

海富通改革驱动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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	6
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
§4 管理人报告	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
§5 托管人报告	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	17
§6 审计报告	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
§7 年度财务报表	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
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	67
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	67
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	67
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
8.12 投资组合报告附注	68
§9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
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	69
§10 开放式基金份额变动	70
§11 重大事件揭示	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
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	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
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	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	72
12 影响投资者决策的其他重要信息	77
§13 备查文件目录	79
13.1 备查文件目录	79
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	80

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	海富通改革驱动混合
基金主代码	519133
交易代码	519133
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 28 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,354,467,423.87 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将积极把握改革带来的投资机会，使投资者充分分享中国改革发展成果，并利用灵活的资产配置，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，形成对不同市场周期的预测和判断，通过灵活主动且有纪律的资产配置，确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例。本基金股票投资组合构建包括三个层次：首先是挖掘受益改革的行业；然后是在受益行业分析基础之上进行行业分析与配置；最后自下而上在行业内部精选个股。在债券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	郭明
	联系电话	021-38650788	010-66105799
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588
传真		021-33830166	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		杨仓兵	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大 楼 8 层
注册登记机构	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
本期已实现收益	474,222,519.80	116,720,971.99	-173,951,911.91
本期利润	830,161,376.04	173,978,858.99	-211,669,732.40
加权平均基金份额 本期利润	1.0986	0.5883	-0.2748
本期加权平均净值 利润率	51.19%	54.72%	-28.06%
本期基金份额净值 增长率	89.50%	74.12%	-27.57%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	1,551,246,332.95	49,919,439.90	-58,773,932.12
期末可供分配基金 份额利润	0.6589	0.2091	-0.2043
期末基金资产净值	5,561,211,649.82	330,838,060.20	228,962,715.88
期末基金份额净值	2.362	1.386	0.796
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值 增长率	209.32%	63.23%	-6.26%

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

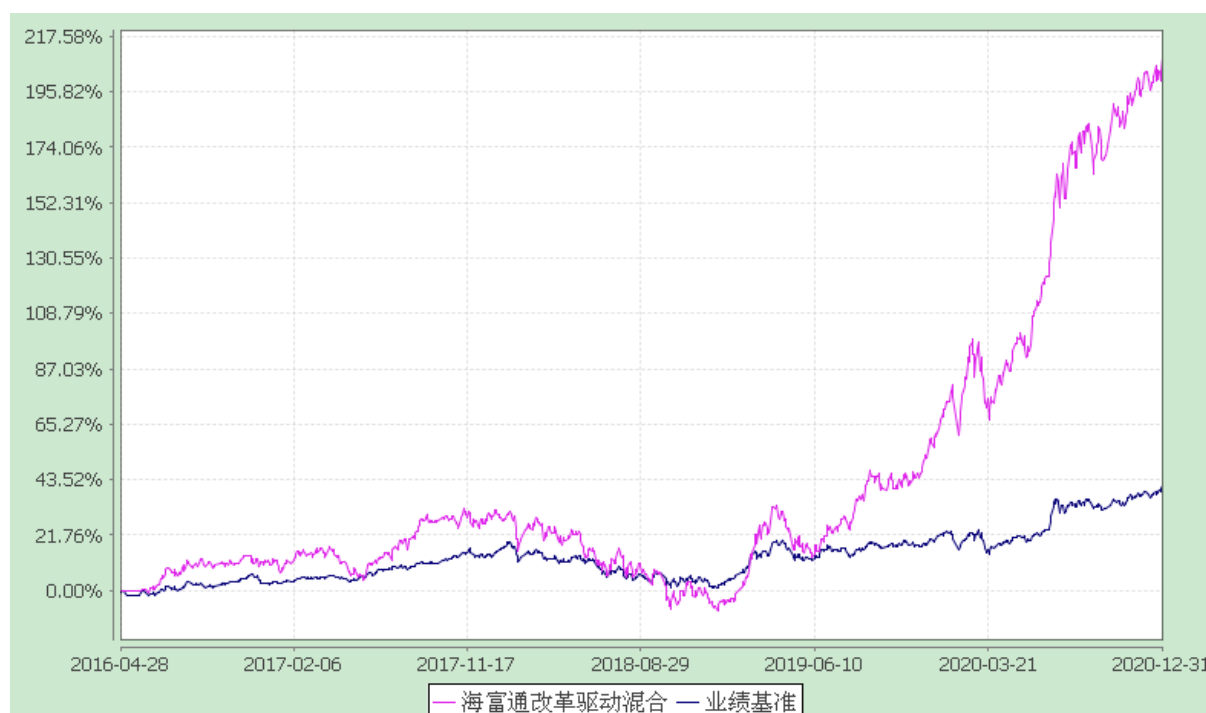
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①—③	②—④
----	--------------	--------------	--------------	--------------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	14.35%	1.14%	6.87%	0.50%	7.48%	0.64%
过去六个月	35.25%	1.41%	12.61%	0.69%	22.64%	0.72%
过去一年	89.50%	1.64%	15.40%	0.72%	74.10%	0.92%
过去三年	138.99%	1.52%	23.21%	0.67%	115.78%	0.85%
自基金合同生效起至今	209.32%	1.32%	41.17%	0.58%	168.15%	0.74%

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

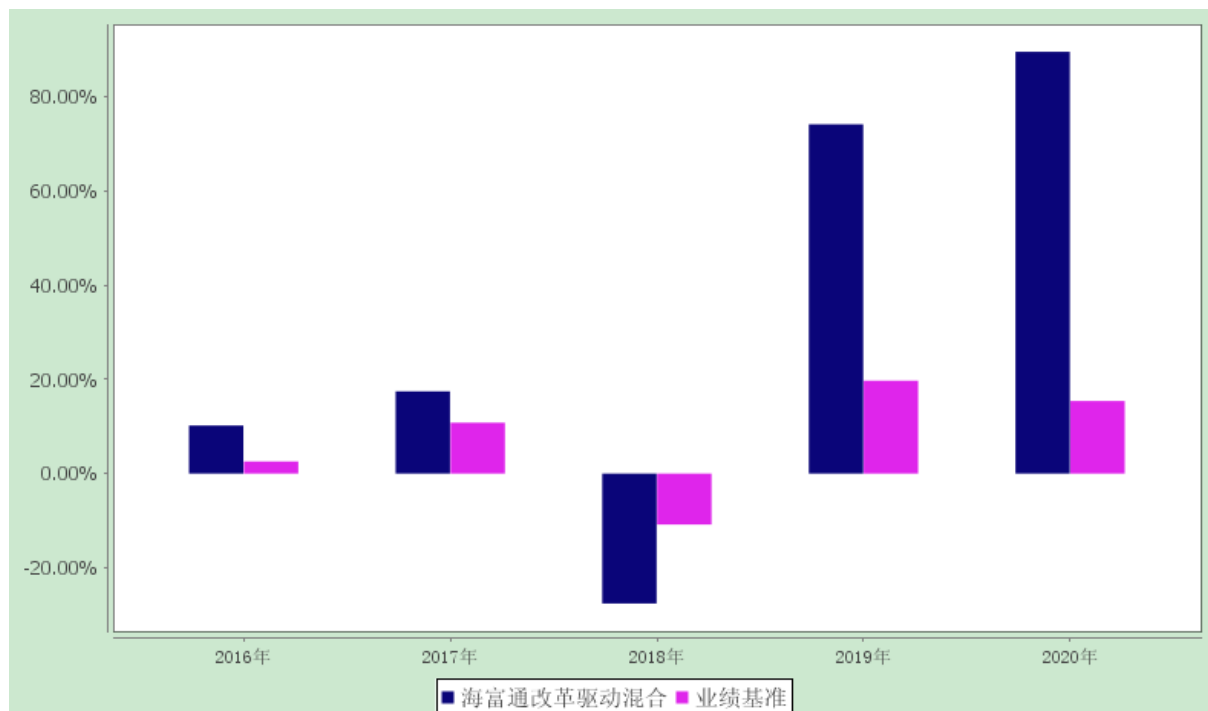
海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2016 年 4 月 28 日至 2020 年 12 月 31 日)



注：本基金合同于 2016 年 4 月 28 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

海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金
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 2016 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 4 月 28 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	2.540	178,493,314.09	235,104,476.83	413,597,790.92	-
2019年	-	-	-	-	-
2018年	-	-	-	-	-
合计	2.540	178,493,314.09	235,104,476.83	413,597,790.92	-

§ 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		
周雪军	本基金的基金经理；海富通沪港深混合基金经理；海富通收益增长混合基金经理；公募权益投资部总监。	2016-04-28	-	12 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任北京金融街控股股份有限公司职员、天治基金管理有限公司研究员，2012 年 6 月至 2015 年 2 月任天治财富增长混合基金经理，2014 年 1 月至 2015 年 2 月兼任天治趋势精选混合基金经理。2015 年 2 月加入海富通基金管理有限公司，历任公募权益投资部总经理，现任公募权益投资部总监。2015 年 6 月起任海富通收益增长混合基金经理。2016 年 4 月起兼任海富通改革驱动混合基金经理。2018 年 11 月至 2019 年 11 月兼任海富通中小盘混合基金经理。2018 年 12 月起兼任海富通沪港深混合基金经理。
陆怡雯	本基金的基金经理助理；海富通精选贰号混合基金经理助理；海富通精选混合基金经理助	2018-06-21	2020-09-02	9 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。曾在中国银行上海分行工作，并历任元大证券（香港）研究员、金元惠理基金管理有限公司研究员、上海申万宏源证券研究所高级分析师。2016 年 1 月加入海富通基金管理有限公

	理；海富通领先成长混合基金经理助理；海富通内需热点混合基金经理助理；海富通收益增长混合基金经理助理。				司，历任股票分析师、高级股票分析师、公募权益投资部基金经理助理。2020 年 9 月起任海富通风格优势混合基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规的具体要求，持续完善了公司投资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。

在 2020 年的操作中，本基金较好把握住了市场的节奏变化和结构转换，同时在科技成长、消费价值、周期金融等板块内进一步强化个股精选，总体取得了较显著的超额受益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期，本基金净值增长率为 89.50%，同期基金业绩比较基准收益率为 15.40%，基金净值跑赢业绩比较基准 74.10 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。

对于 2021 年，本基金将进一步聚焦全球及中国经济复苏的状况，积极挖掘景气趋势向好的细分行业及个股，同时注意规避可能存在估值泡沫或价值陷阱的领域，努力获取基金净值的良好表现。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核

无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金报告期内进行过一次利润分配，以截止 2020 年 11 月 24 日本基金的可供分配利润为基准，分红于 2020 年 12 月 1 日完成权益登记，单位分红金额为 0.2540 元，合计利润分配金额 413,597,790.92 元，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改革驱动灵活配置混合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，海富通改革驱动灵活配置混合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改革驱动灵活配置混合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。

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改革驱动灵活配置混合型证券投资基金 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 2100142 号

海富通改革驱动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

我们审计了后附的海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“海富通改革驱动混合”）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、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，公允反映了海富通改革驱动混合 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（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，我们独立于海富通改革驱动混合，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

海富通改革驱动混合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改革驱动混合 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改革驱动混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非海富通改革驱动混合计划进行清算、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改革驱动混合的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

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

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对海富通改革驱动混合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改革驱动混合不能持续经营。

(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：海富通改革驱动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	434,333,850.85	17,005,297.25
结算备付金	7.4.10.6	15,431,901.64	1,102,161.64
存出保证金		677,268.61	163,620.25
交易性金融资产	7.4.7.2	5,107,132,839.71	295,661,250.02
其中：股票投资		5,106,495,839.71	295,661,250.02

基金投资		-	-
债券投资		637,000.00	-
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		59,766,516.04	-
应收利息	7.4.7.5	39,709.61	4,338.09
应收股利		-	-
应收申购款		95,518,730.75	30,100,212.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,712,900,817.21	344,036,879.79
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		115,473,947.82	11,458,968.22
应付赎回款		23,965,100.73	612,731.77
应付管理人报酬		6,144,075.45	368,479.88
应付托管费		1,024,012.52	61,413.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,817,994.23	507,045.38
应交税费		37.65	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	263,998.99	190,181.01
负债合计		151,689,167.39	13,198,819.59
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,354,467,423.87	238,700,545.79

未分配利润	7.4.7.10	3,206,744,225.95	92,137,514.41
所有者权益合计		5,561,211,649.82	330,838,060.20
负债和所有者权益总计		5,712,900,817.21	344,036,879.79

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.362 元，基金份额总额 2,354,467,423.87 份。

7.2 利润表

会计主体：海富通改革驱动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 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
一、收入		871,834,389.04	183,295,973.14
1.利息收入		790,950.61	215,139.51
其中：存款利息收入	7.4.7.11	787,793.12	215,139.51
债券利息收入		3,157.49	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		513,534,684.14	125,048,543.32
其中：股票投资收益	7.4.7.12	498,914,056.17	119,626,193.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,695,258.88	-
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	11,925,369.09	5,422,350.26
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	355,938,856.24	57,257,887.00
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	1,569,898.05	774,403.31
减：二、费用		41,673,013.00	9,317,114.15
1. 管理人报酬	7.4.10.2.	23,903,214.33	4,738,942.65

	1		
2. 托管费	7.4.10.2. 2	3,983,869.05	789,823.85
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	13,603,929.29	3,597,567.65
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		11.30	-
7. 其他费用	7.4.7.20	181,989.03	190,780.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		830,161,376.04	173,978,858.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		830,161,376.04	173,978,858.99

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通改革驱动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）	238,700,545.79	92,137,514.41	330,838,060.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	830,161,376.04	830,161,376.04
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）	2,115,766,878.08	2,698,043,126.42	4,813,810,004.50
其中：1.基金申购款	2,477,955,981.05	3,064,384,493.50	5,542,340,474.55
2.基金赎回款	-362,189,102.97	-366,341,367.08	-728,530,470.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生	-	-413,597,790.92	-413,597,790.92

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）	2,354,467,423.87	3,206,744,225.95	5,561,211,649.82
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）	287,736,648.00	-58,773,932.12	228,962,715.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	173,978,858.99	173,978,858.99
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）	-49,036,102.21	-23,067,412.46	-72,103,514.67
其中：1.基金申购款	262,395,424.44	20,996,791.76	283,392,216.20
2.基金赎回款	-311,431,526.65	-44,064,204.22	-355,495,730.87
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）	238,700,545.79	92,137,514.41	330,838,060.20

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

海富通改革驱动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[2015]2741 号文《关于准予海富通改革驱动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《海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金基金

合同》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 264,051,625.44 元。经向中国证监会备案，《海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 264,112,228.69 份基金份额，其中认购资金利息折合 60,603.25 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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、债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指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）。本基金的投资组合比例为：基金投资组合中股票资产及存托凭证占基金资产的 0%~95%，权证投资占基金资产净值的 0%~3%，现金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%~100%，其中，在每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金将 80% 以上的非现金资产投资于改革驱动主题相关的公司发行的股票、存托凭证和债券。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适时合理地调整投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×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、2020 年度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，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

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

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益、资产证券投资收益和衍生工具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。

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

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

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

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用于进行股票、债券、资产支持证券、衍生工具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《海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红。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除权日经除权后的基金份额净值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；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。法律法规或监管机构另有规定的或在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进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

行估值。

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题

的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税 [2017] 90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	434,333,850.85	17,005,297.25
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	434,333,850.85	17,005,297.25

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	4,721,952,371.36	5,106,495,839.71	384,543,468.35
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	637,000.00	637,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	637,000.00	637,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,722,589,371.36	5,107,132,839.71	384,543,468.35
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	267,056,637.91	295,661,250.02	28,604,612.11
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	267,056,637.91	295,661,250.02	28,604,612.11
----	----------------	----------------	---------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末均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及上年度末均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及上年度末均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	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	32,449.34	3,768.49
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	6,944.40	495.90
应收债券利息	11.17	-
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	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	304.70	73.70
合计	39,709.61	4,338.09

7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	4,817,994.23	507,045.38
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	4,817,994.23	507,045.38

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	83,998.99	181.01
预提费用	180,000.00	190,000.00
合计	263,998.99	190,181.01

7.4.7.9 实收基金

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	238,700,545.79	238,700,545.79
本期申购	2,477,955,981.05	2,477,955,981.05
本期赎回（以“-”号填列）	-362,189,102.97	-362,189,102.97
本期末	2,354,467,423.87	2,354,467,423.87

注：此处申购含红利再投资、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
上年度末	49,919,439.90	42,218,074.51	92,137,514.41
本期利润	474,222,519.80	355,938,856.24	830,161,376.04
本期基金份额交易产生的变动数	1,440,702,164.17	1,257,340,962.25	2,698,043,126.42
其中：基金申购款	1,637,168,098.04	1,427,216,395.46	3,064,384,493.50
基金赎回款	-196,465,933.87	-169,875,433.21	-366,341,367.08
本期已分配利润	-413,597,790.92	-	-413,597,790.92

本期末	1,551,246,332.95	1,655,497,893.00	3,206,744,225.95
-----	------------------	------------------	------------------

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	473,679.75	187,983.55
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	74,171.10	18,782.25
其他	239,942.27	8,373.71
合计	787,793.12	215,139.51

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	4,144,977,654.70	1,482,411,720.83
减：卖出股票成本总额	3,646,063,598.53	1,362,785,527.77
买卖股票差价收入	498,914,056.17	119,626,193.06

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	20,666,299.48	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,967,800.00	-
减：应收利息总额	3,240.60	-
买卖债券差价收入	2,695,258.88	-

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

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	11,925,369.09	5,422,350.26
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	11,925,369.09	5,422,350.26

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	355,938,856.24	57,257,887.00
——股票投资	355,938,856.24	57,257,887.00
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——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	355,938,856.24	57,257,887.00

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	1,161,020.49	573,614.83
退还证券交易监管费收入	471.77	-
基金转换费收入	408,405.79	200,788.48
合计	1,569,898.05	774,403.31

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	13,603,929.29	3,597,567.65
银行间市场交易费用	-	-
合计	13,603,929.29	3,597,567.65

7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	60,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
银行划款手续费	1,989.03	780.00
其他	-	-
合计	181,989.03	190,780.00

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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东
上海富诚海富通资产管理有限公司	基金管理人的子公司
海富通资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年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	2,880,912,221.92	23.83%	-	-

7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

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	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例

海通证券	4,409,705.26	21.34%	-	-
------	--------------	--------	---	---

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过回购交易。

7.4.10.1.4 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	2,049,198.55	24.87%	2,010,676.90	41.73%
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	-	-	-	-

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

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

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	23,903,214.33	4,738,942.65
其中：支付销售机构的客户维护费	1,272,075.35	921,823.83

注：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1.50%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×1.50%/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	3,983,869.05	789,823.85

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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×0.25%/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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均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**

本基金在本报告期内及上年度可比期间均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。

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及上年度可比期间均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。

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与上年度可比期间均未持有过本基金。

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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

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 2020年1月1日至2020年12月31	上年度可比期间 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
中国工商银行	434,333,850.85	473,679.75	17,005,297.25	187,983.55

注：本基金通过“中国工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2020 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 15,431,901.64 元。（2019 年 12 月 31 日：人民币 1,102,161.64 元）

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	公开发行	1,421	9,861.74
海通证券	300879	大叶股份	公开发行	4,660	49,302.80
海通证券	688180	君实生物	公开发行	15,357	852,313.50
海通证券	688301	奕瑞科技	公开发行	2,427	290,269.20
海通证券	688521	芯原股份	公开发行	13,200	508,596.00
海通证券	688536	思瑞浦	公开发行	3,566	412,621.86
海通证券	688550	瑞联新材	公开发行	2,539	288,735.08
海通证券	688981	中芯国际	公开发行	208,749	5,732,247.54
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

7.4.10.8.1 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

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	本期利润 分配合计	备注
1	2020-12-01	2020-12-01	2.540	178,493,314.09	235,104,476.83	413,597,790.92	-
合计			2.540	178,493,314.09	235,104,476.83	413,597,790.92	-

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
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
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	-
3030	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	-
3031	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	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股未上市并锁定	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
601615	明阳智能	2020-11-20	2021-05-18	非公开发行流通受限	14.02	17.56	2,710,414	38,000,004.28	47,594,869.84	-

603218	日月股份	2020-12-01	2021-05-27	非公开发行流通受限	20.37	27.91	1,865,488	37,999,990.56	52,065,770.08	-
2332	仙琚制药	2020-11-27	2021-05-27	非公开发行流通受限	13.70	12.69	2,919,708	39,999,999.60	37,051,094.52	-
603218	日月股份	2020-08-05	2021-02-05	大宗交易	17.34	28.79	600,000	10,404,000.00	17,274,000.00	-
600563	法拉电子	2020-12-30	2021-06-30	大宗交易	94.70	99.41	425,000	40,247,500.00	42,249,250.00	-
603501	韦尔股份	2020-09-14	2021-03-15	大宗交易	171.57	217.89	154,300	26,472,798.19	33,621,015.01	-
603501	韦尔股份	2020-09-29	2021-03-29	大宗交易	171.57	217.89	61,400	10,534,217.81	13,378,679.99	-
688095	福昕软件	2020-09-01	2021-03-08	新股锁定	238.53	228.79	1,981	472,527.93	453,232.99	-
688156	路德环境	2020-09-14	2021-03-22	新股锁定	15.91	20.07	2,602	41,397.82	52,222.14	-
688165	埃夫特	2020-07-07	2021-01-15	新股锁定	6.35	13.10	28,728	182,422.80	376,336.80	-
688408	中信博	2020-08-20	2021-03-01	新股锁定	42.19	160.54	4,450	187,745.50	714,403.00	-
688508	芯朋微	2020-07-15	2021-01-22	新股锁定	28.30	91.91	3,729	105,530.70	342,732.39	-
688510	航亚科技	2020-12-07	2021-06-16	新股锁定	8.17	25.53	5,991	48,946.47	152,950.23	-
688559	海目星	2020-08-28	2021-03-09	新股锁定	14.56	30.97	5,924	86,253.44	183,466.28	-
688577	浙海德曼	2020-09-08	2021-03-16	新股锁定	33.13	42.01	1,503	49,794.39	63,141.03	-
300860	锋尚文化	2020-08-06	2021-02-24	新股锁定	138.02	126.67	381	52,585.62	48,261.27	-
300861	美畅股份	2020-08-06	2021-02-24	新股锁定	43.76	51.10	895	39,165.20	45,734.50	-
300863	卡倍亿	2020-08-11	2021-02-24	新股锁定	18.79	103.22	3,421	64,280.59	353,115.62	-

300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	新股锁定	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300866	安克创新	2020-08-11	2021-02-24	新股锁定	66.32	156.18	9,451	626,790.32	1,476,057.18	-
300867	圣元环保	2020-08-12	2021-03-03	新股锁定	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	-
300868	杰美特	2020-08-12	2021-02-24	新股锁定	41.26	43.28	593	24,467.18	25,665.04	-
300872	天阳科技	2020-08-14	2021-02-25	新股锁定	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64	-
300873	海晨股份	2020-08-14	2021-03-02	新股锁定	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300876	蒙泰高新	2020-08-14	2021-02-25	新股锁定	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300877	金春股份	2020-08-17	2021-03-03	新股锁定	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300878	维康药业	2020-08-17	2021-03-03	新股锁定	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300879	大叶股份	2020-08-25	2021-03-01	新股锁定	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	新股锁定	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300882	万胜智能	2020-08-27	2021-03-10	新股锁定	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300884	狄耐克	2020-11-05	2021-05-12	新股锁定	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	新股锁定	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300887	谱尼测试	2020-09-09	2021-03-16	新股锁定	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300889	爱克股份	2020-09-09	2021-03-16	新股锁定	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020-09-10	2021-03-18	新股锁定	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	新股锁定	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020-09-11	2021-03-30	新股锁定	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300893	松原股份	2020-09-17	2021-03-24	新股锁定	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300894	火星人	2020-12-24	2021-07-01	新股锁定	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300899	铜牛	2020-	2021-	新股	12.65	45.30	283	3,579.	12,81	-

5	信息	09-17	03-24	锁定				95	9.90	
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	新股锁定	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-
300898	熊猫乳品	2020-10-09	2021-04-16	新股锁定	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300908	仲景食品	2020-11-13	2021-05-24	新股锁定	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300909	汇创达	2020-11-11	2021-05-18	新股锁定	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300917	特发服务	2020-12-14	2021-06-21	新股锁定	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	新股锁定	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300922	天秦装备	2020-12-18	2021-06-25	新股锁定	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300999	金龙鱼	2020-09-29	2021-04-15	新股锁定	25.70	88.29	10,115	259,955.50	893,053.35	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113616	韦尔转债	2020-12-28	2021-01-22	老股东配债	100.00	100.00	6,370	637,000.00	637,000.00	-

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

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

于 2020 年 12 月 31 日,本基金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

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，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中国工商银行，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 0.01%(2019 年 12 月 31 日：无)。

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	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	637,000.00	-
未评级	-	-
合计	637,000.00	-

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上市公司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上述比例限制）。

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 4.50%。

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、结算备付金及存出保证金等。

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	434,333,850.85	-	-	-	434,333,850.85
结算备付金	15,431,901.64	-	-	-	15,431,901.64
存出保证金	677,268.61	-	-	-	677,268.61
交易性金融资产	-	-	637,000.00	5,106,495,839.71	5,107,132,839.71
应收证券清算款	-	-	-	59,766,516.04	59,766,516.04
应收利息	-	-	-	39,709.61	39,709.61
应收申购款	89,830,657.24	-	-	5,688,073.51	95,518,730.75
资产总计	540,273,678.34	-	637,000.00	5,171,990,138.71	5,712,900,817.05

				87	7.21
负债					
应付证券清算款	-	-	-	115,473,947.82	115,473,947.82
应付赎回款	-	-	-	23,965,100.73	23,965,100.73
应付管理人报酬	-	-	-	6,144,075.45	6,144,075.45
应付托管费	-	-	-	1,024,012.52	1,024,012.52
应付交易费用	-	-	-	4,817,994.23	4,817,994.23
应交税费	-	-	-	37.65	37.65
其他负债	-	-	-	263,998.99	263,998.99
负债总计	-	-	-	151,689,167.39	151,689,167.39
利率敏感度缺口	540,273,678.34	-	637,000.00	5,020,300,971.48	5,561,211,649.82
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	17,005,297.25	-	-	-	17,005,297.25
结算备付金	1,102,161.64	-	-	-	1,102,161.64
存出保证金	163,620.25	-	-	-	163,620.25
交易性金融资产	-	-	-	295,661,250.02	295,661,250.02
应收利息	-	-	-	4,338.09	4,338.09
应收申购款	29,999,000.00	-	-	101,212.54	30,100,212.54
资产总计	48,270,079.14	-	-	295,766,800.65	344,036,879.79
负债					
应付证券清算款	-	-	-	11,458,968.22	11,458,968.22
应付赎回款	-	-	-	612,731.77	612,731.77
应付管理人报酬	-	-	-	368,479.88	368,479.88
应付托管费	-	-	-	61,413.33	61,413.33
应付交易费用	-	-	-	507,045.38	507,045.38
其他负债	-	-	-	190,181.01	190,181.01

负债总计	-	-	-	13,198,819.59	13,198,819.59
利率敏感度缺口	48,270,079.14	-	-	-282,567,981.06	330,838,060.20

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	-9,119.13	-
	市场利率下降 25 个基点	9,275.25	-

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投资比例为基金总资产的 0%-95%，权证投资占基金资产净值的 0%~3%，现金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%~100%，其中，在每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金将 80% 以上的非现金资产投资于改革驱动主题相关的公司发行的股票、存托凭证和

债券。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	5,106,495,839.71	91.82	295,661,250.02	89.37
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	5,106,495,839.71	91.82	295,661,250.02	89.37

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)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%	286,355,195.60	15,866,521.92
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-286,355,195.60	-15,866,521.92

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 4,857,156,334.28 元，属于第二层次的余额为人民币 249,976,505.43 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人民币 289,866,481.51 元，属于第二层次的余额为人民币 5,794,768.51 元，无属于第三层次的余额)。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2019 年 12 月 31 日：无)。

7.4.14.2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，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	5,106,495,839.71	89.39
	其中：股票	5,106,495,839.71	89.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	637,000.00	0.01
	其中：债券	637,000.00	0.01
	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	449,765,752.49	7.87
8	其他各项资产	156,002,225.01	2.73
9	合计	5,712,900,817.21	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	201,833,856.99	3.63
C	制造业	3,648,953,027.27	65.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	130,010,192.05	2.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	19,998.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	192,933,254.53	3.47
J	金融业	726,742,735.83	13.07
K	房地产业	142,688,559.13	2.57
L	租赁和商务服务业	63,026,451.54	1.13
M	科学研究和技术服务业	15,649.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	207,530.30	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	48,261.27	0.00
S	综合	-	-
	合计	5,106,495,839.71	91.82

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	300750	宁德时代	477,194	167,547,585.34	3.01
2	300014	亿纬锂能	1,976,465	161,081,897.50	2.90
3	300035	中科电气	11,657,194	142,800,626.50	2.57
4	601939	建设银行	22,008,500	138,213,380.00	2.49
5	601012	隆基股份	1,409,000	129,909,800.00	2.34
6	601818	光大银行	32,151,142	128,283,056.58	2.31
7	688200	华峰测控	335,976	125,497,115.28	2.26
8	603987	康德莱	7,921,520	124,288,648.80	2.23
9	601233	桐昆股份	5,988,732	123,307,991.88	2.22
10	002064	华峰氨纶	12,099,286	122,081,795.74	2.20
11	300433	蓝思科技	3,753,300	114,888,513.00	2.07
12	600519	贵州茅台	55,175	110,239,650.00	1.98
13	002384	东山精密	4,177,358	108,611,308.00	1.95
14	000333	美的集团	1,071,203	105,449,223.32	1.90
15	002541	鸿路钢构	2,601,050	95,016,356.50	1.71
16	601808	中海油服	7,092,895	90,576,269.15	1.63
17	601601	中国太保	2,328,800	89,425,920.00	1.61
18	601689	拓普集团	2,289,790	87,996,629.70	1.58
19	002812	恩捷股份	611,800	86,741,004.00	1.56
20	600563	法拉电子	793,546	81,886,372.30	1.47
21	002430	杭氧股份	2,811,806	81,795,436.54	1.47
22	600690	海尔智家	2,771,100	80,943,831.00	1.46
23	600028	中国石化	20,006,600	80,626,598.00	1.45
24	002332	仙琚制药	6,143,658	80,123,066.52	1.44
25	002475	立讯精密	1,394,249	78,245,253.88	1.41
26	601336	新华保险	1,348,500	78,172,545.00	1.41
27	002600	领益智造	6,498,700	77,919,413.00	1.40
28	600570	恒生电子	733,470	76,941,003.00	1.38
29	601288	农业银行	24,383,336	76,563,675.04	1.38
30	300408	三环集团	2,016,560	75,116,860.00	1.35
31	600110	诺德股份	7,950,414	73,541,329.50	1.32
32	000739	普洛药业	3,115,312	72,524,463.36	1.30
33	603218	日月股份	2,465,488	69,339,770.08	1.25

34	300601	康泰生物	379,230	66,175,635.00	1.19
35	601318	中国平安	757,300	65,869,954.00	1.18
36	601128	常熟银行	8,891,400	65,618,532.00	1.18
37	300232	洲明科技	6,934,058	65,249,485.78	1.17
38	002142	宁波银行	1,837,900	64,951,386.00	1.17
39	600383	金地集团	4,770,782	64,405,557.00	1.16
40	600138	中青旅	6,142,929	63,026,451.54	1.13
41	300121	阳谷华泰	5,230,079	62,551,744.84	1.12
42	000933	神火股份	7,757,076	61,901,466.48	1.11
43	002637	赞宇科技	4,867,308	61,182,061.56	1.10
44	000100	TCL 科技	8,623,900	61,057,212.00	1.10
45	002262	恩华药业	3,814,872	60,923,505.84	1.10
46	300659	中孚信息	1,239,800	60,849,384.00	1.09
47	601636	旗滨集团	4,289,000	54,899,200.00	0.99
48	002353	杰瑞股份	1,484,843	51,969,505.00	0.93
49	603113	金能科技	3,122,328	51,050,062.80	0.92
50	603501	韦尔股份	226,500	49,495,575.00	0.89
51	600803	新奥股份	3,573,284	48,560,929.56	0.87
52	601615	明阳智能	2,710,414	47,594,869.84	0.86
53	600885	宏发股份	854,388	46,324,917.36	0.83
54	600521	华海药业	1,339,940	45,303,371.40	0.81
55	600166	福田汽车	13,938,400	43,905,960.00	0.79
56	600167	联美控股	3,799,807	43,127,809.45	0.78
57	603589	口子窖	592,542	40,826,143.80	0.73
58	600461	洪城水业	5,668,854	38,321,453.04	0.69
59	300674	宇信科技	1,111,393	37,709,564.49	0.68
60	600741	华域汽车	1,251,734	36,074,973.88	0.65
61	002206	海利得	9,062,355	35,433,808.05	0.64
62	000656	金科股份	4,701,296	33,332,188.64	0.60
63	601168	西部矿业	2,474,200	30,630,596.00	0.55
64	000902	新洋丰	1,808,541	28,936,656.00	0.52
65	000961	中南建设	3,257,105	28,760,237.15	0.52
66	300037	新宙邦	267,111	27,085,055.40	0.49
67	600779	水井坊	309,270	25,675,595.40	0.46
68	601688	华泰证券	1,089,121	19,615,069.21	0.35
69	002539	云图控股	2,309,143	17,064,566.77	0.31
70	000661	长春高新	37,398	16,788,336.18	0.30
71	300451	创业慧康	1,224,896	16,572,842.88	0.30
72	002146	荣盛发展	2,478,040	16,181,601.20	0.29
73	688008	澜起科技	83,290	6,903,075.20	0.12
74	688396	华润微	36,974	2,310,505.26	0.04
75	300866	安克创新	9,451	1,476,057.18	0.03
76	300999	金龙鱼	10,115	893,053.35	0.02
77	688408	中信博	4,450	714,403.00	0.01

78	688095	福昕软件	1,981	453,232.99	0.01
79	688165	埃夫特	28,728	376,336.80	0.01
80	300863	卡倍亿	3,421	353,115.62	0.01
81	688508	芯朋微	3,729	342,732.39	0.01
82	300894	火星人	6,279	300,116.16	0.01
83	300896	爱美客	473	285,389.28	0.01
84	688559	海目星	5,924	183,466.28	0.00
85	688510	航亚科技	5,991	152,950.23	0.00
86	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.00
87	002034	旺能环境	5,800	92,336.00	0.00
88	688577	浙海德曼	1,503	63,141.03	0.00
89	688156	路德环境	2,602	52,222.14	0.00
90	300860	锋尚文化	381	48,261.27	0.00
91	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.00
92	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00
93	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
94	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
95	601166	兴业银行	1,400	29,218.00	0.00
96	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
97	300877	金春股份	569	28,933.65	0.00
98	300868	杰美特	593	25,665.04	0.00
99	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
100	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
101	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
102	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
103	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
104	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
105	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
106	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
107	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
108	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
109	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
110	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
111	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
112	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
113	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
114	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
115	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
116	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
117	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
118	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
119	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
120	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
121	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00

122	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
123	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
124	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
125	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
126	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
127	002850	科达利	61	5,733.39	0.00
128	002601	龙蟠佰利	132	4,061.64	0.00
129	300142	沃森生物	90	3,470.40	0.00
130	000568	泸州老窖	3	678.48	0.00
131	600522	中天科技	47	509.48	0.00
132	000830	鲁西化工	37	472.86	0.00
133	002128	露天煤业	36	393.84	0.00
134	600966	博汇纸业	2	30.06	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	601233	桐昆股份	147,649,393.07	44.63
2	300433	蓝思科技	143,550,661.66	43.39
3	601939	建设银行	143,372,038.50	43.34
4	002384	东山精密	138,826,214.43	41.96
5	601818	光大银行	129,943,961.07	39.28
6	603987	康德莱	129,769,952.37	39.22
7	300035	中科电气	129,014,736.82	39.00
8	300750	宁德时代	123,818,468.66	37.43
9	002064	华峰化学	112,835,737.70	34.11
10	688200	华峰测控	106,877,548.11	32.31
11	300014	亿纬锂能	103,685,147.26	31.34
12	600563	法拉电子	101,363,825.79	30.64
13	300408	三环集团	100,321,407.04	30.32
14	600383	金地集团	99,608,498.24	30.11
15	600519	贵州茅台	99,217,005.18	29.99
16	601808	中海油服	97,759,764.96	29.55
17	002332	仙琚制药	97,373,470.96	29.43

18	601318	中国平安	95,767,055.73	28.95
19	601012	隆基股份	94,706,354.39	28.63
20	002475	立讯精密	94,375,915.54	28.53
21	601689	拓普集团	92,836,212.06	28.06
22	601601	中国太保	92,378,497.58	27.92
23	002600	领益智造	87,537,250.84	26.46
24	000333	美的集团	86,394,254.47	26.11
25	000933	神火股份	85,140,845.24	25.73
26	600028	中国石化	85,130,736.00	25.73
27	000830	鲁西化工	84,108,014.49	25.42
28	002142	宁波银行	81,890,646.07	24.75
29	601288	农业银行	81,564,927.23	24.65
30	600570	恒生电子	81,269,459.07	24.56
31	601336	新华保险	80,945,576.46	24.47
32	002541	鸿路钢构	77,459,421.55	23.41
33	000739	普洛药业	76,724,268.78	23.19
34	002430	杭氧股份	76,582,767.10	23.15
35	300232	洲明科技	75,171,990.46	22.72
36	603218	日月股份	73,176,437.86	22.12
37	600690	海尔智家	72,821,805.69	22.01
38	002637	赞宇科技	71,477,395.85	21.60
39	601166	兴业银行	71,117,777.87	21.50
40	600138	中青旅	70,564,959.82	21.33
41	600110	诺德股份	70,261,228.21	21.24
42	002262	恩华药业	68,507,226.21	20.71
43	002128	露天煤业	68,447,665.03	20.69
44	002353	杰瑞股份	68,256,886.09	20.63
45	002812	恩捷股份	67,689,445.18	20.46
46	601636	旗滨集团	66,925,448.61	20.23
47	601128	常熟银行	66,373,640.00	20.06
48	000100	TCL 科技	66,063,189.00	19.97
49	300142	沃森生物	62,079,054.81	18.76
50	300121	阳谷华泰	61,474,765.61	18.58
51	002241	歌尔股份	59,027,737.33	17.84
52	300659	中孚信息	58,546,120.82	17.70
53	603501	韦尔股份	57,258,433.10	17.31
54	300601	康泰生物	56,929,618.03	17.21
55	000656	金科股份	56,115,816.23	16.96
56	002078	太阳纸业	54,314,954.88	16.42
57	600966	博汇纸业	53,588,024.18	16.20
58	603113	金能科技	51,272,087.35	15.50
59	603890	春秋电子	51,220,273.17	15.48
60	600167	联美控股	50,405,573.18	15.24
61	600089	特变电工	50,084,998.16	15.14

62	601668	中国建筑	49,172,806.00	14.86
63	603589	口子窖	48,713,159.15	14.72
64	688005	容百科技	47,007,083.98	14.21
65	600521	华海药业	46,817,073.53	14.15
66	600036	招商银行	46,197,202.73	13.96
67	600166	福田汽车	44,850,355.00	13.56
68	688396	华润微	42,885,848.35	12.96
69	300037	新宙邦	42,435,470.57	12.83
70	600803	新奥股份	42,397,835.43	12.82
71	300674	宇信科技	42,270,360.62	12.78
72	002001	新和成	41,154,969.70	12.44
73	600887	伊利股份	41,006,870.23	12.39
74	600885	宏发股份	40,606,916.07	12.27
75	002206	海利得	38,686,017.00	11.69
76	600461	洪城水业	38,556,632.46	11.65
77	601615	明阳智能	38,000,004.28	11.49
78	688122	西部超导	37,243,263.21	11.26
79	002601	龙鳞佰利	36,672,863.16	11.08
80	300019	硅宝科技	36,108,584.68	10.91
81	603661	恒林股份	35,463,572.10	10.72
82	601168	西部矿业	33,304,371.99	10.07
83	000932	华菱钢铁	32,716,217.00	9.89
84	600741	华域汽车	31,664,103.75	9.57
85	600522	中天科技	30,926,482.83	9.35
86	000961	中南建设	30,563,596.20	9.24
87	002429	兆驰股份	30,401,346.49	9.19
88	002709	天赐材料	30,385,740.25	9.18
89	300451	创业慧康	29,033,754.28	8.78
90	002444	巨星科技	26,908,363.27	8.13
91	000591	太阳能	26,295,313.07	7.95
92	000902	新洋丰	26,067,243.44	7.88
93	603010	万盛股份	25,711,123.20	7.77
94	603856	东宏股份	25,664,360.99	7.76
95	000001	平安银行	25,475,693.88	7.70
96	002436	兴森科技	25,236,266.80	7.63
97	600261	阳光照明	25,183,749.00	7.61
98	000887	中鼎股份	25,119,539.75	7.59
99	601966	玲珑轮胎	25,034,792.51	7.57
100	300168	万达信息	24,996,540.70	7.56
101	600779	水井坊	24,860,884.70	7.51
102	600782	新钢股份	24,819,156.43	7.50
103	002034	旺能环境	24,098,451.86	7.28
104	300577	开润股份	24,009,317.86	7.26
105	600597	光明乳业	23,866,519.32	7.21

106	002635	安洁科技	22,225,211.44	6.72
107	603986	兆易创新	21,746,433.00	6.57
108	300806	斯迪克	21,645,356.50	6.54
109	002850	科达利	21,161,507.00	6.40
110	002624	完美世界	20,988,959.89	6.34
111	002531	天顺风能	20,681,085.27	6.25
112	300316	晶盛机电	20,642,352.89	6.24
113	002459	晶澳科技	20,563,652.80	6.22
114	600409	三友化工	20,328,006.00	6.14
115	000895	双汇发展	19,931,693.71	6.02
116	002352	顺丰控股	19,489,039.70	5.89
117	002539	云图控股	18,728,953.88	5.66
118	000568	泸州老窖	17,261,895.83	5.22
119	603018	华设集团	17,261,616.22	5.22
120	601688	华泰证券	17,131,771.57	5.18
121	300244	迪安诊断	17,129,157.97	5.18
122	300196	长海股份	16,622,519.80	5.02
123	002185	华天科技	16,619,175.72	5.02
124	600884	杉杉股份	16,372,434.55	4.95
125	002146	荣盛发展	16,294,900.31	4.93
126	002223	鱼跃医疗	15,949,289.39	4.82
127	002212	天融信	15,912,647.00	4.81
128	300226	上海钢联	15,679,731.02	4.74
129	002258	利尔化学	14,979,202.42	4.53
130	300525	博思软件	14,974,618.96	4.53
131	603353	和顺石油	14,951,608.30	4.52
132	002233	塔牌集团	14,912,438.22	4.51
133	002049	紫光国微	14,850,503.00	4.49
134	601888	中国中免	14,846,142.00	4.49
135	002292	奥飞娱乐	14,810,839.00	4.48
136	002449	国星光电	14,566,492.96	4.40
137	002648	卫星石化	14,441,525.46	4.37
138	300364	中文在线	14,228,807.29	4.30
139	002156	通富微电	14,036,668.24	4.24
140	002221	东华能源	13,993,645.00	4.23
141	000951	中国重汽	13,938,256.52	4.21
142	300572	安车检测	13,824,047.04	4.18
143	300144	宋城演艺	13,794,032.00	4.17
144	600585	海螺水泥	13,767,892.94	4.16
145	603690	至纯科技	13,724,294.08	4.15
146	300425	中建环能	13,690,532.25	4.14
147	603583	捷昌驱动	13,287,506.16	4.02
148	688298	东方生物	13,255,949.57	4.01
149	600378	昊华科技	13,158,204.50	3.98

150	601899	紫金矿业	13,076,249.04	3.95
151	000898	鞍钢股份	12,961,204.69	3.92
152	000596	古井贡酒	12,324,577.54	3.73
153	600511	国药股份	12,127,986.82	3.67
154	300454	深信服	12,098,797.00	3.66
155	002759	天际股份	12,051,147.00	3.64
156	002727	一心堂	11,858,182.25	3.58
157	300332	天壕环境	11,741,527.77	3.55
158	000009	中国宝安	11,738,951.10	3.55
159	601865	福莱特	11,059,749.78	3.34
160	000807	云铝股份	10,940,258.00	3.31
161	300138	晨光生物	10,688,194.00	3.23
162	002398	垒知集团	10,675,002.00	3.23
163	002389	航天彩虹	10,667,410.00	3.22
164	000034	神州数码	10,523,210.00	3.18
165	603005	晶方科技	10,490,894.00	3.17
166	601231	环旭电子	10,480,512.42	3.17
167	300502	新易盛	10,479,347.31	3.17
168	603859	能科股份	10,191,168.65	3.08
169	002390	信邦制药	9,984,337.94	3.02
170	600068	葛洲坝	9,977,068.00	3.02
171	600893	航发动力	9,965,686.81	3.01
172	600325	华发股份	9,789,992.00	2.96
173	002643	万润股份	9,688,862.94	2.93
174	300207	欣旺达	9,674,362.04	2.92
175	600079	人福医药	9,641,418.00	2.91
176	002317	众生药业	9,527,238.49	2.88
177	300599	雄塑科技	9,516,052.83	2.88
178	603359	东珠生态	9,403,886.92	2.84
179	300772	运达股份	9,102,192.00	2.75
180	688008	澜起科技	8,811,436.42	2.66
181	000885	城发环境	8,693,683.10	2.63
182	600048	保利地产	8,660,097.00	2.62
183	000661	长春高新	8,504,193.00	2.57
184	000338	潍柴动力	8,498,367.36	2.57
185	600802	福建水泥	8,387,662.74	2.54
186	603883	老百姓	8,378,858.61	2.53
187	600990	四创电子	8,365,484.00	2.53
188	300132	青松股份	8,290,676.65	2.51
189	002641	永高股份	7,593,300.77	2.30
190	603686	龙马环卫	7,582,341.20	2.29
191	600572	康恩贝	7,570,840.00	2.29
192	300570	太辰光	7,366,289.00	2.23
193	000547	航天发展	7,302,252.96	2.21

194	603298	杭叉集团	7,293,682.20	2.20
195	601633	长城汽车	7,110,738.80	2.15
196	300771	智莱科技	7,050,947.00	2.13
197	002666	德联集团	7,042,117.00	2.13
198	000975	银泰黄金	7,003,773.60	2.12
199	000513	丽珠集团	6,934,307.30	2.10
200	300197	铁汉生态	6,848,423.00	2.07

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	000830	鲁西化工	109,873,876.16	33.21
2	601166	兴业银行	90,318,830.00	27.30
3	002128	露天煤业	66,802,586.34	20.19
4	002078	太阳纸业	62,591,356.66	18.92
5	002241	歌尔股份	62,255,130.87	18.82
6	603890	春秋电子	58,382,432.54	17.65
7	600966	博汇纸业	58,348,893.59	17.64
8	601668	中国建筑	57,490,100.00	17.38
9	300037	新宙邦	56,840,306.11	17.18
10	601233	桐昆股份	56,290,174.10	17.01
11	600036	招商银行	53,711,847.38	16.24
12	300142	沃森生物	51,775,257.10	15.65
13	600089	特变电工	50,508,170.88	15.27
14	002475	立讯精密	48,721,231.28	14.73
15	688396	华润微	48,609,000.15	14.69
16	000933	神火股份	48,421,859.00	14.64
17	002444	巨星科技	47,091,510.58	14.23
18	603218	日月股份	45,465,305.05	13.74
19	300019	硅宝科技	45,313,231.96	13.70
20	600887	伊利股份	44,903,069.06	13.57
21	300433	蓝思科技	42,719,751.02	12.91
22	002001	新和成	42,441,763.76	12.83
23	002709	天赐材料	42,046,137.63	12.71
24	688005	容百科技	41,976,818.63	12.69
25	002601	龙鳞佰利	40,925,998.85	12.37
26	600383	金地集团	40,514,122.06	12.25
27	688122	西部超导	40,176,145.58	12.14

28	300408	三环集团	37,631,588.56	11.37
29	603661	恒林股份	34,206,638.64	10.34
30	000001	平安银行	34,112,277.68	10.31
31	002436	兴森科技	33,660,403.84	10.17
32	601318	中国平安	32,818,500.43	9.92
33	600563	法拉电子	31,692,809.03	9.58
34	002531	天顺风能	30,156,057.48	9.12
35	000568	泸州老窖	29,903,933.58	9.04
36	002352	顺丰控股	29,731,508.23	8.99
37	600522	中天科技	29,674,329.27	8.97
38	002429	兆驰股份	29,073,320.96	8.79
39	000932	华菱钢铁	28,816,713.00	8.71
40	603010	万盛股份	28,277,251.61	8.55
41	002353	杰瑞股份	28,256,860.70	8.54
42	300196	长海股份	28,253,219.25	8.54
43	300806	斯迪克	26,864,122.62	8.12
44	000887	中鼎股份	26,226,597.25	7.93
45	603986	兆易创新	26,087,252.83	7.89
46	002142	宁波银行	25,929,246.69	7.84
47	600782	新钢股份	25,291,890.00	7.64
48	601966	玲珑轮胎	25,284,593.78	7.64
49	002459	晶澳科技	25,254,760.32	7.63
50	000591	太阳能	25,039,114.00	7.57
51	603583	捷昌驱动	24,813,453.88	7.50
52	600597	光明乳业	24,726,338.13	7.47
53	002850	科达利	24,168,881.59	7.31
54	002384	东山精密	23,780,343.76	7.19
55	300364	中文在线	23,711,533.45	7.17
56	002185	华天科技	23,581,797.31	7.13
57	300577	开润股份	23,261,965.57	7.03
58	600261	阳光照明	22,957,361.00	6.94
59	603856	东宏股份	22,790,323.00	6.89
60	603353	和顺石油	22,209,176.74	6.71
61	300168	万达信息	21,954,162.98	6.64
62	600409	三友化工	21,953,565.82	6.64
63	300316	晶盛机电	21,748,777.36	6.57
64	000656	金科股份	21,694,865.43	6.56
65	000951	中国重汽	21,484,416.06	6.49
66	603589	口子窖	21,215,572.21	6.41
67	002759	天际股份	21,132,835.00	6.39
68	603018	华设集团	21,088,602.52	6.37
69	002332	仙琚制药	21,076,279.47	6.37
70	002034	旺能环境	20,986,587.70	6.34
71	002635	安洁科技	20,838,929.67	6.30

72	002233	塔牌集团	20,533,023.60	6.21
73	002648	卫星石化	20,437,783.89	6.18
74	300525	博思软件	19,967,438.92	6.04
75	000895	双汇发展	19,081,230.65	5.77
76	300244	迪安诊断	18,548,107.00	5.61
77	300454	深信服	18,360,029.75	5.55
78	600325	华发股份	18,207,818.00	5.50
79	600884	杉杉股份	18,176,427.08	5.49
80	002624	完美世界	18,056,359.00	5.46
81	300226	上海钢联	18,007,346.63	5.44
82	000338	潍柴动力	17,722,098.57	5.36
83	600893	航发动力	17,656,846.89	5.34
84	002156	通富微电	17,581,020.73	5.31
85	300572	安车检测	17,550,977.38	5.31
86	601899	紫金矿业	17,504,694.00	5.29
87	002223	鱼跃医疗	17,330,864.65	5.24
88	002292	奥飞娱乐	17,198,984.00	5.20
89	002430	杭氧股份	16,991,242.00	5.14
90	603501	韦尔股份	16,894,165.00	5.11
91	002398	垒知集团	16,498,482.59	4.99
92	600570	恒生电子	16,468,077.30	4.98
93	002449	国星光电	16,015,204.40	4.84
94	002258	利尔化学	15,742,344.40	4.76
95	601888	中国中免	15,738,050.58	4.76
96	688981	中芯国际	15,638,375.51	4.73
97	300144	宋城演艺	15,511,095.07	4.69
98	002212	天融信	15,500,524.86	4.69
99	002727	一心堂	15,298,726.61	4.62
100	603005	晶方科技	15,005,534.58	4.54
101	600585	海螺水泥	14,881,957.00	4.50
102	603690	至纯科技	14,842,026.49	4.49
103	000596	古井贡酒	14,811,609.09	4.48
104	601601	中国太保	14,725,993.95	4.45
105	002221	东华能源	14,279,124.68	4.32
106	300502	新易盛	13,993,686.08	4.23
107	601636	旗滨集团	13,540,038.08	4.09
108	002049	紫光国微	13,531,371.00	4.09
109	000898	鞍钢股份	13,465,975.00	4.07
110	600378	昊华科技	12,805,617.75	3.87
111	300570	太辰光	12,706,168.80	3.84
112	002317	众生药业	12,583,200.97	3.80
113	000807	云铝股份	12,564,408.00	3.80
114	603987	康德莱	12,561,948.50	3.80
115	300425	中建环能	12,561,436.37	3.80

116	300332	天壕环境	12,550,648.71	3.79
117	300014	亿纬锂能	12,421,017.30	3.75
118	300138	晨光生物	12,342,153.98	3.73
119	300451	创业慧康	12,163,202.14	3.68
120	600079	人福医药	12,105,529.00	3.66
121	600511	国药股份	12,085,597.08	3.65
122	000009	中国宝安	12,040,227.00	3.64
123	000100	TCL 科技	12,002,620.00	3.63
124	000961	中南建设	11,921,710.00	3.60
125	000034	神州数码	11,604,338.00	3.51
126	300132	青松股份	11,469,469.82	3.47
127	601865	福莱特	11,449,581.55	3.46
128	601689	拓普集团	11,299,832.61	3.42
129	688298	东方生物	11,139,294.21	3.37
130	002390	信邦制药	10,994,706.76	3.32
131	600068	葛洲坝	10,954,612.20	3.31
132	300303	聚飞光电	10,715,704.00	3.24
133	603686	龙马环卫	10,710,461.32	3.24
134	603359	东珠生态	10,550,915.98	3.19
135	002013	中航机电	10,540,421.56	3.19
136	300599	雄塑科技	10,325,842.00	3.12
137	300395	菲利华	10,115,325.25	3.06
138	600031	三一重工	10,075,721.00	3.05
139	300207	欣旺达	10,043,026.49	3.04
140	601231	环旭电子	9,985,420.40	3.02
141	002081	金螳螂	9,787,597.00	2.96
142	002389	航天彩虹	9,717,146.00	2.94
143	002643	万润股份	9,669,280.66	2.92
144	300772	运达股份	9,654,475.00	2.92
145	600048	保利地产	9,609,834.12	2.90
146	601633	长城汽车	9,486,294.90	2.87
147	600802	福建水泥	9,428,427.77	2.85
148	603883	老百姓	9,425,852.20	2.85
149	603881	数据港	9,355,155.00	2.83
150	002174	游族网络	9,252,584.00	2.80
151	000885	城发环境	9,081,617.18	2.75
152	002641	永高股份	8,840,985.55	2.67
153	300791	仙乐健康	8,700,759.00	2.63
154	300415	伊之密	8,372,903.80	2.53
155	603859	能科股份	8,012,532.76	2.42
156	300197	铁汉生态	7,937,898.50	2.40
157	000733	振华科技	7,857,785.84	2.38
158	002637	赞宇科技	7,505,850.00	2.27
159	002600	领益智造	7,433,899.00	2.25

160	000739	普洛药业	7,404,001.16	2.24
161	000547	航天发展	7,338,678.00	2.22
162	000651	格力电器	7,283,515.52	2.20
163	603298	杭叉集团	7,097,482.40	2.15
164	002605	姚记科技	7,070,103.00	2.14
165	600572	康恩贝	7,061,058.00	2.13
166	600990	四创电子	6,965,528.34	2.11
167	000513	丽珠集团	6,886,958.97	2.08
168	300630	普利制药	6,750,910.00	2.04
169	300284	苏交科	6,702,049.80	2.03

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	8,107,856,944.78
卖出股票的收入（成交）总额	4,144,977,654.70

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	-	-
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）	637,000.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	637,000.00	0.01

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	113616	韦尔转债	6,370	637,000.00	0.01

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。

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合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

根据基金合同，本组合暂不投资国债期货。

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合约。

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光大银行（601818）的发行人因未按规定履行客户身份识别义务，未按规定保存客户身份资料和交易记录，未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告等违规行为，于 2020 年 2 月 10 日被中国人民银行处罚罚款 1820 万元。

对该证券的投资决策程序的说明：公司主要业务为经中国银行业监督管理委员会批准的包括对公及对私存款、贷款、支付结算、资金业务及其他金融业务，公司经营平稳，“打造一流财富管理银行”战略持续推进，未来业务和业绩表现均有望受益于零售业务注入的新动能。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

报告期内本基金投资的建设银行（601939），因内控管理不到位、理财资金违规投资房地产、逆流程开展业务操作、理财业务相关风险管控不到位、同业投资违规接受担保等行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》的规定和相关审慎经营规则，被中国银行保险监督管理委员会罚款合计 3920 万元。

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

其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	677,268.61
2	应收证券清算款	59,766,516.04
3	应收股利	-
4	应收利息	39,709.61
5	应收申购款	95,518,730.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	156,002,225.01

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

本基金本期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§ 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
10,014	235,117.58	2,251,712,165.22	95.64%	102,755,258.65	4.36%

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	666,197.73	0.0300%

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年4月28日)基金份额总额	264,112,228.69
本报告期期初基金份额总额	238,700,545.79
本报告期基金总申购份额	2,477,955,981.05
减：本报告期基金总赎回份额	362,189,102.97
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,354,467,423.87

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2020年5月26日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第三次会议审议通过，陶网雄先生由公司副总经理转任首席信息官。

2、2020年6月24日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第三次会议审议通过，聘请王智慧先生担任公司副总经理职务。

3、2020年7月25日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第三次会议审议通过，分别聘请孙海忠先生、胡光涛先生担任公司副总经理职务。

4、2020年8月11日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第四次会议审议通过，奚万荣先生不再担任公司督察长职务，并决定由公司董事长杨仓兵先生代为履行督察长职务，代为履行督察长职务的期限不超过90日。

5、2020年8月22日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第四次会议审议通过，聘请岳冲先生担任公司督察长职务，公司董事长杨仓兵先生不再代行督察长职务。

6、2020年11月11日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第二十七次临时会议审议通过，孙海忠先生不再担任公司副总经理职务。

7、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	2,880,912,221.92	23.83%	2,049,198.55	24.87%	-
申万宏源	2	2,129,103,604.76	17.61%	905,391.61	10.99%	-
东吴证券	2	2,128,999,347.42	17.61%	1,536,889.68	18.65%	-
方正证券	1	1,601,610,909.43	13.25%	1,251,708.68	15.19%	-
中泰证券(原齐鲁)	2	1,407,616,845.20	11.64%	1,029,385.28	12.49%	-
华泰证券	1	1,242,092,051.70	10.27%	957,944.49	11.62%	-
中信建投	1	227,960,166.86	1.89%	166,707.12	2.02%	-
东北证券	1	211,375,808.86	1.75%	150,351.79	1.82%	-
东方证券	1	145,438,874.01	1.20%	109,637.99	1.33%	-
东兴证券	2	114,882,209.11	0.95%	84,013.16	1.02%	-

中金公司	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
------	---	------	-------	------	-------	---

注：1、报告期内本基金新增海通证券一个交易单元，退租兴业证券两个交易单元。

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的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	4,409,705.26	21.34%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东吴证券	16,256,594.22	78.66%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券(原齐鲁)	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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	海富通基金管理有限公司关于旗下部分	证券时报、基金管理	2020-01-02

	基金新增江苏银行股份有限公司为销售机构的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加西藏东方财富证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-14
3	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台通联支付渠道新增部分银行卡并开展申购费率优惠的公告	证券时报、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参加部分销售机构申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-04
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华安证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-25
6	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-27
7	海富通基金管理有限公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-24
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信建投期货有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-20
9	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-22
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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
11	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
12	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会	2020-06-06

		会基金电子披露网站	
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大连网金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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-17
14	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-24
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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-01
16	海富通基金管理有限公司关于开展部分基金直销中心申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-07
17	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-08
18	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-11
19	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增交通银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-25
20	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-25
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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-25
22	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-11
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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-13

		站	
24	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-22
25	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-26
26	海富通基金管理有限公司关于调整基金经理助理的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-03
27	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-11
28	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-15
29	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-16
30	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-17
31	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-19
32	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-24
33	海富通基金管理有限公司关于海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金新增太平洋证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-30
34	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-10-24

35	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-10-28
36	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-10-29
37	海富通基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-10-30
38	海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购和转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-05
39	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-11
40	海富通基金管理有限公司关于海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金新增泛华普益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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-18
41	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-18
42	海富通基金管理有限公司关于旗下基金获配明阳智能（601615）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-24
43	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加宁波银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-26
44	海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金第二次分红公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-28
45	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-01
46	海富通基金管理有限公司关于旗下部分	证券时报、基金管理	2020-12-01

	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	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
47	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-01
48	海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购和转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-02
49	海富通基金管理有限公司关于旗下基金获配日月股份（603218）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-03
50	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-05
51	海富通基金管理有限公司关于海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金新增湘财证券股份有限公司为销售机构并参加其中申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-16
52	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-18
53	海富通基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司、浙江金观诚基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-18

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	2020/1/10-202	28,92	65,78	68,235,	26,480,977	1.12%

		0/1/13	8,640 .31	7,879 .64	542.29	.66	
	2	2020/1/6-2020 /11/4	24,95 7,570 .72	322,1 20,36 1.13	9,460,2 91.43	337,617,64 0.42	14.34%
	3	2020/1/1-2020 /6/21	94,84 7,225 .07	43,55 3,571 .43	94,847, 225.07	43,553,571 .43	1.85%
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>							

注：注：该单一投资者报告期内申购份额包含红利再投资确认份额。

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改革驱动灵活配置混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通改革驱动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）报告期内海富通改革驱动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