

**海富通富盈混合型证券投资基金**  
**2020 年第 3 季度报告**  
**2020 年 9 月 30 日**

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日

## §1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	海富通富盈混合
基金主代码	009154
交易代码	009154
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 20 日
报告期末基金份额总额	2,118,270,119.26 份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。
投资策略	本基金以在风险可控下寻求稳定的超额收益作为投资理念，采用稳健的大类资产配置和股票投资策略。本基金通过对宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究，同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素，兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动，结合投资时钟理论，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例。并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，或借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应，以规避或分散市场风险。股票投资方面，本基

	金将采用量化选股方法构建股票组合，以价值投资作为核心理念，通过量化模型构建多因子 alpha 模型。 债券投资主要采取利率策略、信用策略、收益率曲线策略以及杠杆策略，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。另外，本基金投资策略还包括将资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略、流通受限证券投资策略、股票期权投资策略。	
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
下属两级基金的交易代码	009154	009155
报告期末下属两级基金的份额总额	925,302,785.64 份	1,192,967,333.62 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日)	
	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
1.本期已实现收益	22,375,141.53	34,566,586.13
2.本期利润	24,764,472.57	40,672,356.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.0237	0.0250
4.期末基金资产净值	948,593,166.04	1,221,206,771.64

5.期末基金份额净值	1.0252	1.0237
------------	--------	--------

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 1、海富通富盈混合 A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.23%	0.20%	0.00%	0.26%	2.23%	-0.06%
自基金合同生效起至今	2.52%	0.17%	-0.25%	0.24%	2.77%	-0.07%

#### 2、海富通富盈混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.12%	0.20%	0.00%	0.26%	2.12%	-0.06%
自基金合同生效起至今	2.37%	0.17%	-0.25%	0.24%	2.62%	-0.07%

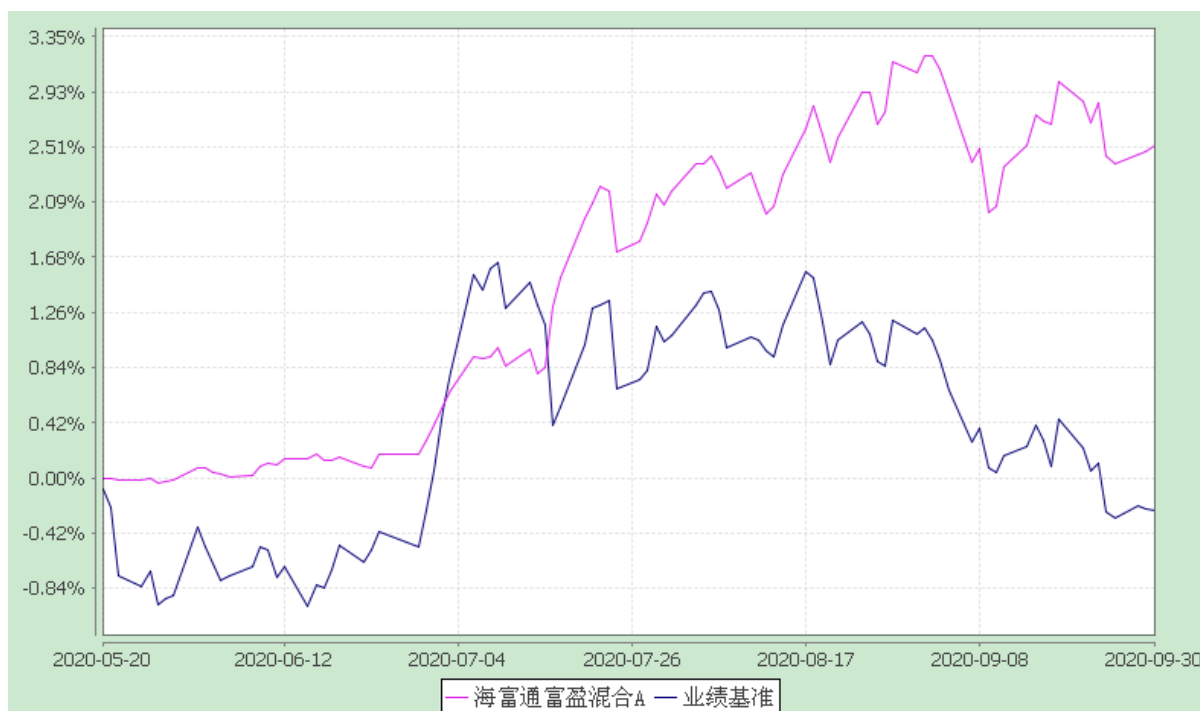
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通富盈混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

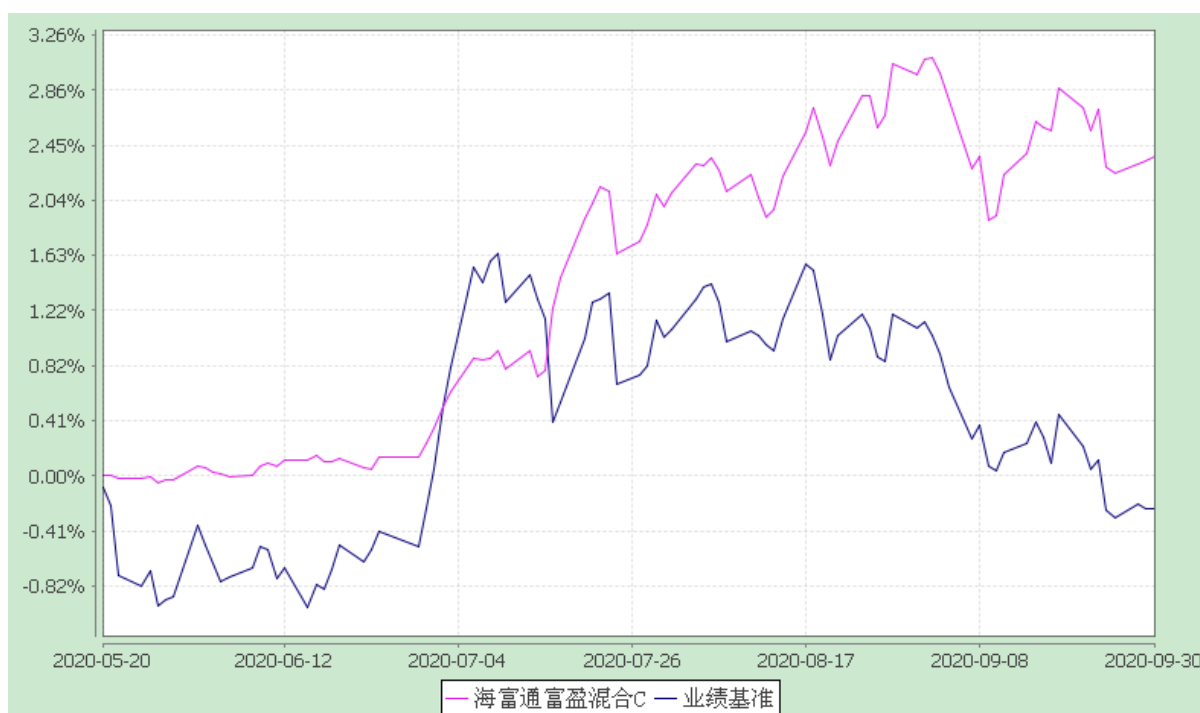
#### 1. 海富通富盈混合 A

(2020 年 5 月 20 日至 2020 年 9 月 30 日)



## 2. 海富通富盈混合 C

(2020 年 5 月 20 日至 2020 年 9 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2020 年 5 月 20 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	2020-05-20	-	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

	<p>通稳 固收 益债 券基 金经 理；海 富通 欣荣 混合 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</p>			<p>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。</p>
--	--	--	--	--

	收益 债券 基金 经理； 海富 通富 泽混 合基 金经 理；量 化投 资部 总监。				
夏妍妍	本基 金的 基金 经理； 海富 通安 颐收 益混 合基 金经 理；海 富通 富祥 混合 基金 经理； 海富 通聚 合纯 债基 金经 理；海 富通 融丰 定开 债券 基金 经理； 海富 通瑞	2020-05- 20	-	6 年	上海交通大学经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生，西门子财务租赁有限公司上海分公司高级财务分析师，2014 年加入海富通基金管理有限公司，历任固定收益投资部固定收益分析师、基金经理助理。2018 年 1 月起任海富通欣益混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通一年定期开放债券和海富通融丰定开债券基金经理。2019 年 5 月起兼任海富通安颐收益混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通聚合纯债、海富通富祥混合、海富通瑞丰债券及海富通瑞合纯债的基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。



	丰 债 基 金 经 理；海 富 通 瑞 合 纯 债 基 金 经 理； 海 富 通 欣 益 混 合 基 金 经 理；海 富 通 一 年 定 期 开 放 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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年三季度，全球开始逐步从疫情影响中恢复过来。分主要区域看，中国的恢复情况较好，基本只有外部零星的输入病例；欧洲、美国也基本控制住了疫情快速蔓延的趋势，虽然还有一定反复；一些发展中国家的防疫形势仍较为严峻，但对全球经济的整体影响相对较小。全球均开始推动生活、消费、生产的正常化运行，中国由于疫情控制得力而经济修复显著，除了需要人员聚集的一些社交性消费仍有制约外，国内其它日常生活、商品交易、工业生产、交通运输等均基本恢复。中国三季度各项经济数据也逐步接近正常水平，因此监管层也开始考虑和推动货币、财政等各项托底政策转向正常化。

在国内各项经济指标逐步接近正常水平的推动下，三季度国内权益市场的表现也较为优异。A 股主要指数方面，上证指数上涨 7.82%，沪深 300 上涨 10.17%，中证 800 上涨 9.03%，中小板指上涨 8.19%，创业板指上涨 5.60%。分行业看，中信一级行业中绝大部分上涨，其中国防军工、消费者服务、电力设备、汽车、食品饮料涨幅居前，涨幅分别达到 32.02%、26.56%、23.69%、20.42%和 19.38%，而通信、商贸零售、综合金融、计算机、传媒、农林牧渔是仅有的六个下跌行业，下跌幅度分别为-8.03%、-3.05%、-2.37%、-2.06%、-1.70%和-0.13%。从三季度 A 股内部的结构看，受益于经济逐步恢复的顺周期行业取得了不错的表现，包括餐饮旅游、汽车、食品饮料、建材、非银行金融、机械、基础化工、轻工制造等；以国防军工、电力设备为代表的部分高端装备制造行业自身行业景气好、之前估值不贵，因此也有显著表现；上半年涨幅较大、估值也较高的通信、计算机、传媒、医药等高估值板块，在货币政策逐步转向正常化的背景下出现了阶段性的落后。

本报告期,本基金在控制回撤的基础上，力图寻找合适的股票投资机会以赚取绝对收益。同时，本基金积极参与新股申购，以增强投资收益。

下季度，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。

债券方面，从经济基本面来看，2020 年三季度国内经济逐步修复，1-9 月工业增加值、固定资产投资和社会消费品零售总额累计同比上升 1.2%、上升 0.8%和下跌 7.2%，较 1-6 月分别上涨 2.5%，3.9%和 4.2%。三季度实际 GDP 同比增长 4.9%，较二季度回升 1.7 个百分点，前三季度同比上涨 0.7%。通胀方面，猪肉等食品价格均有所下跌，CPI 延续回落态势；但国内经济恢复较好，原油等主要工业品价格均有所上涨，PPI 仍

不改向上趋势。三季度 CPI 和 PPI 的中枢或分别落在 2.3%和-2.2%左右。在国内经济逐步企稳的背景下，国内货币政策边际难以实质转松，7-9 月央行并未进一步降准或者调降 7 天逆回购利率和 MLF 利率；银行间质押式回购加权利率中枢由二季度的 1.45%回升至三季度的 1.98%。在国内经济逐步修复、资金面边际收紧以及利率债供给压力仍然较大的情况下，各期限利率债收益率呈现震荡上行的态势。整体看，三季度 1 年期国债收益率累计上行 47bp 至 2.65%，而 10 年期国债收益率累计上行 33bp 至 3.15%，期限利差有所收窄。信用债方面，三季度信用债收益率整体震荡上行，从中债估值来看，各主要品种和期限的信用债绝对收益率多数处于历史三分之一分位数以内。但信用利差继续压缩至历史低位，与利率债相比，信用债供给弹性相对更大，市场波动对于信用债的收益率冲击相对较低。可转债方面，中证转债指数先扬后抑，7 月初权益市场涨幅较大，转债乘势而上，但随后跟随正股震荡，三季度累计上涨 4.59%。

在 5-7 月债券市场调整过程中，本基金债券部分采取了较为谨慎的操作策略，从绝对收益的角度出发，控制节奏逐渐进行配置，目前以中短久期信用债为主。

四季度，本基金债券部分配置还是秉承绝对收益的思路，以精选中短久期、票息较高的高等级信用个券为主。同时，积极关注利率债和可转债的交易性机会，并配合股票部分投资策略，做好流动性管理。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金处于建仓期，海富通富盈 A 净值增长率为 2.23%，同期业绩比较基准收益率为 0%，基金净值跑赢业绩比较基准 2.23 个百分点。海富通富盈 C 净值增长率为 2.12%，同期业绩比较基准收益率为 0%，基金净值跑赢业绩比较基准 2.12 个百分点。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	462,582,490.44	19.46
	其中：股票	462,582,490.44	19.46
2	固定收益投资	1,815,144,013.36	76.35
	其中：债券	1,815,144,013.36	76.35
	资产支持证券	-	-

3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	32,714,257.56	1.38
7	其他资产	66,916,020.52	2.81
8	合计	2,377,356,781.88	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,433,953.00	0.30
C	制造业	301,681,541.96	13.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	341,243.00	0.02
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	10,001,666.00	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	1,033,653.36	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,166,225.57	1.94
J	金融业	68,386,030.00	3.15
K	房地产业	20,516,971.00	0.95
L	租赁和商务服务业	2,136,788.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	4,890,873.40	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	151,487.60	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,103,675.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	567,665.26	0.03

S	综合	-	-
	合计	460,424,802.27	21.22

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	1,749,645.75	0.08
金融	408,042.42	0.02
合计	2,157,688.17	0.10

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	710,900	25,592,400.00	1.18
2	600031	三一重工	1,028,000	25,586,920.00	1.18
3	601318	中国平安	228,400	17,417,784.00	0.80
4	600519	贵州茅台	8,200	13,681,700.00	0.63
5	002001	新和成	439,600	13,095,684.00	0.60
6	600585	海螺水泥	223,400	12,345,084.00	0.57
7	300607	拓斯达	304,720	12,215,512.80	0.56
8	002602	世纪华通	1,302,000	11,849,580.00	0.55
9	002555	三七互娱	300,000	11,499,000.00	0.53
10	600486	扬农化工	114,700	10,059,190.00	0.46

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	44,152,000.00	2.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	166,903,000.00	7.69
	其中：政策性金融债	166,903,000.00	7.69
4	企业债券	460,107,000.00	21.21
5	企业短期融资券	19,982,000.00	0.92

6	中期票据	786,354,000.00	36.24
7	可转债（可交换债）	94,325,013.36	4.35
8	同业存单	243,321,000.00	11.21
9	其他	-	-
10	合计	1,815,144,013.36	83.65

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	200206	20 国开 06	1,000,000	99,050,000.00	4.56
2	136845	16 环球 03	900,000	90,270,000.00	4.16
3	101801231	18 中交房产 MTN001	700,000	71,477,000.00	3.29
4	112007021	20 招商银行 CD021	700,000	68,082,000.00	3.14
5	155058	18 京能 01	600,000	60,432,000.00	2.79

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2010	IF2010	-45.00	-61,576,200.00	3,527,968.97	-
IF2103	IF2103	-13.00	-17,419,740.00	42,360.00	-

			0		
IH2010	IH2010	-10.00	-9,658,800.00	289,260.00	-
公允价值变动总额合计(元)					3,859,588.97
股指期货投资本期收益(元)					-1,769,437.51
股指期货投资本期公允价值变动(元)					3,859,588.97

注：股指期货投资本期收益中已扣除本期股指期货差价收入应缴纳增值税额。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

### 5.11 投资组合报告附注

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

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

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	11,745,949.09
2	应收证券清算款	31,126,429.57

3	应收股利	-
4	应收利息	23,734,633.53
5	应收申购款	309,008.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,916,020.52

## 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	132013	17 宝武 EB	10,675,600.00	0.49
2	132015	18 中油 EB	9,366,328.30	0.43
3	132008	17 山高 EB	9,270,000.00	0.43
4	132009	17 中油 EB	7,111,152.00	0.33
5	113014	林洋转债	4,226,886.30	0.19
6	110059	浦发转债	3,580,850.00	0.17
7	110034	九州转债	3,304,198.80	0.15
8	110045	海澜转债	2,917,800.00	0.13
9	127012	招路转债	2,489,439.97	0.11
10	113017	吉视转债	2,162,167.50	0.10
11	132007	16 凤凰 EB	2,046,000.00	0.09
12	110064	建工转债	2,012,119.20	0.09
13	128044	岭南转债	1,867,290.00	0.09
14	113505	杭电转债	1,635,520.00	0.08
15	110048	福能转债	1,625,540.00	0.07
16	113519	长久转债	1,363,645.40	0.06
17	128058	拓邦转债	1,335,227.28	0.06
18	128010	顺昌转债	1,273,440.00	0.06
19	110068	龙净转债	1,211,320.00	0.06



20	110033	国贸转债	1,164,996.20	0.05
21	113532	海环转债	1,138,131.20	0.05
22	110041	蒙电转债	1,122,700.00	0.05
23	128037	岩土转债	1,073,270.00	0.05
24	128064	司尔转债	1,046,855.20	0.05
25	113508	新风转债	1,031,000.00	0.05
26	128087	孚日转债	997,500.00	0.05
27	128085	鸿达转债	964,980.00	0.04
28	113012	骆驼转债	963,540.00	0.04
29	127011	中鼎转 2	928,640.00	0.04
30	113030	东风转债	793,687.00	0.04
31	128071	合兴转债	682,991.00	0.03
32	128081	海亮转债	662,550.02	0.03
33	128096	奥瑞转债	623,773.68	0.03
34	113525	台华转债	592,263.00	0.03
35	113025	明泰转债	556,250.00	0.03
36	113530	大丰转债	517,000.00	0.02
37	113026	核能转债	508,500.00	0.02
38	123004	铁汉转债	393,832.53	0.02
39	113545	金能转债	353,400.00	0.02
40	113534	鼎胜转债	327,390.00	0.02
41	113021	中信转债	314,970.00	0.01
42	113537	文灿转债	304,024.60	0.01
43	113024	核建转债	299,164.00	0.01
44	128075	远东转债	275,813.70	0.01
45	128046	利尔转债	244,680.00	0.01
46	128083	新北转债	221,020.00	0.01
47	132004	15 国盛 EB	200,740.00	0.01
48	110051	中天转债	119,620.00	0.01
49	110047	山鹰转债	111,440.00	0.01
50	128101	联创转债	109,370.00	0.01

## 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002555	三七互娱	11,499,000.00	0.53	大宗交易限售
2	300607	拓斯达	12,117,168.00	0.56	大宗交易限售
3	002602	世纪华通	11,849,580.00	0.55	大宗交易限售

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通富盈混合A	海富通富盈混合C
本报告期期初基金份额总额	1,092,446,802.70	1,839,497,101.82
本报告期基金总申购份额	2,481,067.46	11,432,550.82
减：本报告期基金总赎回份额	169,625,084.52	657,962,319.02
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	925,302,785.64	1,192,967,333.62

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

## 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 90 只公募基金。截至 2020 年 9 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1283 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再度被权威媒体《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。2020 年 7 月，由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金基金·股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

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

### 9.2 存放地点

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。

### 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司  
二〇二〇年十月二十八日