总经理，现任公募权益投资部总监。2015 年 6 月起任海富通收益增长混合基金经理。2016 年 4 月起兼任海富通改革驱动混合基金经理。2018 年 11 月至 2019 年 11 月兼任海富通中小盘混合基金经理。2018 年 12 月起兼任海富通沪港深混合基金经理。

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

2、证券从业年限的计算标准为：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 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

2020 年上半年，全球各大经济体均显著受到新冠疫情的巨大冲击。目前看，中国采取了及时、有力的防控举措，在较短时间内抑制住了疫情发展并在二季度有效地推动复工复产。欧美等发达经济体、印度巴西等发展中国家的疫情防控相对滞后一些，经济运行的恢复时间、速度也比中国慢一些。为了应对疫情的巨大冲击，全球主要经济体的央行资产负债表明显扩张，全球呈现较显著的流动性宽松态势。目前看，整体宽松、低利率的环境还将持续一段时间。

先有疫情剧烈冲击、随后流动性显著宽松，全球资本市场基本呈现出剧烈波动、先大跌后大涨的态势，中国 A 股由于疫情防控得力、经济恢复相对较好而表现更好一些。上半年 A 股主要指数方面，上证指数下跌 2.15%，沪深 300 上涨 1.64%，中证 800 上涨 3.94%，中小板指上涨 20.85%，创业板指上涨 35.60%。分行业看，医药泛消费和科技成长行业领涨，医药、消费者服务、食品饮料、电子元器件、计算机分别上涨 41.54%、26.32%、25.41%、24.22% 和 22.92%；大金融、周期品显著落后，石油石化、煤炭、银行、非银行金融、房地产分别下跌 17.47%、15.53%、13.02%、10.67% 和 8.54%。

从上半年市场内部的结构看，业绩高确定和较高增长的资产获得了市场的追捧。内需类的医药、食品饮料、免税等板块是机构投资者看好和投资的主要方向，代表未来成长方向的新能源车产业链、消费电子、自主可控和半导体、新基建的 IDC 数据中心等也是机构投资者重要的布局领域，金融地

产和部分传统行业短期受经济冲击影响较大，上半年明显跑输其他板块。

回顾上半年港股市场表现，疫情导致市场呈现“过山车”式行情，三重负面因素导致港股市场表现落后全球其它市场。具体而言：1) 1月中旬至1月底，国内新冠疫情的爆发导致市场大幅下挫，但此后在疫情防控政策推动下，市场逐步反弹；2) 2月中旬以来，海外疫情波及面明显更广，而且程度更为严重，引发更多恐慌，导致海外市场大幅下挫。由于风险偏好恶化、尤其是美元流动性紧张，海外中资股市场大幅下挫，跌幅超过A股市场，主要是由于海外中资股市场受全球投资情绪和资金流动影响较大。不过，此后在全球积极的政策应对推动下，流动性开始出现改善，3月底风险偏好逐步回升；3) 从5月份开始，中美争端再次浮出水面，尤其是围绕香港和美国上市中概股方面的中美摩擦导致投资者猝不及防。但其影响较为短暂，在国内外持续复工推动下，风险偏好改善，市场出现反弹。整体来看，恒生指数和恒生国企指数上半年分别下跌13.35%和12.62%。

回顾2020年上半年，本基金仍然维持均衡结构，聚焦纯内需板块，坚定持有估值性价比依然具备吸引力的核心标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期本基金净值增长率为7.90%，同期业绩比较基准收益率为-4.35%，基金净值跑赢业绩比较基准12.25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

展望下半年，虽然疫情可能有一定反复，但总体应该不会改变中国及全球经济逐步恢复的趋势。国内社融短期仍维持宽松，但后续货币条件正常化将纳入监管层考量。本质上，我们相信疫情对国内外经济的冲击是一次外生冲击，未来半年至一年的经济及各行业不断修复、走向正常是相对确定的，节奏、结构则需要自下而上的密切跟踪和把握。

3月下旬国内股市触底后，资本市场短期对于疫情走势、经济与各行业受到的冲击情况尚不清晰，同时国内外流动性较为充裕，因此二季度市场结构聚焦在长期看好、短期经营和业绩风险也不大的医药泛消费、科技成长的优质个股。3月海外疫情爆发，港股市场经历了美元流动性恐慌危机之后，流动性出现逆转，海外流动性充裕叠加国内流动性溢出，科技医药板块估值得到显著提升。展望下半年，随着经济及各行业继续向正常状态修复（2020年上半年又是低基数），与宏观经济正相关的很多行业将迎来企业基本面的逐步好转，因此整体A股市场和港股市场均有不错的投资机会；预计下半年市场风格将相对均衡，大金融、周期品、制造业也开始涌现一些投资机会，而长期看好的医药泛消费、科技成长更需关注行业、个股的景气能否超预期。

4.6 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，组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、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。估值委员会下设估值工作小组，估值工作小组对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，向估值委员会提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金会计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。

4.7 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期末可供分配利润的 10%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2020 年 1 月 17 日至 2020 年 3 月 5 日，已连续二十九个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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

2020 年上半年度，基金托管人在海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2020 年上半年度，海富通基金管理有限公司在海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发

现损害基金持有人利益的行为。

个别工作日，托管人发现个别监督指标不符合基金合同的约定，托管人及时通知了基金管理人，基金管理人根据规定进行了调整。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2020 年上半年度，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,603,926.58	21,255,698.00
结算备付金		8,345,734.52	11,521,675.26
存出保证金		106,896.57	2,367,038.31
交易性金融资产	6.4.7.2	170,136,077.32	151,706,549.25
其中：股票投资		170,136,077.32	151,706,549.25
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		10,350,459.48	-
应收利息	6.4.7.5	1,791.04	2,850.52
应收股利		722,423.24	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		195,267,308.75	186,853,811.34

负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		11,633,505.96	17,500,358.40
应付赎回款		41,112.72	304.97
应付管理人报酬		223,222.33	204,106.86
应付托管费		37,203.71	34,017.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	362,733.05	195,550.54
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	209,591.65	180,000.00
负债合计		12,507,369.42	18,114,338.57
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	124,267,298.85	123,798,527.91
未分配利润	6.4.7.10	58,492,640.48	44,940,944.86
所有者权益合计		182,759,939.33	168,739,472.77
负债和所有者权益总计		195,267,308.75	186,853,811.34

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4707 元，基金份额总额 124,267,298.85 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年6月30日
一、收入		16,415,770.70	23,898,457.45
1.利息收入		72,832.77	104,620.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	72,832.77	104,084.67
债券利息收入		-	536.26
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,327,461.24	10,209,761.04

其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,930,230.07	8,921,618.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	149,684.99
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,397,231.17	1,138,457.19
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,014,336.45	13,584,072.65
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,140.24	2.83
减：二、费用		3,062,519.65	2,064,962.60
1. 管理人报酬		1,238,233.97	1,072,547.70
2. 托管费		206,372.34	178,758.01
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,524,704.65	716,765.82
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	93,208.69	96,891.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,353,251.05	21,833,494.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,353,251.05	21,833,494.85

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	123,798,527.91	44,940,944.86	168,739,472.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,353,251.05	13,353,251.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	468,770.94	198,444.57	667,215.51
其中：1.基金申购款	738,179.60	280,712.27	1,018,891.87
2.基金赎回款	-269,408.66	-82,267.70	-351,676.36

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	124,267,298.85	58,492,640.48	182,759,939.33
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	123,701,089.38	4,479,013.23	128,180,102.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,833,494.85	21,833,494.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,938.42	-466.00	-2,404.42
其中：1.基金申购款	154.26	33.46	187.72
2.基金赎回款	-2,092.68	-499.46	-2,592.14
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	123,699,150.96	26,312,042.08	150,011,193.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]第 1647 号《关于准予海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》组织基金发售。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 230,010,422.60 元，已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2016）第 1389 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 11 日正式

生效，基金合同生效日的基金份额总额为 230,023,025.79 份基金份额，其中认购资金利息折合 12,603.19 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通沪港深灵活配置混合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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债券、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、证券公司发行的短期公司债及其他经中国证监会允许投资的债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、国债期货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（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 0-95%（其中，投资于国内依法发行上市的股票比例为基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票比例为基金资产的 0-95%）；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×40% + 恒生指数收益率×40% + 中债综合财富指数收益率×20%。

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 2020 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的

个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	5,603,926.58
定期存款	-
其他存款	-
合计	5,603,926.58

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	151,645,063.83	170,136,077.32	18,491,013.49
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	151,645,063.83	170,136,077.32	18,491,013.49

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	1,625.62
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	137.79
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	27.63
合计	1,791.04

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	362,733.05
银行间市场应付交易费用	-
合计	362,733.05

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	84.05
应付证券出借违约金	-
预提费用	209,507.60
合计	209,591.65

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	123,798,527.91	123,798,527.91
本期申购	738,179.60	738,179.60
本期赎回（以“-”号填列）	-269,408.66	-269,408.66
本期末	124,267,298.85	124,267,298.85

6.4.7.10 未分配利润

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	37,512,250.23	7,428,694.63	44,940,944.86
本期利润	10,338,914.60	3,014,336.45	13,353,251.05
本期基金份额交易产生的变动数	153,273.67	45,170.90	198,444.57
其中：基金申购款	231,804.73	48,907.54	280,712.27
基金赎回款	-78,531.06	-3,736.64	-82,267.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,004,438.50	10,488,201.98	58,492,640.48

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	46,757.96
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	24,461.29
其他	1,613.52
合计	72,832.77

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	458,911,519.25
减：卖出股票成本总额	446,981,289.18
买卖股票差价收入	11,930,230.07

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,397,231.17
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	1,397,231.17

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
------	----------------------------

1.交易性金融资产	3,014,336.45
——股票投资	3,014,336.45
——债券投资	-
——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	3,014,336.45

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	1,140.24
合计	1,140.24

注：本基金赎回费收入归入基金财产部分具体见本基金基金合同、招募说明书（更新）等法律文件规定。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	1,524,704.65
银行间市场交易费用	-
合计	1,524,704.65

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	765.00

港股通证券组合费	2,936.09
合计	93,208.69

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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	451,686,114.30	49.08%	57,545,882.10	13.14%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30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	373,082.89	46.33%	226,565.94	62.46%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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	50,857.56	13.30%	4,727.41	3.26%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,238,233.97	1,072,547.70
其中：支付销售机构的客户维护费	2,821.55	140.15

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 1.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	206,372.34	178,758.01

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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:

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 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

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	5,603,926.58	46,757.96	23,200,924.65	94,544.47

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未实施利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股未上市	36.18	36.18	2,075	75,073.50	75,073.50	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新股未上市	11.33	11.33	6,200	70,246.00	70,246.00	-
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	16.21	16.21	6,612	107,180.52	107,180.52	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。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。本基金在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供长期稳定的投资回报。

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。

6.4.13.2 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在本基金的托管行交通银行，因而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 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有债券和资产支持证券(2019 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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 6.4.12。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%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.15%。

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。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2020年6月30日					
资产					
银行存款	5,603,926.58	-	-	-	5,603,926.58
结算备付金	8,345,734.52	-	-	-	8,345,734.52
存出保证金	106,896.57	-	-	-	106,896.57
交易性金融资产	-	-	-	170,136,077.32	170,136,077.32
应收证券清算款	-	-	-	10,350,459.48	10,350,459.48
应收股利	-	-	-	722,423.24	722,423.24
应收利息	-	-	-	1,791.04	1,791.04
资产总计	14,056,557.67	0.00	0.00	181,210,751.08	195,267,308.75
负债					
应付证券清算款	-	-	-	11,633,505.96	11,633,505.96
应付赎回款	-	-	-	41,112.72	41,112.72
应付管理人报酬	-	-	-	223,222.33	223,222.33
应付托管费	-	-	-	37,203.71	37,203.71
应付交易费用	-	-	-	362,733.05	362,733.05
其他负债	-	-	-	209,591.65	209,591.65
负债总计	-	-	-	12,507,369.42	12,507,369.42
利率敏感度缺口	14,056,557.67	0.00	0.00	168,703,381.66	182,759,939.33
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,255,698.00	-	-	-	21,255,698.00
结算备付金	11,521,675.26	-	-	-	11,521,675.26
存出保证金	2,367,038.31	-	-	-	2,367,038.31
交易性金融资产	-	-	-	151,706,549.25	151,706,549.25
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,850.52	2,850.52
应收股利	-	-	-	-	-
资产总计	35,144,411.57	-	-	151,709,399.77	186,853,811.34

					4
负债					
应付证券清算款	-	-	-	17,500,358.40	17,500,358.40
应付赎回款	-	-	-	304.97	304.97
应付管理人报酬	-	-	-	204,106.86	204,106.86
应付托管费	-	-	-	34,017.80	34,017.80
应付交易费用	-	-	-	195,550.54	195,550.54
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	18,114,338.57	18,114,338.57
利率敏感度缺口	35,144,411.57	-	-	133,595,061.20	168,739,472.77

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2019 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	77,964,617.78	77,964,617.78
应收股利	-	722,423.24	722,423.24

应收证券清算款	-	8,161,946.29	8,161,946.29
资产合计	-	86,848,987.31	86,848,987.31
以外币计价的负债			
应付证券清算款	-	8,837,178.44	8,837,178.44
负债合计	-	8,837,178.44	8,837,178.44
资产负债表外汇风险敞口净额	-	78,011,808.87	78,011,808.87
项目	上年度末		
	2019年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	101,887,978.96	101,887,978.96
应收股利	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-
资产合计	-	101,887,978.96	101,887,978.96
以外币计价的负债			
应付证券清算款	-	17,311,177.98	17,311,177.98
负债合计	-	17,311,177.98	17,311,177.98
资产负债表外汇风险敞口净额	-	84,576,800.98	84,576,800.98

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变
----	------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2020 年 6 月 30 日	2019 年 12 月 31 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	3,900,590.44	4,228,840.05
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-3,900,590.44	-4,228,840.05

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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，采用“自上而下”与“自下而上”相结合的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；同时通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	170,136,077.32	93.09	151,706,549.2	89.91

			5	
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	170,136,077.32	93.09	151,706,549.2 5	89.91

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	8,513,123.29	2,635,648.77
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-8,513,123.29	-2,635,648.77

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	170,136,077.32	87.13
	其中: 股票	170,136,077.32	87.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	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	13,949,661.10	7.14
8	其他各项资产	11,181,570.33	5.73
9	合计	195,267,308.75	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	-	-
C	制造业	61,656,941.73	33.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,382,925.49	7.32
J	金融业	5,369,280.00	2.94
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	6,477,996.00	3.54
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	5,271,550.00	2.88
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	92,171,459.54	50.43

7.2.2 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（%）
房地产	12,984,942.38	7.10
非日常生活消费品	23,308,376.36	12.75
工业	13,519,450.93	7.40
金融	7,537,067.47	4.12
日常消费品	7,659,468.43	4.19
信息技术	5,669,590.54	3.10
原材料	7,285,721.67	3.99
合计	77,964,617.78	42.66

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.3 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	03690	美团点评-W	86,100	13,519,450.93	7.40
2	00700	腾讯控股	24,900	11,340,485.48	6.21
3	600585	海螺水泥	198,700	10,513,217.00	5.75
4	03323	中国建材	1,116,000	8,410,042.08	4.60
5	01918	融创中国	283,000	8,388,439.22	4.59
6	000651	格力电器	138,600	7,840,602.00	4.29
7	06110	滔搏	847,000	7,659,468.43	4.19
8	00817	中国金茂	1,514,000	7,537,067.47	4.12
9	600031	三一重工	389,200	7,301,392.00	4.00
10	01896	猫眼娱乐	674,800	7,285,721.67	3.99
11	300525	博思软件	178,020	6,545,795.40	3.58
12	600570	恒生电子	60,200	6,483,540.00	3.55
13	603259	药明康德	67,060	6,477,996.00	3.54
14	603538	美诺华	125,800	6,413,284.00	3.51
15	01810	小米集团-W	483,400	5,669,590.54	3.10
16	600521	华海药业	158,380	5,373,833.40	2.94
17	601318	中国平安	75,200	5,369,280.00	2.94
18	603882	金域医学	58,900	5,271,550.00	2.88
19	300832	新产业	27,400	4,718,006.00	2.58
20	000568	泸州老窖	51,600	4,701,792.00	2.57
21	00772	阅文集团	96,400	4,596,503.16	2.52
22	002332	仙琚制药	259,368	4,367,757.12	2.39
23	688298	东方生物	25,916	3,972,922.80	2.17
24	603787	新日股份	202,800	3,948,516.00	2.16

25	02669	中海物业	475,000	3,557,848.80	1.95
26	600176	中国巨石	184,500	1,688,175.00	0.92
27	688520	神州细胞	3,842	290,147.84	0.16
28	688518	联赢激光	10,442	288,512.46	0.16
29	688555	泽达易盛	3,004	234,312.00	0.13
30	688568	中科星图	6,612	107,180.52	0.06
31	688027	国盾量子	2,075	75,073.50	0.04
32	688528	秦川物联	6,200	70,246.00	0.04
33	603087	甘李药业	602	60,380.60	0.03
34	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
35	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
36	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
37	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
38	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
39	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	00700	腾讯控股	20,238,398.50	11.99
2	02669	中海物业	14,824,472.67	8.79
3	600741	华域汽车	14,319,951.17	8.49
4	300525	博思软件	13,903,177.75	8.24
5	600887	伊利股份	12,654,773.00	7.50
6	601688	华泰证券	12,491,992.69	7.40
7	600585	海螺水泥	10,370,249.11	6.15
8	600547	山东黄金	9,831,354.60	5.83
9	601318	中国平安	8,427,757.00	4.99
10	00939	建设银行	8,211,838.39	4.87
11	06110	滔搏	7,941,023.84	4.71
12	002332	仙琚制药	7,918,431.74	4.69
13	01896	猫眼娱乐	7,344,301.56	4.35
14	603538	美诺华	6,890,161.00	4.08
15	01797	新东方在线	6,751,400.30	4.00
16	02269	药明生物	6,687,816.22	3.96
17	01347	华虹半导体	6,620,886.84	3.92
18	600570	恒生电子	6,380,249.40	3.78
19	000786	北新建材	6,249,384.06	3.70
20	02382	舜宇光学科技	5,889,138.25	3.49

21	00384	中国燃气	5,800,547.84	3.44
22	01810	小米集团-W	5,739,747.99	3.40
23	002635	安洁科技	5,639,325.00	3.34
24	002353	杰瑞股份	5,465,236.07	3.24
25	603018	中设集团	5,064,180.64	3.00
26	00772	阅文集团	5,041,920.81	2.99
27	603882	金域医学	4,991,192.00	2.96
28	300059	东方财富	4,932,818.76	2.92
29	01789	爱康医疗	4,716,741.49	2.80
30	603259	药明康德	4,701,444.00	2.79
31	603713	密尔克卫	4,573,941.00	2.71
32	600521	华海药业	4,564,594.00	2.71
33	300832	新产业	4,518,777.00	2.68
34	02899	紫金矿业	4,509,680.63	2.67
35	06186	中国飞鹤	4,410,847.53	2.61
36	000977	浪潮信息	4,246,793.20	2.52
37	603019	中科曙光	4,142,286.00	2.45
38	002415	海康威视	4,136,240.00	2.45
39	600060	海信视像	4,129,651.04	2.45
40	00763	中兴通讯	4,000,181.26	2.37
41	603787	新日股份	3,953,090.00	2.34
42	688298	东方生物	3,891,490.54	2.31
43	300702	天宇股份	3,886,957.34	2.30
44	600183	生益科技	3,859,137.40	2.29
45	00291	华润啤酒	3,819,278.82	2.26
46	000002	万科A	3,693,604.00	2.19
47	688016	心脉医疗	3,625,703.93	2.15
48	603108	润达医疗	3,595,020.00	2.13
49	603881	数据港	3,490,291.16	2.07
50	000877	天山股份	3,452,244.00	2.05
51	600486	扬农化工	3,429,981.00	2.03
52	02400	心动公司	3,391,319.90	2.01

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	600887	伊利股份	17,183,869.95	10.18
2	00939	建设银行	16,572,506.55	9.82
3	600741	华域汽车	14,559,989.93	8.63

4	02669	中海物业	13,874,858.48	8.22
5	601688	华泰证券	11,960,454.00	7.09
6	00700	腾讯控股	10,781,201.03	6.39
7	02338	潍柴动力	10,659,802.15	6.32
8	600547	山东黄金	10,399,714.70	6.16
9	01797	新东方在线	10,081,824.38	5.97
10	300525	博思软件	9,722,210.97	5.76
11	00921	海信家电	7,608,544.75	4.51
12	601058	赛轮轮胎	7,438,089.00	4.41
13	00763	中兴通讯	6,977,417.51	4.14
14	002078	太阳纸业	6,888,244.00	4.08
15	00384	中国燃气	6,442,019.02	3.82
16	02319	蒙牛乳业	6,416,534.97	3.80
17	000786	北新建材	6,322,802.23	3.75
18	03808	中国重汽	6,319,773.38	3.75
19	002332	仙琚制药	6,259,838.13	3.71
20	02269	药明生物	6,188,814.59	3.67
21	603713	密尔克卫	6,145,799.00	3.64
22	300059	东方财富	5,946,537.00	3.52
23	300037	新宙邦	5,895,263.44	3.49
24	02313	申洲国际	5,872,261.63	3.48
25	603018	中设集团	5,685,425.00	3.37
26	02382	舜宇光学科技	5,610,879.50	3.33
27	01347	华虹半导体	5,526,735.90	3.28
28	688016	心脉医疗	5,501,301.24	3.26
29	00175	吉利汽车	5,479,509.80	3.25
30	06186	中国飞鹤	5,140,491.68	3.05
31	002635	安洁科技	5,061,087.75	3.00
32	002050	三花智控	5,000,521.97	2.96
33	00753	中国国航	4,861,434.12	2.88
34	01789	爱康医疗	4,852,547.28	2.88
35	300702	天宇股份	4,711,213.00	2.79
36	600060	海信视像	4,449,279.48	2.64
37	00291	华润啤酒	4,268,176.48	2.53
38	00902	华能国际电力股份	4,161,852.00	2.47
39	002415	海康威视	4,099,616.00	2.43
40	02899	紫金矿业	4,098,297.65	2.43
41	002968	新大正	4,061,050.50	2.41
42	000877	天山股份	3,932,330.00	2.33
43	002353	杰瑞股份	3,805,405.55	2.26
44	02400	心动公司	3,793,543.06	2.25
45	000977	浪潮信息	3,732,582.92	2.21
46	600055	万东医疗	3,695,290.00	2.19
47	600183	生益科技	3,607,492.50	2.14

48	603019	中科曙光	3,602,376.00	2.13
49	600486	扬农化工	3,518,584.99	2.09
50	02359	药明康德	3,451,530.12	2.05

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	462,396,480.80
卖出股票的收入（成交）总额	458,911,519.25

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资用于套期保值。在预期市场上涨时，可以通过买入股指期货作为股票替代，增加股票仓位，同时提高资金的利用效率；在预期市场下跌时，可以通过卖出股指期货对冲股市整体下跌的系统性风险，对投资组合的价值进行保护。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金的国债期货投资以风险管理为原则，以套期保值为目的。管理人按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

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

7.12.3 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	106,896.57
2	应收证券清算款	10,350,459.48
3	应收股利	722,423.24
4	应收利息	1,791.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,181,570.33

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
201	618,245.27	123,666,679.99	99.52%	600,618.86	0.48%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	836.78	0.0007%

8.3 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年11月11日）基金份额总额	230,023,025.79
本报告期期初基金份额总额	123,798,527.91
本报告期基金总申购份额	738,179.60
减：本报告期基金总赎回份额	269,408.66
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	124,267,298.85

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

1、2020年5月26日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第三次会议审议通过，陶网雄先生由公司副总经理转任首席信息官。

2、2020年6月24日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第三次会议审议通过，聘请王智慧先生担任公司副总经理职务。

3、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	451,686,114.30	49.08%	373,082.89	46.33%	-
光大证券	1	188,462,922.93	20.48%	171,746.35	21.33%	-
兴业证券	2	157,421,981.60	17.11%	146,607.33	18.21%	-
申万宏源（原申万）	2	104,862,707.81	11.39%	97,659.61	12.13%	-
长江证券	1	10,334,198.56	1.12%	9,624.38	1.20%	-
国元证券	2	5,000,521.97	0.54%	4,557.01	0.57%	-
中金公司	1	2,539,947.92	0.28%	2,031.83	0.25%	-

国金证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内租用券商交易单元未发生变更。

2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分,进行主观性评议,独立的评分,形成证券公司排名及交易单元租用意见。

(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,经投资部部门会议讨论,形成重点评估的证券公司备选池,从中进行甄选。原则上,备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定,进行主观性评议,独立的评分,形成证券公司排名及交易单元租用意见,并报公司总经理办公会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后,由基金管理人的总经理办公会核准。

10.7.2 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	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源（原申万）	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金 2020 年因境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的提示	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-02
2	海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-20
3	海富通基金管理有限公司调整旗下基金 2020 年春节假期期间交易确认、清算交收、开放日期、基金分红等相关事项的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-31
4	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台通联支付渠道新增部分银行卡并开展申购费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-02
5	海富通基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-27
6	海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-31
7	海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-07
8	海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-24
9	海富通基金管理有限公司关于海富通沪港深灵活配置混合型证券投资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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-25

	费率优惠活动的公告		
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-22
11	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
12	海富通基金管理有限公司关于延迟和耕传承基金销售有限公司代销旗下基金的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
13	海富通基金管理有限公司关于变更直销中心交易传真号码的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-06
14	海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-19
15	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-24
16	海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-29
17	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	2020/1/1-2020/6/30	48,532,350.87	-	-	48,532,350.87	39.05%
	2	2020/1/1-2020/6/30	35,003,500.00	-	-	35,003,500.00	28.17%
	3	2020/1/1-2020/6/30	40,130,829.12	-	-	40,130,829.12	32.29%
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的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。

11.2 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 83 只公募基金。截至 2020 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1338 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，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金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，海富通基金管理有限公司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。

2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·成长基金管理公司奖。2020 年 3 月，由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金牛进取奖”，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖项。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准设立海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金的文件
- (二) 海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (三) 海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通沪港深灵活配置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) 报告期内海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36—37 层本基金管理人办公地址。

12.3 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

二〇二〇年八月三十一日