

海富通稳固收益债券型证券投资基金
2020 年第 4 季度报告
2020 年 12 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年一月二十二日

§1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 21 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通稳固收益债券
基金主代码	519030
交易代码	519030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 11 月 23 日
报告期末基金份额总额	489,358,722.67 份
投资目标	通过合理运用投资组合优化策略，力争实现基金收益随着时间增长的逐步提升。
投资策略	本基金的整体投资策略分为三个层次：第一层次，即资产配置策略，将以优化投资组合保险策略为核心，实现基金投资目标；第二层次，即债券投资策略，将采用自上而下的策略，以久期管理为核心；第三层次，即股票投资策略，包括新股申购策略和积极的精选个股策略。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于中低风险品种。其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	17,058,508.43
2.本期利润	19,094,974.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0388
4.期末基金资产净值	604,004,155.02
5.期末基金份额净值	1.234

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.26%	0.28%	0.69%	0.01%	2.57%	0.27%
过去六个月	6.10%	0.37%	1.38%	0.01%	4.72%	0.36%
过去一年	7.87%	0.33%	2.76%	0.01%	5.11%	0.32%
过去三年	25.33%	0.25%	8.49%	0.01%	16.84%	0.24%
过去五年	11.78%	0.30%	14.54%	0.01%	-2.76%	0.29%
自基金合同生效起至今	82.65%	0.52%	41.58%	0.01%	41.07%	0.51%

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

海富通稳固收益债券型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2010 年 11 月 23 日至 2020 年 12 月 31 日)



注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分（二）投资范围、（五）投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈轶平	本基金的基金经理；海富通恒丰定	2015-12-18	-	11 年	博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副

	<p>开债券基金经理;海富通弘丰定开债券基金经理;海富通瑞利债券基金经理;海富通上清所短融债券基金经理;海富通上证 10 年期地方政府债 ETF 基金经理;海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金经理;海富通上</p>				<p>董事,2011 年 10 月加入海富通基金管理有限公司,历任债券投资经理、基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监,现任固定收益投资副总监兼债券基金部总监。2013 年 8 月至 2020 年 7 月任海富通货币基金经理。2014 年 8 月至 2019 年 9 月兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014 年 11 月起兼任海富通上证可质押城投债 ETF (现为海富通上证城投债 ETF) 基金经理。2015 年 12 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 9 月兼任海富通稳进增利债券 (LOF) 基金经理。2016 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定开债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2016 年 8 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞丰一年定开债券 (现为海富通瑞丰债券) 基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 11 月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 10 月兼任海富通美元债 (QDII) 基金经理。2017 年 1 月起兼任海富通上证周期产业债 ETF 基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 6 月兼任海富通富源债券基金经理。</p>
--	---	--	--	--	---

	证城投债 ETF 基金经理；海富通上证周期产业债 ETF 基金经理；海富通添鑫收益债券基金经理；海富通上证投资级可转债 ETF 基金经理；固定收益投资副总监兼债券基金部总监。				2017 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 9 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 指数增强）基金经理。2017 年 7 月至 2019 年 9 月兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2017 年 7 月至 2018 年 12 月兼任海富通欣悦混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018 年 10 月起兼任海富通上证 10 年期地方政府债 ETF 基金经理。2018 年 11 月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。2019 年 1 月起兼任海富通上清所短融债券基金经理。2019 年 11 月起兼任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 7 月起兼任海富通上证投资级可转债 ETF 基金经理。
杜晓海	本基金的基金经理；海富通阿尔法	2018-04-09	2020-10-23	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

对冲混合基金经理;海富通安颐收益混合基金经理;海富通安益对冲混合基金经理;海富通创业板增强基金经理;海富通富盈混合基金经理;海富通富泽混合基金经理;海富通添鑫收益债券基金经理;海富通欣荣混合					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月起任海富通安颐收益混合(原海富通养老收益混合)基金经理。2016年6月至2020年10月兼任海富通新内需混合基金经理。2016年9月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017年4月至2018年1月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017年5月至2019年10月兼任海富通富睿混合(现海富通沪深300增强)基金经理。2018年3月至2019年10月兼任海富通富祥混合基金经理。2018年4月至2018年7月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018年4月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018年4月至2020年10月兼任海富通量化前锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018年4月至2019年10月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019年6月至2020年10月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020年1月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020年3月起
---	--	--	--	--	--

	基金 经理； 海富 通中 证 500 增强 基金 经理； 量化 投资 部总 监。				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。
江勇	本基 金的 基金 经理； 海富 通上 证非 周期 ETF 基金 经理； 海富 通上 证非 周期 ETF 联接 基金 经理； 海富 通上 证周 期 ETF 基金 经理； 海富 通上 证周 期 ETF	2020-10-29	-	9 年	经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师，资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2018 年 7 月起任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF、海富通上证非周期 ETF 联接、海富通中证 100 指数 (LOF) 基金经理。2018 年 7 月至 2020 年 3 月任海富通中证 500 增强（原海富通中证内地低碳指数）基金经理。2020 年 8 月起兼任海富通中证长三角领先 ETF、海富通中证长三角领先 ETF 联接基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。

	联接基金 经理；海富通中证 100 指数（LOF）基金经理；海富通中证长三角领先 ETF 基金经理；海富通中证长三角领先 ETF 联接基金经理。									
--	---	--	--	--	--	--	--	--	--	--

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

从经济基本面来看，2020 年四季度国内经济延续修复趋势，1-11 月工业增加值、固定资产投资累计同比分别上升 2.3%、2.6%，社会消费品零售总额累计同比下跌 4.8% 但跌幅收窄。四季度实际 GDP 增速较三季度大概率继续回升。通胀方面表现分化，猪肉价格在基数效应以及产能逐步释放的情况下开启下行周期，CPI 有所走弱，11 月同比回落 0.5%；但国内经济恢复较好，原油等主要工业品以及原材料价格均有所上涨，11 月同比回落 1.5%，降幅继续收窄。虽然国内经济仍处于恢复期，但以“永煤”为代表的信用事件爆发，四季度央行货币政策边际上有所放松，四季度 MLF 净投放 10500 亿元，年末重启 14 天逆回购操作，资金面总体维持平稳宽松，银行间质押式回购加权利率中枢由三季度的 1.98% 回落至四季度的 1.88%。在这种情况下，四季度各期限利率债收益率呈现先上后下的态势。整体看，四季度 1 年期国债收益率累计下行 17bp 至 2.47%，而 10 年期国债收益率累计下行 0.53bp 至 3.14%，期限利差较三季度有所走扩。信用债方面，四季度出现华晨汽车、永煤超预期信用风险事件，弱国企风险暴露下债券市场经历了新一轮“信仰”的破灭，其带来的流动性冲击也使得信用债收益率短期内出现快速上行。尽管随后金稳委会议召开，市场情绪逐步企稳，但结构性分化进一步加大，信用利差走扩。可转债方面，四季度中证转债指数上涨 2.5%。行业方面，有色金属、电气设备涨幅较多，商业贸易和传媒则跌幅较大，转债市场整体仍表现较为分化。

本管理人在四季度根据组合规模情况配置信用债并调整利率债久期，积极参与波段机会。同时，本管理人四季度根据市场情况增加了可转债资产，以在控制波动的同时获取权益上涨收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通稳固收益基金净值增长率为 3.26%，同期业绩比较基准收益率为

0.69%。

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	119,074,609.90	16.61
	其中：股票	119,074,609.90	16.61
2	固定收益投资	582,332,625.07	81.26
	其中：债券	582,332,625.07	81.26
	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	7,833,287.44	1.09
7	其他资产	7,431,376.18	1.04
8	合计	716,671,898.59	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	3,596,887.00	0.60
C	制造业	76,774,617.94	12.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供	1,565,770.00	0.26

	应业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	430,522.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	2,208,460.00	0.37
H	住宿和餐饮业	87,002.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,581,513.00	0.43
J	金融业	22,250,622.00	3.68
K	房地产业	6,239,164.00	1.03
L	租赁和商务服务业	664,351.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	820,708.96	0.14
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	269,052.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	1,585,940.00	0.26
S	综合	-	-
	合计	119,074,609.90	19.71

5.2.2 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。

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	600519	贵州茅台	3,300	6,593,400.00	1.09
2	601318	中国平安	70,700	6,149,486.00	1.02
3	600036	招商银行	123,600	5,432,220.00	0.90
4	600031	三一重工	111,100	3,886,278.00	0.64
5	601166	兴业银行	186,100	3,883,907.00	0.64
6	000333	美的集团	35,839	3,527,991.16	0.58

7	603218	日月股份	120,680	3,459,770.00	0.57
8	600887	伊利股份	69,200	3,070,404.00	0.51
9	600048	保利地产	190,600	3,015,292.00	0.50
10	000538	云南白药	22,000	2,378,200.00	0.39

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	70,749,000.00	11.71
2	央行票据	-	-
3	金融债券	247,732,958.40	41.02
	其中：政策性金融债	137,377,958.40	22.74
4	企业债券	61,087,100.00	10.11
5	企业短期融资券	10,013,000.00	1.66
6	中期票据	130,406,000.00	21.59
7	可转债（可交换债）	62,344,566.67	10.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	582,332,625.07	96.41

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	018009	国开 1803	788,060	87,190,958.40	14.44
2	200016	20 付息国债 16	700,000	70,749,000.00	11.71
3	2028047	20 交通银行 02	500,000	50,160,000.00	8.30
4	110220	11 国开 20	300,000	30,165,000.00	4.99
5	2028030	20 兴业银行小微债 05	300,000	30,114,000.00	4.99

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金暂未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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20兴业银行小微债05（2028030）的发行人，作为债务融资工具主承销商，因在债务融资工具存续期间未能对京粮集团资产无偿划转重大事项进行有效监测，及时督导京粮集团进行存续期重大事项披露，也未及时召开持有人会议，于2020年5月15日被中国银行间市场交易商协会责令整改。因同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权等违规行为，于2020年8月31日被中国银保监会福建监管局没收违法所得6,361,807.97元，并合计处以罚款15,961,807.97元。因为无证机构提供转接清算服务、为支付机构超范围经营提供支付服务、违规连通上下游支付机构提供转接清算服务等，且上述违规行为未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定等行为，于2020年9月4日被中国人民银行福州中心支行给予警告，没收违法所得10,875,088.15元，并处

13,824,431.23元罚款。对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为全国大型银行，综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	27,161.23
2	应收证券清算款	1,959,327.47
3	应收股利	-
4	应收利息	5,088,339.48
5	应收申购款	356,548.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,431,376.18

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	110059	浦发转债	804,220.00	0.13
2	132014	18 中化 EB	675,070.00	0.11
3	132021	19 中电 EB	640,609.00	0.11
4	132020	19 蓝星 EB	548,898.00	0.09
5	128110	永兴转债	508,453.20	0.08
6	123029	英科转债	441,932.00	0.07
7	128065	雅化转债	433,847.40	0.07
8	110066	盛屯转债	416,080.00	0.07
9	110053	苏银转债	395,149.00	0.07
10	110051	中天转债	389,914.80	0.06

11	113582	火炬转债	384,733.90	0.06
12	128095	恩捷转债	377,918.40	0.06
13	113586	上机转债	373,176.00	0.06
14	128028	赣锋转债	367,794.40	0.06
15	128111	中矿转债	365,362.20	0.06
16	113035	福莱转债	362,033.70	0.06
17	128010	蔚蓝转债	345,601.90	0.06
18	113509	新泉转债	334,367.40	0.06
19	123055	晨光转债	332,941.20	0.06
20	113545	金能转债	331,229.00	0.05
21	113029	明阳转债	329,276.70	0.05
22	110055	伊力转债	325,489.00	0.05
23	113548	石英转债	322,462.80	0.05
24	128019	久立转 2	317,945.25	0.05
25	113587	泛微转债	313,921.80	0.05
26	113032	桐 20 转债	309,452.00	0.05
27	110034	九州转债	308,299.20	0.05
28	128017	金禾转债	308,125.44	0.05
29	113543	欧派转债	306,729.20	0.05
30	123044	红相转债	306,460.70	0.05
31	128053	尚荣转债	304,426.80	0.05
32	113508	新风转债	302,377.50	0.05
33	113014	林洋转债	298,777.50	0.05
34	110069	瀚蓝转债	298,039.50	0.05
35	113504	艾华转债	297,194.50	0.05
36	123007	道氏转债	297,026.40	0.05
37	113025	明泰转债	296,194.40	0.05
38	113009	广汽转债	295,276.30	0.05
39	128029	太阳转债	294,482.50	0.05
40	123004	铁汉转债	292,905.50	0.05
41	128035	大族转债	292,685.40	0.05

42	128078	太极转债	292,661.49	0.05
43	113026	核能转债	292,650.30	0.05
44	128026	众兴转债	292,242.50	0.05
45	128097	奥佳转债	291,433.47	0.05
46	128023	亚太转债	291,255.90	0.05
47	113011	光大转债	291,118.00	0.05
48	113012	骆驼转债	290,954.40	0.05
49	128113	比音转债	290,881.80	0.05
50	110065	淮矿转债	290,030.00	0.05
51	128018	时达转债	289,735.40	0.05
52	113534	鼎胜转债	289,720.80	0.05
53	113575	东时转债	289,288.80	0.05
54	113017	吉视转债	289,103.10	0.05
55	110048	福能转债	288,868.00	0.05
56	132018	G 三峡 EB1	288,634.50	0.05
57	127005	长证转债	288,400.00	0.05
58	128114	正邦转债	288,139.80	0.05
59	128046	利尔转债	288,063.88	0.05
60	110041	蒙电转债	287,997.60	0.05
61	132017	19 新钢 EB	287,928.00	0.05
62	128108	蓝帆转债	287,765.80	0.05
63	128048	张行转债	287,762.40	0.05
64	132015	18 中油 EB	287,716.00	0.05
65	132009	17 中油 EB	287,663.60	0.05
66	132007	16 凤凰 EB	287,342.10	0.05
67	132004	15 国盛 EB	287,337.00	0.05
68	113576	起步转债	287,280.00	0.05
69	113021	中信转债	287,223.30	0.05
70	113013	国君转债	286,752.00	0.05
71	113583	益丰转债	286,348.40	0.05
72	110061	川投转债	286,344.00	0.05

73	113034	滨化转债	286,233.50	0.05
74	110043	无锡转债	285,679.80	0.05
75	113033	利群转债	285,624.20	0.05
76	113027	华钰转债	285,572.00	0.05
77	128064	司尔转债	285,389.12	0.05
78	113024	核建转债	285,186.90	0.05
79	110058	永鼎转债	285,068.00	0.05
80	113542	好客转债	285,037.20	0.05
81	110045	海澜转债	284,944.80	0.05
82	128075	远东转债	284,607.54	0.05
83	127011	中鼎转 2	284,498.00	0.05
84	110056	亨通转债	284,276.70	0.05
85	113016	小康转债	284,164.90	0.05
86	128034	江银转债	284,136.32	0.05
87	110064	建工转债	284,060.40	0.05
88	110033	国贸转债	283,777.00	0.05
89	128063	未来转债	283,607.40	0.05
90	113516	苏农转债	283,592.90	0.05
91	123050	聚飞转债	283,339.50	0.05
92	127015	希望转债	283,081.00	0.05
93	128112	歌尔转 2	283,076.10	0.05
94	127006	敖东转债	282,907.20	0.05
95	110031	航信转债	282,391.60	0.05
96	128033	迪龙转债	282,122.70	0.05
97	128109	楚江转债	282,077.40	0.05
98	128083	新北转债	281,880.20	0.05
99	128071	合兴转债	280,869.00	0.05
100	113577	春秋转债	280,721.00	0.05
101	110057	现代转债	280,339.80	0.05
102	113008	电气转债	280,262.40	0.05
103	110052	贵广转债	280,185.50	0.05

104	128051	光华转债	280,052.90	0.05
105	123002	国祯转债	280,048.60	0.05
106	113505	杭电转债	280,024.00	0.05
107	113584	家悦转债	279,861.70	0.05
108	128032	双环转债	279,777.62	0.05
109	123023	迪森转债	279,639.60	0.05
110	128036	金农转债	279,614.40	0.05
111	113524	奇精转债	279,468.00	0.05
112	128037	岩土转债	279,444.00	0.05
113	127007	湖广转债	279,028.60	0.05
114	113528	长城转债	278,376.00	0.05
115	113530	大丰转债	277,937.10	0.05
116	127012	招路转债	277,730.60	0.05
117	123048	应急转债	277,579.40	0.05
118	127003	海印转债	277,469.10	0.05
119	110063	鹰 19 转债	277,311.30	0.05
120	123049	维尔转债	276,888.00	0.05
121	110060	天路转债	275,792.40	0.05
122	110047	山鹰转债	275,621.40	0.05
123	128101	联创转债	275,601.90	0.05
124	113535	大业转债	275,462.60	0.05
125	128107	交科转债	275,349.00	0.05
126	113532	海环转债	274,886.40	0.05
127	128042	凯中转债	274,752.00	0.05
128	113578	全筑转债	274,751.40	0.05
129	113030	东风转债	273,919.50	0.05
130	113526	联泰转债	273,121.50	0.05
131	123010	博世转债	272,969.04	0.05
132	123028	清水转债	272,862.00	0.05
133	128025	特一转债	272,300.80	0.05
134	128021	兄弟转债	271,983.80	0.05

135	113541	荣晟转债	271,950.00	0.05
136	128049	华源转债	271,905.20	0.05
137	127016	鲁泰转债	271,755.00	0.04
138	113537	文灿转债	271,718.40	0.04
139	128081	海亮转债	271,671.00	0.04
140	123011	德尔转债	271,232.50	0.04
141	127013	创维转债	271,075.20	0.04
142	128106	华统转债	270,723.80	0.04
143	128105	长集转债	270,723.60	0.04
144	128069	华森转债	270,667.20	0.04
145	113557	森特转债	270,545.90	0.04
146	128096	奥瑞转债	270,163.50	0.04
147	113563	柳药转债	269,526.40	0.04
148	128090	汽模转 2	269,523.30	0.04
149	123035	利德转债	269,444.98	0.04
150	110068	龙净转债	268,777.80	0.04
151	127017	万青转债	268,676.10	0.04
152	128087	孚日转债	268,452.10	0.04
153	113568	新春转债	268,435.10	0.04
154	113550	常汽转债	268,106.80	0.04
155	113564	天目转债	267,718.00	0.04
156	128066	亚泰转债	267,332.00	0.04
157	123054	思特转债	266,892.40	0.04
158	128072	翔鹭转债	265,925.00	0.04
159	128022	众信转债	265,125.60	0.04
160	123022	长信转债	264,654.60	0.04
161	128057	博彦转债	264,632.20	0.04
162	113519	长久转债	264,627.00	0.04
163	113527	维格转债	264,311.40	0.04
164	128100	搜特转债	262,659.60	0.04
165	113569	科达转债	258,829.10	0.04

166	128044	岭南转债	258,354.80	0.04
167	113565	宏辉转债	257,599.60	0.04
168	128050	钧达转债	256,756.50	0.04
169	123046	天铁转债	251,901.20	0.04
170	113585	寿仙转债	229,468.20	0.04
171	113588	润达转债	65,471.30	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	603218	日月股份	3,439,200.00	0.57	大宗交易
2	000538	云南白药	2,378,200.00	0.39	大宗交易

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	488,301,368.26
本报告期基金总申购份额	86,307,564.39
减：本报告期基金总赎回份额	85,250,209.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	489,358,722.67

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020/10/1-2020/12/31	120,000,000.00	-	-	120,000,000.00	24.52%

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。

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 92 只公募基金。截至 2020 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1251 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稳固收益债券型证券投资基金的文件
- （二）海富通稳固收益债券型证券投资基金基金合同
- （三）海富通稳固收益债券型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通稳固收益债券型证券投资基金托管协议
- （五）中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- （六）法律法规及中国证监会规定的其他文件

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
二〇二一年一月二十二日