

海富通欣荣灵活配置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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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 1 月 1 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	6
§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	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	20
§6 审计报告	20
6.1 审计意见	21
6.2 形成审计意见的基础	21
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	21
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	21
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表	23
7.2 利润表	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	27
§8 投资组合报告	59
8.1 期末基金资产组合情况	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60
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	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70

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	71
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	71
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	71
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	71
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	71
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12	投资组合报告附注	72
§9	基金份额持有人信息	73
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
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	74
§10	开放式基金份额变动	74
§11	重大事件揭示	74
11.1	基金份额持有人大会决议	74
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	74
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
11.4	基金投资策略的改变	75
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	75
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	75
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8	其他重大事件	77
12	影响投资者决策的其他重要信息	80
§13	备查文件目录	82
13.1	备查文件目录	82
13.2	存放地点	82
13.3	查阅方式	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	海富通欣荣混合	
基金主代码	519223	
交易代码	519223	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 22 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	286,355,537.17 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
下属分级基金的交易代码	519224	519223
报告期末下属分级基金的份 额总额	163,609,848.37 份	122,745,688.80 份

2.2 基金产品说明

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

	合理的债券组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 $\times 50\%$ + 中证全债指数收益率 $\times 50\%$
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	陆志俊
	联系电话	021-38650788	95559
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559
传真		021-33830166	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		杨仓兵	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金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	普华永道中天会计师事务所	上海市湖滨路 202 号普华永道

	(特殊普通合伙)	中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公 司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、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		2019 年		2018 年	
	海富通欣 荣混合 A	海富通欣 荣混合 C	海富通欣 荣混合 A	海富通欣 荣混合 C	海富通欣 荣混合 A	海富通欣 荣混合 C
本期已实现 收益	36,480,84 0.37	19,056,69 1.73	21,186,01 2.72	9,587,199. 15	-9,906,820 .52	-138.88
本期利润	105,983,1 47.00	51,409,94 9.83	59,225,93 4.91	19,611,33 9.32	-22,691,23 1.28	-34,093.67
加权平均基 金份额本期 利润	0.6273	0.5663	0.4205	0.4303	-0.1876	-0.3413
本期加权平 均净值利润 率	40.90%	36.35%	37.33%	35.81%	-18.57%	-32.36%
本期基金份 额净值增长 率	47.55%	47.26%	48.04%	48.41%	-16.79%	-16.45%
3.1.2 期末数据 和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
	海富通欣 荣混合 A	海富通欣 荣混合 C	海富通欣 荣混合 A	海富通欣 荣混合 C	海富通欣 荣混合 A	海富通欣 荣混合 C
期末可供分 配利润	54,244,07 6.53	40,663,32 0.41	19,739,50 4.55	11,430,24 4.82	-14,704,40 9.42	-4,017.12
期末可供分 配基金份额 利润	0.3315	0.3313	0.1212	0.1238	-0.1205	-0.1210
期末基金资 产净值	314,304,2 90.08	235,789,5 66.34	212,035,2 11.81	120,448,3 89.39	107,283,6 51.33	29,174.11

期末基金份额净值	1.9211	1.9210	1.3020	1.3045	0.8795	0.8790
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
基金份额累计净值增长率	92.11%	92.10%	30.20%	30.45%	-12.05%	-12.10%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 海富通欣荣混合 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.35%	0.98%	7.34%	0.50%	6.01%	0.48%
过去六个月	32.02%	1.22%	12.49%	0.69%	19.53%	0.53%
过去一年	47.55%	1.35%	15.06%	0.71%	32.49%	0.64%
过去三年	81.75%	1.22%	25.14%	0.66%	56.61%	0.56%
自基金合同生效起至今	92.11%	1.02%	36.87%	0.59%	55.24%	0.43%

2. 海富通欣荣混合 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④

过去三个月	13.29%	0.98%	7.34%	0.50%	5.95%	0.48%
过去六个月	31.88%	1.22%	12.49%	0.69%	19.39%	0.53%
过去一年	47.26%	1.35%	15.06%	0.71%	32.20%	0.64%
过去三年	82.59%	1.22%	25.14%	0.66%	57.45%	0.56%
自基金合同生效起至今	92.10%	1.02%	36.87%	0.59%	55.23%	0.43%

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

海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1. 海富通欣荣混合 A

(2016 年 9 月 22 日至 2020 年 12 月 31 日)



2. 海富通欣荣混合 C

(2016 年 9 月 22 日至 2020 年 12 月 31 日)



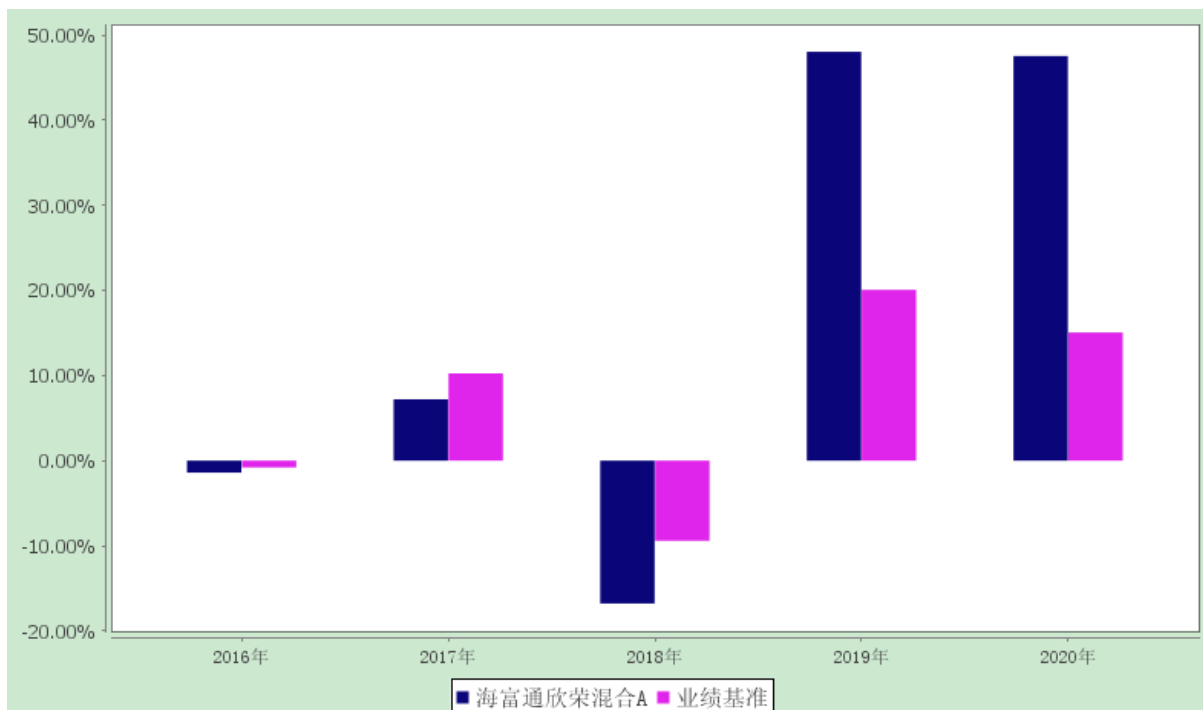
注：本基金合同于 2016 年 9 月 22 日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分(二) 投资范围、(四) 投资限制中规定的各项比例。

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

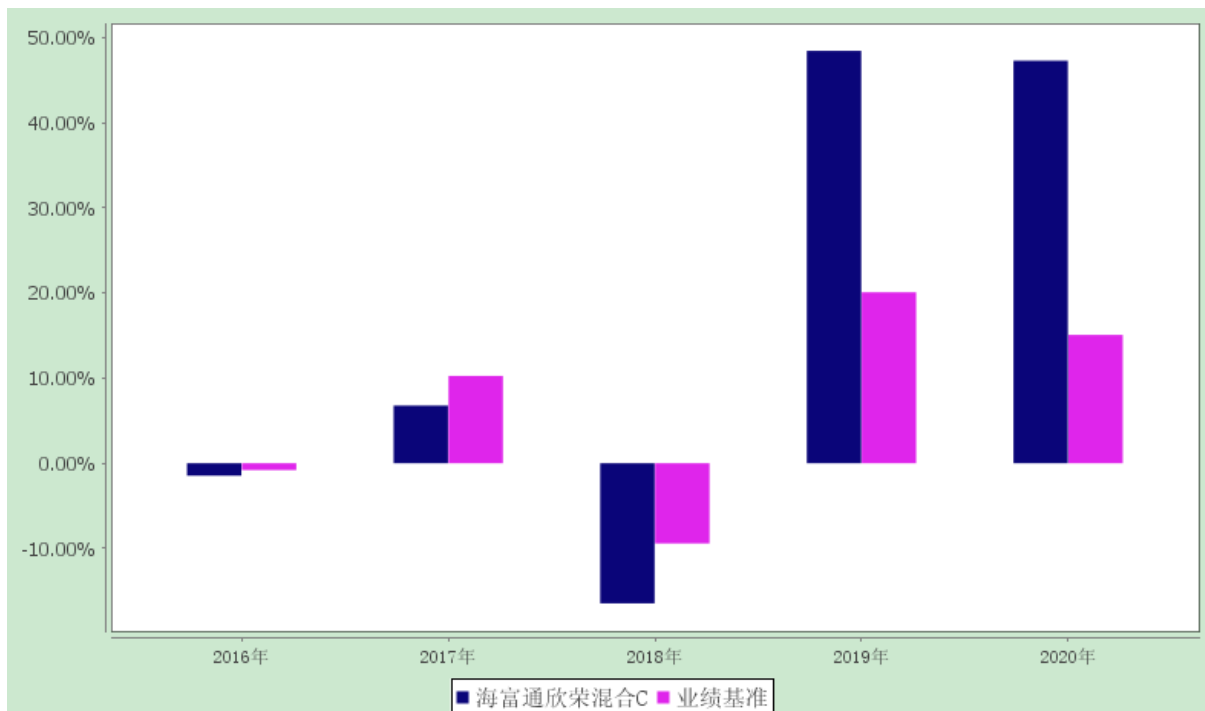
海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金

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. 海富通欣荣混合 A



2. 海富通欣荣混合 C



注：图中列示的 2016 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 9 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、海富通欣荣混合 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	-	-	-	-	-
2019 年	-	-	-	-	-
2018 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

2、海富通欣荣混合 C:

单位：人民币元

年度	每 10 份基	现金形式发放	再投资形式发放	年度利润分配	备注

	金份额分 红数	总额	总额	合计	
2020 年	-	-	-	-	-
2019 年	-	-	-	-	-
2018 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金过去三年未发生利润分配。

§ 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	2016-09-28	-	20 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通基金管理有限公司量化投资部总监。2016 年 6 月

	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；海富通中证 500 增强基金经理；量化投资部总监。				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。
谈云飞	本基金的基金	2016-09-22	2020-01-02	15 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 4 月至

	<p>经理；海富通货币基金经理；海富通季季通利理财债券基金经理；海富通季季增利基金经理；海富通聚利债券基金经理；海富通强化回报混合基金经理；海富通稳健添利债券基金经理；海富通欣享混合基金经理；海富通中短债债券基金经理。</p>			<p>2014 年 6 月就职于华宝兴业基金管理有限公司，曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2014 年 7 月至 2015 年 10 月任海富通现金管理货币基金经理。2014 年 9 月至 2020 年 9 月任海富通季季增利理财债券基金经理。2015 年 1 月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015 年 4 月至 2020 年 1 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 2 月起兼任海富通货币基金经理。2016 年 4 月至 2017 年 6 月兼任海富通纯债债券、海富通双福债券（原海富通双福分级债券）、海富通双利债券基金经理。2016 年 4 月至 2020 年 1 月兼任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通聚利债券基金经理。2016 年 9 月至 2020 年 1 月兼任海富通欣荣混合基金经理。2016 年 9 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2017 年 3 月起兼任海富通欣享混合基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 7 月至 2020 年 9 月任海富通季季通利理财债券基金经理。2019 年 9 月起兼任海富通中短债债券基金经理。</p>
--	---	--	--	---

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。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通欣荣混合 A 净值增长率为 47.55%，同期业绩比较基准收益率为 15.06%，基金净值跑赢业绩比较基准 32.49 个百分点。海富通欣荣混合 C 净值增长率为 47.26%，同期业绩比较基准收益率为 15.06%，基金净值跑赢业绩比较基准 32.20 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。同时，基金依然会积极参与新股申购，努力增厚收益。本基金也将利用动态的仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。

4.6 管理人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估工作。

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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

4.9 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，基金托管人在海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，海富通基金管理有限公司在海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。个别工作日，托管人发现个别监督指标不符合基金合同的约定，托管人及时通知了基金管理人，基金管理人根据规定进行了调整。

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，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2021)第 21035 号

海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“海富通欣荣混合基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了海富通欣荣混合基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果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。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。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于海富通欣荣混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

海富通欣荣混合基金的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”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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欣荣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,除非基金管理人管理层计划清算海富通欣荣混合基金、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欣荣混合基金的财务报告过程。

6.4 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：

(一) 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。

(二) 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。

(三) 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。

(四) 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，就可能导致对海富通欣荣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欣荣混合基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，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。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

薛竞 沈兆杰

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2021 年 3 月 29 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通欣荣灵活配置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	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	5,669,429.50	7,119,211.75
结算备付金		17,759,961.32	11,905,329.41
存出保证金		1,987,512.75	76,623.18
交易性金融资产	7.4.7.2	523,171,770.26	317,255,447.79
其中：股票投资		501,583,040.56	301,639,971.39
基金投资		-	-
债券投资		21,588,729.70	15,615,476.40
资产支持证券投资		-	-
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	-	-
应收证券清算款		1,753,728.89	-
应收利息	7.4.7.5	475,283.77	331,523.12
应收股利		-	-
应收申购款		570.00	2,580.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		550,818,256.49	336,690,715.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	3,648,363.65
应付赎回款		54,783.34	6,537.37
应付管理人报酬		264,276.29	168,044.94
应付托管费		66,069.09	42,011.26
应付销售服务费		36,513.43	21,051.36
应付交易费用	7.4.7.7	105,461.30	130,333.69
应交税费		17,296.59	10,771.78
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	180,000.03	180,000.00
负债合计		724,400.07	4,207,114.05
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	286,355,537.17	255,189,981.37
未分配利润	7.4.7.10	263,738,319.25	77,293,619.83
所有者权益合计		550,093,856.42	332,483,601.20
负债和所有者权益总计		550,818,256.49	336,690,715.25

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 286,355,537.17 份，其中海富通欣荣混合基金 A 类份额 163,609,848.37 份，海富通欣荣混合基金 C 类份额 122,745,688.80 份。A 类份额净值 1.9211 元，C 类份额净值 1.9210 元。

7.2 利润表

会计主体：海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		161,772,745.91	81,596,115.63
1.利息收入		630,068.48	439,018.80
其中：存款利息收入	7.4.7.11	244,960.51	126,394.76
债券利息收入		350,089.47	269,092.43
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		35,018.50	43,531.61

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		59,245,584.24	32,996,512.40
其中：股票投资收益	7.4.7.12	50,748,449.56	26,834,946.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	431,157.94	287,829.37
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	2,496,091.54	2,099,339.81
股利收益	7.4.7.16	5,569,885.20	3,774,396.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	101,855,564.73	48,064,062.36
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	41,528.46	96,522.07
减：二、费用		4,379,649.08	2,758,841.40
1. 管理人报酬		2,388,171.84	1,275,620.51
2. 托管费		597,042.95	318,905.12
3. 销售服务费		280,689.50	108,263.53
4. 交易费用	7.4.7.19	880,952.32	822,146.54
5. 利息支出		-	4,130.41
其中：卖出回购金融资产支出		-	4,130.41
6. 税金及附加		8,988.38	7,502.03
7. 其他费用	7.4.7.20	223,804.09	222,273.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		157,393,096.83	78,837,274.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		157,393,096.83	78,837,274.23

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 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)	255,189,981.37	77,293,619.83	332,483,601.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	157,393,096.83	157,393,096.83
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)	31,165,555.80	29,051,602.59	60,217,158.39
其中: 1.基金申购款	144,585,203.20	80,756,946.21	225,342,149.41
2.基金赎回款	-113,419,647.40	-51,705,343.62	-165,124,991.02
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)	286,355,537.17	263,738,319.25	550,093,856.42
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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)	122,021,251.98	-14,708,426.54	107,312,825.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	78,837,274.23	78,837,274.23
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)	133,168,729.39	13,164,772.14	146,333,501.53
其中: 1.基金申购款	221,513,559.56	32,857,965.56	254,371,525.12
2.基金赎回款	-88,344,830.17	-19,693,193.42	-108,038,023.59
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)	255,189,981.37	77,293,619.83	332,483,601.20
---------------------	----------------	---------------	----------------

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

海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]第 1480 号《关于准予海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 450,020,570.20 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1193 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 450,135,331.01 份，其中认购资金利息折合 114,760.81 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、权证、股指期货等权益类品种，债券等固定收益类品种（包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等），国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金

每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times 50\%$ + 中证全债指数收益率 $\times 50\%$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2021 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到

期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公

允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，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。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

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。由于申购和赎回引起的实收基金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

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本

金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 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和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)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。

(2)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。

(3)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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来

等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对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。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

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	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	5,669,429.50	7,119,211.75
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	5,669,429.50	7,119,211.75

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	364,793,195.54	501,583,040.56	136,789,845.02
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	21,600,435.60	21,588,729.70
	银行间市场	-	-
	合计	21,600,435.60	21,588,729.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	386,393,631.14	523,171,770.26	136,778,139.12
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	266,555,493.30	301,639,971.39	35,084,478.09
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	15,580,714.38	15,615,476.40
	银行间市场	-	-
	合计	15,580,714.38	15,615,476.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	282,136,207.68	317,255,447.79	35,119,240.11

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	14,257,614.28	-	-	-
——股指期货	14,257,614.28	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	14,257,614.28	-	-	-
项目	上年度末 2019 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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货情况：持有买入 IC2106 合约市值 9,763,840.00 元，公允价值变动-19,000.00 元；买入 IF2103 合约市值 4,690,440.00 元，公允价值变动 215,665.72 元；公允价值变动合计 196,665.72 元(2019 年 12 月 31 日：未持有)。

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

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

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有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	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,666.74	2,102.52
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	4,050.42	1,044.54
应收债券利息	467,428.11	328,041.56
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	112.50	300.00
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	26.00	34.50
合计	475,283.77	331,523.12

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末其他资产无余额。

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	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	105,461.30	130,333.69
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	105,461.30	130,333.69

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	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.03	-
预提费用	180,000.00	180,000.00
合计	180,000.03	180,000.00

7.4.7.9 实收基金

海富通欣荣混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	162,856,338.52	162,856,338.52
本期申购	24,624,815.86	24,624,815.86
本期赎回（以“-”号填列）	-23,871,306.01	-23,871,306.01
本期末	163,609,848.37	163,609,848.37

海富通欣荣混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	92,333,642.85	92,333,642.85
本期申购	119,960,387.34	119,960,387.34
本期赎回（以“-”号填列）	-89,548,341.39	-89,548,341.39
本期末	122,745,688.80	122,745,688.80

注：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

海富通欣荣混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,739,504.55	29,439,368.74	49,178,873.29
本期利润	36,480,840.37	69,502,306.63	105,983,147.00
本期基金份额交易产生的变动数	-1,976,268.39	-2,491,310.19	-4,467,578.58
其中：基金申购款	4,745,555.00	8,375,316.79	13,120,871.79
基金赎回款	-6,721,823.39	-10,866,626.98	-17,588,450.37
本期已分配利润	-	-	-

本期末	54,244,076.53	96,450,365.18	150,694,441.71
-----	---------------	---------------	----------------

海富通欣荣混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,430,244.82	16,684,501.72	28,114,746.54
本期利润	19,056,691.73	32,353,258.10	51,409,949.83
本期基金份额交易产生的变动数	10,176,383.86	23,342,797.31	33,519,181.17
其中：基金申购款	25,971,852.95	41,664,221.47	67,636,074.42
基金赎回款	-15,795,469.09	-18,321,424.16	-34,116,893.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,663,320.41	72,380,557.13	113,043,877.54

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
活期存款利息收入	172,648.77	64,145.85
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	64,989.55	56,213.89
其他	7,322.19	6,035.02
合计	244,960.51	126,394.76

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
卖出股票成交总额	287,655,717.22	213,890,216.26
减：卖出股票成本总额	236,907,267.66	187,055,269.50
买卖股票差价收入	50,748,449.56	26,834,946.76

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付） 成交总额	30,005,837.47	11,415,514.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期 兑付）成本总额	28,848,288.28	10,864,557.50
减：应收利息总额	726,391.25	263,127.93
买卖债券差价收入	431,157.94	287,829.37

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
股指期货投资收益(税前)	2,570,974.28	2,162,320.00
股指期货差价收入应缴纳 增值税额	-74,882.74	-62,980.19
合计	2,496,091.54	2,099,339.81

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
股票投资产生的股利收益	5,569,885.20	3,774,396.46
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	5,569,885.20	3,774,396.46
----	--------------	--------------

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1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
1.交易性金融资产	101,658,899.01	48,064,062.36
——股票投资	101,705,366.93	48,038,677.18
——债券投资	-46,467.92	25,385.18
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
2.衍生工具	196,665.72	-
——权证投资	-	-
——股指期货	196,665.72	-
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	101,855,564.73	48,064,062.36

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
基金赎回费收入	41,421.13	96,522.07
其他	106.93	-
基金转换费收入	0.40	-
合计	41,528.46	96,522.07

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年1月1日至2020年12月 31日	2019年1月1日至2019年12月 31日
交易所市场交易费用	877,506.90	814,996.19
银行间市场交易费用	-	-
股指期货交易费用	3,445.42	7,150.35
合计	880,952.32	822,146.54

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
银行划款手续费	6,604.09	5,073.26
合计	223,804.09	222,273.26

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、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。

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1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	10,711,255.32	1.80%	63,198,368.61	11.74%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

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1月1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	9,761.04	2.18%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	57,856.30	12.11%	11,921.47	9.15%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,388,171.84	1,275,620.51
其中：支付销售机构的客户维护费	3,285.36	6,418.47

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.6% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	597,042.95	318,905.12

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

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1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通欣荣混合A	海富通欣荣混合C	合计
交通银行	-	-	-
海通证券	-	50.54	50.54
海富通	-	279,190.61	279,190.61
合计	-	279,241.15	279,241.15
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通欣荣混合A	海富通欣荣混合C	合计
交通银行	-	21.80	21.80
海通证券	-	0.18	0.18
海富通	-	104,165.29	104,165.29
合计	-	104,187.27	104,187.27

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

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额对应的资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31	2019年1月1日至2019年12月31

	日		日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	5,669,429.50	172,648.77	7,119,211.75	64,145.85

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

本期 2020年1月1日至2020年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
海通证券	300847	中船汉光	网下发行	1,421	9,861.74
海通证券	300879	大叶股份	网下发行	4,660	49,302.80
海通证券	688180	君实生物	网下发行	6,471	359,140.50
海通证券	688301	奕瑞科技	网下发行	1,554	185,858.40
海通证券	688521	芯原股份	网下发行	8,560	329,816.80
海通证券	688536	思瑞浦	网下发行	1,997	231,072.87
海通证券	688550	瑞联新材	网下发行	1,778	202,194.16
海通证券	688981	中芯国际	网下发行	90,895	2,495,976.70
上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

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
000333	美的集团	2020-09-03	2021-03-03	大宗交易	67.53	95.26	150,000	10,129,500.00	14,289,000.00	-
000538	云南白药	2020-09-23	2021-03-23	大宗交易	97.23	110.15	21,000	2,041,830.00	2,313,150.00	-
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	-
002332	仙琚制药	2020-11-27	2021-05-27	非公开定增	13.70	12.69	145,985	1,999,994.50	1,852,549.65	-
002532	天山铝业	2020-12-23	2021-06-24	非公开定增	6.55	6.95	152,672	1,000,001.60	1,061,070.40	-
002726	龙大肉食	2020-08-26	2021-02-26	大宗交易	11.03	12.38	185,000	2,040,550.00	2,290,300.00	-
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	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300860	锋尚文化	2020-08-06	2021-02-24	新股锁定流通受限	138.02	126.67	190	26,223.80	24,067.30	-
300861	美畅股份	2020-08-06	2021-02-24	新股锁定流通受限	43.76	51.10	531	23,236.56	27,134.10	-
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	新股锁定流通受限	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
30086	圣元	2020-	2021-	新股	19.34	31.97	1,498	28,97	47,89	-

7	环保	08-12	03-03	锁定 流通 受限				1.32	1.06	
30086 8	杰美 特	2020- 08-12	2021- 02-24	新股 锁定 流通 受限	41.26	43.28	534	22,03 2.84	23,11 1.52	-
30087 2	天阳 科技	2020- 08-14	2021- 02-25	新股 锁定 流通 受限	21.34	37.84	764	16,30 3.76	28,90 9.76	-
30087 3	海晨 股份	2020- 08-14	2021- 03-02	新股 锁定 流通 受限	30.72	41.32	479	14,71 4.88	19,79 2.28	-
30087 6	蒙泰 高新	2020- 08-14	2021- 02-25	新股 锁定 流通 受限	20.09	36.62	350	7,031. 50	12,81 7.00	-
30087 7	金春 股份	2020- 08-17	2021- 03-03	新股 锁定 流通 受限	30.54	50.85	569	17,37 7.26	28,93 3.65	-
30087 8	维康 药业	2020- 08-17	2021- 03-03	新股 锁定 流通 受限	41.34	48.72	401	16,57 7.34	19,53 6.72	-
30087 9	大叶 股份	2020- 08-25	2021- 03-01	新股 锁定 流通 受限	10.58	27.12	466	4,930. 28	12,63 7.92	-
30088 1	盛德 鑫泰	2020- 08-25	2021- 03-05	新股 锁定 流通 受限	14.17	32.31	291	4,123. 47	9,402. 21	-
30088 2	万胜 智能	2020- 08-27	2021- 03-10	新股 锁定 流通 受限	10.33	25.79	440	4,545. 20	11,34 7.60	-
30088 4	狄耐 克	2020- 11-05	2021- 05-12	新股 锁定 流通 受限	24.87	33.51	499	12,41 0.13	16,72 1.49	-
30088 6	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	-

				流通受限						
300887	谱尼测试	2020-09-09	2021-03-16	新股锁定流通受限	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300889	爱克股份	2020-09-09	2021-03-16	新股锁定流通受限	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020-09-10	2021-03-18	新股锁定流通受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	新股锁定流通受限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020-09-11	2021-03-30	新股锁定流通受限	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300893	松原股份	2020-09-17	2021-03-24	新股锁定流通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300894	火星	2020-12-24	2021-07-01	新股锁定流通受限	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300895	铜牛信息	2020-09-17	2021-03-24	新股锁定流通受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	新股锁定流通受限	118.27	603.36	171	20,224.17	103,174.56	-
300898	熊猫乳品	2020-10-09	2021-04-16	新股锁定流通受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300908	仲景食品	2020-11-13	2021-05-24	新股锁定流通	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-

				受限						
300909	汇创达	2020-11-11	2021-05-18	新股锁定流通受限	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300917	特发服务	2020-12-14	2021-06-21	新股锁定流通受限	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	新股锁定流通受限	24.60	61.51	530	13,038.00	32,600.30	-
300922	天秦装备	2020-12-18	2021-06-25	新股锁定流通受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
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	-
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	-
300999	金龙鱼	2020-09-29	2021-04-15	新股锁定流通受限	25.70	88.29	2,620	67,334.00	231,319.80	-
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	-
600745	闻泰科技	2020-07-31	2021-01-29	大宗交易	135.16	96.82	15,000	2,027,400.00	1,452,300.00	-
601100	恒立液压	2020-12-17	2021-06-17	大宗交易	91.60	106.14	22,000	2,015,200.00	2,335,080.00	-
603218	日月股份	2020-08-26	2021-02-25	大宗交易	17.73	28.66	120,000	2,127,600.00	3,439,200.00	-
603233	大参林	2020-09-25	2021-03-25	大宗交易	76.26	74.95	27,000	2,059,020.00	2,023,650.00	-
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新股未上	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-

				市						
688055	龙腾光电	2020-08-10	2021-02-18	新股锁定流通受限	1.22	8.04	45,228	55,178.16	363,633.12	-
688056	莱伯泰科	2020-08-25	2021-03-02	新股锁定流通受限	24.80	30.56	2,010	49,848.00	61,425.60	-
688069	德林海	2020-07-15	2021-01-22	新股锁定流通受限	67.20	62.45	2,162	145,286.40	135,016.90	-
688129	东来技术	2020-10-15	2021-04-23	新股锁定流通受限	15.22	16.34	5,033	76,602.26	82,239.22	-
688338	赛科希德	2020-07-27	2021-02-08	新股锁定流通受限	50.35	54.59	3,041	153,114.35	166,008.19	-
688356	键凯科技	2020-08-17	2021-02-26	新股锁定流通受限	41.18	105.06	2,433	100,190.94	255,610.98	-
688508	芯朋微	2020-07-15	2021-01-22	新股锁定流通受限	28.30	91.91	3,729	105,530.70	342,732.39	-
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	-
688678	福立旺	2020-12-15	2021-06-23	新股锁定流通受限	18.05	19.25	4,198	75,773.90	80,811.50	-

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
113044	大秦转债	2020-12-14	2021-01-15	老股东配	100.00	100.00	1,370	137,000.00	137,000.00	-

				债						
11361 6	韦尔 转债	2020- 12-28	2021- 01-22	老股 东配 债	100.0 0	100.0 0	120	12,00 0.00	12,00 0.00	-
12309 1	长海 转债	2020- 12-23	2021- 01-15	老股 东配 债	100.0 0	100.0 0	133	13,30 0.00	13,30 0.00	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股票，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股票数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股票不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

3、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

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

本基金是一只混合型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

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

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同责任，或者基金所投资证券

之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.06%(2019 年 12 月 31 日：0.13%)。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	21,234,876.30	14,167,495.40
合计	21,234,876.30	14,167,495.40

注：未评级部分为国债。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	137,000.00	-
AAA 以下	216,853.40	440,481.00
未评级	-	1,007,500.00
合计	353,853.40	1,447,981.00

注：未评级部分为政策性金融债。

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，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个半月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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期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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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 7.49%。

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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资和买入返售金融资产等。

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	5,669,429.50	-	-	-	5,669,429.50

结算备付金	17,759,961.32	-	-	-	17,759,961.32
存出保证金	1,987,512.75	-	-	-	1,987,512.75
交易性金融资产	21,234,876.30	-	353,853.40	501,583,040.56	523,171,770.26
应收证券清算款	-	-	-	1,753,728.89	1,753,728.89
应收利息	-	-	-	475,283.77	475,283.77
应收申购款	-	-	-	570.00	570.00
资产总计	46,651,779.87	-	353,853.40	503,812,623.22	550,818,256.49
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	54,783.34	54,783.34
应付管理人报酬	-	-	-	264,276.29	264,276.29
应付托管费	-	-	-	66,069.09	66,069.09
应付销售服务费	-	-	-	36,513.43	36,513.43
应付交易费用	-	-	-	105,461.30	105,461.30
应交税费	-	-	-	17,296.59	17,296.59
其他负债	-	-	-	180,000.03	180,000.03
负债总计	-	-	-	724,400.07	724,400.07
利率敏感度缺口	46,651,779.87	-	353,853.40	503,088,223.15	550,093,856.42
上年度末 2019 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	7,119,211.75	-	-	-	7,119,211.75
结算备付金	11,905,329.41	-	-	-	11,905,329.41
存出保证金	76,623.18	-	-	-	76,623.18
交易性金融资产	15,174,995.40	137,241.00	303,240.00	301,639,971.39	317,255,447.79
应收利息	-	-	-	331,523.12	331,523.12
应收申购款	-	-	-	2,580.00	2,580.00
资产总计	34,276,159.74	137,241.00	303,240.00	301,974,074.51	336,690,715.25
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,648,363.65	3,648,363.65
应付赎回款	-	-	-	6,537.37	6,537.37
应付管理人报酬	-	-	-	168,044.94	168,044.94
应付托管费	-	-	-	42,011.26	42,011.26
应付销售服务费	-	-	-	21,051.36	21,051.36
应付交易费用	-	-	-	130,333.69	130,333.69
应交税费	-	-	-	10,771.78	10,771.78
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	4,207,114.05	4,207,114.05
利率敏感度缺口	34,276,159.74	137,241.00	303,240.00	297,766,960.46	332,483,601.20

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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	上年度末 2019年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-6,333.56	-8,268.77
	市场利率下降 25 个基点	6,422.90	8,355.73

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资及存托凭证比例为基金总资产的 0%-95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	501,583,040.56	91.18	301,639,971.39	90.72
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	501,583,040.56	91.18	301,639,971.39	90.72

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	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准（附注 7.4.1）上升 5%	26,982,399.04	15,355,694.26
	业绩比较基准（附注 7.4.1）下降 5%	-26,982,399.04	-15,355,694.26

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

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 460,740,100.12 元，属于第二层次的余额为 62,431,670.14 元，无属于第三层次的余额（2019 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 293,242,177.05 元，属于第二层次的余额为 24,013,270.74 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2019 年 12 月 31 日：同）。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	501,583,040.56	91.06
	其中：股票	501,583,040.56	91.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,588,729.70	3.92
	其中：债券	21,588,729.70	3.92
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23,429,390.82	4.25
8	其他各项资产	4,217,095.41	0.77
9	合计	550,818,256.49	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	922,709.00	0.17
B	采矿业	6,531,799.00	1.19
C	制造业	334,204,771.79	60.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,414,235.00	1.35
E	建筑业	17,108.00	0.00
F	批发和零售业	5,812,555.24	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	3,830,171.28	0.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,845,621.78	3.06
J	金融业	88,911,552.43	16.16
K	房地产业	14,657,919.24	2.66
L	租赁和商务服务业	7,536,470.40	1.37
M	科学研究和技术服务业	5,464,668.44	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	701,632.06	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,403,315.60	0.98
R	文化、体育和娱乐业	3,328,511.30	0.61
S	综合	-	-
	合计	501,583,040.56	91.18

8.2.2 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。

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	14,000	27,972,000.00	5.08

2	600036	招商银行	557,500	24,502,125.00	4.45
3	601318	中国平安	243,700	21,197,026.00	3.85
4	000333	美的集团	161,864	15,456,892.16	2.81
5	601012	隆基股份	161,700	14,908,740.00	2.71
6	600031	三一重工	419,000	14,656,620.00	2.66
7	000858	五粮液	42,100	12,286,885.00	2.23
8	002475	立讯精密	196,891	11,049,522.92	2.01
9	600887	伊利股份	205,800	9,131,346.00	1.66
10	600030	中信证券	293,900	8,640,660.00	1.57
11	000661	长春高新	19,200	8,448,522.00	1.54
12	600276	恒瑞医药	70,545	7,862,945.70	1.43
13	300760	迈瑞医疗	17,800	7,582,800.00	1.38
14	601166	兴业银行	348,389	7,270,878.43	1.32
15	000568	泸州老窖	31,900	7,214,504.00	1.31
16	002142	宁波银行	181,900	6,428,346.00	1.17
17	600048	保利地产	380,700	6,022,674.00	1.09
18	002415	海康威视	116,976	5,674,505.76	1.03
19	300014	亿纬锂能	68,602	5,591,063.00	1.02
20	600438	通威股份	139,400	5,358,536.00	0.97
21	600563	法拉电子	51,700	5,299,855.00	0.96
22	600521	华海药业	147,840	4,998,470.40	0.91
23	000651	格力电器	80,000	4,955,200.00	0.90
24	600486	扬农化工	37,400	4,936,800.00	0.90
25	002311	海大集团	75,334	4,934,377.00	0.90
26	300059	东方财富	157,980	4,897,380.00	0.89
27	603259	药明康德	35,492	4,781,482.24	0.87
28	601888	中国中免	16,900	4,773,405.00	0.87
29	601966	玲珑轮胎	126,927	4,464,022.59	0.81
30	600570	恒生电子	40,590	4,257,891.00	0.77
31	600900	长江电力	219,100	4,197,956.00	0.76
32	601899	紫金矿业	444,000	4,124,760.00	0.75
33	002241	歌尔股份	109,500	4,086,540.00	0.74
34	000338	潍柴动力	250,530	3,955,868.70	0.72
35	600741	华域汽车	136,200	3,925,284.00	0.71
36	000001	平安银行	202,500	3,916,350.00	0.71
37	600309	万华化学	42,800	3,896,512.00	0.71
38	000002	万科 A	133,500	3,831,450.00	0.70
39	002271	东方雨虹	92,325	3,582,210.00	0.65
40	603218	日月股份	124,400	3,572,300.00	0.65
41	000895	双汇发展	75,200	3,529,888.00	0.64
42	601211	国泰君安	201,100	3,525,283.00	0.64
43	601688	华泰证券	192,800	3,472,328.00	0.63
44	600690	海尔智家	118,000	3,446,780.00	0.63
45	300316	晶盛机电	110,600	3,326,848.00	0.60

46	300122	智飞生物	22,400	3,313,184.00	0.60
47	000538	云南白药	28,800	3,199,230.00	0.58
48	601100	恒立液压	29,400	3,171,280.00	0.58
49	600406	国电南瑞	116,300	3,090,091.00	0.56
50	600585	海螺水泥	59,828	3,088,321.36	0.56
51	000725	京东方 A	462,200	2,773,200.00	0.50
52	002332	仙琚制药	206,585	2,662,165.65	0.48
53	603233	大参林	33,000	2,493,750.00	0.45
54	002938	鹏鼎控股	50,900	2,489,953.00	0.45
55	603678	火炬电子	33,500	2,422,050.00	0.44
56	002493	荣盛石化	87,200	2,407,592.00	0.44
57	002726	龙大肉食	185,000	2,290,300.00	0.42
58	600763	通策医疗	8,100	2,239,812.00	0.41
59	000786	北新建材	54,800	2,194,740.00	0.40
60	300144	宋城演艺	120,200	2,129,944.00	0.39
61	002557	洽洽食品	38,027	2,047,753.95	0.37
62	600803	新奥股份	149,700	2,034,423.00	0.37
63	002027	分众传媒	201,220	1,986,041.40	0.36
64	300433	蓝思科技	63,500	1,943,735.00	0.35
65	601877	正泰电器	48,900	1,914,924.00	0.35
66	002352	顺丰控股	21,200	1,870,476.00	0.34
67	000157	中联重科	182,200	1,803,780.00	0.33
68	300408	三环集团	48,100	1,791,725.00	0.33
69	300037	新宙邦	17,400	1,764,360.00	0.32
70	000100	TCL 科技	248,500	1,759,380.00	0.32
71	600745	闻泰科技	17,300	1,680,000.00	0.31
72	601636	旗滨集团	129,300	1,655,040.00	0.30
73	600176	中国巨石	82,000	1,636,720.00	0.30
74	002410	广联达	20,100	1,582,674.00	0.29
75	600104	上汽集团	62,200	1,520,168.00	0.28
76	002008	大族激光	35,400	1,513,350.00	0.28
77	002444	巨星科技	48,586	1,511,510.46	0.27
78	600426	华鲁恒升	40,254	1,501,474.20	0.27
79	300146	汤臣倍健	61,900	1,494,885.00	0.27
80	600383	金地集团	110,300	1,489,050.00	0.27
81	600009	上海机场	19,600	1,482,936.00	0.27
82	002001	新和成	43,900	1,478,552.00	0.27
83	000656	金科股份	207,400	1,470,466.00	0.27
84	601398	工商银行	293,400	1,464,066.00	0.27
85	603501	韦尔股份	6,300	1,455,930.00	0.26
86	300454	深信服	5,600	1,388,856.00	0.25
87	603883	老百姓	21,000	1,319,430.00	0.24
88	000063	中兴通讯	39,100	1,315,715.00	0.24
89	000513	丽珠集团	30,616	1,239,948.00	0.23

90	603939	益丰药房	13,560	1,222,976.40	0.22
91	300413	芒果超媒	16,200	1,174,500.00	0.21
92	000739	普洛药业	50,000	1,164,000.00	0.21
93	600346	恒力石化	41,200	1,152,364.00	0.21
94	002028	思源电气	56,800	1,139,408.00	0.21
95	002258	利尔化学	53,700	1,122,330.00	0.20
96	601088	中国神华	61,800	1,113,018.00	0.20
97	600885	宏发股份	20,340	1,102,834.80	0.20
98	002968	新大正	21,800	1,080,190.00	0.20
99	002532	天山铝业	152,672	1,061,070.40	0.19
100	603369	今世缘	18,200	1,044,316.00	0.19
101	300347	泰格医药	6,400	1,034,304.00	0.19
102	603882	金域医学	8,000	1,024,960.00	0.19
103	600522	中天科技	93,200	1,010,288.00	0.18
104	002624	完美世界	32,600	961,700.00	0.17
105	300525	博思软件	33,285	955,279.50	0.17
106	002821	凯莱英	3,100	927,334.00	0.17
107	002714	牧原股份	11,830	912,093.00	0.17
108	600872	中炬高新	13,600	906,440.00	0.16
109	002511	中顺洁柔	42,400	884,888.00	0.16
110	002242	九阳股份	27,600	884,304.00	0.16
111	601225	陕西煤业	93,100	869,554.00	0.16
112	300138	晨光生物	44,800	857,920.00	0.16
113	002430	杭氧股份	28,900	840,701.00	0.15
114	300601	康泰生物	4,800	837,600.00	0.15
115	300529	健帆生物	12,200	827,404.00	0.15
116	002236	大华股份	40,800	811,512.00	0.15
117	002127	南极电商	56,800	777,024.00	0.14
118	600461	洪城水业	114,000	770,640.00	0.14
119	002705	新宝股份	18,200	768,950.00	0.14
120	603538	美诺华	20,400	757,452.00	0.14
121	600352	浙江龙盛	54,200	738,204.00	0.13
122	000877	天山股份	48,200	727,820.00	0.13
123	000961	中南建设	81,900	723,177.00	0.13
124	002643	万润股份	32,900	716,233.00	0.13
125	002050	三花智控	28,864	711,497.60	0.13
126	002841	视源股份	6,100	701,683.00	0.13
127	300450	先导智能	8,200	688,718.00	0.13
128	601939	建设银行	108,100	678,868.00	0.12
129	300015	爱尔眼科	8,840	662,027.60	0.12
130	603799	华友钴业	8,188	649,308.40	0.12
131	000977	浪潮信息	24,048	646,410.24	0.12
132	600845	宝信软件	9,200	634,616.00	0.12
133	300003	乐普医疗	23,100	627,858.00	0.11

134	002601	龙鳞佰利	19,500	600,015.00	0.11
135	300572	安车检测	14,300	584,584.00	0.11
136	603583	捷昌驱动	7,520	580,920.00	0.11
137	002967	广电计量	15,600	571,740.00	0.10
138	300207	欣旺达	18,500	568,135.00	0.10
139	000830	鲁西化工	44,300	566,154.00	0.10
140	002422	科伦药业	28,700	557,928.00	0.10
141	601336	新华保险	9,600	556,512.00	0.10
142	600926	杭州银行	37,000	552,040.00	0.10
143	600183	生益科技	19,385	545,881.60	0.10
144	601799	星宇股份	2,700	541,350.00	0.10
145	600507	方大特钢	77,573	538,356.62	0.10
146	002600	领益智造	43,800	525,162.00	0.10
147	300737	科顺股份	24,300	521,478.00	0.09
148	603444	吉比特	1,200	511,200.00	0.09
149	002318	久立特材	46,500	506,850.00	0.09
150	603129	春风动力	2,900	505,151.00	0.09
151	600323	瀚蓝环境	20,300	503,643.00	0.09
152	300226	上海钢联	7,520	493,312.00	0.09
153	002007	华兰生物	11,650	492,096.00	0.09
154	300750	宁德时代	1,400	491,554.00	0.09
155	300285	国瓷材料	10,800	487,188.00	0.09
156	603899	晨光文具	5,500	487,080.00	0.09
157	002594	比亚迪	2,500	485,750.00	0.09
158	000581	威孚高科	20,900	484,671.00	0.09
159	603236	移远通信	2,520	471,088.80	0.09
160	603987	康德莱	29,900	469,131.00	0.09
161	603298	杭叉集团	22,120	464,741.20	0.08
162	002064	华峰氨纶	45,900	463,131.00	0.08
163	002541	鸿路钢构	12,500	456,625.00	0.08
164	603416	信捷电气	5,000	454,200.00	0.08
165	300244	迪安诊断	12,900	442,212.00	0.08
166	300575	中旗股份	11,500	441,600.00	0.08
167	601222	林洋能源	55,200	437,184.00	0.08
168	600529	山东药玻	8,680	435,302.00	0.08
169	002371	北方华创	2,400	433,776.00	0.08
170	002812	恩捷股份	3,000	425,340.00	0.08
171	600988	赤峰黄金	23,700	424,467.00	0.08
172	600660	福耀玻璃	8,800	422,840.00	0.08
173	000915	山大华特	18,000	421,020.00	0.08
174	300124	汇川技术	4,500	419,850.00	0.08
175	300451	创业慧康	30,800	416,724.00	0.08
176	002138	顺络电子	16,900	414,388.00	0.08
177	603601	再升科技	30,100	410,865.00	0.07

178	601006	大秦铁路	63,600	410,856.00	0.07
179	002602	世纪华通	57,689	410,168.79	0.07
180	603700	宁水集团	14,000	408,380.00	0.07
181	300639	凯普生物	10,800	405,864.00	0.07
182	300136	信维通信	11,300	405,444.00	0.07
183	300033	同花顺	3,200	396,736.00	0.07
184	002605	姚记科技	15,900	390,186.00	0.07
185	601233	桐昆股份	18,940	389,974.60	0.07
186	300785	值得买	4,185	380,332.80	0.07
187	603833	欧派家居	2,800	376,600.00	0.07
188	300142	沃森生物	9,500	366,320.00	0.07
189	688055	龙腾光电	45,228	363,633.12	0.07
190	002727	一心堂	10,800	359,748.00	0.07
191	002262	恩华药业	22,300	356,131.00	0.06
192	000951	中国重汽	11,300	355,498.00	0.06
193	300702	天宇股份	3,800	355,300.00	0.06
194	600038	中直股份	5,600	351,176.00	0.06
195	002384	东山精密	13,300	345,800.00	0.06
196	688508	芯朋微	3,729	342,732.39	0.06
197	000596	古井贡酒	1,200	326,400.00	0.06
198	601818	光大银行	80,900	322,791.00	0.06
199	300502	新易盛	5,800	321,784.00	0.06
200	000708	中信特钢	14,620	318,569.80	0.06
201	600958	东方证券	26,800	311,684.00	0.06
202	300628	亿联网络	4,200	307,104.00	0.06
203	601009	南京银行	37,800	305,424.00	0.06
204	601838	成都银行	28,500	304,095.00	0.06
205	300577	开润股份	11,600	302,528.00	0.05
206	603288	海天味业	1,500	300,810.00	0.05
207	002080	中材科技	12,090	292,336.20	0.05
208	002803	吉宏股份	9,010	290,482.40	0.05
209	600332	白云山	9,616	281,268.00	0.05
210	002372	伟星新材	14,811	276,965.70	0.05
211	600580	卧龙电驱	17,700	276,120.00	0.05
212	300699	光威复材	3,100	276,055.00	0.05
213	002273	水晶光电	23,600	273,524.00	0.05
214	603515	欧普照明	8,900	268,869.00	0.05
215	002555	三七互娱	8,600	268,578.00	0.05
216	688356	键凯科技	2,433	255,610.98	0.05
217	601139	深圳燃气	33,400	241,816.00	0.04
218	603228	景旺电子	8,000	241,200.00	0.04
219	300999	金龙鱼	2,620	231,319.80	0.04
220	600160	巨化股份	27,900	226,269.00	0.04
221	300253	卫宁健康	12,870	225,225.00	0.04

222	600809	山西汾酒	600	225,174.00	0.04
223	600998	九州通	11,800	214,288.00	0.04
224	603305	旭升股份	6,700	209,643.00	0.04
225	600875	东方电气	20,800	207,376.00	0.04
226	603659	璞泰来	1,800	202,302.00	0.04
227	002223	鱼跃医疗	6,800	191,828.00	0.03
228	300193	佳士科技	26,200	188,902.00	0.03
229	603658	安图生物	1,300	188,734.00	0.03
230	002035	华帝股份	20,350	179,690.50	0.03
231	300114	中航电测	12,000	179,400.00	0.03
232	002697	红旗连锁	26,200	173,182.00	0.03
233	601601	中国太保	4,400	168,960.00	0.03
234	300196	长海股份	9,900	168,597.00	0.03
235	688338	赛科希德	3,041	166,008.19	0.03
236	002597	金禾实业	5,100	165,393.00	0.03
237	002773	康弘药业	3,390	163,228.50	0.03
238	600528	中铁工业	18,200	159,068.00	0.03
239	002508	老板电器	3,400	138,652.00	0.03
240	600452	涪陵电力	8,400	138,180.00	0.03
241	688069	德林海	2,162	135,016.90	0.02
242	002440	闰土股份	14,400	134,208.00	0.02
243	600132	重庆啤酒	1,100	130,889.00	0.02
244	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.02
245	002434	万里扬	13,800	123,096.00	0.02
246	603690	至纯科技	3,000	117,960.00	0.02
247	600298	安琪酵母	2,285	116,694.95	0.02
248	300832	新产业	882	116,476.92	0.02
249	002078	太阳纸业	7,920	114,285.60	0.02
250	002032	苏泊尔	1,400	109,186.00	0.02
251	300896	爱美客	171	103,174.56	0.02
252	300607	拓斯达	2,940	102,165.00	0.02
253	000049	德赛电池	1,500	101,400.00	0.02
254	002456	欧菲光	7,400	97,532.00	0.02
255	300470	中密控股	1,900	90,440.00	0.02
256	300776	帝尔激光	600	90,120.00	0.02
257	002648	卫星石化	3,200	83,584.00	0.02
258	688129	东来技术	5,033	82,239.22	0.01
259	688678	福立旺	4,198	80,811.50	0.01
260	600479	千金药业	8,960	77,414.40	0.01
261	601058	赛轮轮胎	12,500	75,500.00	0.01
262	603986	兆易创新	380	75,050.00	0.01
263	002459	晶澳科技	1,800	73,296.00	0.01
264	600761	安徽合力	5,100	72,420.00	0.01
265	300741	华宝股份	1,298	71,221.26	0.01

266	000938	紫光股份	3,220	65,849.00	0.01
267	688056	莱伯泰科	2,010	61,425.60	0.01
268	000625	长安汽车	2,500	54,700.00	0.01
269	600835	上海机电	2,700	52,542.00	0.01
270	300271	华宇软件	2,200	52,514.00	0.01
271	000425	徐工机械	9,300	49,941.00	0.01
272	300759	康龙化成	400	48,160.00	0.01
273	300383	光环新网	2,800	48,076.00	0.01
274	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.01
275	300685	艾德生物	600	46,950.00	0.01
276	603026	石大胜华	900	45,369.00	0.01
277	002540	亚太科技	8,500	44,200.00	0.01
278	002353	杰瑞股份	1,200	42,000.00	0.01
279	002439	启明星辰	1,300	37,973.00	0.01
280	002478	常宝股份	7,900	34,681.00	0.01
281	603018	华设集团	3,100	33,945.00	0.01
282	300919	中伟股份	530	32,600.30	0.01
283	600340	华夏幸福	2,470	31,937.10	0.01
284	600025	华能水电	7,000	31,220.00	0.01
285	601137	博威合金	2,700	30,996.00	0.01
286	300888	稳健医疗	181	30,046.00	0.01
287	603626	科森科技	2,600	29,926.00	0.01
288	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
289	300877	金春股份	569	28,933.65	0.01
290	300872	天阳科技	764	28,909.76	0.01
291	002632	道明光学	3,800	28,196.00	0.01
292	300861	美畅股份	531	27,134.10	0.00
293	600004	白云机场	1,900	26,847.00	0.00
294	600566	济川药业	1,301	26,319.23	0.00
295	300166	东方国信	2,400	26,280.00	0.00
296	300860	锋尚文化	190	24,067.30	0.00
297	002180	纳思达	900	24,057.00	0.00
298	600271	航天信息	1,900	23,940.00	0.00
299	300894	火星人	628	23,217.16	0.00
300	300868	杰美特	534	23,111.52	0.00
301	600984	建设机械	1,700	20,995.00	0.00
302	600873	梅花生物	4,500	20,970.00	0.00
303	300036	超图软件	1,100	20,284.00	0.00
304	300873	海晨股份	479	19,792.28	0.00
305	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
306	002757	南兴股份	1,250	19,425.00	0.00
307	600125	铁龙物流	3,200	19,264.00	0.00
308	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
309	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00

310	600055	万东医疗	1,800	18,216.00	0.00
311	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
312	002014	永新股份	1,800	17,658.00	0.00
313	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
314	600068	葛洲坝	2,600	17,108.00	0.00
315	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
316	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
317	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
318	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
319	603328	依顿电子	2,000	15,900.00	0.00
320	300326	凯利泰	1,000	15,850.00	0.00
321	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
322	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
323	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
324	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
325	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
326	603060	国检集团	700	13,692.00	0.00
327	003020	立方制药	374	12,858.12	0.00
328	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
329	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
330	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
331	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
332	002299	圣农发展	400	10,616.00	0.00
333	603886	元祖股份	600	10,224.00	0.00
334	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
335	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
336	600285	羚锐制药	1,100	9,317.00	0.00
337	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
338	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
339	603156	养元饮品	336	8,682.24	0.00
340	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
341	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
342	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
343	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
344	300233	金城医药	300	5,715.00	0.00
345	002837	英维克	150	2,625.00	0.00
346	603985	恒润股份	52	1,716.52	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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	13,816,572.00	4.16
2	600036	招商银行	7,948,747.00	2.39
3	600031	三一重工	7,713,739.00	2.32
4	002415	海康威视	5,727,870.72	1.72
5	601318	中国平安	4,939,768.00	1.49
6	600563	法拉电子	4,830,621.46	1.45
7	600521	华海药业	4,600,607.68	1.38
8	002938	鹏鼎控股	4,482,154.00	1.35
9	002332	仙琚制药	4,440,922.50	1.34
10	002142	宁波银行	4,299,332.00	1.29
11	600309	万华化学	4,046,574.88	1.22
12	603218	日月股份	4,040,372.96	1.22
13	300059	东方财富	3,818,671.00	1.15
14	600900	长江电力	3,709,888.00	1.12
15	601688	华泰证券	3,675,632.94	1.11
16	600887	伊利股份	3,613,375.00	1.09
17	002001	新和成	3,440,908.00	1.03
18	600570	恒生电子	3,415,028.00	1.03
19	600519	贵州茅台	3,378,073.00	1.02
20	002311	海大集团	3,352,938.91	1.01

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	9,578,342.29	2.88
2	601398	工商银行	8,769,348.00	2.64
3	688981	中芯国际	8,210,853.71	2.47
4	601318	中国平安	7,119,936.00	2.14
5	002007	华兰生物	6,416,374.58	1.93
6	000651	格力电器	6,350,656.08	1.91
7	002415	海康威视	5,544,325.80	1.67

8	002001	新和成	4,647,922.00	1.40
9	601658	邮储银行	3,867,720.26	1.16
10	000338	潍柴动力	3,660,310.52	1.10
11	600585	海螺水泥	3,576,178.00	1.08
12	601166	兴业银行	3,500,153.00	1.05
13	002008	大族激光	3,447,018.94	1.04
14	300607	拓斯达	3,145,425.00	0.95
15	600036	招商银行	2,817,642.00	0.85
16	002938	鹏鼎控股	2,724,201.00	0.82
17	603218	日月股份	2,613,503.00	0.79
18	600529	山东药玻	2,551,493.36	0.77
19	000786	北新建材	2,505,156.86	0.75
20	600309	万华化学	2,439,171.79	0.73

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	336,706,438.17
卖出股票的收入（成交）总额	287,655,717.22

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	21,234,876.30	3.86
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	353,853.40	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,588,729.70	3.92

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	019627	20 国债 01	212,370	21,234,876.30	3.86
2	113044	大秦转债	1,370	137,000.00	0.02
3	128135	洽洽转债	908	110,639.80	0.02
4	110077	洪城转债	720	80,913.60	0.01
5	123091	长海转债	133	13,300.00	0.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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投资。

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
IC2106	IC2106	8.00	9,763,840.00	-19,000.00	-
IF2103	IF2103	3.00	4,690,440.00	215,665.72	-
公允价值变动总额合计					196,665.72
股指期货投资本期收益					2,496,091.54
股指期货投资本期公允价值变动					196,665.72

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

本基金的股指期货投资用于套期保值。在预期市场上涨时，可以通过买入股指期货

作为股票替代，增加股票仓位，同时提高资金的利用效率；在预期市场下跌时，可以通过卖出股指期货对冲股市整体下跌的系统性风险，对投资组合的价值进行保护。

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

本基金的国债期货投资以风险管理为原则，以套期保值为目的。管理人按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

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合约。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金投资的前十名证券中，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	1,987,512.75
2	应收证券清算款	1,753,728.89
3	应收股利	-
4	应收利息	475,283.77
5	应收申购款	570.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,217,095.41

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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	000333	美的集团	14,289,000.00	2.60	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
海富通欣荣混合 A	220	743,681.13	163,199,064.92	99.75%	410,783.45	0.25%
海富通欣荣混合 C	482	254,659.11	122,105,745.74	99.48%	639,943.06	0.52%
合计	702	407,913.87	285,304,810.66	99.63%	1,050,726.51	0.37%

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	海富通欣荣混合 A	103,464.58	0.0632%
	海富通欣荣混合 C	25,810.35	0.0210%
	合计	129,274.93	0.0451%

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	海富通欣荣混合 A	0~10
	海富通欣荣混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通欣荣混合 A	0
	海富通欣荣混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
基金合同生效日（2016 年 9 月 22 日）基金份额总额	250,120,830.38	200,014,500.63
本报告期期初基金份额总额	162,856,338.52	92,333,642.85
本报告期基金总申购份额	24,624,815.86	119,960,387.34
减：本报告期基金总赎回份额	23,871,306.01	89,548,341.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	163,609,848.37	122,745,688.80

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

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是60,000.00元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是5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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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	
太平洋证券	2	233,161,455.96	39.25%	168,772.46	37.62%	-
招商证券	1	108,072,842.70	18.19%	85,282.03	19.01%	-
长江证券	1	63,742,871.06	10.73%	46,644.03	10.40%	-
光大证券	1	51,664,165.08	8.70%	38,369.23	8.55%	-
国元证券	1	51,120,033.42	8.61%	38,993.24	8.69%	-
华创证券	1	38,402,914.83	6.46%	28,621.33	6.38%	-
兴业证券	1	32,600,518.98	5.49%	28,778.74	6.42%	-
海通证券	2	10,711,255.32	1.80%	9,761.04	2.18%	-
平安证券	1	3,400,749.87	0.57%	2,486.98	0.55%	-
国泰君安	2	1,193,555.60	0.20%	872.83	0.19%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
申万宏源(原申万)	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金减少国元证券一个券商交易单元。

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	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

		的比例				
太平洋证券	20,749,095.28	57.72%	-	-	-	-
招商证券	365,670.29	1.02%	-	-	-	-
长江证券	858,558.80	2.39%	-	-	-	-
光大证券	130,207.97	0.36%	-	-	-	-
国元证券	6,827,643.60	18.99%	31,000,000.00	58.49%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	6,895,526.40	19.18%	22,000,000.00	41.51%	-	-
海通证券	123,886.88	0.34%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申万宏源(原申万)	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

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	海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-07
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-16
3	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台银联支付渠道新增部分银行卡并开展申购费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-02
4	海富通基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-27
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分	证券日报、基金管理	2020-05-08

	基金新增蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-22
7	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
8	海富通基金管理有限公司关于延迟和耕传承基金销售有限公司代销旗下基金的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
9	海富通基金管理有限公司关于变更直销中心交易传真号码的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-06
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京肯特瑞基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-23
11	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-24
12	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-30
13	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-01
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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-08
15	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-11
16	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会	2020-07-25

		会基金电子披露网站	
17	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-25
18	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-28
19	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-11
20	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-13
21	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-22
22	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-26
23	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-11
24	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-15
25	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-17
26	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-24
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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-10-24

		站	
28	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-10-29
29	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-11
30	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行招赢通为销售平台的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-27
31	海富通基金管理有限公司关于旗下基金获配仙琚制药（002332）非公开发行 A 股的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-01
32	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-01
33	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-01
34	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海长量基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-16
35	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-25

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

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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		区间					
机构	1	2020/3/19-2020/6/8	47,249,102.25	-	-	47,249,102.25	16.50%
	2	2020/3/19-2020/6/8	47,249,102.25	-	-	47,249,102.25	16.50%
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>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；</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4、其他可能的风险。</p> <p>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。</p>							

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欣荣灵活配置混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- （五）中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- （六）报告期内海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

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