

海富通富泽混合型证券投资基金
2020 年年度报告
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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年三月三十一日

§ 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。本年度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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 29 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。

本报告期自 2020 年 6 月 22 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
4.9 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.....	20
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	21
§6 审计报告	21
6.1 审计意见.....	21
6.2 形成审计意见的基础.....	21
6.3 其他信息.....	21
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任.....	22
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任.....	22
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	27
§8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况.....	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	58
8.3 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.....	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
8.6 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	67
8.7 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	67
8.8 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	68
8.9 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	68
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	69
§9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
9.3 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	72
§10 开放式基金份额变动	72
§11 重大事件揭示	73
11.1 基金份额持有人大会决议	73
11.2 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	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	75
12 影响投资者决策的其他重要信息	78
§13 备查文件目录	79
13.1 备查文件目录	79
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通富泽混合型证券投资基金	
基金简称	海富通富泽混合	
基金主代码	009156	
交易代码	009156	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 6 月 22 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,489,041,898.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
下属分级基金的交易代码	009156	009157
报告期末下属分级基金的份 额总额	1,022,189,480.03 份	466,852,418.21 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制下跌风险的前提下,通过量化选股和主动债券投资相结合的投资策略,力争实现战胜业绩比较基准的目标,追求资产净值的长期稳健增值。
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。本基金投资策略还包括债券投资组合策略、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。
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。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	胡波
	联系电话	021-38650788	021-61618888
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95528
传真		021-33830166	021-63602540
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	上海市中山东一路12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	上海市北京东路689号
邮政编码		200120	200001
法定代表人		杨仓兵	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com

基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
注册登记机构	海富通基金管理有限公司	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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2020年6月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
本期已实现收益	16,015,839.33	7,388,485.07
本期利润	34,549,700.75	15,917,563.34
加权平均基金份额本期利润	0.0471	0.0449
本期加权平均净值利润率	4.61%	4.40%
本期基金份额净值增长率	4.58%	4.36%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末	
	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
期末可供分配利润	25,163,418.02	10,489,149.55
期末可供分配基金份额利润	0.0246	0.0225
期末基金资产净值	1,069,015,363.84	487,220,409.28
期末基金份额净值	1.0458	1.0436
3.1.3 累计期末指标	2020年末	
	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
基金份额累计净值增长率	4.58%	4.36%

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)。

4、本基金合同生效日为 2020 年 6 月 22 日,合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

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

1. 海富通富泽混合 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
过去三个月	2.73%	0.16%	3.27%	0.18%	-0.54%	-0.02%
过去六个月	4.60%	0.19%	3.47%	0.22%	1.13%	-0.03%
自基金合同生效起至今	4.58%	0.18%	3.75%	0.22%	0.83%	-0.04%

2. 海富通富泽混合 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
过去三个月	2.63%	0.15%	3.27%	0.18%	-0.64%	-0.03%
过去六个月	4.39%	0.19%	3.47%	0.22%	0.92%	-0.03%
自基金合同生效起至今	4.36%	0.18%	3.75%	0.22%	0.61%	-0.04%

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

海富通富泽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

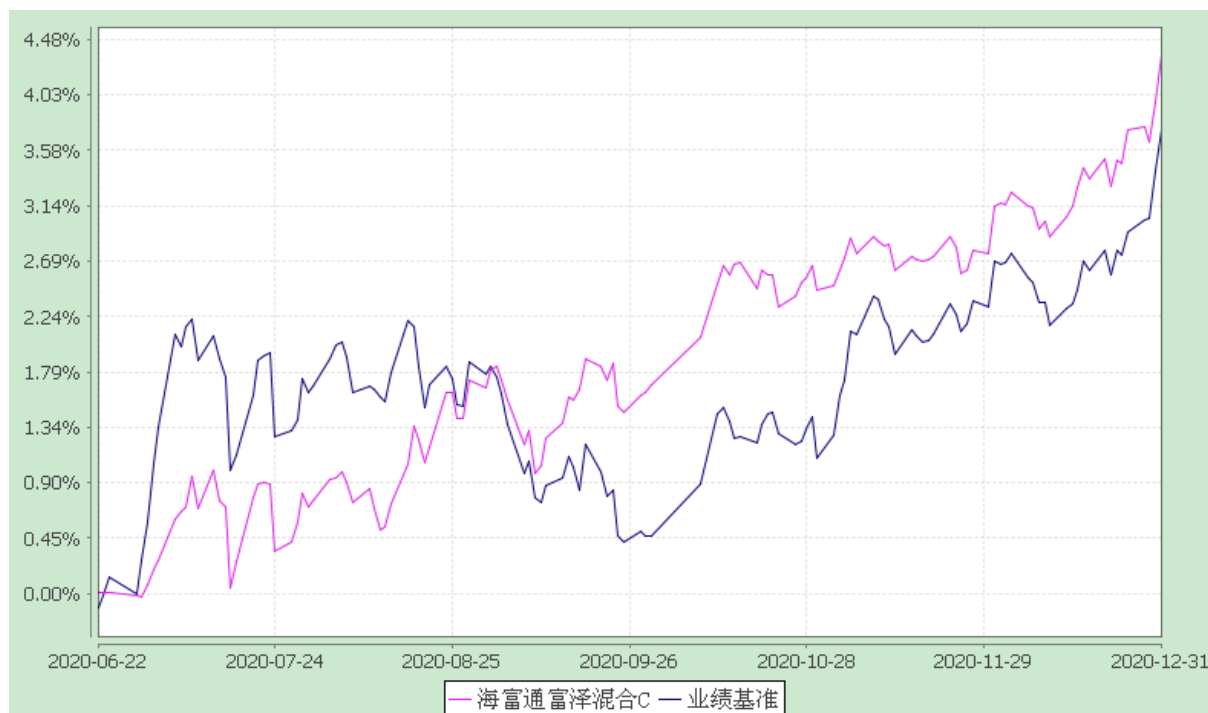
1. 海富通富泽混合 A

(2020 年 6 月 22 日至 2020 年 12 月 31 日)



2. 海富通富泽混合 C

(2020 年 6 月 22 日至 2020 年 12 月 31 日)



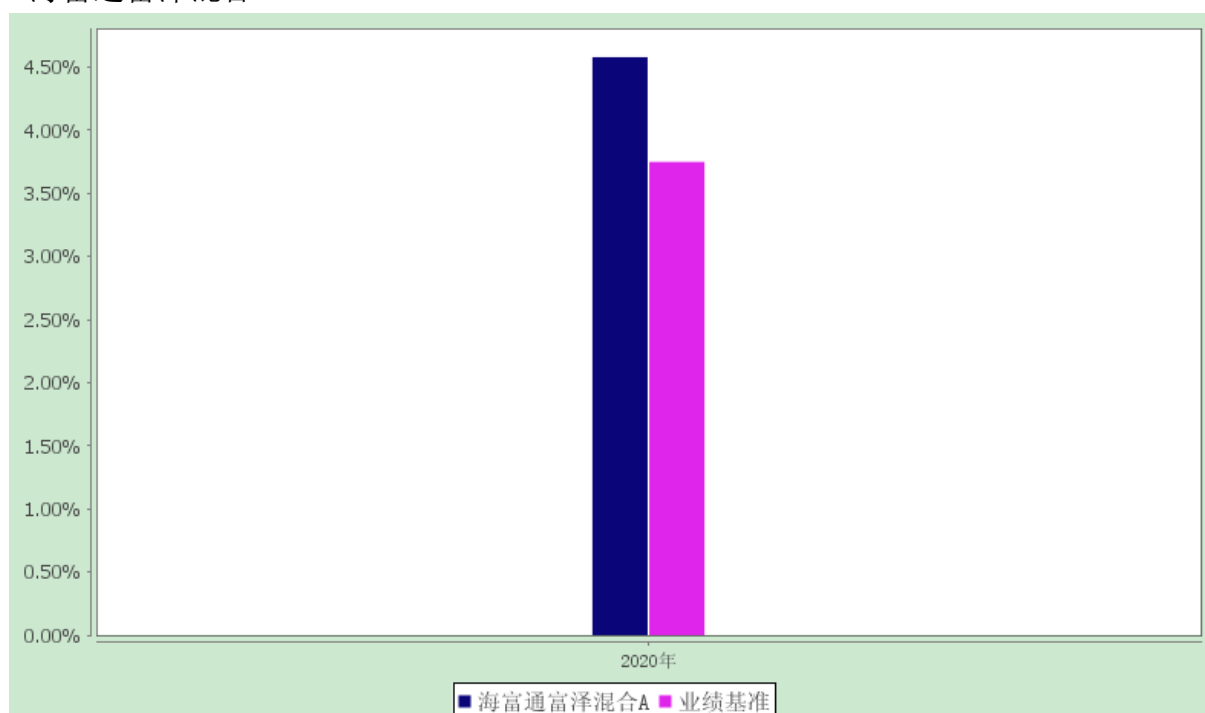
注：1、本基金合同于 2020 年 6 月 22 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

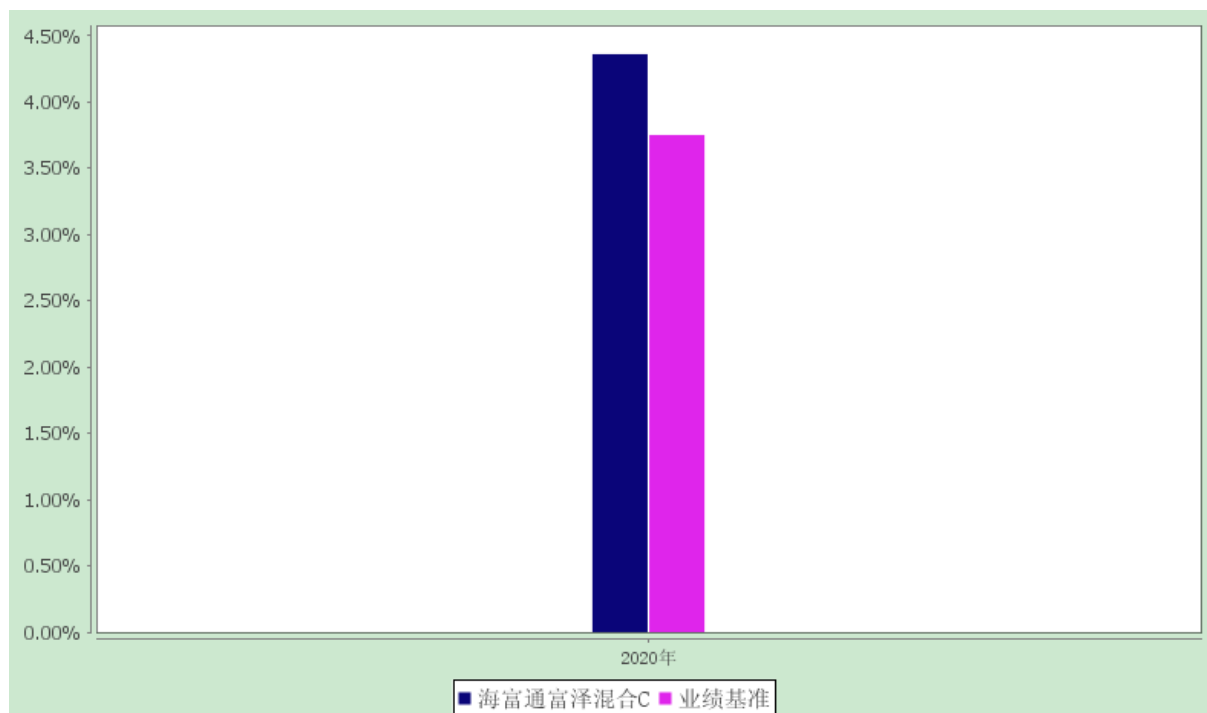
海富通富泽混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1. 海富通富泽混合 A



2. 海富通富泽混合 C



注：图中列示的 2020 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 6 月 22 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、海富通富泽混合 A：

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

2、海富通富泽混合 C：

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金合同于 2020 年 6 月 22 日生效，过去一年未发生利润分配。

§ 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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 81 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、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

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、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值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	2020-06-22	-	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

	富盈混合基金经理；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。				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。
张靖爽	本基金的基金经理；海富通裕通 30 个月定开债券的基金经理；海富通聚合	2020-06-22	-	10 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中银基金管理有限公司研究员，交银施罗德基金管理有限公司投资经理、基金经理助理、研究员。2016 年 7 月至 2017 年 10 月任海富通双利债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定期开放债

	纯债基金 基金经理； 海富通 融丰定 开债券 基金经 理；海富 通瑞福 债券基 金经理； 海富通 瑞祥一 年定开 债券基 金经理； 海富通 新内需 混合基 金经理； 海富通 裕昇三 年定开 债券基 金经理； 海富通 瑞弘 6 个 月定开 债券基 金经理。			券基金经 理。2016 年 11 月至 2019 年 11 月兼任海 富通纯债债券基金经 理。2017 年 8 月起兼任海富通 瑞福一年定开债券（现为 海富通瑞福债券）和海富 通瑞祥一年定开债券基 金经理。2018 年 2 月起兼任 海富通融丰定开债券基 金经理。2018 年 11 月至 2020 年 10 月任海富通鼎丰定 开债券基金经 理。2019 年 5 月起兼任海富通新内需 混合基金经 理。2019 年 10 月起兼任海富通聚合纯债 基金经 理。2019 年 12 月 起兼任海富通裕通 30 个 月定开债券基 金经 理。2020 年 4 月起兼任海富通 裕昇三年定开债券基 金经 理。2020 年 5 月起兼任海 富通瑞弘 6 个月定开债券 基金经 理。2020 年 6 月起 兼任海富通富泽混合基金 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：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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了一级市场和二级市场的所有投资交易管理活动以及公司内部的证券分配，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、

业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 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 1 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。

4.3.3 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

回顾 2020 年，A 股市场不但经受住了突发疫情的冲击，而且经受住了特朗普政府对华摩擦带来的外部冲击。二季度之后，在经济基本面率先回升与政策面呵护之下，成为全球主要股市中表现最亮眼的市场之一。具体来看，沪深 300 指数、科创 50 指数、中小板指、创业板指等主要指数当年涨幅分别达到 27.21%、39.30%、43.91%、64.96%。

就行业表现而言，28 个申万一级行业表现两极分化显著。全年涨幅居于前五位的行业分别是休闲服务、电气设备、食品饮料、国防军工和医药生物，全年涨幅均超过 50%。与之相比，房地产、通信、建筑装饰、纺织服装、银行等五个表现最差的行业全年跌幅 3%-10% 不等。全年行情的主线集中于消费和成长两个方向，既包括了以白酒、免税服务为代表的消费升级板块，也包括了新能源车、光伏、CXO 与创新药、半导体与 5G 等中国经济转型升级的板块。而传统经济集中的相关行业除大炼化等少数细分领域之外，虽然也有过脉冲式的上涨，但是总体表现低迷。与结构性牛市相伴的是 A 股 4000 多支股票在 2020 年超过一半是下跌或者持平的。

从业绩的角度来看，跌幅居于前五位的行业当中，除通信和纺织服装之外的其余三个行业万得一致预期的行业利润增速都是下滑的。而行业盈利增速预期前五位的行业除电气设备之外，不论是传统经济的有色金属、农林牧渔、机械设备，还是偏成长的计算

机，均未进入年度涨幅前五位。

与二级市场不断走高相应的则是热络的一级市场。在推行股票发行注册制的环境下，从万得统计数据来看，全年 A 股市场的权益融资规模，包括 IPO、再融资、优先股、可转债等合计超过 1.6 万亿元，仅次于 2016 年和 2015 年。截至 2020 年年底，沪深两市的股票数量突破了 4000 支。沪深两市总市值接近 80 万亿元，与当年 GDP 的比值接近 0.8。

本报告期，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。

债券方面，从经济基本面来看，受到新冠疫情影响，国内 GDP 增速在一季度砸下深坑，同比下降 6.8%，随后三个季度经济迅速修复，全年 GDP 增速为 2.3%。国内经济恢复的主要动力由年初的房地产与基建投资转向下半年的出口以及消费，1-12 月工业增加值、固定资产投资累计同比分别上升 2.8%、2.9%，社会消费品零售总额累计同比下跌 3.9% 但跌幅收窄，进出口方面 20 年贸易顺差 5350 亿美元，对经济的拉动较为明显。

通胀方面表现分化，CPI 总体走弱，同比由 1 月的 5.4% 回落至 12 月的 0.2%；而 PPI 同比在 5 月见底后逐月回暖，12 月同比下降 0.4%。

货币政策方面，1-4 月为对冲新冠疫情对国内经济造成的剧烈影响，央行两次调降逆回购操作利率和 MLF 利率累计达 30BP，并调降超储利率至 0.35%；5-10 月随着经济逐步企稳，货币政策回归中性；年末以“永煤”为代表的信用事件频发，货币政策的边际上有所放松。在上述情况下，2020 年债市呈现一波三折由牛转熊的格局。

债券市场整体来看，2020 年 10 年期国债收益率累计上行 0.64BP，1 年期国债收益率累计上行 11BP。信用债方面，受到疫情和违约影响，2020 年的信用债市场同样呈现大起大落的态势，收益率先下后上。四季度华晨汽车、永煤等信用风险事件使得中低等级走扩幅度更大。

本组合在 2020 年参与利率债和高等级信用债的投资，在保持合理流动性的基础上，积极运用中长久期利率债获取 beta 收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通富泽混合 A 净值增长率为 4.58%，同期业绩比较基准收益率为 3.75%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.83 个百分点。海富通富泽混合 C 净值增长率为 4.36%，同期业绩比较基准收益率为 3.75%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.61 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 2021 年，随着全球主要经济体财政与货币刺激政策的落地，疫苗接种率的不断提升，疫情的外部冲击的边际钝化，经济回升的方向是比较确定的。而 2020 年以来，从农产品到石油以外的矿产品出现的广泛价格上升将抬升全球的 PPI 和 CPI。若不再出现加深全球结构对立与冲突的因素，那么 2021 年的宏观环境将会是偏暖的。

映射到 A 股市场, 实体经济的回升和外部环境的缓和可能对于全市场的盈利增速和估值中枢带来正好相反的影响。对于盈利增速, 存量部分的传统经济由负转正是大概率, 这就决定了全年的利润增速同比上行的趋势。而对于估值部分则可能正好相反, 边际流动性持续宽松的概率非常小, 那么由其带来的估值扩张也基本到头。由此带来的结构性行情将更多地是由企业季度经营业绩的逐季连续变化来决定, 即哪些细分行业的龙头公司能够保持经营业绩的逐季提升与扩张, 哪些公司的股价表现则会更坚挺。那些需要把 2025 年乃至 2030 年的市场空间与市占率预期折现到当前的公司, 股价可能存在着估值消化的压力。

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。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, 展望 2021 年, 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。在疫苗逐步开始接种的情况下, 经济将继续处于复苏趋势中, CPI 中枢下移, PPI 重新回正。

政策方面, 年初货币政策例会提到“不急转弯”、“汇率稳定”, 或均指向稳货币为主, 经济基本面的拐点尚未来临, 政策也未必很快退出, 债市或呈现震荡。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020 年, 基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则, 通过业务审核、现场检查、系统监控、人员访谈、重点抽查等一系列方式开展工作, 强化基金运作和公司运营的合规性, 督促业务部门不断改进内部控制和风险管理, 并按规定定期出具监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内, 本基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面:

一、持续完善公司的规章制度, 健全内部控制体系, 落实内控责任。

根据法律法规和监管政策的发展和变化以及股东方针对公司内部风险管理的要求, 自上而下地推动了内部控制机制的梳理和完善工作, 组织各部门对多项内部制度和流程进行了更新, 健全了公司内部控制制度体系, 强化了各项内控职责, 提升了公司内部控制环境建设, 为公司各项业务合规开展提供有效的制度保障, 为基金持有人利益最大化提供有力的保障。

二、加强对公司和基金日常运作的合规管理。

本报告期内, 坚持以法律法规和公司管理制度为依据, 对公司和基金日常运作的各项业务实施事前、事中、事后的合规性审核, 对新产品和新业务进行合规性审核, 确保了基金运作的诚信和合法合规性。此外, 督察稽核部根据法规、监管要求并结合公司内部控制的需要, 对公司各部门的业务有重点的开展了多项专项检查和内部审计, 对检查中发现的问题向公司经营管理层汇报, 并跟踪落实各项问题的整改情况, 严格控制了各部门的主要风险, 加强并完善公司的内部控制状况。同时, 根据法规、股东方等要求,

公司聘请会计师事务所、律师事务所等对公司内部控制管理、合规有效性、反洗钱风险等开展了专项评估。通过事前、事中、事后的全方位合规审核及内部审计，公司对治理结构、投资交易、销售及客户服务体系、信息安全控制、基金运营控制、分支机构管理及人力资源管理等方面的内部规章制度和各项业务流程予以了完善，强化了现有规章制度的执行力度。

三、有效推进反洗钱工作。

本报告期内，结合反洗钱法规及公司业务特点，完善了反洗钱制度及流程，组织多场反洗钱专项培训和考试；重点开展全面的直销客户信息核查清理工作，对于直销投资者身份信息资料不完整、不准确、未在合理期限内补充完善的客户予以限制交易；梳理高风险业务清单并更新业务流程，针对机构洗钱风险评估发现的问题进行整改和优化；稳步推进代销模式洗钱风险管理工作，督促代销机构签署反洗钱补充协议；牵头持续对反洗钱系统进行升级改造，强化对大额交易和可疑交易方面的监控，并按时向中国反洗钱监测分析中心报送相关数据。报告期内，公司根据监管要求完成了 2019 年度的反洗钱分类评级自评工作。

四、加强投资者教育，培养投资者风险意识和投资理念。

本报告期内，公司为鼓励投资者进行长期投资，持续不断的和投资者进行沟通，并利用网络互动平台、主流媒体专栏及举办投资者交流会等多种渠道、多种媒介积极推进投资者教育工作，努力倡导“长期持有、理性投资”的投资理念，培养广大投资者的风险意识、切实加强保护了广大基金持有人的合法权益。

五、强化法规学习，组织开展内外部培训，提升员工的合规及风险意识。

本报告期内，为提高公司全员的合规意识，进一步加强组织各类合规培训频率，及时将新颁布的各项法律法规进行解读和落实，并组织全体员工开展各类内外部培训，剖析风险案例，培训内容包括新法规政策落实、监管精神传达、投资交易、市场销售业务、信息技术管理、廉洁从业管理、宣传推介合规管理、员工行为管理、反洗钱、子公司资管业务合规风险等方面，并通过结合内部考试系统多次组织了线上培训及在线考试。通过培训，增强了员工的合规意识和风险防范意识，提升了员工的主动识别和控制业务风险的积极性和能力。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金财产安全、合规、诚信运作。

4.7 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，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、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。估值委员会对经济环境发生重大变化或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，提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金运营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。

4.8 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，基金收益分配后份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

4.9 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对海富通富泽混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《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、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对海富通富泽混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由海富通富泽混合型证券投资基金编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

毕马威华振审字第 2100159 号

海富通富泽混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了后附的海富通富泽混合型证券投资基金（以下简称“海富通富泽混合基金”）财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2020 年 6 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了海富通富泽混合基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2020 年 6 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果及和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于海富通富泽混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

海富通富泽混合基金管理人海富通基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括海富通富泽混合基金 2020 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形

式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估海富通富泽混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非海富通富泽混合基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督海富通富泽混合基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对海富通富泽混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致海富通富泽混合基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师
 王国蓓 倪益
 北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
 2021 年 3 月 29 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通富泽混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-
银行存款	7.4.7.1	12,615,015.83
结算备付金	7.4.10.6	67,835,210.86
存出保证金		2,060,151.10
交易性金融资产	7.4.7.2	1,323,962,348.27
其中：股票投资		289,592,238.15

基金投资		-
债券投资		1,024,337,110.12
资产支持证券投资		10,033,000.00
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	133,290,697.74
应收证券清算款		3,543,155.26
应收利息	7.4.7.5	13,112,020.88
应收股利		-
应收申购款		45,482,246.54
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,601,900,846.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
负 债:		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		22,900,000.00
应付证券清算款		9,561,554.84
应付赎回款		11,494,685.25
应付管理人报酬		1,012,610.39
应付托管费		253,152.61
应付销售服务费		143,226.63
应付交易费用	7.4.7.7	132,903.73
应交税费		33,016.74
应付利息		1,486.07
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	132,437.10
负债合计		45,665,073.36
所有者权益:		-
实收基金	7.4.7.9	1,489,041,898.24

未分配利润	7.4.7.10	67,193,874.88
所有者权益合计		1,556,235,773.12
负债和所有者权益总计		1,601,900,846.48

注：1、报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,489,041,898.24 份。其中海富通富泽混合基金 A 类基金份额总额 1,022,189,480.03 份，基金份额净值 1.0458 元，海富通富泽混合基金 C 类基金份额总额 466,852,418.21 份，基金份额净值 1.0436 元。

2、基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.2 利润表

会计主体：海富通富泽混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 6 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2020 年 6 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		57,907,622.00
1.利息收入		15,136,310.13
其中：存款利息收入	7.4.7.11	693,164.26
债券利息收入		11,111,532.82
资产支持证券利息收入		28,659.02
买入返售金融资产收入		3,302,954.03
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,227,632.41
其中：股票投资收益	7.4.7.12	15,586,567.60
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-726,442.39
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-610,760.39
股利收益	7.4.7.16	978,267.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	27,062,939.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	480,739.77

减：二、费用		7,440,357.91
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,634,014.08
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,158,503.50
3. 销售服务费		755,756.02
4. 交易费用	7.4.7.19	437,229.19
5. 利息支出		284,690.18
其中：卖出回购金融资产支出		284,690.18
6. 税金及附加		21,817.76
7. 其他费用	7.4.7.20	148,347.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		50,467,264.09
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		50,467,264.09

注：财务报表的实际编制期间为 2020 年 6 月 22 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日，上年度可比期间无比较数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通富泽混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 6 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2020 年 6 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 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）	903,461,549.19	-	903,461,549.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	50,467,264.09	50,467,264.09
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）	585,580,349.05	16,726,610.79	602,306,959.84
其中：1.基金申购款	1,112,776,447.92	30,254,855.24	1,143,031,303.16

2.基金赎回款	-527,196,098.87	-13,528,244.45	-540,724,343.32
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）	1,489,041,898.24	67,193,874.88	1,556,235,773.12

注：基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海富通富泽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[2020]126 号《关于准予海富通富泽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《海富通富泽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，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 903,252,947.38 元，其中海富通富泽混合 A 为人民币 570,320,022.61 元，海富通富泽混合 C 为人民币 332,932,924.77 元。经向中国证监会备案，《海富通富泽混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 6 月 22 日正式生效，基金合同生效日的海富通富泽混合 A 基金份额总额为 570,462,800.39 份，其中认购资金利息折合 142,777.78 份基金份额，海富通富泽混合 C 基金份额总额为 332,998,748.80 份，其中认购资金利息折合 65,824.03 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《海富通富泽混合型证券投资基金基金合同》及《海富通富泽混合型证券投资基金基金招募说明书》的有关规定，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《海富通富泽混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融

资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、同业存单、股指期货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。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产及存托凭证的比例占基金资产的比例为 0%-40%,投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%,投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%;每个交易日日终,扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金业绩比较基准为:中债-综合全价(总值)指数收益率 \times 80%+沪深 300 指数收益率 \times 15%+恒生指数收益率(经汇率调整) \times 5%。

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 2021 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况、自 2020 年 6 月 22 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2020 年 6 月 22 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具（主要为股指期货投资）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。
- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。
- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如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，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益(主要为股指期货投资)按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业或兑付机构代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、资产支持证券、衍生工具(主要为股指期货投资)等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较

小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《海富通富泽混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金各类份额默认的收益分配方式是现金分红；本基金不同份额类别基金份额，其分红相互独立、互不影响；投资者不同基金交易账户设置的基金分红相互独立、互不影响；若《海富通富泽混合型证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术

进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 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[2014]81号文《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]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：

(a) 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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 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。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(d) 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。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	12,615,015.83
定期存款	-

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	12,615,015.83

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	259,247,745.43	289,592,238.15	30,344,492.72	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	250,796,469.92	248,733,110.12	-2,063,359.80
	银行间市场	774,657,313.78	775,604,000.00	946,686.22
	合计	1,025,453,783.70	1,024,337,110.12	-1,116,673.58
资产支持证券	10,000,199.45	10,033,000.00	32,800.55	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,294,701,728.58	1,323,962,348.27	29,260,619.69	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	-13,437,120.00	-	-	-
其中：股指期货	-13,437,120.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	-13,437,120.00	-	-	-
----	----------------	---	---	---

1.于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货情况：持有卖出 IF2103 合约市值 -15,634,800.00 元，公允价值变动-2,197,680.00 元。

2.按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	14,800,000.00	-
银行间市场	118,490,697.74	-
合计	133,290,697.74	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	5,478.97
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	20,916.30
应收债券利息	13,004,132.00
应收资产支持证券利息	30,316.71
应收买入返售证券利息	49,308.02
应收申购款利息	1,800.00
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	68.88
合计	13,112,020.88

7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	125,167.27
银行间市场应付交易费用	7,736.46
合计	132,903.73

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,437.10
预提费用	130,000.00
合计	132,437.10

7.4.7.9 实收基金

海富通富泽混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年6月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	570,462,800.39	570,462,800.39
本期申购	680,500,959.23	680,500,959.23
本期赎回（以“-”号填列）	-228,774,279.59	-228,774,279.59
本期末	1,022,189,480.03	1,022,189,480.03

海富通富泽混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年6月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	332,998,748.80	332,998,748.80
本期申购	432,275,488.69	432,275,488.69
本期赎回（以“-”号填列）	-298,421,819.28	-298,421,819.28
本期末	466,852,418.21	466,852,418.21

注：1、本基金自 2020 年 6 月 8 日至 2020 年 6 月 17 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 903,252,947.38 元，折合为 903,252,947.38 份基金份额(其中 A 类基金份额 570,320,022.61 份，C 类基金份额 332,932,924.77 份)。根据《海富通富泽混合型证券投资基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 208,601.81 元在本基金成立后，折合为 208,601.81 份基金份额(其中 A 类基金份额 142,777.78 份，C 类基金份额 65,824.03 份)，划入基金份额持有人账户。

2、根据《海富通富泽混合型证券投资基金招募说明书》、《海富通富泽混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告》相关规定，本基金于 2020 年 6 月 22 日(基金合同生效日)至 2020 年 9 月 20 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回、转换、定投业务自 2020 年 9 月 21 日起开始办理。

3、此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

海富通富泽混合 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
本期利润	16,015,839.33	18,533,861.42	34,549,700.75
本期基金份额交易产生的变动数	9,147,578.69	3,128,604.37	12,276,183.06
其中：基金申购款	13,845,129.54	5,242,210.14	19,087,339.68
基金赎回款	-4,697,550.85	-2,113,605.77	-6,811,156.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,163,418.02	21,662,465.79	46,825,883.81

海富通富泽混合 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
本期利润	7,388,485.07	8,529,078.27	15,917,563.34
本期基金份额交易产生的变动数	3,100,664.48	1,349,763.25	4,450,427.73
其中：基金申购款	7,659,074.33	3,508,441.23	11,167,515.56
基金赎回款	-4,558,409.85	-2,158,677.98	-6,717,087.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,489,149.55	9,878,841.52	20,367,991.07

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年6月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	272,459.86
定期存款利息收入	161,000.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	246,391.76
其他	13,312.64
合计	693,164.26

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年6月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	72,182,223.13
减：卖出股票成本总额	56,595,655.53
买卖股票差价收入	15,586,567.60

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年6月22日（基金合同生效日）至2020年12

	月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	515,268,831.72
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	512,321,425.97
减：应收利息总额	3,673,848.14
买卖债券差价收入	-726,442.39

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年6月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股指期货投资收益（税前）	-599,880.00
股指期货差价收入应缴纳增值税额	-10,880.39
合计	-610,760.39

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年6月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	978,267.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	978,267.59

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年6月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1.交易性金融资产	29,260,619.69
——股票投资	30,344,492.72

——债券投资	-1,116,673.58
——资产支持证券投资	32,800.55
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-2,197,680.00
——权证投资	-
——股指期货	-2,197,680.00
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	27,062,939.69

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年6月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	480,268.80
基金转换费收入	253.96
其他	217.01
合计	480,739.77

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年6月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	428,479.19
银行间市场交易费用	8,750.00
合计	437,229.19

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年6月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日

审计费用	60,000.00
信息披露费	70,000.00
债券托管账户维护费	6,000.00
其他	200.00
银行划款手续费	12,063.96
证券组合费	83.22
合计	148,347.18

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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、登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	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、基金销售机构
法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东
上海富诚海富通资产管理有限公司	基金管理人的子公司
海富通资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司

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，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年6月22日(基金合同生效日)至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	371,103,167.80	100.00%

注：基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易，基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.1.3 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6月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣 金总量的 比例	期末应付佣金余 额	占期末应付 佣金总额的 比例
海通证券	269,081.01	100.00%	125,167.27	100.00%

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、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用海通证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从海通证券获得研究综合服务。

3. 基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年6月22日（基金合同生效日）至2020年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,634,014.08
其中：支付销售机构的客户维护 费	1,971,206.56

注：1、支付基金管理人海富通基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

2、基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年6月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,158,503.50

注：1、支付基金托管人上海浦东发展银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

2、基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.2.3 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6月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C	合计
浦发银行	-	438,946.17	438,946.17
海通证券	-	906.20	906.20
海富通	-	199,505.31	199,505.31
合计	-	639,357.68	639,357.68

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

海富通富泽混合 C 类基金日基金销售服务费=前一日 C 类份额对应的基金资产净值×0.40%/ 当年天数。

2、基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易，基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务，基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.4.2 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

本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务，基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内未持有过本基金，基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.5.2 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金，基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.6 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6月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
浦发银行	12,615,015.83	272,459.86

注：本基金通过“上海浦东发展银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2020 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 67,835,210.86 元。基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.7 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

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2020年6月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
				基金在承销期内买入 数量(单位： 股/张)	总金额
海通证券	300879	大叶股份	公开发行	4,660	49,302.80
海通证券	688301	奕瑞科技	公开发行	2,427	290,269.20
海通证券	688521	芯原股份	公开发行	13,200	508,596.00
海通证券	688536	思瑞浦	公开发行	3,566	412,621.86
海通证券	688550	瑞联新材	公开发行	2,539	288,735.08

注：基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内无须作说明的其他关联交易事项，基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
000538	云南白药	2020-11-10	2021-05-10	大宗交易	94.68	108.10	43,000	4,071,240.00	4,648,300.00	-
000661	长春高新	2020-12-23	2021-06-23	大宗交易	418.86	414.80	5,000	2,094,300.00	2,074,000.00	-
002532	天山铝业	2020-12-23	2021-06-24	非公开发行流通受限	6.55	6.95	152,672	1,000,001.60	1,061,070.40	-
002602	世纪华通	2020-07-09	2021-01-11	大宗交易	15.51	7.03	312,000	4,032,600.00	2,193,360.00	2
002938	鹏鼎控股	2020-07-30	2021-02-01	大宗交易	45.80	48.82	45,000	2,061,000.00	2,196,900.00	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-

				市						
300607	拓斯达	2020-07-02	2021-01-04	大宗交易	36.06	34.60	110,000	3,966,600.00	3,806,000.00	-
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	新股锁定	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300867	圣元环保	2020-08-12	2021-03-03	新股锁定	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	-
300868	杰美特	2020-08-12	2021-02-24	新股锁定	41.26	43.28	593	24,467.18	25,665.04	-
300872	天阳科技	2020-08-14	2021-02-25	新股锁定	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64	-
300873	海晨股份	2020-08-14	2021-03-02	新股锁定	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300876	蒙泰高新	2020-08-14	2021-02-25	新股锁定	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300877	金春股份	2020-08-17	2021-03-03	新股锁定	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300878	维康药业	2020-08-17	2021-03-03	新股锁定	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300879	大叶股份	2020-08-25	2021-03-01	新股锁定	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	新股锁定	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300882	万胜智能	2020-08-27	2021-03-10	新股锁定	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300884	狄耐克	2020-11-05	2021-05-12	新股锁定	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	新股锁定	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300887	谱尼测试	2020-09-09	2021-03-16	新股锁定	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300889	爱克股份	2020-09-09	2021-03-16	新股锁定	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020-09-10	2021-03-18	新股锁定	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	新股锁定	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020-09-11	2021-03-30	新股锁定	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300893	松原股份	2020-09-17	2021-03-24	新股锁定	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300894	火星	2020-12-24	2021-07-01	新股锁定	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-

300895	铜牛信息	2020-09-17	2021-03-24	新股锁定	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	新股锁定	118.27	603.36	350	41,394.50	211,176.00	-
300898	熊猫乳品	2020-10-09	2021-04-16	新股锁定	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300908	仲景食品	2020-11-13	2021-05-24	新股锁定	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300909	汇创达	2020-11-11	2021-05-18	新股锁定	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300917	特发服务	2020-12-14	2021-06-21	新股锁定	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	新股锁定	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300922	天秦装备	2020-12-18	2021-06-25	新股锁定	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股未上市并锁定	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300999	金龙鱼	2020-09-29	2021-04-15	新股锁定	25.70	88.29	5,360	137,752.00	473,234.40	-
600563	法拉电子	2020-12-30	2021-06-30	大宗交易	94.70	99.41	32,000	3,030,400.00	3,181,120.00	-
600989	宝丰能源	2020-11-12	2021-05-12	大宗交易	9.74	11.09	210,000	2,045,400.00	2,328,900.00	-
603218	日月股份	2020-08-26	2021-02-26	大宗交易	17.73	28.66	120,000	2,127,600.00	3,439,200.00	-
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688063	派能科技	2020-12-22	2021-06-30	新股锁定	56.00	189.24	5,499	307,944.00	1,040,630.76	-
688221	前沿生物	2020-10-20	2021-04-28	新股锁定	20.50	17.15	16,148	331,034.00	276,938.20	-
688551	科威尔	2020-09-01	2021-03-10	新股锁定	37.94	33.34	2,211	83,885.34	73,714.74	-

688559	海目星	2020-08-28	2021-03-09	新股锁定	14.56	30.97	5,924	86,253.44	183,466.28	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-01-07	新股未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688699	明微电子	2020-12-10	2021-06-18	新股锁定	38.43	45.27	1,869	71,825.67	84,609.63	-
7.4.12.1.2 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
113616	韦尔转债	2020-12-28	2021-01-22	老股东配债	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.00	-

注：1、根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算，在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金持有的上市公司非公开发行股份，减持采取集中竞价交易方式或采取大宗交易方式的根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由法规规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

2、[002602]世纪华通于 2020 年 7 月 9 日大宗交易买入数量 260,000 股，成本 4,032,600.00 元；于 2020 年 7 月 13 日送股，数量 52,000 股。因此总数量 312,000 股，总成本 4,032,600.00 元。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2020 年 12 月 31 日，本基金无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 22,900,000.00 元，于 2021 年 1 月 4 日到期。该类交易要

求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对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“相对收益高、风险适中”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，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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 12 月 31 日，本基金持有除国债、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 44.00%。

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。

7.4.13.2.1 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12月31日
A-1	9,974,000.00
A-1 以下	-
未评级	71,628,435.00
合计	81,602,435.00

注：未评级债券为国债。基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	254,611,000.00
合计	254,611,000.00

注：基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.2.3 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12月31日
AAA	274,491,831.00
AAA 以下	135,688,044.12
未评级	277,943,800.00
合计	688,123,675.12

注：未评级债券为国债及政策性金融债。基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日
AAA	10,033,000.00
AAA 以下	-
未评级	-
合计	10,033,000.00

注：基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.3 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 12 月 31 日，除卖出回购金融资产余额中有人民币 22,900,000.00 元将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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公司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上述比例限制）。

本基金所持的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 7.4.12。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 12 月 31 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 2.44%。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分权益类金融资产和金融负债不计息，该部分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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种存在相应的利率风险，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,615,015.83	-	-	-	12,615,015.83
结算备付金	67,835,210.86	-	-	-	67,835,210.86
存出保证金	2,060,151.10	-	-	-	2,060,151.10
交易性金融资产	352,296,235.00	657,657,711.50	24,416,163.62	289,592,238.15	1,323,962,348.27
买入返售金融资产	133,290,697.74	-	-	-	133,290,697.74
应收证券清算款	-	-	-	3,543,155.26	3,543,155.26
应收利息	-	-	-	13,112,020.88	13,112,020.88
应收申购款	20,000,000.00	-	-	25,482,246.54	45,482,246.54
资产总计	588,097,310.53	657,657,711.50	24,416,163.62	331,729,660.83	1,601,900,846.48
负债					
卖出回购金融资产款	22,900,000.00	-	-	-	22,900,000.00
应付证券清算款	-	-	-	9,561,554.84	9,561,554.84
应付赎回款	-	-	-	11,494,685.25	11,494,685.25
应付管理人报酬	-	-	-	1,012,610.39	1,012,610.39
应付托管费	-	-	-	253,152.61	253,152.61
应付销售服务费	-	-	-	143,226.63	143,226.63
应付交易费用	-	-	-	132,903.73	132,903.73

应交税费	-	-	-	33,016.74	33,016.74
应付利息	-	-	-	1,486.07	1,486.07
其他负债	-	-	-	132,437.10	132,437.10
负债总计	22,900,000.00	-	-	22,765,073.36	45,665,073.36
利率敏感度缺口	565,197,310.53	657,657,711.50	24,416,163.62	308,964,587.47	1,556,235,773.12

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。基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2020年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-4,806,394.25
	市场利率下降 25 个基点	4,851,417.57

注：基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	9,966,465.21	9,966,465.21
资产合计	-	9,966,465.21	9,966,465.21
以外币计价			

的负债			
应付证券清算款	-	1,197,801.24	1,197,801.24
负债合计	-	1,197,801.24	1,197,801.24
资产负债表外汇风险敞口净额	-	8,768,663.97	8,768,663.97

注：基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他变量不变	
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 12 月 31 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	438,433.20
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-438,433.20

注：基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，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，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其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	289,592,238.15	18.61
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	-	-
合计	289,592,238.15	18.61

注：基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)
		本期末 2020年12月31日
	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	13,779,795.46
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-13,779,795.46

注：基金合同成立于 2020 年 6 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

下文列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 267,070,994.73 元，属于第二层次的余额为人民币 1,056,891,353.54 元，无属于第三层次的余额。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调

整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§8 投资组合报告

8.1 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	289,592,238.15	18.08
	其中：股票	289,592,238.15	18.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,034,370,110.12	64.57
	其中：债券	1,024,337,110.12	63.95
	资产支持证券	10,033,000.00	0.63
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	133,290,697.74	8.32
	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	80,450,226.69	5.02
8	其他各项资产	64,197,573.78	4.01
9	合计	1,601,900,846.48	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	5,181,587.20	0.33
C	制造业	195,907,088.06	12.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,146,232.00	0.59
E	建筑业	630,069.00	0.04
F	批发和零售业	2,911,891.24	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	851,758.88	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,002,242.06	0.58
J	金融业	37,372,560.00	2.40
K	房地产业	10,896,351.14	0.70
L	租赁和商务服务业	2,090,475.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	1,814,096.20	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	62,972.16	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,428,942.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	2,329,508.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	279,625,772.94	17.97

8.2.2 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（%）
信息传输、软件和信息技术服务业	1,973,123.98	0.13
金融业	7,403,519.92	0.48
卫生和社会工作	589,821.31	0.04
合计	9,966,465.21	0.64

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

8.3 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	5,700	11,388,600.00	0.73
2	601318	中国平安	113,700	9,889,626.00	0.64
3	600036	招商银行	214,700	9,436,065.00	0.61
4	000333	美的集团	89,200	8,780,848.00	0.56
5	000538	云南白药	68,700	7,567,820.00	0.49
6	600031	三一重工	188,200	6,583,236.00	0.42
7	000661	长春高新	14,900	6,518,209.00	0.42
8	600486	扬农化工	48,600	6,415,200.00	0.41
9	600887	伊利股份	136,500	6,056,505.00	0.39
10	002475	立讯精密	101,400	5,690,568.00	0.37
11	600741	华域汽车	189,800	5,470,036.00	0.35
12	601966	玲珑轮胎	155,155	5,456,801.35	0.35
13	601012	隆基股份	57,800	5,329,160.00	0.34
14	601166	兴业银行	247,000	5,154,890.00	0.33
15	600900	长江电力	261,000	5,000,760.00	0.32
16	002311	海大集团	75,486	4,944,333.00	0.32
17	600438	通威股份	127,900	4,916,476.00	0.32
18	600048	保利地产	300,700	4,757,074.00	0.31
19	600521	华海药业	137,410	4,645,832.10	0.30
20	600563	法拉电子	45,000	4,579,270.00	0.29
21	600585	海螺水泥	88,500	4,568,370.00	0.29
22	01336	新华保险	164,400	4,185,559.88	0.27
23	000568	泸州老窖	17,200	3,889,952.00	0.25
24	600690	海尔智家	131,800	3,849,878.00	0.25
25	300760	迈瑞医疗	9,000	3,834,000.00	0.25
26	300607	拓斯达	110,200	3,812,950.00	0.25
27	002142	宁波银行	106,200	3,753,108.00	0.24
28	002415	海康威视	75,200	3,647,952.00	0.23
29	603218	日月股份	126,200	3,626,750.00	0.23
30	000001	平安银行	187,300	3,622,382.00	0.23
31	002332	仙琚制药	250,100	3,341,336.00	0.21
32	000157	中联重科	321,000	3,177,900.00	0.20
33	000002	万科 A	108,400	3,111,080.00	0.20
34	002938	鹏鼎控股	56,900	2,787,973.00	0.18
35	300014	亿纬锂能	34,100	2,779,150.00	0.18
36	000338	潍柴动力	173,000	2,731,670.00	0.18
37	002602	世纪华通	367,200	2,585,832.00	0.17
38	600989	宝丰能源	210,000	2,328,900.00	0.15
39	300316	晶盛机电	75,500	2,271,040.00	0.15
40	600176	中国巨石	111,500	2,225,540.00	0.14
41	601225	陕西煤业	235,000	2,194,900.00	0.14

42	002241	歌尔股份	57,000	2,127,240.00	0.14
43	600803	新奥股份	150,000	2,038,500.00	0.13
44	06030	中信证券	138,000	2,030,237.67	0.13
45	002557	洽洽食品	36,800	1,981,680.00	0.13
46	00700	腾讯控股	4,000	1,898,739.84	0.12
47	600570	恒生电子	17,700	1,856,730.00	0.12
48	600406	国电南瑞	69,800	1,854,586.00	0.12
49	601899	紫金矿业	191,700	1,780,893.00	0.11
50	000895	双汇发展	37,700	1,769,638.00	0.11
51	000739	普洛药业	75,200	1,750,656.00	0.11
52	600309	万华化学	19,000	1,729,760.00	0.11
53	603883	老百姓	27,380	1,720,285.40	0.11
54	000651	格力电器	27,300	1,690,962.00	0.11
55	000513	丽珠集团	40,800	1,652,400.00	0.11
56	601398	工商银行	327,800	1,635,722.00	0.11
57	603259	药明康德	11,100	1,495,392.00	0.10
58	300144	宋城演艺	82,100	1,454,812.00	0.09
59	000858	五粮液	4,900	1,430,065.00	0.09
60	601888	中国中免	5,000	1,412,250.00	0.09
61	300146	汤臣倍健	57,300	1,383,795.00	0.09
62	600461	洪城水业	198,400	1,341,184.00	0.09
63	000656	金科股份	181,800	1,288,962.00	0.08
64	600383	金地集团	94,400	1,274,400.00	0.08
65	000786	北新建材	31,100	1,245,555.00	0.08
66	600030	中信证券	40,900	1,202,460.00	0.08
67	03908	中金公司	67,200	1,187,722.37	0.08
68	600872	中炬高新	17,700	1,179,705.00	0.08
69	300122	智飞生物	7,900	1,168,489.00	0.08
70	002493	荣盛石化	40,600	1,120,966.00	0.07
71	002430	杭氧股份	38,300	1,114,147.00	0.07
72	002271	东方雨虹	28,200	1,094,160.00	0.07
73	600276	恒瑞医药	9,700	1,081,162.00	0.07
74	002532	天山铝业	152,672	1,061,070.40	0.07
75	300059	东方财富	34,000	1,054,000.00	0.07
76	688063	派能科技	5,499	1,040,630.76	0.07
77	601877	正泰电器	26,053	1,020,235.48	0.07
78	601636	旗滨集团	76,600	980,480.00	0.06
79	000725	京东方 A	159,800	958,800.00	0.06
80	601088	中国神华	53,100	956,331.00	0.06
81	600917	重庆燃气	139,000	953,540.00	0.06
82	000598	兴蓉环境	196,800	944,640.00	0.06
83	600522	中天科技	87,000	943,080.00	0.06
84	002258	利尔化学	44,800	936,320.00	0.06
85	002039	黔源电力	58,800	906,108.00	0.06

86	300454	深信服	3,600	892,836.00	0.06
87	000100	TCL 科技	124,000	877,920.00	0.06
88	002600	领益智造	69,600	834,504.00	0.05
89	300347	泰格医药	5,000	808,050.00	0.05
90	600373	中文传媒	78,000	787,020.00	0.05
91	002624	完美世界	25,850	762,575.00	0.05
92	601939	建设银行	118,700	745,436.00	0.05
93	603538	美诺华	20,000	742,600.00	0.05
94	002001	新和成	18,800	633,184.00	0.04
95	002081	金螳螂	67,100	630,069.00	0.04
96	603678	火炬电子	8,700	629,010.00	0.04
97	000581	威孚高科	26,600	616,854.00	0.04
98	01066	威高股份	40,000	589,821.31	0.04
99	002727	一心堂	17,700	589,587.00	0.04
100	002008	大族激光	12,500	534,375.00	0.03
101	002304	洋河股份	2,200	519,178.00	0.03
102	002028	思源电气	25,500	511,530.00	0.03
103	002242	九阳股份	15,300	490,212.00	0.03
104	300999	金龙鱼	5,360	473,234.40	0.03
105	002541	鸿路钢构	12,800	467,584.00	0.03
106	300037	新宙邦	4,600	466,440.00	0.03
107	300408	三环集团	12,500	465,625.00	0.03
108	603501	韦尔股份	2,000	462,200.00	0.03
109	601211	国泰君安	26,300	461,039.00	0.03
110	002444	巨星科技	14,800	460,428.00	0.03
111	002968	新大正	9,200	455,860.00	0.03
112	002127	南极电商	33,200	454,176.00	0.03
113	002384	东山精密	17,200	447,200.00	0.03
114	601688	华泰证券	23,200	417,832.00	0.03
115	000877	天山股份	27,600	416,760.00	0.03
116	603882	金域医学	3,000	384,360.00	0.02
117	600580	卧龙电驱	24,100	375,960.00	0.02
118	001965	招商公路	52,100	358,969.00	0.02
119	300750	宁德时代	900	315,999.00	0.02
120	002511	中顺洁柔	15,000	313,050.00	0.02
121	000915	山大华特	13,200	308,748.00	0.02
122	002967	广电计量	8,000	293,200.00	0.02
123	600009	上海机场	3,800	287,508.00	0.02
124	688221	前沿生物	16,148	276,938.20	0.02
125	603658	安图生物	1,900	275,842.00	0.02
126	300073	当升科技	4,200	272,370.00	0.02
127	603129	春风动力	1,500	261,285.00	0.02
128	300525	博思软件	8,800	252,560.00	0.02
129	600346	恒力石化	9,000	251,730.00	0.02

130	603987	康德莱	16,000	251,040.00	0.02
131	002318	久立特材	23,000	250,700.00	0.02
132	601233	桐昆股份	11,800	242,962.00	0.02
133	300244	迪安诊断	6,900	236,532.00	0.02
134	002064	华峰氨纶	23,400	236,106.00	0.02
135	600426	华鲁恒升	6,300	234,990.00	0.02
136	000063	中兴通讯	6,900	232,185.00	0.01
137	603416	信捷电气	2,500	227,100.00	0.01
138	600507	方大特钢	32,400	224,856.00	0.01
139	002027	分众传媒	22,700	224,049.00	0.01
140	603700	宁水集团	7,600	221,692.00	0.01
141	603601	再升科技	16,100	219,765.00	0.01
142	600988	赤峰黄金	11,900	213,129.00	0.01
143	300896	爱美客	350	211,176.00	0.01
144	300451	创业慧康	15,500	209,715.00	0.01
145	002138	顺络电子	8,500	208,420.00	0.01
146	300575	中旗股份	5,300	203,520.00	0.01
147	300572	安车检测	4,900	200,312.00	0.01
148	002179	中航光电	2,400	187,896.00	0.01
149	002352	顺丰控股	2,100	185,283.00	0.01
150	688559	海目星	5,924	183,466.28	0.01
151	300253	卫宁健康	10,300	180,250.00	0.01
152	002821	凯莱英	600	179,484.00	0.01
153	603368	柳药股份	8,300	178,782.00	0.01
154	000830	鲁西化工	13,800	176,364.00	0.01
155	000708	中信特钢	8,000	174,320.00	0.01
156	002643	万润股份	7,800	169,806.00	0.01
157	300383	光环新网	9,745	167,321.65	0.01
158	000977	浪潮信息	5,948	159,882.24	0.01
159	300737	科顺股份	7,200	154,512.00	0.01
160	601222	林洋能源	18,800	148,896.00	0.01
161	600885	宏发股份	2,700	146,394.00	0.01
162	600183	生益科技	5,000	140,800.00	0.01
163	603233	大参林	1,700	133,195.00	0.01
164	600998	九州通	7,300	132,568.00	0.01
165	002705	新宝股份	3,100	130,975.00	0.01
166	002262	恩华药业	8,100	129,357.00	0.01
167	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.01
168	000951	中国重汽	3,900	122,694.00	0.01
169	603583	捷昌驱动	1,440	111,240.00	0.01
170	002507	涪陵榨菜	2,600	109,980.00	0.01
171	300577	开润股份	4,100	106,928.00	0.01
172	300193	佳士科技	14,600	105,266.00	0.01
173	603939	益丰药房	1,100	99,209.00	0.01

174	002223	鱼跃医疗	3,500	98,735.00	0.01
175	300639	凯普生物	2,600	97,708.00	0.01
176	300136	信维通信	2,700	96,876.00	0.01
177	002273	水晶光电	8,300	96,197.00	0.01
178	300003	乐普医疗	3,500	95,130.00	0.01
179	002831	裕同科技	2,900	88,798.00	0.01
180	601098	中南传媒	9,200	87,676.00	0.01
181	000425	徐工机械	16,200	86,994.00	0.01
182	603444	吉比特	200	85,200.00	0.01
183	688699	明微电子	1,869	84,609.63	0.01
184	002080	中材科技	3,300	79,794.00	0.01
185	300702	天宇股份	800	74,800.00	0.00
186	03690	美团点评-W	300	74,384.14	0.00
187	688551	科威尔	2,211	73,714.74	0.00
188	002595	豪迈科技	2,400	71,160.00	0.00
189	600529	山东药玻	1,200	60,180.00	0.00
190	300114	中航电测	3,800	56,810.00	0.00
191	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.00
192	300776	帝尔激光	300	45,060.00	0.00
193	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
194	000975	银泰黄金	4,220	36,334.20	0.00
195	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
196	002697	红旗连锁	4,400	29,084.00	0.00
197	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
198	300877	金春股份	569	28,933.65	0.00
199	300868	杰美特	593	25,665.04	0.00
200	300894	火星人	628	23,217.16	0.00
201	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
202	002014	永新股份	2,000	19,620.00	0.00
203	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
204	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
205	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
206	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
207	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
208	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
209	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
210	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
211	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
212	002459	晶澳科技	400	16,288.00	0.00
213	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
214	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
215	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
216	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
217	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00

218	003020	立方制药	374	12,858.12	0.00
219	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
220	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
221	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
222	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
223	603018	华设集团	900	9,855.00	0.00
224	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
225	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
226	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
227	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
228	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
229	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
230	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
231	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
232	300036	超图软件	300	5,532.00	0.00

注：根据浙江华峰氨纶股份有限公司于 2021 年 1 月 4 日发布的《关于公司名称及经营范围变更完成的公告》，经公司申请，并经深圳证券交易所核准，公司证券简称于 2021 年 1 月 4 日起由“华峰氨纶”变更为“华峰化学”，证券代码不变，仍为“002064”。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	9,402,257.69	0.60
2	601318	中国平安	9,170,608.00	0.59
3	600036	招商银行	7,789,873.00	0.50
4	000333	美的集团	7,661,428.79	0.49
5	000538	云南白药	6,715,766.44	0.43
6	600585	海螺水泥	6,104,012.00	0.39
7	000661	长春高新	6,058,644.00	0.39
8	600031	三一重工	5,995,487.00	0.39
9	600741	华域汽车	5,942,234.67	0.38
10	002311	海大集团	5,642,538.26	0.36
11	002475	立讯精密	5,439,401.50	0.35
12	600887	伊利股份	5,187,846.00	0.33
13	601398	工商银行	4,999,698.00	0.32
14	600900	长江电力	4,994,713.00	0.32
15	600521	华海药业	4,882,316.40	0.31

16	002602	世纪华通	4,789,968.00	0.31
17	600048	保利地产	4,687,066.00	0.30
18	01336	新华保险	4,559,862.10	0.29
19	601166	兴业银行	4,552,780.00	0.29
20	600563	法拉电子	4,240,305.48	0.27

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002001	新和成	3,744,023.00	0.24
2	601398	工商银行	3,225,940.03	0.21
3	600031	三一重工	2,996,232.00	0.19
4	601933	永辉超市	2,597,675.00	0.17
5	300999	金龙鱼	2,494,632.00	0.16
6	600845	宝信软件	2,231,310.86	0.14
7	601939	建设银行	2,224,998.00	0.14
8	688521	芯原股份	2,182,108.08	0.14
9	601668	中国建筑	1,943,235.00	0.12
10	000776	广发证券	1,909,134.00	0.12
11	000333	美的集团	1,702,264.00	0.11
12	000425	徐工机械	1,594,427.00	0.10
13	688608	恒玄科技	1,565,349.41	0.10
14	002697	红旗连锁	1,534,782.49	0.10
15	002938	鹏鼎控股	1,325,580.00	0.09
16	300866	安克创新	1,173,710.75	0.08
17	603259	药明康德	1,146,636.00	0.07
18	300896	爱美客	1,056,535.00	0.07
19	603218	日月股份	1,040,536.00	0.07
20	600585	海螺水泥	996,592.00	0.06

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。

8.4.3 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	319,016,319.36
卖出股票的收入(成交)总额	72,182,223.13

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。

8.5 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	131,688,435.00	8.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	258,023,800.00	16.58
	其中：政策性金融债	217,883,800.00	14.00
4	企业债券	171,194,000.00	11.00
5	企业短期融资券	9,974,000.00	0.64
6	中期票据	182,577,000.00	11.73
7	可转债（可交换债）	16,268,875.12	1.05
8	同业存单	254,611,000.00	16.36
9	其他	-	-
10	合计	1,024,337,110.12	65.82

8.6 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	200313	20 进出 13	1,700,000	171,428,000.00	11.02
2	112017275	20 光大银行 CD275	1,000,000	97,850,000.00	6.29
3	019627	20 国债 01	596,500	59,644,035.00	3.83
4	112072063	20 郑州银行 CD247	500,000	49,315,000.00	3.17
5	112012127	20 北京银行 CD127	400,000	39,128,000.00	2.51

8.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2089344	20 招银和	100,000	10,033,000.00	0.64

		智 2 优先 A1			
--	--	--------------	--	--	--

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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
IF2103	IF2103	-10.00	-15,634,800.00	-2,197,680.00	-
公允价值变动总额合计					-2,197,680.00
股指期货投资本期收益					-599,880.00
股指期货投资本期公允价值变动					-2,197,680.00

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。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金管理人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。符合既定投资政策及投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的 20 光大银行 CD275（112017275）的发行人因未按规定履行客户身份识别义务，未按规定保存客户身份资料和交易记录，未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告等违规行为，于 2020 年 2 月 10 日被中国人民银行处以罚款 1820 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 长沙银行 CD154（112089888）的发行人因为身份不明的开户申请人开立账户并提供账户身份信息验证服务，账户可疑交易监测不到位，线上正常开立的 II 类户中部分账户留存影像资料不完整，于 2020 年 2 月 18 日被中国人民银行长沙中心支行警告、并处以罚款 80 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，且该银行为地区中型银行，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 北京银行 CD127（112012127）的发行人，因在债务融资工具注册发行和后续管理期间尽职调查工作未遵循勤勉尽责原则、未保证调查质量，未对康得新参与现金管理业务的情况进行充分尽职调查并督导披露。未监测到康得新将募集资金划出体外的情况并督导披露募集资金用途变更信息，被中国银行间市场交易协会处以警告处分并暂停债务融资工具主承销相关业务 6 个月。此外，发行人因同业投资对资产转让业务承担回购义务，同业投资资产风险分类调整不及时、延缓风险暴露，收费管理政策执行不严、违规收取相关费用，个人贷款自主支付管理薄弱、贷款资金违规流入股市、房市，于 2020 年 7 月 11 日被北京银保监局责令改正，并给予合计 150 万元罚款的行政处罚；对相关责任人给予警告的行政处罚。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为地区中大型银行，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。

其余七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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	2,060,151.10

2	应收证券清算款	3,543,155.26
3	应收股利	-
4	应收利息	13,112,020.88
5	应收申购款	45,482,246.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,197,573.78

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	127012	招路转债	1,357,330.00	0.09
2	110064	建工转债	1,123,980.00	0.07
3	113014	林洋转债	963,585.00	0.06
4	113017	吉视转债	676,830.00	0.04
5	110033	国贸转债	647,400.00	0.04
6	113532	海环转债	593,280.00	0.04
7	113508	新风转债	566,250.00	0.04
8	110048	福能转债	562,000.00	0.04
9	110068	龙净转债	544,764.20	0.04
10	113505	杭电转债	525,538.00	0.03
11	113024	核建转债	497,301.00	0.03
12	128081	海亮转债	495,750.00	0.03
13	113564	天目转债	486,760.00	0.03
14	127013	创维转债	448,470.00	0.03
15	113525	台华转债	356,860.00	0.02
16	127016	鲁泰转债	352,886.22	0.02
17	128083	新北转债	317,910.00	0.02
18	113026	核能转债	310,230.00	0.02
19	110034	九州转债	233,560.00	0.02
20	128044	岭南转债	227,425.00	0.01
21	128071	合兴转债	223,800.00	0.01
22	123049	维尔转债	222,400.00	0.01
23	113030	东风转债	209,900.00	0.01
24	110038	济川转债	209,900.00	0.01
25	110052	贵广转债	202,300.00	0.01
26	113025	明泰转债	127,670.00	0.01

27	110051	中天转债	119,240.00	0.01
28	113034	滨化转债	116,830.00	0.01
29	110047	山鹰转债	106,830.00	0.01
30	113021	中信转债	105,210.00	0.01
31	128018	时达转债	102,380.00	0.01
32	113530	大丰转债	98,910.00	0.01
33	113519	长久转债	98,010.00	0.01
34	110045	海澜转债	96,920.00	0.01
35	128037	岩土转债	96,360.00	0.01
36	128087	孚日转债	23,222.50	0.00

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000538	云南白药	4,648,300.00	0.30	大宗交易
2	000661	长春高新	2,074,000.00	0.13	大宗交易

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
海富通富泽混合 A	7,180	142,366.22	23,399,632.63	2.29%	998,789,847.40	97.71%
海富通富泽混合 C	2,002	233,193.02	185,652,782.56	39.77%	281,199,635.65	60.23%
合计	9,182	162,169.67	209,052,415.19	14.04%	1,279,989,483.05	85.96%

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）。

9.2 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	海富通富泽混合 A	24,339.96	0.0024%
	海富通富泽混合 C	10.00	0.0000%
	合计	24,349.96	0.0016%

9.3 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	海富通富泽混合 A	0
	海富通富泽混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通富泽混合 A	0
	海富通富泽混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
基金合同生效日（2020 年 6 月 22 日）基金份额总额	570,462,800.39	332,998,748.80
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	680,500,959.23	432,275,488.69
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	228,774,279.59	298,421,819.28
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,022,189,480.03	466,852,418.21

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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、2020 年 7 月 25 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，分别聘请孙海忠先生、胡光涛先生担任公司副总经理职务。

4、2020 年 8 月 11 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四次会议审议通过，奚万荣先生不再担任公司督察长职务，并决定由公司董事长杨仓兵先生代为履行督察长职务，代为履行督察长职务的期限不超过 90 日。

5、2020 年 8 月 22 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四次会议审议通过，聘请岳冲先生担任公司督察长职务，公司董事长杨仓兵先生不再代行督察长职务。

6、2020 年 11 月 11 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二十七次临时会议审议通过，孙海忠先生不再担任公司副总经理职务。

7、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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内改聘毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所，并依法履行了公告手续。报告期内本基金应支付给所聘任会计师事务所的报酬为 60,000.00 元，该审计机构已为本基金提供审计服务的连续年限为 1 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	371,103,167.80	100.00%	269,081.01	100.00%	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

2、(1)交易单元的选择标准

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

(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，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会核准。

<2> 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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	256,658,729.37	100.00%	6,727,565,000.00	100.00%	-	-

11.8 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	海富通富泽混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-28
2	海富通基金管理有限公司关于海富通富泽混合型证券投资基金新增交通银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-05
3	海富通基金管理有限公司关于海富通富泽混合型证券投资基金新增销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-05
4	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-06
5	海富通基金管理有限公司关于海富通富泽混合型证券投资基金新增销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-09
6	海富通基金管理有限公司关于海富通富泽混合型证券投资基金新增销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-12
7	海富通基金管理有限公司关于海富通富泽混合型证券投资基金新增销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-16
8	海富通富泽混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-23
9	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-24
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中山证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-13
11	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员	中国证券报、基金管	2020-07-25

	人员变更的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
12	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-25
13	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-11
14	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-13
15	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-22
16	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-26
17	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-11
18	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-11
19	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-15
20	海富通富泽混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-16
21	海富通基金管理有限公司关于网上直销开通汇款交易业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-17
22	海富通基金管理有限公司关于进一步提请投资者及时提供或更新身份信息以免	中国证券报、基金管理人网站及中国证	2020-09-24

	影响业务办理的公告	监会基金电子披露网站	
23	海富通基金管理有限公司关于进一步提请投资者及时提供或更新身份信息以免影响业务办理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-10-24
24	海富通基金管理有限公司关于网上直销汇款交易业务开展费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-10-29
25	海富通基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-11
26	海富通基金管理有限公司 关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-18
27	海富通基金管理有限公司关于进一步提请投资者及时提供或更新身份信息以免影响业务办理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-01
28	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-01
29	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-05
30	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-24
31	海富通基金管理有限公司关于旗下基金获配天山铝业（002532）非公开发行 A 股的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-25
32	海富通基金管理有限公司关于海富通富泽混合型证券投资基金新增华金证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-30
33	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-31

		网站	
--	--	----	--

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 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”。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准设立海富通富泽混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通富泽混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通富泽混合型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通富泽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

13.2 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。

13.3 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
二〇二一年三月三十一日