

海富通富盈混合型证券投资基金
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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	1,167,783,074.29 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

	<p>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。</p> <p>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。</p>	
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	<p>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。</p>	
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	508,304,749.87 份	659,478,324.42 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 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 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	6,668,190.40	7,147,244.29
2.本期利润	20,433,291.21	25,412,571.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.0278	0.0283
4.期末基金资产净值	536,396,517.73	694,201,792.06

5.期末基金份额净值	1.0553	1.0527
------------	--------	--------

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	2.94%	0.22%	3.05%	0.18%	-0.11%	0.04%
过去六个月	5.24%	0.21%	3.04%	0.22%	2.20%	-0.01%
自基金合同生效起至今	5.53%	0.19%	2.78%	0.22%	2.75%	-0.03%

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	2.83%	0.22%	3.05%	0.18%	-0.22%	0.04%
过去六个月	5.02%	0.21%	3.04%	0.22%	1.98%	-0.01%
自基金合同生效起至今	5.27%	0.19%	2.78%	0.22%	2.49%	-0.03%

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

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

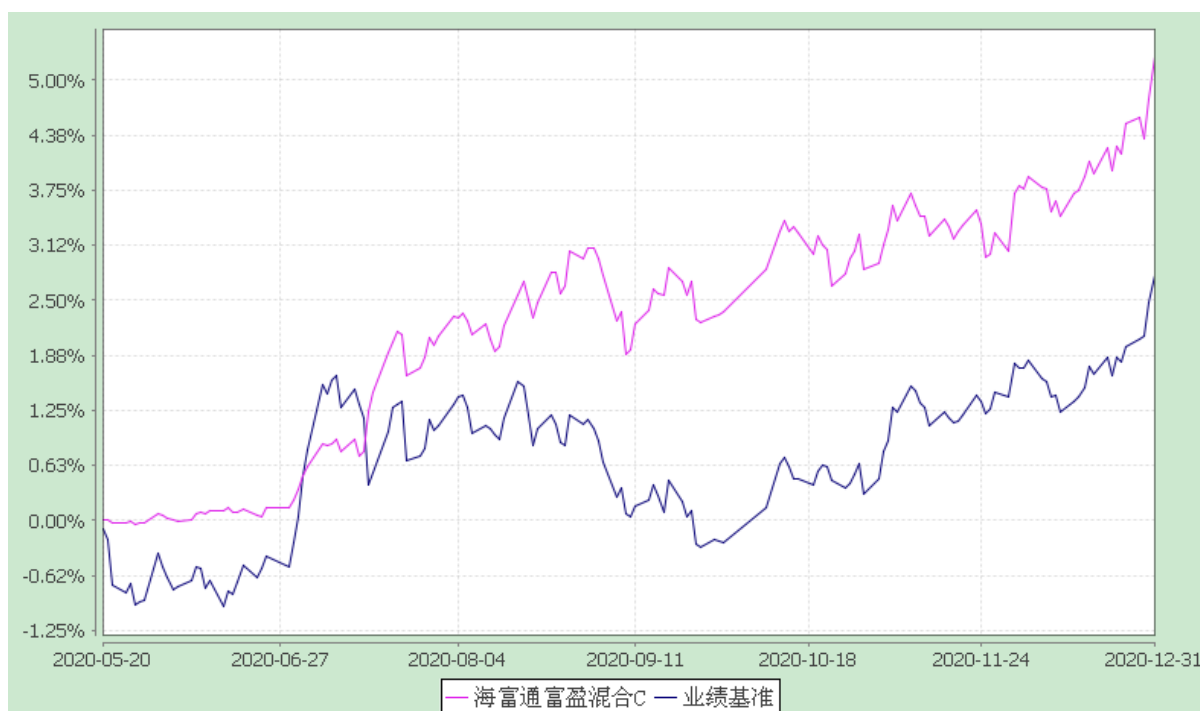
1. 海富通富盈混合 A

(2020 年 5 月 20 日至 2020 年 12 月 31 日)



2. 海富通富盈混合 C

(2020 年 5 月 20 日至 2020 年 12 月 31 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。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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；海富通安益对冲混合基金经理；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

	通创业板增强基金经理；海富通富泽混合基金经理；海富通添鑫收益债券基金经理；海富通欣荣混合基金经理；海富通中证 500 增强基金经理；量化投资部总监。				年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月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。
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	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

	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。			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、海富通富祥混合及海富通瑞合纯债的基金经理。2019 年 10 月至 2020 年 11 月任海富通瑞丰债券基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。
--	---	--	--	---

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年四季度，全球继续从疫情冲击中渐进恢复，但进入冬季疫情形势仍有反复。中国疫情控制较好，国内出现的零星病例基本得到了较为有效的控制。海外疫情仍在蔓延，给全球经济复苏带来一定拖累，但货币与财政支持仍在延续，疫情再次爆发只是拖慢复苏节奏，但整体复苏趋势并未改变，全球经济仍在复苏通道之中。

中国经济继续修复，生产端工业增加值增速回升至疫情前水平，需求端修复深化，逆周期的房地产、基建投资力量在逐步撤出，顺周期的消费、制造业投资及出口接棒恢复。四季度各项经济数据逐步接近正常水平，决策层在继续推动货币、财政等各项托底政策转向正常化。中央经济工作会议定调要保持宏观政策的连续性、稳定性、可持续性，不急转弯，预计宏观政策回归常态的节奏将边走边看，不会操之过急。

随着宏观经济及企业盈利的恢复，四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 7.92%，沪深 300 上涨 13.60%，中证 800 上涨 11.00%，中小板指上涨 10.07%，创业板指上涨 15.21%。分行业看，中信一级行业中绝大部分上涨，其中有色金属、电力设备、食品饮料、汽车、家电涨幅居前，涨幅分别达到 29.44%、29.38%、25.61%、21.57% 和 21.53%，而综合金融、传媒、商贸零售、通信、房地产、建筑、综合跌幅较大，下跌幅度分别为-13.57%、-11.78%、-9.93%、-8.75%、-6.25%、-5.45% 和 -5.24%。从四季度 A 股内部的结构看，市场风格较为均衡，前两个月受益于经济逐步恢复的顺周期行业取得了不错的表现，包括有色金属、石油石化、煤炭、钢铁等；进入 12 月，机构重仓的新能源及新能源汽车、食品饮料等行业表现突出。

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。

2021 年 1 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 PPI 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第三季度的 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。

四季度, 本基金债券部分仍以中短久期、中高评级信用债为主。在利率相对高点增配长长期利率债和银行同业存单, 增厚了组合收益。

展望 2021 年一季度, 经济将继续处于复苏趋势中, 通胀大概率延续分化格局。国内经济复苏动能较强, 顺周期力量的制造业投资与可选消费仍具有向上的空间。地产投资在拿地量有所收紧的情况下或有所放缓但仍具有韧性; 基建投资难超预期但同样具有韧性。此外海外疫情有所恶化, 新冠疫苗的接种进度不及预期, 疫情对海外生产或继续造成扰动, 供需缺口下海外补库存需求仍将支撑一季度我国出口。政策方面, 近期货币政策例会提到“不急转弯”、“汇率稳定”、“巩固下降成果”, 或均指向短期稳货币为主; 财政政策大概率有所收紧但从力度到节奏或比较温和。因此一季度预计经济环比增速仍不弱, 在去年疫情“挖坑”下 GDP 同比增速将是年内高点, 而通胀方面 CPI 和 PPI 走势或继续分化。综上, 经济基本面的拐点尚未来临, 同时政策也未必很快退出, 债市或呈现震荡, 节前或有交易性机会。信用债方面, 政府信用扩张放缓, 地方政府腾挪能力将面临挑战。在信用紧缩之时, 债市风险偏好下行, 配债资金更多回流利率债及高等级信用债, 信用利差和等级利差将普遍走扩, 融资能力较弱的主体信用风险可能加速暴露。可转债方面, 春季行情或正在路上, 目前优质个券抱团依然较为明显, 在选择高景气度标的的同时也需考虑市场仓位较高带来的可能的拥挤现象, 对于价格偏低的个券, 主要

的机会还是精选正股以期平价上涨消化估值。行业方面，中短期看顺周期品种逻辑仍在，另一方面关注业绩估值匹配且有明确催化的科技消费类进行适当平衡。

2021 年一季度，本基金债券部分配置以高等级信用债为主，以求获得稳定较高票息收益。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，海富通富盈混合 A 净值增长率为 2.94%，同期业绩比较基准收益率为 3.05%，基金净值跑输业绩比较基准 0.11 个百分点。海富通富盈混合 C 净值增长率为 2.83%，同期业绩比较基准收益率为 3.05%，基金净值跑输业绩比较基准 0.22 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	338,744,596.47	24.04
	其中：股票	338,744,596.47	24.04
2	固定收益投资	1,006,079,310.76	71.39
	其中：债券	1,006,079,310.76	71.39
	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	38,160,566.65	2.71
7	其他资产	26,228,688.72	1.86
8	合计	1,409,213,162.60	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	8,378,673.00	0.68
C	制造业	242,068,079.36	19.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,525,288.00	0.21
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,990,320.56	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	1,122,873.88	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,139,809.16	0.91
J	金融业	46,296,928.00	3.76
K	房地产业	10,839,036.14	0.88
L	租赁和商务服务业	797,220.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	2,607,662.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	149,928.30	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	3,252,303.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	1,509,199.27	0.12
S	综合	-	-
	合计	334,677,320.67	27.20

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	1,897,275.38	0.15
金融	1,875,089.76	0.15
医疗保健	294,910.66	0.02
合计	4,067,275.80	0.33

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	379,200	16,665,840.00	1.35
2	600519	贵州茅台	8,200	16,383,600.00	1.33
3	601318	中国平安	153,000	13,307,940.00	1.08
4	600031	三一重工	329,300	11,518,914.00	0.94
5	000333	美的集团	103,700	10,208,228.00	0.83
6	000858	五粮液	32,800	9,572,680.00	0.78
7	000568	泸州老窖	39,100	8,842,856.00	0.72
8	603218	日月股份	301,951	8,444,768.41	0.69
9	601012	隆基股份	88,036	8,116,919.20	0.66
10	600486	扬农化工	58,800	7,761,600.00	0.63

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	29,618,000.00	2.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	89,078,000.00	7.24
	其中：政策性金融债	89,078,000.00	7.24
4	企业债券	411,245,000.00	33.42
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	271,765,000.00	22.08
7	可转债（可交换债）	58,080,310.76	4.72
8	同业存单	146,293,000.00	11.89
9	其他	-	-
10	合计	1,006,079,310.76	81.76

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	155058	18 京能 01	600,000	60,426,000.00	4.91
2	200206	20 国开 06	600,000	59,748,000.00	4.86
3	101900773	19 外高桥 MTN002	500,000	50,565,000.00	4.11
4	101901035	19 中电投 MTN014A	500,000	50,250,000.00	4.08
5	112962	19 深建 01	500,000	50,200,000.00	4.08

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
IF2103	IF2103	-34.00	-53,158,320.0 0	-6,787,255.87	-
IH2103	IH2103	-10.00	-10,910,400.0 0	-1,238,880.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-8,026,135.8 7
股指期货投资本期收益(元)					-64,158.10
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-11,885,724. 84

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20民生银行CD126（112015126）的发行人，因未按规定履行客户身份识别义务、保存客户身份资料和交易记录、报送大额交易报告和可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易，于2020年2月10日被中国人民银行处罚罚款人民币2360万元。因违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资、为“四证”不全的房地产项目提供融资等多项行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》、《中华人民共和国商业银行法》，于2020年7月14日被中国银行保险监督管理委员会处罚没收违法所得296.47万元，罚款10486.47万元，罚没合计10782.94万元。因未按照规定进行审核，未按规定进行尽职调查，未按规定以适当方式监督债务人按照其申明的用途使用担保项下资金和未按规定对跨境担保交易的背景进行尽职调查，于2020年9月30日被外管局泉州市中心支局处以罚款800万元，没收违法所得304.10万元。

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。

报告期内本基金投资的20浦发银行CD030（112009030）的发行人因未按专营部门制规定开展同业业务，同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目，为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保，未按规定进行贷款资金支付管理与控制，通过票据转贴现业务调节信贷规模，办理无真实贸易背景的贴现业务，未按权限和程序办理委托贷款业务等违规行为，于2020年8月10日被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正、并处以罚款2100万元。

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。

其余八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	7,917,409.41
2	应收证券清算款	4,186,321.87
3	应收股利	-
4	应收利息	13,486,656.09
5	应收申购款	638,301.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,228,688.72

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	3,563,000.00	0.29
2	113014	林洋转债	3,370,342.50	0.27
3	110034	九州转债	3,134,375.20	0.25
4	132009	17 中油 EB	3,118,719.10	0.25
5	110045	海澜转债	2,907,600.00	0.24
6	127012	招路转债	2,489,238.81	0.20
7	110033	国贸转债	2,314,455.00	0.19
8	110064	建工转债	2,170,303.20	0.18
9	113017	吉视转债	2,103,007.50	0.17
10	113532	海环转债	2,067,580.80	0.17

11	132007	16 凤凰 EB	2,059,800.00	0.17
12	113505	杭电转债	1,972,000.00	0.16
13	110048	福能转债	1,712,976.00	0.14
14	128044	岭南转债	1,690,222.60	0.14
15	110068	龙净转债	1,338,740.00	0.11
16	113508	新风转债	1,132,500.00	0.09
17	127016	鲁泰转债	1,124,966.88	0.09
18	110041	蒙电转债	1,090,900.00	0.09
19	128037	岩土转债	1,059,960.00	0.09
20	113024	核建转债	1,004,751.00	0.08
21	113012	骆驼转债	991,890.00	0.08
22	128064	司尔转债	969,790.40	0.08
23	128087	孚日转债	952,122.50	0.08
24	113519	长久转债	941,876.10	0.08
25	113030	东风转债	737,798.50	0.06
26	127013	创维转债	697,620.00	0.06
27	113525	台华转债	672,936.00	0.05
28	128081	海亮转债	631,288.05	0.05
29	113026	核能转债	517,050.00	0.04
30	113530	大丰转债	494,550.00	0.04
31	110038	济川转债	490,116.50	0.04
32	128107	交科转债	484,182.32	0.04
33	123004	铁汉转债	367,273.71	0.03
34	113564	天目转债	365,070.00	0.03
35	113534	鼎胜转债	330,480.00	0.03
36	128083	新北转债	317,910.00	0.03
37	113021	中信转债	315,630.00	0.03
38	110052	贵广转债	303,450.00	0.02
39	128071	合兴转债	223,800.00	0.02
40	132004	15 国盛 EB	201,640.00	0.02
41	110051	中天转债	119,240.00	0.01

42	110047	山鹰转债	106,830.00	0.01
43	128101	联创转债	106,410.00	0.01
44	128018	时达转债	102,380.00	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	603218	日月股份	8,220,918.41	0.67	非公开定增

§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	925,302,785.64	1,192,967,333.62
本报告期基金总申购份额	3,391,028.06	128,773,023.34
减：本报告期基金总赎回份额	420,389,063.83	662,262,032.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	508,304,749.87	659,478,324.42

§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 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
二〇二一年一月二十二日