

海富通欣荣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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§9 开放式基金份额变动	53
§10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	海富通欣荣混合	
基金主代码	519223	
交易代码	519223	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2016年9月22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	245,330,937.68 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
下属分级基金的交易代码	519224	519223
报告期末下属分级基金的份额总额	175,749,375.29 份	69,581,562.39 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金坚持灵活的资产配置，在严格控制下跌风险的基础上，积极把握证券市场的投资机会，追求资产的保值增值。
投资策略	本基金的资产配置策略以基金的投资目标为中心，首先按照投资时钟理论，根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段，作出权益类资产的初步配置，并根据投资时钟判断大致的行业配置；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，从而做出权益类资产的具体仓位选择。债券投资采取“自上而下”的策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，在市场创新和变化中寻找投资机会，采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略和套利等积极投资管理方式，确定和构造合理的债券组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%
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。

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	姓名	岳冲	陆志俊
	联系电话	021-38650788	95559

负责人	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桥路66号东亚银行金融大厦 36-37层	中国（上海）自由贸易试验区 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	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.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）	
	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
本期已实现收益	7,852,991.89	3,940,512.87
本期利润	25,780,325.05	8,748,077.35
加权平均基金份额本期利润	0.1575	0.1088
本期加权平均净值利润率	12.01%	8.29%
本期基金份额净值增长率	11.77%	11.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
期末可供分配利润	29,692,657.72	11,849,151.27
期末可供分配基金份额利润	0.1689	0.1703

期末基金资产净值	255,749,136.14	101,349,068.27
期末基金份额净值	1.4552	1.4566
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
基金份额累计净值增长率	45.52%	45.66%

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

海富通欣荣混合 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
过去一个月	10.41%	0.80%	3.40%	0.45%	7.01%	0.35%
过去三个月	18.74%	0.89%	6.19%	0.46%	12.55%	0.43%
过去六个月	11.77%	1.48%	2.29%	0.74%	9.48%	0.74%
过去一年	31.55%	1.18%	7.40%	0.60%	24.15%	0.58%
过去三年	44.48%	1.11%	16.61%	0.62%	27.87%	0.49%
自基金合同生效起至今	45.52%	0.99%	21.67%	0.57%	23.85%	0.42%

海富通欣荣混合 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
过去一个月	10.39%	0.80%	3.40%	0.45%	6.99%	0.35%
过去三个月	18.68%	0.89%	6.19%	0.46%	12.49%	0.43%
过去六个月	11.66%	1.48%	2.29%	0.74%	9.37%	0.74%
过去一年	31.38%	1.18%	7.40%	0.60%	23.98%	0.58%
过去三年	44.76%	1.11%	16.61%	0.62%	28.15%	0.49%
自基金合同生效起至今	45.66%	0.99%	21.67%	0.57%	23.99%	0.42%

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

海富通欣荣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 9 月 22 日至 2020 年 6 月 30 日)

海富通欣荣混合 A



海富通欣荣混合 C



注：本基金合同于 2016 年 9 月 22 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		
杜晓海	本基金的基金经理；海富通阿尔法对冲混合基金经理；海富通安颐收益混合基金经理；海富通创业板增强基金经理；海富通量化先锋股票基金经理；海富通稳固收益债券基金经理；海富通欣享混合基金经理；海富通新内需混合基金经理；海富通研究精选混合基金经理；海	2016-09-28	-	20 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通基金管理有限公司量化投资部总监。2016 年 6 月起任海富通新内需混合和海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）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 月兼任海富通沪深 300 增强（原海富通富睿混合）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

	富通安益对冲混合基金经理；海富通中证 500 增强基金经理；海富通添鑫收益债券基金经理；海富通富盈混合基金经理；海富通富泽混合基金经理；量化投资部总监。				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、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 月起兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月起兼任海富通中证 500 增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月起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。
谈云飞	本基金的基金经理；海富通货币基金经理；海富通季季通理财债券基金经理；海富通季季增利基金经理；海富通聚利债券基金经理；海富通强化回报混合基金经理；海富通稳健添利债券基金经理；海富通欣享混合基金经理；海富通中短债债券基金经理。	2016-09-22	2020-01-02	14 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 4 月至 2014 年 6 月就职于华宝兴业基金管理有限公司，曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2014 年 7 月至 2015 年 10 月任海富通现金管理货币基金经理。2014 年 9 月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2015 年 1 月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015 年 4 月至 2020 年 1 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 2 月起兼任海富通货币基金经理。2016 年 4 月至 2017 年 6 月兼任海富通纯债债券、海富通双福债券(原海富通双福分级债券)、海富通双利债券基金经理。2016 年 4 月至 2020 年 1 月兼任海富通安颐收益混合(原海富通养老收益混合)基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通聚利债券基金经理。2016 年 9 月至 2020 年 1 月兼任海富通欣荣混合基金经理。2016 年 9 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合基金经理。2017 年 2 月起兼

					任海富通强化回报混合基金经理。2017 年 3 月起兼任海富通欣享混合基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 7 月起兼任海富通季季通利理财债券基金经理。2019 年 9 月起兼任海富通中短债债券基金经理。
--	--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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、

得力的防控举措，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。

本报告期，基金积极投资股票市场，力争在风险可控的基础上，跑赢市场。同时，本基金积极参与新股申购，以增强投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通欣荣混合 A 净值增长率为 11.77%，同期业绩比较基准收益率为 2.29%，基金净值跑赢业绩比较基准 9.48 个百分点。海富通欣荣混合 C 净值增长率为 11.66%，同期业绩比较基准收益率为 2.29%，基金净值跑赢业绩比较基准 9.37 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。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，因此整体市场仍有不错的投资机会；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。

本基金的投资思路将在控制风险的基础上，积极地捕捉市场的结构性机会，力争跑赢市场。同时，基金依然会积极参与新股申购，努力增厚收益。本基金也将利用动态的仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。

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该次可供分配利润的 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

2020 年上半年度，基金托管人在海富通欣荣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合规守信、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欣荣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。

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欣荣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：海富通欣荣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	12,503,296.53	7,119,211.75
结算备付金		4,099,981.53	11,905,329.41
存出保证金		1,114,233.96	76,623.18
交易性金融资产	6.4.7.2	334,610,964.67	317,255,447.79
其中：股票投资		319,621,017.49	301,639,971.39
基金投资		-	-
债券投资		14,989,947.18	15,615,476.40
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		1,026,268.72	-
应收利息	6.4.7.5	293,094.40	331,523.12

应收股利		-	-
应收申购款		5,012,017.60	2,580.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		358,659,857.41	336,690,715.25
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		999,142.69	3,648,363.65
应付赎回款		172,668.86	6,537.37
应付管理人报酬		162,808.56	168,044.94
应付托管费		40,702.12	42,011.26
应付销售服务费		15,893.51	21,051.36
应付交易费用	6.4.7.7	80,927.99	130,333.69
应交税费		1.53	10,771.78
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,507.74	180,000.00
负债合计		1,561,653.00	4,207,114.05
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	245,330,937.68	255,189,981.37
未分配利润	6.4.7.10	111,767,266.73	77,293,619.83
所有者权益合计		357,098,204.41	332,483,601.20
负债和所有者权益总计		358,659,857.41	336,690,715.25

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 245,330,937.68 份，其中海富通欣荣混合基金 A 类份额 175,749,375.29 份，海富通欣荣混合基金 C 类份额 69,581,562.39 份。A 类份额净值 1.4552 元，C 类份额净值 1.4566 元。

6.2 利润表

会计主体：海富通欣荣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		36,348,063.99	28,455,405.72

1.利息收入		243,902.13	137,875.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	78,488.47	44,630.51
债券利息收入		152,439.68	90,793.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		12,973.98	2,451.51
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,369,040.51	6,063,405.51
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,212,950.96	4,028,738.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	129,102.37	145,483.42
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	-	165,370.54
股利收益	6.4.7.16	3,026,987.18	1,723,813.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	22,734,897.64	22,253,920.85
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	223.71	203.61
减：二、费用		1,819,661.59	785,898.52
1. 管理人报酬		956,629.98	373,445.57
2. 托管费		239,157.43	93,361.36
3. 销售服务费		105,227.02	61.61
4. 交易费用	6.4.7.19	407,667.53	208,773.99
5. 利息支出		-	395.74
其中：卖出回购金融资产支出		-	395.74
6.税金及附加		1.57	698.25
7. 其他费用	6.4.7.20	110,978.06	109,162.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,528,402.40	27,669,507.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,528,402.40	27,669,507.20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通欣荣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）	255,189,981.37	77,293,619.83	332,483,601.20

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,528,402.40	34,528,402.40
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）	-9,859,043.69	-54,755.50	-9,913,799.19
其中：1.基金申购款	60,460,227.95	19,367,998.97	79,828,226.92
2.基金赎回款	-70,319,271.64	-19,422,754.47	-89,742,026.11
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）	245,330,937.68	111,767,266.73	357,098,204.41
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）	122,021,251.98	-14,708,426.54	107,312,825.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,669,507.20	27,669,507.20
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）	936,253.30	102,131.00	1,038,384.30
其中：1.基金申购款	1,024,144.90	108,229.17	1,132,374.07
2.基金赎回款	-87,891.60	-6,098.17	-93,989.77
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）	122,957,505.28	13,063,211.66	136,020,716.94

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

海富通欣荣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 1480 号《关于准予海富通欣荣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《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 450,020,570.20 元,业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 1193 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 450,135,331.01 份,其中认购资金利息折合 114,760.81 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《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象是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)、权证、股指期货等权益类品种,债券等固定收益类品种(包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等),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的相关规定。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。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times 50\%$ +中证全债指数收益率 $\times 50\%$ 。

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》、《海富通欣荣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[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:

(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。

(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。

(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	12,503,296.53
定期存款	-
其他存款	-
合计	12,503,296.53

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	262,076,903.82	319,621,017.49	57,544,113.67
贵金属投资-金交所黄	-	-	-

金合约				
债券	交易所市场	15,035,883.10	14,989,947.18	-45,935.92
	银行间市场	-	-	-
	合计	15,035,883.10	14,989,947.18	-45,935.92
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	277,112,786.92	334,610,964.67	57,498,177.75	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	8,438,600.00	-	-	-
——股指期货	8,438,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,438,600.00	-	-	-

注：于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货情况：持有买入 IC2012 合约市值 8,794,560.00 元，公允价值变动 355,960.00 元。

衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0 元。

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	2,830.12
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	1,822.91
应收债券利息	288,317.54
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	99.98
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	23.85
合计	293,094.40

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	80,927.99
银行间市场应付交易费用	-
合计	80,927.99

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	0.14
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,507.60
合计	89,507.74

6.4.7.9 实收基金

海富通欣荣混合 A

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	账面金额
上年度末	162,856,338.52	162,856,338.52
本期申购	12,988,387.05	12,988,387.05
本期赎回（以“-”号填列）	-95,350.28	-95,350.28
本期末	175,749,375.29	175,749,375.29

海富通欣荣混合 C

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	账面金额
上年度末	92,333,642.85	92,333,642.85
本期申购	47,471,840.90	47,471,840.90
本期赎回（以“-”号填列）	-70,223,921.36	-70,223,921.36
本期末	69,581,562.39	69,581,562.39

6.4.7.10 未分配利润

海富通欣荣混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,739,504.55	29,439,368.74	49,178,873.29
本期利润	7,852,991.89	17,927,333.16	25,780,325.05
本期基金份额交易产生的变动数	2,100,161.28	2,940,401.23	5,040,562.51
其中：基金申购款	2,114,012.43	2,957,115.52	5,071,127.95
基金赎回款	-13,851.15	-16,714.29	-30,565.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,692,657.72	50,307,103.13	79,999,760.85

海富通欣荣混合 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	11,430,244.82	16,684,501.72	28,114,746.54
本期利润	3,940,512.87	4,807,564.48	8,748,077.35
本期基金份额交易产生的变动数	-3,521,606.42	-1,573,711.59	-5,095,318.01
其中：基金申购款	6,408,673.27	7,888,197.75	14,296,871.02

基金赎回款	-9,930,279.69	-9,461,909.34	-19,392,189.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,849,151.27	19,918,354.61	31,767,505.88

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	56,194.99	
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	20,110.47	
其他	2,183.01	
合计	78,488.47	

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	142,760,513.76	
减：卖出股票成本总额	132,547,562.80	
买卖股票差价收入	10,212,950.96	

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年6月30日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	22,314,276.74	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	21,675,140.78	
减：应收利息总额	510,033.59	
买卖债券差价收入	129,102.37	

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	3,026,987.18
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	3,026,987.18

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	22,378,937.64
——股票投资	22,459,635.58
——债券投资	-80,697.94
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	355,960.00
——权证投资	-
——股指期货	355,960.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	22,734,897.64

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	223.71
合计	223.71

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	407,465.94
银行间市场交易费用	-
股指期货交易费用	201.59
合计	407,667.53

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	-
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00
银行划款手续费	2,870.46
合计	110,978.06

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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	10,711,255.32	4.07%	13,823,973.70	9.68%

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 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	占期末应付佣金总量的 比例
海通证券	9,761.04	4.65%	9,761.04	12.06%
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	占期末应付佣金总量的 比例
海通证券	12,265.16	9.88%	-	-

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	956,629.98	373,445.57
其中：支付销售机构的客户维护费	1,236.09	204.61

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 0.6% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.6\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	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
当期发生的基金应支付的托管费	239,157.43	93,361.36

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 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 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		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C	合计
交通银行	-	-	-
海通证券	-	-	-
海富通基金	-	104,745.33	104,745.33
合计	-	104,745.33	104,745.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C	合计
交通银行	-	-	-
海通证券	-	-	-
海富通基金	-	9.92	9.92
合计	-	9.92	9.92

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金份额对应的资产净值 X 0.2% / 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	12,503,296.53	56,194.99	4,219,172.80	15,447.84

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
海通证券	300847	中船汉光	网下发行	1,421	9,861.74

上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
海通证券	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期内未实施利润分配。

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
002555	三七互娱	2020-05-12	2020-11-12	大宗交易	33.57	43.56	60,000	2,014,200.00	2,613,600.00	-
002602	世纪华通	2020-06-15	2020-12-15	大宗交易	13.02	14.10	160,000	2,083,200.00	2,256,000.00	-
300607	拓斯达	2020-06-23	2020-12-23	大宗交易	34.67	37.26	59,400	2,059,200.00	2,213,244.00	-
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	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-

688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688051	佳华科技	2020-03-12	2020-09-21	新股锁定流通受限	50.81	120.27	3,358	170,619.98	403,866.66	-
688080	映翰通	2020-02-03	2020-08-12	新股锁定流通受限	27.63	86.78	2,233	61,697.79	193,779.74	-
688298	东方生物	2020-01-20	2020-08-05	新股锁定流通受限	21.25	144.17	5,286	112,327.50	762,082.62	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688398	赛特新材	2020-02-03	2020-08-11	新股锁定流通受限	24.12	54.47	3,246	78,293.52	176,809.62	-
688466	金科环境	2020-04-27	2020-11-09	新股锁定流通受限	24.61	36.59	4,907	120,761.27	179,547.13	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123055	晨光转债	2020-06-17	2020-07-13	老股东配债	100.00	100.00	580	58,000.00	58,000.00	-
128112	歌尔转2	2020-06-12	2020-07-13	老股东配债	100.00	100.00	860	86,000.00	86,000.00	-
128115	巨星转债	2020-06-24	2020-07-16	老股东配	100.00	100.00	440	44,000.00	44,000.00	-

				债						
--	--	--	--	---	--	--	--	--	--	--

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

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

本基金是一只混合型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

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，本基金持有的除国债、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 0.08%(2019 年 12 月 31 日：0.13%)。

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。

6.4.13.2.1 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 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
A-1	-	-

A-1 以下	-	-
未评级	8,490,243.00	14,167,495.40
合计	8,490,243.00	14,167,495.40

注：未评级部分为国债。

6.4.13.2.2 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 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	297,414.68	440,481.00
未评级	6,202,289.50	1,007,500.00
合计	6,499,704.18	1,447,981.00

注：未评级部分为政策性金融债。

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 2.62%。

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、存出保证金、债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,503,296.53	-	-	-	12,503,296.53
结算备付金	4,099,981.53	-	-	-	4,099,981.53
存出保证金	1,114,233.96	-	-	-	1,114,233.96
交易性金融资产	14,692,532.50	-	297,414.68	319,621,017.49	334,610,964.67
应收证券清算款	-	-	-	1,026,268.72	1,026,268.72
应收利息	-	-	-	293,094.40	293,094.40
应收申购款	-	-	-	5,012,017.60	5,012,017.60
资产总计	32,410,044.52	-	297,414.68	325,952,398.21	358,659,857.41
负债					
应付证券清算款	-	-	-	999,142.69	999,142.69
应付赎回款	-	-	-	172,668.86	172,668.86
应付管理人报酬	-	-	-	162,808.56	162,808.56
应付托管费	-	-	-	40,702.12	40,702.12
应付销售服务费	-	-	-	15,893.51	15,893.51
应付交易费用	-	-	-	80,927.99	80,927.99
应交税费	-	-	-	1.53	1.53
其他负债	-	-	-	89,507.74	89,507.74
负债总计	-	-	-	1,561,653.00	1,561,653.00
利率敏感度缺口	32,410,044.52	-	297,414.68	324,390,745.21	357,098,204.41
上年度末 2019年12月31	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	7,119,211.75	-	-	-	7,119,211.75
结算备付金	11,905,329.41	-	-	-	11,905,329.41
存出保证金	76,623.18	-	-	-	76,623.18
交易性金融资产	15,174,995.40	137,241.00	303,240.00	301,639,971.39	317,255,447.79
应收利息	-	-	-	331,523.12	331,523.12
应收申购款	-	-	-	2,580.00	2,580.00
资产总计	34,276,159.74	137,241.00	303,240.00	301,974,074.51	336,690,715.25
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,648,363.65	3,648,363.65
应付赎回款	-	-	-	6,537.37	6,537.37
应付管理人报酬	-	-	-	168,044.94	168,044.94
应付托管费	-	-	-	42,011.26	42,011.26
应付销售服务费	-	-	-	21,051.36	21,051.36
应付交易费用	-	-	-	130,333.69	130,333.69
应交税费	-	-	-	10,771.78	10,771.78
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	4,207,114.05	4,207,114.05
利率敏感度缺口	34,276,159.74	137,241.00	303,240.00	297,766,960.46	332,483,601.20

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

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
		市场利率上升 25 个基点	-115,574.23
市场利率下降 25 个基点	115,692.73	8,355.73	

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

的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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，采用“自上而下”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；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市场价格风险。

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投资比例为基金总资产的 0%-95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	319,621,017. 49	89.51	301,639,971.3 9	90.72
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	319,621,017.	89.51	301,639,971.3	90.72

	49		9	
--	----	--	---	--

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
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	17,408,329.00	15,355,694.26
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-17,408,329.00	-15,355,694.26

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	319,621,017.49	89.12
	其中:股票	319,621,017.49	89.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,989,947.18	4.18
	其中:债券	14,989,947.18	4.18
	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	16,603,278.06	4.63
8	其他各项资产	7,445,614.68	2.08

9	合计	358,659,857.41	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	1,606,084.00	0.45
B	采矿业	2,564,779.00	0.72
C	制造业	194,805,652.09	54.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,129,186.32	0.60
E	建筑业	946,004.00	0.26
F	批发和零售业	6,912,655.00	1.94
G	交通运输、仓储和邮政业	2,490,239.00	0.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,718,018.23	6.92
J	金融业	62,143,782.88	17.40
K	房地产业	11,434,745.24	3.20
L	租赁和商务服务业	3,460,979.40	0.97
M	科学研究和技术服务业	3,005,180.20	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	623,711.13	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,099,781.00	0.59
R	文化、体育和娱乐业	680,220.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	319,621,017.49	89.51

7.2.2 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。

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	600519	贵州茅台	12,000	17,554,560.00	4.92
2	600036	招商银行	482,800	16,280,016.00	4.56
3	601318	中国平安	189,600	13,537,440.00	3.79
4	002475	立讯精密	213,091	10,942,222.85	3.06
5	000858	五粮液	42,100	7,204,152.00	2.02
6	600030	中信证券	293,900	7,085,929.00	1.98
7	300760	迈瑞医疗	22,800	6,969,960.00	1.95
8	000333	美的集团	111,864	6,688,348.56	1.87
9	600031	三一重工	339,500	6,369,020.00	1.78
10	000661	长春高新	13,400	5,833,020.00	1.63
11	600585	海螺水泥	107,028	5,662,851.48	1.59
12	601012	隆基股份	136,300	5,551,499.00	1.55
13	000651	格力电器	84,700	4,791,479.00	1.34
14	600276	恒瑞医药	50,645	4,674,533.50	1.31
15	600048	保利地产	314,700	4,651,266.00	1.30
16	601166	兴业银行	291,989	4,607,586.42	1.29
17	600887	伊利股份	136,900	4,261,697.00	1.19
18	002001	新和成	137,000	3,986,700.00	1.12
19	002007	华兰生物	72,050	3,610,425.50	1.01
20	002142	宁波银行	136,400	3,583,228.00	1.00
21	002415	海康威视	116,976	3,550,221.60	0.99
22	000338	潍柴动力	258,330	3,544,287.60	0.99
23	601211	国泰君安	201,100	3,470,986.00	0.97
24	000002	万科A	121,400	3,173,396.00	0.89
25	002555	三七互娱	69,200	3,044,160.00	0.85
26	002127	南极电商	139,600	2,955,332.00	0.83
27	600406	国电南瑞	145,400	2,944,350.00	0.82
28	601398	工商银行	586,800	2,922,264.00	0.82
29	002602	世纪华通	202,600	2,908,206.00	0.81
30	300607	拓斯达	75,240	2,857,773.60	0.80
31	601688	华泰证券	149,100	2,803,080.00	0.78
32	000568	泸州老窖	29,300	2,669,816.00	0.75
33	002241	歌尔股份	90,700	2,662,952.00	0.75
34	000895	双汇发展	57,000	2,627,130.00	0.74
35	603259	药明康德	26,992	2,607,427.20	0.73
36	603939	益丰药房	27,160	2,471,560.00	0.69
37	002311	海大集团	49,800	2,369,982.00	0.66
38	300014	亿纬锂能	47,902	2,292,110.70	0.64
39	600183	生益科技	77,485	2,267,985.95	0.64
40	300316	晶盛机电	88,700	2,194,438.00	0.61
41	300383	光环新网	83,700	2,182,059.00	0.61
42	000001	平安银行	168,800	2,160,640.00	0.61

43	002624	完美世界	34,800	2,005,872.00	0.56
44	002511	中顺洁柔	84,800	1,891,040.00	0.53
45	000776	广发证券	132,000	1,863,840.00	0.52
46	601658	邮储银行	398,278	1,820,130.46	0.51
47	300433	蓝思科技	63,500	1,780,540.00	0.50
48	600438	通威股份	100,700	1,750,166.00	0.49
49	600570	恒生电子	15,990	1,722,123.00	0.48
50	300525	博思软件	43,485	1,598,943.45	0.45
51	002557	洽洽食品	29,127	1,578,392.13	0.44
52	000063	中兴通讯	39,100	1,569,083.00	0.44
53	600803	新奥股份	149,700	1,547,898.00	0.43
54	300003	乐普医疗	41,400	1,511,928.00	0.42
55	600900	长江电力	79,700	1,509,518.00	0.42
56	601933	永辉超市	157,200	1,474,536.00	0.41
57	000513	丽珠集团	30,616	1,469,874.16	0.41
58	002271	东方雨虹	34,250	1,391,577.50	0.39
59	600763	通策医疗	8,100	1,350,837.00	0.38
60	600009	上海机场	17,900	1,290,053.00	0.36
61	002410	广联达	18,100	1,261,570.00	0.35
62	603369	今世缘	31,700	1,261,343.00	0.35
63	601966	玲珑轮胎	62,400	1,260,480.00	0.35
64	600486	扬农化工	14,800	1,221,000.00	0.34
65	002841	视源股份	12,200	1,214,144.00	0.34
66	601877	正泰电器	45,800	1,206,830.00	0.34
67	600309	万华化学	23,800	1,189,762.00	0.33
68	002597	金禾实业	50,700	1,164,579.00	0.33
69	300226	上海钢联	14,520	1,141,272.00	0.32
70	600521	华海药业	33,440	1,134,619.20	0.32
71	600741	华域汽车	54,500	1,133,055.00	0.32
72	002773	康弘药业	22,590	1,120,464.00	0.31
73	000725	京东方 A	231,200	1,079,704.00	0.30
74	600104	上汽集团	62,200	1,056,778.00	0.30
75	600383	金地集团	76,900	1,053,530.00	0.30
76	600529	山东药玻	17,380	1,008,040.00	0.28
77	300498	温氏股份	43,680	952,224.00	0.27
78	603678	火炬电子	33,500	938,670.00	0.26
79	002605	姚记科技	23,700	900,600.00	0.25
80	603986	兆易创新	3,780	891,739.80	0.25
81	601088	中国神华	61,800	887,448.00	0.25
82	002456	欧菲光	47,900	880,881.00	0.25
83	300418	昆仑万维	34,200	853,632.00	0.24
84	600298	安琪酵母	16,785	830,521.80	0.23
85	000786	北新建材	38,700	825,471.00	0.23
86	002008	大族激光	22,900	823,255.00	0.23

87	002697	红旗连锁	75,200	821,184.00	0.23
88	002236	大华股份	40,800	783,768.00	0.22
89	300454	深信服	3,800	782,648.00	0.22
90	603883	老百姓	7,700	770,308.00	0.22
91	688298	东方生物	5,286	762,082.62	0.21
92	000656	金科股份	92,200	752,352.00	0.21
93	000596	古井贡酒	5,000	751,200.00	0.21
94	000739	普洛药业	31,300	728,977.00	0.20
95	000961	中南建设	81,900	728,910.00	0.20
96	688363	华熙生物	4,900	724,710.00	0.20
97	600426	华鲁恒升	40,254	711,690.72	0.20
98	002352	顺丰控股	12,900	705,630.00	0.20
99	601186	中国铁建	84,100	704,758.00	0.20
100	600352	浙江龙盛	54,200	693,218.00	0.19
101	601939	建设银行	108,100	682,111.00	0.19
102	002332	仙琚制药	40,300	678,652.00	0.19
103	601225	陕西煤业	93,100	671,251.00	0.19
104	300146	汤臣倍健	33,900	667,491.00	0.19
105	600332	白云山	20,516	663,282.28	0.19
106	603444	吉比特	1,200	658,812.00	0.18
107	300059	东方财富	31,680	639,936.00	0.18
108	002242	九阳股份	17,000	633,590.00	0.18
109	600998	九州通	33,700	627,494.00	0.18
110	002493	荣盛石化	50,000	615,000.00	0.17
111	603538	美诺华	12,000	611,760.00	0.17
112	300271	华宇软件	21,600	609,336.00	0.17
113	000625	长安汽车	55,000	605,000.00	0.17
114	002968	新大正	9,500	603,250.00	0.17
115	002422	科伦药业	28,700	602,700.00	0.17
116	300037	新宙邦	10,800	594,648.00	0.17
117	300413	芒果超媒	9,000	586,800.00	0.16
118	002028	思源电气	28,400	581,064.00	0.16
119	002444	巨星科技	48,586	577,201.68	0.16
120	002439	启明星辰	13,300	559,531.00	0.16
121	000425	徐工机械	92,600	547,266.00	0.15
122	300138	晨光生物	44,800	543,872.00	0.15
123	002714	牧原股份	6,630	543,660.00	0.15
124	603583	捷昌驱动	7,800	533,364.00	0.15
125	300785	值得买	4,185	526,096.35	0.15
126	603501	韦尔股份	2,600	525,070.00	0.15
127	603236	移远通信	2,520	524,160.00	0.15
128	000157	中联重科	81,000	520,830.00	0.15
129	300122	智飞生物	5,100	510,765.00	0.14
130	002223	鱼跃医疗	13,600	495,040.00	0.14

131	000538	云南白药	5,200	487,812.00	0.14
132	603233	大参林	6,000	487,320.00	0.14
133	000977	浪潮信息	12,048	472,040.64	0.13
134	601888	中国中免	3,000	462,090.00	0.13
135	601006	大秦铁路	63,600	447,744.00	0.13
136	600323	瀚蓝环境	20,300	444,164.00	0.12
137	600720	祁连山	27,300	443,625.00	0.12
138	601058	赛轮轮胎	125,200	441,956.00	0.12
139	001979	招商蛇口	26,071	428,607.24	0.12
140	002757	南兴股份	25,050	427,102.50	0.12
141	300750	宁德时代	2,400	418,464.00	0.12
142	002938	鹏鼎控股	8,100	405,486.00	0.11
143	688051	佳华科技	3,358	403,866.66	0.11
144	688037	芯源微	3,028	384,858.80	0.11
145	300015	爱尔眼科	8,840	384,098.00	0.11
146	300759	康龙化成	3,900	383,760.00	0.11
147	300450	先导智能	8,200	378,922.00	0.11
148	000975	银泰黄金	24,000	376,320.00	0.11
149	002353	杰瑞股份	12,100	375,100.00	0.11
150	002080	中材科技	24,090	373,395.00	0.10
151	300702	天宇股份	3,500	372,120.00	0.10
152	600449	宁夏建材	30,100	367,822.00	0.10
153	600547	山东黄金	10,000	366,200.00	0.10
154	600285	羚锐制药	38,300	358,105.00	0.10
155	300036	超图软件	14,200	357,556.00	0.10
156	002463	沪电股份	14,000	349,720.00	0.10
157	600690	海尔智家	19,500	345,150.00	0.10
158	002821	凯莱英	1,400	340,200.00	0.10
159	002459	晶澳科技	18,000	338,040.00	0.09
160	000581	威孚高科	16,100	332,948.00	0.09
161	600779	水井坊	5,300	330,826.00	0.09
162	601231	环旭电子	15,100	329,784.00	0.09
163	300347	泰格医药	3,200	326,016.00	0.09
164	002396	星网锐捷	9,100	321,503.00	0.09
165	002632	道明光学	37,700	319,319.00	0.09
166	002202	金风科技	32,000	319,040.00	0.09
167	603556	海兴电力	21,330	308,005.20	0.09
168	603218	日月股份	16,800	307,440.00	0.09
169	300572	安车检测	4,800	305,040.00	0.09
170	603899	晨光文具	5,500	300,300.00	0.08
171	002230	科大讯飞	7,900	295,697.00	0.08
172	300253	卫宁健康	12,870	295,237.80	0.08
173	600055	万东医疗	18,400	294,584.00	0.08
174	002734	利民股份	19,370	289,968.90	0.08

175	600745	闻泰科技	2,300	289,685.00	0.08
176	601818	光大银行	80,900	289,622.00	0.08
177	300628	亿联网络	4,200	286,692.00	0.08
178	603228	景旺电子	8,000	281,520.00	0.08
179	300476	胜宏科技	11,700	281,385.00	0.08
180	601009	南京银行	37,800	277,074.00	0.08
181	300114	中航电测	24,100	274,981.00	0.08
182	600062	华润双鹤	20,300	268,366.00	0.08
183	002440	闰土股份	28,900	264,146.00	0.07
184	601899	紫金矿业	59,900	263,560.00	0.07
185	300737	科顺股份	13,300	262,409.00	0.07
186	603368	柳药股份	11,340	260,253.00	0.07
187	603305	旭升股份	6,700	256,476.00	0.07
188	000708	中信特钢	14,620	249,855.80	0.07
189	603026	石大胜华	9,200	245,548.00	0.07
190	603298	杭叉集团	22,120	243,762.40	0.07
191	603515	欧普照明	8,900	243,593.00	0.07
192	600461	洪城水业	38,000	242,060.00	0.07
193	300747	锐科激光	2,200	239,426.00	0.07
194	603833	欧派家居	2,000	231,800.00	0.06
195	601117	中国化学	41,200	225,776.00	0.06
196	002803	吉宏股份	9,010	224,709.40	0.06
197	601139	深圳燃气	33,400	217,100.00	0.06
198	300136	信维通信	4,000	212,080.00	0.06
199	600176	中国巨石	22,800	208,620.00	0.06
200	002035	华帝股份	20,350	206,145.50	0.06
201	002371	北方华创	1,200	205,092.00	0.06
202	002643	万润股份	11,800	202,606.00	0.06
203	000100	TCL 科技	32,500	201,500.00	0.06
204	600580	卧龙电驱	17,700	198,948.00	0.06
205	688080	映翰通	2,233	193,779.74	0.05
206	600160	巨化股份	27,900	192,231.00	0.05
207	603659	璞泰来	1,800	185,436.00	0.05
208	600875	东方电气	20,800	184,080.00	0.05
209	300285	国瓷材料	5,400	180,954.00	0.05
210	688466	金科环境	4,907	179,547.13	0.05
211	002594	比亚迪	2,500	179,500.00	0.05
212	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.05
213	688398	赛特新材	3,246	176,809.62	0.05
214	002384	东山精密	5,800	173,710.00	0.05
215	002372	伟星新材	14,811	172,251.93	0.05
216	600528	中铁工业	18,200	160,524.00	0.04
217	300832	新产业	882	151,871.58	0.04
218	000876	新希望	4,800	143,040.00	0.04

219	300016	北陆药业	10,850	131,936.00	0.04
220	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.04
221	603690	至纯科技	3,000	124,140.00	0.03
222	600452	涪陵电力	8,400	121,212.00	0.03
223	601601	中国太保	4,400	119,900.00	0.03
224	002434	万里扬	13,800	119,784.00	0.03
225	600196	复星医药	3,500	118,475.00	0.03
226	601799	星宇股份	900	114,300.00	0.03
227	002299	圣农发展	3,800	110,200.00	0.03
228	300033	同花顺	800	106,464.00	0.03
229	002508	老板电器	3,400	105,774.00	0.03
230	300196	长海股份	9,900	104,742.00	0.03
231	600073	上海梅林	10,800	102,492.00	0.03
232	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.03
233	603589	口子窖	2,000	101,800.00	0.03
234	603087	甘李药业	1,011	101,403.30	0.03
235	002032	苏泊尔	1,400	99,400.00	0.03
236	000938	紫光股份	2,300	98,854.00	0.03
237	002812	恩捷股份	1,500	98,700.00	0.03
238	300639	凯普生物	1,900	98,667.00	0.03
239	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.03
240	300144	宋城演艺	5,400	93,420.00	0.03
241	600660	福耀玻璃	4,400	91,828.00	0.03
242	603160	汇顶科技	400	89,160.00	0.02
243	600479	千金药业	8,960	82,880.00	0.02
244	600132	重庆啤酒	1,100	80,300.00	0.02
245	002124	天邦股份	6,100	78,385.00	0.02
246	002078	太阳纸业	7,920	75,398.40	0.02
247	000049	德赛电池	1,500	73,515.00	0.02
248	002050	三花智控	2,864	62,721.60	0.02
249	601233	桐昆股份	4,740	60,482.40	0.02
250	300470	中密控股	1,900	59,850.00	0.02
251	600507	方大特钢	11,473	59,544.87	0.02
252	688123	聚辰股份	681	52,437.00	0.01
253	002648	卫星石化	3,200	52,064.00	0.01
254	600761	安徽合力	5,100	49,164.00	0.01
255	002430	杭氧股份	3,400	48,280.00	0.01
256	300741	华宝股份	1,298	47,870.24	0.01
257	300685	艾德生物	600	46,176.00	0.01
258	603799	华友钴业	1,188	46,165.68	0.01
259	600835	上海机电	2,700	45,711.00	0.01
260	002027	分众传媒	7,820	43,557.40	0.01
261	600340	华夏幸福	1,900	43,434.00	0.01
262	300244	迪安诊断	1,100	38,830.00	0.01

263	300408	三环集团	1,400	38,780.00	0.01
264	002478	常宝股份	7,900	38,157.00	0.01
265	002540	亚太科技	8,500	36,635.00	0.01
266	300207	欣旺达	1,800	34,020.00	0.01
267	600566	济川药业	1,301	33,123.46	0.01
268	603626	科森科技	2,600	31,590.00	0.01
269	600271	航天信息	1,900	30,856.00	0.01
270	300166	东方国信	2,400	29,784.00	0.01
271	002180	纳思达	900	29,619.00	0.01
272	300326	凯利泰	1,000	29,100.00	0.01
273	600004	白云机场	1,900	28,956.00	0.01
274	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
275	600025	华能水电	7,000	26,530.00	0.01
276	002318	久立特材	3,500	25,550.00	0.01
277	603328	依顿电子	2,000	20,860.00	0.01
278	600873	梅花生物	4,500	20,430.00	0.01
279	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
280	600125	铁龙物流	3,200	17,856.00	0.01
281	002798	帝欧家居	500	16,235.00	0.00
282	600068	葛洲坝	2,600	15,470.00	0.00
283	600845	宝信软件	260	15,360.80	0.00
284	603060	国检集团	700	13,993.00	0.00
285	600885	宏发股份	340	13,640.80	0.00
286	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
287	300088	长信科技	900	10,080.00	0.00
288	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
289	603886	元祖股份	600	9,840.00	0.00
290	300233	金城医药	300	9,225.00	0.00
291	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
292	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
293	603156	养元饮品	336	7,224.00	0.00
294	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
295	002837	英维克	150	4,443.00	0.00
296	603985	恒润股份	252	4,135.32	0.00
297	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	002415	海康威视	5,727,870.72	1.72
2	600031	三一重工	5,710,944.00	1.72
3	600036	招商银行	5,265,875.00	1.58
4	300607	拓斯达	3,013,461.00	0.91
5	002142	宁波银行	2,695,869.00	0.81
6	002602	世纪华通	2,663,854.00	0.80
7	600309	万华化学	2,483,485.88	0.75
8	000333	美的集团	2,395,832.00	0.72
9	002555	三七互娱	2,312,280.00	0.70
10	000338	潍柴动力	2,165,238.00	0.65
11	000776	广发证券	2,093,471.00	0.63
12	600183	生益科技	2,038,108.00	0.61
13	600030	中信证券	1,997,354.00	0.60
14	002007	华兰生物	1,955,558.00	0.59
15	601398	工商银行	1,791,034.00	0.54
16	300760	迈瑞医疗	1,761,595.00	0.53
17	000001	平安银行	1,743,446.00	0.52
18	300003	乐普医疗	1,502,120.00	0.45
19	600803	新奥股份	1,480,313.00	0.45
20	002001	新 和 成	1,464,032.00	0.44

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	601398	工商银行	7,316,835.00	2.20
2	601318	中国平安	7,119,936.00	2.14
3	002415	海康威视	5,544,325.80	1.67
4	000651	格力电器	4,699,533.00	1.41
5	601166	兴业银行	3,500,153.00	1.05
6	002008	大族激光	3,447,018.94	1.04
7	002007	华兰生物	3,230,524.60	0.97
8	000338	潍柴动力	3,124,180.52	0.94
9	600036	招商银行	2,817,642.00	0.85
10	600309	万华化学	2,439,171.79	0.73
11	601601	中国太保	2,341,581.00	0.70
12	000002	万 科 A	2,168,220.00	0.65
13	600529	山东药玻	2,133,756.36	0.64
14	601939	建设银行	2,130,254.00	0.64
15	000568	泸州老窖	1,972,076.00	0.59

16	300207	欣旺达	1,826,028.00	0.55
17	601658	邮储银行	1,812,265.00	0.55
18	600104	上汽集团	1,760,128.00	0.53
19	000786	北新建材	1,606,350.86	0.48
20	600028	中国石化	1,578,221.00	0.47

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	128,068,973.32
卖出股票的收入（成交）总额	142,760,513.76

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

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	8,490,243.00	2.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,202,289.50	1.74
	其中：政策性金融债	6,202,289.50	1.74
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）	297,414.68	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,989,947.18	4.20

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

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	019627	20 国债 01	84,860	8,490,243.00	2.38
2	018007	国开 1801	61,930	6,202,289.50	1.74
3	113583	益丰转债	810	107,713.80	0.03
4	128112	歌尔转 2	860	86,000.00	0.02
5	123055	晨光转债	580	58,000.00	0.02

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投资。

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

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2012	IC2012	8.00	8,794,560.00	355,960.00	-
公允价值变动总额合计					355,960.00
股指期货投资本期收益					-
股指期货投资本期公允价值变动					355,960.00

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	1,114,233.96
2	应收证券清算款	1,026,268.72
3	应收股利	-
4	应收利息	293,094.40
5	应收申购款	5,012,017.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,445,614.68

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的情况。

§ 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

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
海富通欣荣混合 A	151	1,163,903.15	175,509,062.97	99.86%	240,312.32	0.14%
海富通欣荣混合 C	208	334,526.74	69,306,161.90	99.60%	275,400.49	0.40%
合计	359	683,373.09	244,815,224.87	99.79%	515,712.81	0.21%

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)。

8.2 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	海富通欣荣混合 A	100,821.42	0.0574%
	海富通欣荣混合 C	672.18	0.0010%
	合计	101,493.60	0.0414%

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海富通欣荣混合 A	0~10
	海富通欣荣混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通欣荣混合 A	0~10
	海富通欣荣混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
基金合同生效日（2016 年 9 月 22 日）基金份额总额	250,120,830.38	200,014,500.63
本报告期期初基金份额总额	162,856,338.52	92,333,642.85
本报告期基金总申购份额	12,988,387.05	47,471,840.90
减：本报告期基金总赎回份额	95,350.28	70,223,921.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	175,749,375.29	69,581,562.39

§ 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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
太平洋证券	2	165,312,789.28	62.76%	119,676.50	57.07%	-
招商证券	1	40,153,407.28	15.24%	36,677.36	17.49%	-
兴业证券	1	24,466,716.54	9.29%	22,786.14	10.87%	-
海通证券	2	10,711,255.32	4.07%	9,761.04	4.65%	-
国元证券	2	8,774,015.53	3.33%	7,995.73	3.81%	-
光大证券	1	7,884,975.94	2.99%	7,185.72	3.43%	-
华创证券	1	6,109,764.76	2.32%	5,609.22	2.67%	-
申万宏源（原申万）	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元没有发生变更。

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	成交金额	占当期回购成交总	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		额的比例		额的比例
太平洋证券	14,806,344.88	67.55%	-	-	-	-
招商证券	94,086.70	0.43%	-	-	-	-
兴业证券	6,895,526.40	31.46%	15,000,000.00	100.00%	-	-
海通证券	123,886.88	0.57%	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源（原申万）	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
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	海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-07
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江同花顺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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-16
3	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-02
4	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-27
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增蚂蚁（杭州）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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-08
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金	证券日报、基金管理人网	2020-05-22

	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	站及中国证监会基金电子披露网站	
7	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
8	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
9	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-06
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京肯特瑞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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-23
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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-24
12	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	证券日报、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	2020/3/19-2020/6/8	47,249,102.25	-	-	47,249,102.25	19.26%
	2	2020/3/19-2020/6/8	47,249,102.25	-	-	47,249,102.25	19.26%

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欣荣灵活配置混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

- (四) 海富通欣荣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) 报告期内海富通欣荣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