

**海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金**  
**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：东方证券股份有限公司

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。

基金托管人东方证券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 5 月 13 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	17
6.1 审计意见.....	17
6.2 形成审计意见的基础.....	17
6.3 其他信息.....	17
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任.....	18
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	46
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 .....	46
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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	47
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
8.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>48</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>49</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>49</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
11.4 基金投资策略的改变 .....	50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
11.8 其他重大事件 .....	51
<b>12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>53</b>
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>55</b>
13.1 备查文件目录 .....	55
13.2 存放地点 .....	55
13.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金
基金简称	海富通瑞弘 6 个月定开债券
场内简称	海富通瑞弘 6 个月定开债券
基金主代码	008803
交易代码	008803
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 13 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	东方证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	460,008,361.19 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，通过积极主动的管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金为债券型基金，除《基金合同》另有约定外，对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%。在此约束下，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。在债券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期管理、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。另外，本基金采用信用类债券投资策略、资产支持证券投资策略、杠杆投资策略、开放期投资策略。
业绩比较基准	中债综合财富（1 年以下）指数收益率×60%+中债综合财富（1-3 年）指数收益率×20%+一年期定期存款利率（税后）×20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市

	场基金，但低于混合型基金、股票型基金。
--	---------------------

### 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	东方证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	马丽华
	联系电话	021-38650788	021-63320216
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	dftg@orientsec.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95503
传真		021-33830166	021-63320039
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	中国上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦
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	中国上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦,中国上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 3-6 层,12 层,13 层,22 层,25-27 层,29 层,32 层,36 层,38 层
邮政编码		200120	200010
法定代表人		杨仓兵	金文忠

### 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	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
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 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	10,757,512.72
本期利润	4,973,596.75
加权平均基金份额本期利润	0.0069
本期加权平均净值利润率	0.69%
本期基金份额净值增长率	0.89%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末
期末可供分配利润	4,085,589.52
期末可供分配基金份额利润	0.0089
期末基金资产净值	464,093,950.71
期末基金份额净值	1.0089
3.1.3 累计期末指标	2020 年末
基金份额累计净值增长率	0.89%

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 5 月 13 日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

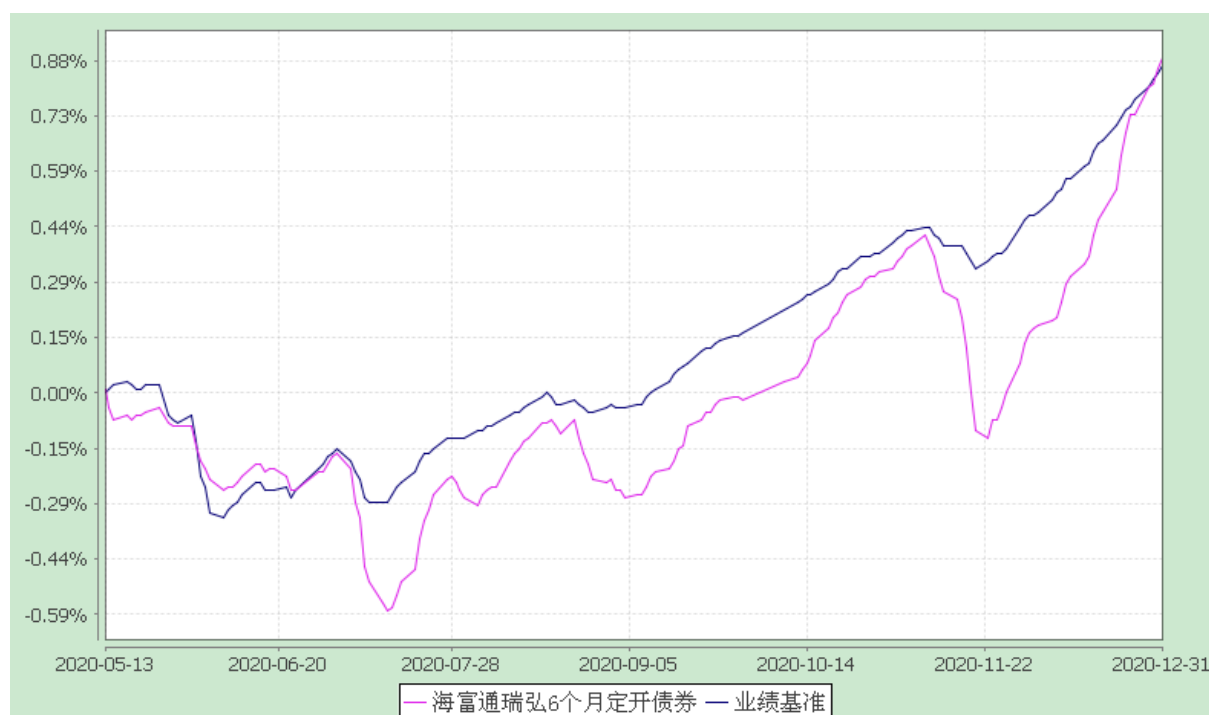
#### 3.2 基金净值表现

##### 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

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	0.91%	0.04%	0.71%	0.02%	0.20%	0.02%
过去六个 月	1.10%	0.04%	1.07%	0.02%	0.03%	0.02%
自基金合 同生效起 至今	0.89%	0.04%	0.87%	0.02%	0.02%	0.02%

### 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

海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
 (2020 年 5 月 13 日至 2020 年 12 月 31 日)



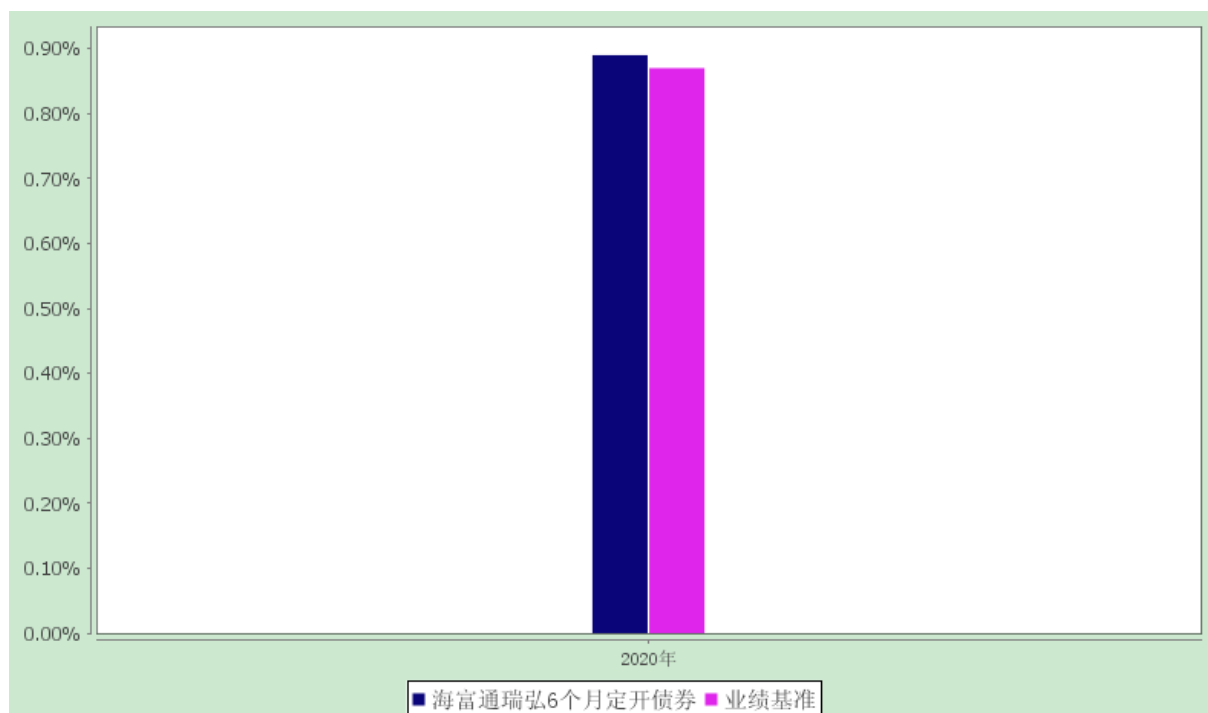
注：1、本基金合同于 2020 年 5 月 13 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。  
 2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。



### 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

#### 海富通瑞弘6个月定期开放债券型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



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5月13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

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5月13日生效，未实施利润分配。

## § 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、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		
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；海富通聚合纯债基金经理；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；海富通富泽混合基金经理。	2020-05-13	-	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。
陶斐然	本基金的基金经理助理；海富通添益货币的基金经理助理；海富通货币基金经理助理；海富通聚利债券基金经理助理；海富通融丰定开债券基金经理助理；海富通瑞合纯债基金经理助理；海富通瑞利债券基金经理助理；海富通聚合纯债基金经理助理。	2020-07-22	-	6年	金融学硕士，持有基金从业人员资格证书。2014年12月加入海富通基金管理有限公司，历任助理交易员、交易员、高级交易员。2020年6月起任海富通货币、海富通聚利债券、海富通融丰定开债券、海富通瑞合纯债、海富通瑞利债券、海富通添益货币的基金经理助理。2020年7月起兼任海富通聚合纯债、海富通瑞弘6个月定开债券基金经理助理。

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

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。

报告期，本基金重点投资于中高评级信用债，并维持中等杠杆，以获得稳定收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 0.89%，同期业绩比较基准收益率为 0.87%。

#### 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，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，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

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，本基金托管人在对海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金的管理人——海富通基金管理有限公司在海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金未进行利润分配。

#### **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**

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金 2020 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。



## § 6 审计报告

毕马威华振审字第 2100156 号

海富通瑞弘 6 个月定期开放债券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瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“海富通瑞弘 6 个月定开债券基金”）财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2020 年 5 月 13 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，公允反映了海富通瑞弘 6 个月定开债券基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2020 年 5 月 13 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。

### 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，我们独立于海富通瑞弘 6 个月定开债券基金，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

海富通瑞弘 6 个月定开债券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瑞弘 6 个月定开债券基金 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瑞弘 6 个月定开债券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，除非海富通瑞弘 6 个月定开债券基金计划进行清算、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瑞弘 6 个月定开债券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，就可能导致对海富通瑞弘 6 个月定开债券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瑞弘 6 个月定开债券基金不能持续经营。

(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：海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	594,431.56
结算备付金	7.4.10.6	3,998,031.96
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	589,434,000.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		559,359,000.00
资产支持证券投资		30,075,000.00

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	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	7,203,919.60
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		601,230,383.12
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>		
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		136,800,000.00
应付证券清算款		23,627.40
应付赎回款		-
应付管理人报酬		117,390.34
应付托管费		19,565.06
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	7,353.40
应交税费		32,311.48
应付利息		1,184.73
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	135,000.00
负债合计		137,136,432.41
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	460,008,361.19
未分配利润	7.4.7.10	4,085,589.52
所有者权益合计		464,093,950.71
负债和所有者权益总计		601,230,383.12

注：1、报告截止日2020年12月31日，基金份额净值1.0089元，基金份额总额460,008,361.19份。

2、基金合同成立于2020年5月13日，上年度可比期间无比较数据。

## 7.2 利润表

会计主体：海富通瑞弘6个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020年5月13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5月13日（基金合同生效日）至 2020年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>7,390,692.26</b>
1.利息收入		14,926,369.05
其中：存款利息收入	7.4.7.11	344,229.42
债券利息收入		10,781,198.92
资产支持证券利息收入		78,648.86
买入返售金融资产收入		3,722,291.85
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,751,761.27
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,751,761.27
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	-
股利收益	7.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-5,783,915.97
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	0.45
<b>减：二、费用</b>		<b>2,417,095.51</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,396,445.01
2. 托管费	7.4.10.2.2	232,740.91

3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	5,535.94
5. 利息支出		608,744.05
其中：卖出回购金融资产支出		608,744.05
6. 税金及附加		27,829.60
7. 其他费用	7.4.7.20	145,800.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>4,973,596.75</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>4,973,596.75</b>

注：本财务报表的实际编制期间为 2020 年 5 月 13 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：海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 5 月 13 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 5 月 13 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）	800,010,350.31	-	800,010,350.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,973,596.75	4,973,596.75
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）	-340,001,989.12	-888,007.23	-340,889,996.35
其中：1.基金申购款	3,645.42	7.70	3,653.12
2.基金赎回款	-340,005,634.54	-888,014.93	-340,893,649.47
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)	460,008,361.19	4,085,589.52	464,093,950.71

注：本财务报表的实际编制期间为 2020 年 5 月 13 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。

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

海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金（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[2019]2682 号《关于准予海富通瑞弘 6 个月定期开放债券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《海富通瑞弘 6 个月定期开放债券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 800,010,344.59 元。经向中国证监会备案，《海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 800,010,350.31 份，其中认购资金利息折合 5.72 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，基金托管人为东方证券股份有限公司。

根据《海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。本基金以定期开放的方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。本基金以 6 个月为一个封闭期。本基金的封闭期为自《海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效之日起（包括生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）至该封闭期首日的 6 个月对日的前一日止。本基金的首个封闭期为自《海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效之日起（包括生效之日）至基金合同生效日的 6 个月对日的前一日止。第二个封闭期为首个开放期结束之日次日起（包括该日）至该封闭期首日的 6 个月对日的前一日止，以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期最长不超过 20 个工作日，最短不少于 5 个工作日，开放期的具体时间由基金管理人在开放期前依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证

券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）、货币市场工具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）。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券、可交换债券。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规与基金托管人协商一致后适时合理地调整投资范围。本基金投资组合资产配置比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产总值的 80%。但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每个开放期开始前 15 个工作日、开放期及开放期结束后 15 个工作日的期间内，本基金的债券资产的投资比例可不受前述限制。开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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、应收申购款等，封闭期内，本基金不受前述 5% 的限制。本基金业绩比较基准为：中债综合财富（1 年以下）指数收益率×60%+中债综合财富（1-3 年）指数收益率×20%+一年期定期存款利率（税后）×20%。

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 5 月 13 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 5 月 13 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。

本基金持有的债券投资和资产支持证券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。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

债券投资收益和资产支持证券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

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和托管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债券、资产支持证券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《海富通瑞弘 6 个月定期开放债券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基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若《海富通瑞弘 6 个月定期开放债券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基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；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。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。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。

#### 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 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《中国证券监督管理委员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交易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 [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。

(d)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	594,431.56
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	594,431.56

#### 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	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	244,869,845.77	-4,260,845.77
	银行间市场	320,470,098.70	-1,720,098.70
	合计	565,339,944.47	-5,980,944.47
资产支持证券	29,877,971.50	30,075,000.00	197,028.50
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	595,217,915.97	589,434,000.00	-5,783,915.97

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产 / 负债。

#### 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

本基金于本报告期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

本基金于本报告期末未持有从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	2,563.04
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	1,979.01
应收债券利息	7,108,243.30
应收资产支持证券利息	91,134.25
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	7,203,919.60

#### 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	-
银行间市场应付交易费用	7,353.40
合计	7,353.40

#### 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	-
预提费用	135,000.00
合计	135,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 5 月 13 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	800,010,350.31	800,010,350.31
本期申购	3,645.42	3,645.42
本期赎回（以“-”号填列）	-340,005,634.54	-340,005,634.54
本期末	460,008,361.19	460,008,361.19

注：1、本基金自 2020 年 4 月 15 日至 2020 年 5 月 7 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 800,010,344.59 元。根据《海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 5.72 元在本基金成立后，折算为 5.72 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、根据《海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》和《海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告》的相关规定，本基金以定期开放的方式运作，本基金的第一个封闭期为 2020 年 5 月 13 日起至 2020 年 11 月 12 日，自 2020 年 11 月 13 日起（含该日）至 2020 年 11 月 19 日（含该日）期间的工作日，本基金接受投资者的申购、赎回、转入及转出申请。自 2020 年 11 月 20 日至 2021 年 5 月 19 日止，为本基金的第二个封闭期。

3、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

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	10,757,512.72	-5,783,915.97	4,973,596.75
本期基金份额交易产生的变动数	-4,027,574.09	3,139,566.86	-888,007.23
其中：基金申购款	43.99	-36.29	7.70
基金赎回款	-4,027,618.08	3,139,603.15	-888,014.93
本期已分配利润	-	-	-



本期末	6,729,938.63	-2,644,349.11	4,085,589.52
-----	--------------	---------------	--------------

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年5月13日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
活期存款利息收入	177,104.58	
定期存款利息收入	105,416.67	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	61,708.07	
其他	0.10	
合计	344,229.42	

**7.4.7.12 股票投资收益**

本基金在本报告期内无股票投资收益。

**7.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年5月13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	210,321,185.67	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	209,660,350.91	
减：应收利息总额	2,412,596.03	
买卖债券差价收入	-1,751,761.27	

**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**

本基金在本报告期内无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

本基金在本报告期内无股利收益。

**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5月13日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-5,783,915.97
——股票投资	-
——债券投资	-5,980,944.47
——资产支持证券投资	197,028.50
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
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	-5,783,915.97

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年5月13日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	0.45
合计	0.45

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年5月13日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	310.94
银行间市场交易费用	5,225.00
合计	5,535.94

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年5月13日（基金合同生效日）至2020年12月31日
审计费用	55,000.00
信息披露费	80,000.00
债券托管账户维护费	10,500.00
其他	300.00
合计	145,800.00

## 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、注册登记机构、基金销售机构
东方证券股份有限公司(“东方证券”)	基金托管人
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东
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

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过股票交易，基金合同成立于2020年5月13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5月13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

本基金在本报告期内没有应支付关联方的佣金，基金合同成立于2020年5月13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5月13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	1,396,445.01
其中：支付销售机构的客户维护费	14.46

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0.30%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×0.30%/当年天数。

2、基金合同成立于2020年5月13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5月13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	232,740.91

注：1、支付基金托管人东方证券的基金托管费按前一日基金资产净值0.05%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×0.05%/当年天数。

2、基金合同成立于2020年5月13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

单位：人民币元

本期
----

2020年5月13日（基金合同生效日）至2020年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收 入	交易金额	利息支 出
东方证券	61,180,736.83	-	-	-	-	-

注：基金合同成立于2020年5月13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5月13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5月13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5月13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5月13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5月13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
东方证券	594,431.56	177,104.58

注：1、本基金通过托管人东方证券转存于兴业银行股份有限公司上海分行的银行存款，于2020年12月31日的相关余额为人民币594,431.56元，2020年产生的利息收入为人民币177,104.58元。

本基金通过东方证券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3,998,031.96元。

2、基金合同成立于 2020 年 5 月 13 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**

本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券，基金合同成立于 2020 年 5 月 13 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**

##### **7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金于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 5 月 13 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**

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

##### **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 136,800,000.00 元，于 2021 年 1 月 27 日（先后）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

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。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，使本基金在严格控制风险的基础上，追求基金资产长期稳定增值，力争实现高于业绩比较基准的投资收益。

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多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。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，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127.01%。基金合同成立于2020年5月13日，上年度可比期间无比较数据。

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	469,725,000.00
AAA 以下	89,634,000.00
未评级	-
合计	559,359,000.00

注：基金合同成立于2020年5月13日，上年度可比期间无比较数据。

#### 7.4.13.2.2 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	30,075,000.00
AAA 以下	-
未评级	-
合计	30,075,000.00

注：基金合同成立于2020年5月13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于约定开放日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于开放期内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款余额中有 136,800,000.00 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》且于基金开放期内按照《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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内,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。在开放期内,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 6.48%。

于开放期内,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。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 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	594,431.56	-	-	-	594,431.56
结算备付金	3,998,031.96	-	-	-	3,998,031.96
交易性金融资产	181,023,000.00	408,411,000.00	-	-	589,434,000.00
应收利息	-	-	-	7,203,919.60	7,203,919.60
资产总计	185,615,463.52	408,411,000.00	-	7,203,919.60	601,230,383.12
负债					
卖出回购金融资产款	136,800,000.00	-	-	-	136,800,000.00
应付证券清算	-	-	-	23,627.40	23,627.40

款					
应付管理人报酬	-	-	-	117,390.34	117,390.34
应付托管费	-	-	-	19,565.06	19,565.06
应付交易费用	-	-	-	7,353.40	7,353.40
应交税费	-	-	-	32,311.48	32,311.48
应付利息	-	-	-	1,184.73	1,184.73
其他负债	-	-	-	135,000.00	135,000.00
负债总计	136,800,000.00	-	-	336,432.41	137,136,432.41
利率敏感度缺口	48,815,463.52	408,411,000.00	-	6,867,487.19	464,093,950.71

注：1、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。

2、基金合同成立于 2020 年 5 月 13 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	-4,153,808.20
	市场利率下降 25 个基点	4,203,618.61

注：基金合同成立于 2020 年 5 月 13 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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券的比例不低于基金资产总值的 80%。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。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。基金合同成立于 2020 年 5 月 13 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

##### 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二层次的余额为人民币 589,434,000.00 元，无属于第一或第三层次的余额。

##### (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。

##### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	589,434,000.00	98.04
	其中：债券	559,359,000.00	93.04
	资产支持证券	30,075,000.00	5.00
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	4,592,463.52	0.76
8	其他各项资产	7,203,919.60	1.20
9	合计	601,230,383.12	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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期内未买入股票。

### 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

本基金本报告期内未卖出股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	209,580,000.00	45.16
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	180,477,000.00	38.89
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	169,302,000.00	36.48
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	559,359,000.00	120.53

### 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	102001762	20 首机场股 MTN001	300,000	30,249,000.00	6.52
2	101900893	19 中建材 MTN002	300,000	30,249,000.00	6.52
3	155019	18 浙商 01	300,000	30,240,000.00	6.52
4	143621	18 蓝星 02	300,000	30,228,000.00	6.51
5	1620029	16 齐鲁银行二级 01	300,000	30,183,000.00	6.50

**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	占基金资产 净值比例 (%)
1	2089382	20 飞驰建 融 2A_bc	300,000	30,075,000.00	6.48

**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**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

根据合同规定，本基金不投资股指期货。

**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，本基金暂不投资国债期货。

**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，本基金暂不投资国债期货。

**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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,203,919.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,203,919.60

**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**

本基金本报告期末未持有股票。

**§ 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

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
245	1,877,585.15	459,998,000.00	100.00%	10,361.19	0.00%



**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	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	109.16	0.0000%

**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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2020年5月13日)基金份额总额	800,010,350.31
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,645.42
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	340,005,634.54
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	460,008,361.19

**§ 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、自 2021 年 1 月起，罗敏同志担任东方证券股份有限公司托管业务总部副总经理，主持工作。张梅同志自 2020 年 12 月 31 日起不再担任托管业务总部总经理。

## 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 55,000.00 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	
东方证券	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元没有发生变更。

## 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
东方证券	305,908,487.98	100.00%	9,615,400,000.00	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	海富通瑞弘6个月定期开放债券型证券投资基金基金份额发售公告	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	2020-04-10
2	关于海富通瑞弘6个月定期开放债券型证券投资基金提前结束募集的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网	2020-05-07

		站	
3	海富通瑞弘6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告	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	2020-05-14
4	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
5	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
6	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
7	海富通基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告	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	2020-07-22
8	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
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	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
10	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
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	2020-08-22
12	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
13	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

14	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
15	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
16	海富通瑞弘6个月定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告	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	2020-11-11
17	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
18	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	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	2020-11-18
19	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

## 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%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020/5/13-2020/12/31	399,999.00	-	-	399,999.00	86.95%
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>							

2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于 5000 万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

4、其他可能的风险。

另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50% 或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50% 时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

注：本基金合同生效日为 2020 年 5 月 13 日，期初份额指基金合同生效日持有份额。

## 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瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金的文件
- (二) 海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同
- (三) 海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议
- (五) 中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六) 法律法规及中国证监会规定的其他文件

### 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

