

海富通富盈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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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 5 月 20 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	21
§5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	21
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.....	21
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	21
§6 审计报告	21
6.1 审计意见.....	21
6.2 形成审计意见的基础.....	22
6.3 其他信息.....	22
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任.....	22
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任.....	23
§7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	27
7.4 报表附注.....	28
§8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况.....	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	59
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65

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	67
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	67
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	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	68
8.12 投资组合报告附注	68
§9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
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	71
§10 开放式基金份额变动	72
§11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
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	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	74
12 影响投资者决策的其他重要信息	79
§13 备查文件目录	80
13.1 备查文件目录	80
13.2 存放地点	80
13.3 查阅方式	80

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通富盈混合型证券投资基金	
基金简称	海富通富盈混合	
基金主代码	009154	
交易代码	009154	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 月 20 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,167,783,074.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
下属分级基金的交易代码	009154	009155
报告期末下属分级基金的份 额总额	508,304,749.87 份	659,478,324.42 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的管理,追求基金资产的长期稳定回报。
投资策略	本基金以在风险可控下寻求稳定的超额收益作为投资理念,采用稳健的大类资产配置和股票投资策略。本基金通过对宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究,同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素,兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动,结合投资时钟理论,确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例。并随着各类证券风险收益特征的相对变化,动态调整组合中各类资产的比例,或借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应,以规避或分散市场风险。股票投资方面,本基金将采用量化选股方法构建股票组合,以价值投资作为核心理念,通过量化模型构建多因子 alpha 模型。

	债券投资主要采取利率策略、信用策略、收益率曲线策略以及杠杆策略，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。另外，本基金投资策略还包括将资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略、流通受限证券投资策略、股票期权投资策略。
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	曾麓燕
	联系电话	021-38650788	021-52629999-212040
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	zengluyan@cib.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95561
传真		021-33830166	021-62535823
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	福建省福州市湖东路154号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层	上海市银城路167号4楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		杨仓兵	陶以平

2.4 信息披露方式

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

网址	
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 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
本期已实现收益	31,012,737.66	44,204,231.34
本期利润	48,281,607.41	70,451,257.48
加权平均基金份额本期利润	0.0522	0.0541
本期加权平均净值利润率	5.07%	5.00%
本期基金份额净值增长率	5.53%	5.27%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	
	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
期末可供分配利润	15,361,223.45	18,238,971.28
期末可供分配基金份额利润	0.0302	0.0277
期末基金资产净值	536,396,517.73	694,201,792.06
期末基金份额净值	1.0553	1.0527
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	
	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
基金份额累计净值增长率	5.53%	5.27%

注：1、本基金合同生效日为 2020 年 5 月 20 日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

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

3、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。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 海富通富盈混合 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.94%	0.22%	3.05%	0.18%	-0.11%	0.04%
过去六个月	5.24%	0.21%	3.04%	0.22%	2.20%	-0.01%
自基金合同生效起至今	5.53%	0.19%	2.78%	0.22%	2.75%	-0.03%

2. 海富通富盈混合 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.83%	0.22%	3.05%	0.18%	-0.22%	0.04%
过去六个月	5.02%	0.21%	3.04%	0.22%	1.98%	-0.01%
自基金合同生效起至今	5.27%	0.19%	2.78%	0.22%	2.49%	-0.03%

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

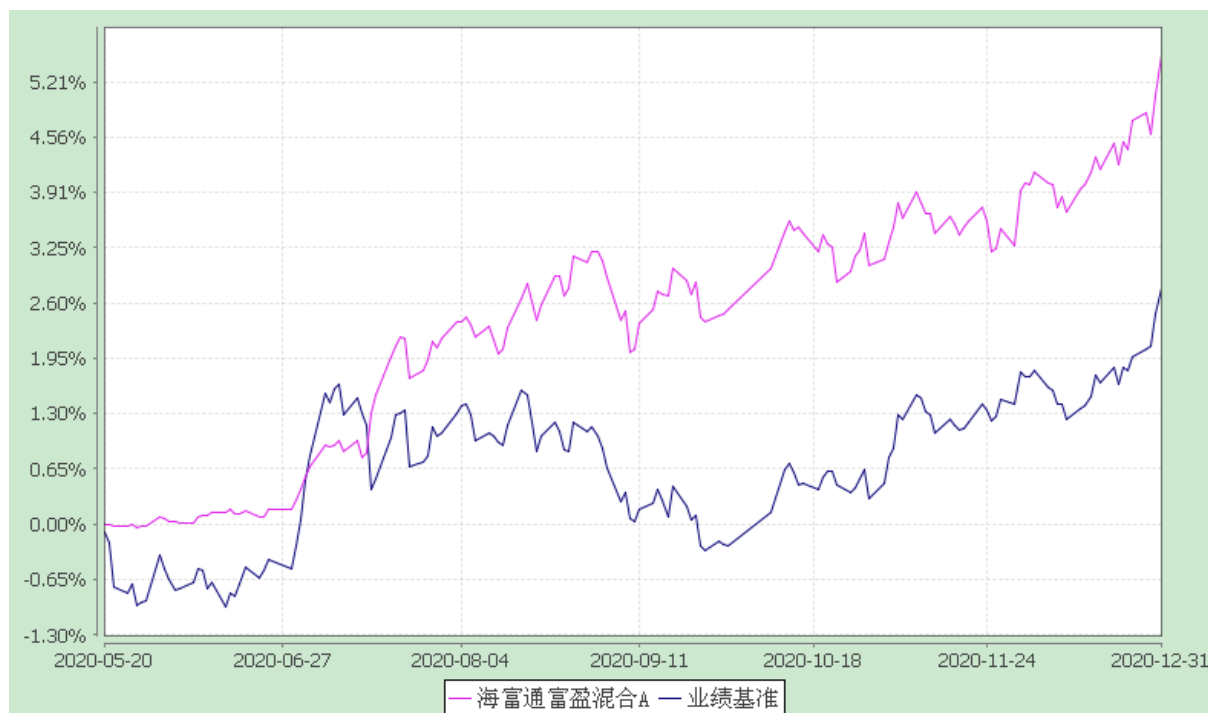
率变动的比较

海富通富盈混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

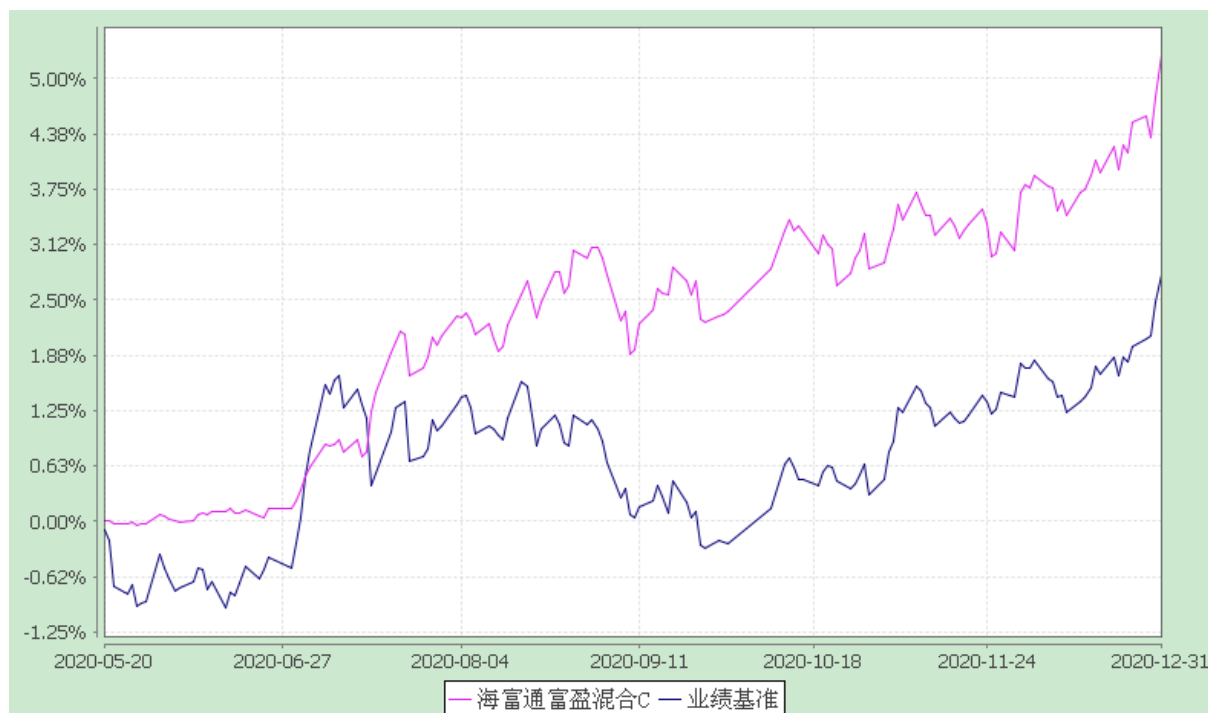
1. 海富通富盈混合 A

(2020 年 5 月 20 日至 2020 年 12 月 31 日)



2. 海富通富盈混合 C

(2020 年 5 月 20 日至 2020 年 12 月 31 日)



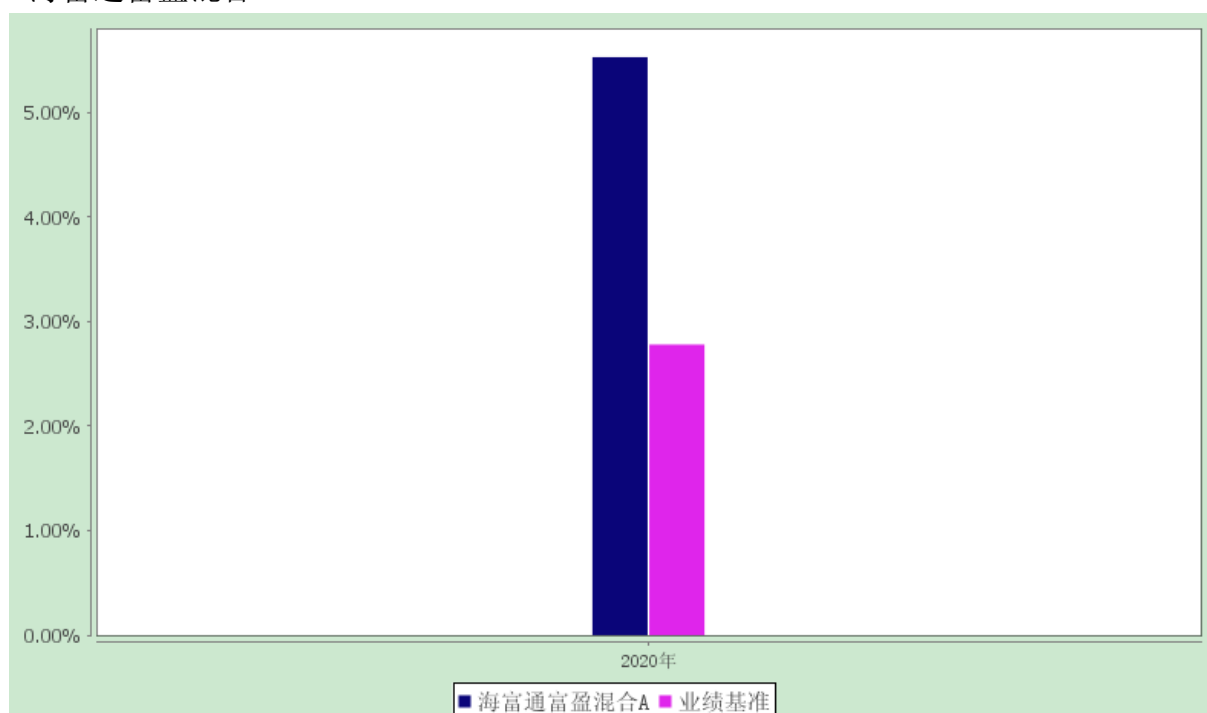
注：1、本基金合同于 2020 年 5 月 20 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

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

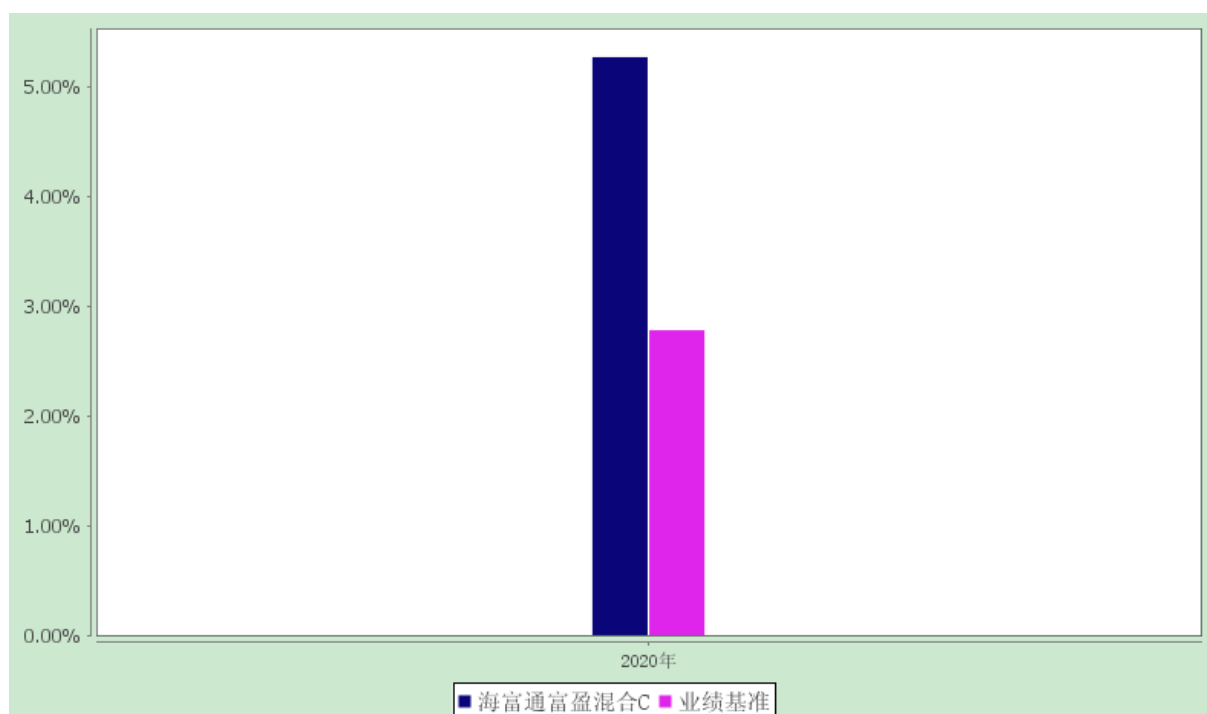
海富通富盈混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1. 海富通富盈混合 A



2. 海富通富盈混合 C



注：图中列示的 2020 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 5 月 20 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、海富通富盈混合 A：

单位：人民币元

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

2、海富通富盈混合 C：

单位：人民币元

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

注：本基金合同于 2020 年 5 月 20 日生效，过去一年未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2020 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 81 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通可转债优选债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资

资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜晓海	本基金的基金经理；海富通阿尔法对冲混合基金经理；海富通安颐收益混合基金经理；海富通安益对冲混合基金经理；海富通创业板增强基金经理；海富通	2020-05-20	-	20 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通基金管理有限公司量化投资部总监。2016 年 6 月起任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1

	富泽混合基金经理；海富通添鑫收益债券基金经理；海富通欣荣混合基金经理；海富通中证 500 增强基金经理；量化投资部总监。				月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 10 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 增强）基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月起兼任海富通中证 500 增强（原海富通中证内地低碳指数）基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。
夏妍妍	本基金的基金经理；海富通安颐收益混合基金经理；海富通富祥混合基金	2020-05-20	-	6 年	上海交通大学经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生，西门子财务租赁有限公司上海分公司高级财务分析师，2014 年加入海富通基金管理有限公司，历任固定收益投资部固定收益分析师、基金经理助理。

	经理；海富通聚合纯债基金经理；海富通融丰定开债券基金经理；海富通瑞合纯债基金经理；海富通欣益混合基金经理；海富通一年定期开放基金经理。				2018 年 1 月起任海富通欣益混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通一年定期开放债券和海富通融丰定开债券基金经理。2019 年 5 月起兼任海富通安颐收益混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通聚合纯债、海富通富祥混合及海富通瑞合纯债的基金经理。2019 年 10 月至 2020 年 11 月任海富通瑞丰债券基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。
--	---	--	--	--	---

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

2、证券从业年限的计算标准：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

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、交易占比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

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

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

本报告期，基金在控制回撤的基础上，力图寻找合适的股票投资机会以赚取绝对收益。同时，本基金积极参与新股申购，以增强投资收益。

债券方面，从经济基本面来看，受到新冠疫情影响，国内 GDP 增速在一季度砸下深坑，同比下降 6.8%，随后三个季度经济迅速修复，全年 GDP 增速为 2.3%。国内经济恢复的主要动力由年初的房地产与基建投资转向下半年的出口以及消费，1-12 月工业增加值、固定资产投资累计同比分别上升 2.8%、2.9%，社会消费品零售总额累计同比下跌 3.9%但跌幅收窄，进出口方面 20 年贸易顺差 5350 亿美元，对经济的拉动较为明显。通胀方面表现分化，CPI 总体走弱，同比由 1 月的 5.4%回落至 12 月的 0.2%；而 PPI 同比在 5 月见底后逐月回暖，12 月同比下降 0.4%。货币政策方面，1-4 月为对冲新冠疫情对国内经济造成的剧烈影响，央行两次调降逆回购操作利率和 MLF 利率累计达 30BP，并调降超储利率至 0.35%；5-10 月随着经济逐步企稳，货币政策回归中性；年末以“永煤”为代表的信用事件频发，货币政策的边际上有所放松。在上述情况下，2020 年债市呈现一波三折由牛转熊的格局。1 月至 5 月，受新冠疫情影响，国内外宽松不断，债市表现为牛市。5-10 月，短端方面资金面稳定性较差，资金利率上行，而经济基本面利好增多，利率债供给放量，叠加信用风险事件频发，债券表现为熊市。11-12 月为对冲信用风险事件带来的流动性冲击，央行再次释放流动性，缓解货币政策进一步收紧的预期，债市有所回暖。整体看，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、永煤发生超预期信用风险事件，弱国企风险暴露下债券市场经历了新一轮“信仰”的破灭，使得全年信用利差多数走扩，中低等级走扩幅度更大。可转债方面，2020 年中证转债指数上涨 5.26%。上半年医疗器械行业转债个券、生猪养殖板块个券、科技行业个券以及特斯拉产业链个券均录得较大涨幅，下半年新能源汽车产业链个券、光伏行业个券以及顺周期相关行业个券表现出色。整体上看，转债连续第二年取得正收益，但却大幅跑输股票指数。

本基金建仓以来固定收益配置以中高等级、中短久期信用债为主。在严格控制信用风险的基础上，选择较高收益品种，追求兼顾稳定收益和流动性。全年来看，债券部分有效规避了信用风险，获得了较好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通富盈混合 A 净值增长率为 5.53%，同期业绩比较基准收益率为 2.78%，基金净值跑赢业绩比较基准 2.75 个百分点。海富通富盈混合 C 净值增长率为 5.27%，同期业绩比较基准收益率为 2.78%，基金净值跑赢业绩比较基准 2.49 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年，随着全球主要经济体财政与货币刺激政策的落地，疫苗接种率的不断提升，疫情的外部冲击的边际钝化，经济回升的方向是比较确定的。而 2020 年以来，从农产品到石油以外的矿产品出现的广泛价格上升将抬升全球的 PPI 和 CPI。若不再出

现加深全球结构对立与冲突的因素，那么 2021 年的宏观环境将会是偏暖的。

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

本基金的投资思路将在控制风险的基础上，积极地捕捉市场的结构性机会，力争跑赢市场。本基金也将利用动态的仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。

债券方面，展望 2021 年，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。国内经济复苏动能较强，顺周期力量的制造业投资与可选消费仍具有向上的空间。地产投资在拿地量有所收紧的情况下或有所放缓但仍具有韧性；基建投资难超预期但同样具有韧性。此外海外疫情依然严重，对海外生产或继续造成扰动，供需缺口下海外补库存需求或仍有利于我国出口。政策方面，年初货币政策例会提到“不急转弯”、“汇率稳定”、“巩固下降成果”，或均指向稳货币为主；财政政策在特别国债以及地方政府专项债发行方面或有所收敛。总体来看，经济复苏仍将延续，但由于 20 年大部分数据在一季度都创造了历史性的低基数，21 年经济增速将呈现“前高后低”走势，GDP 实际增速在一季度达到年内高点，二季度开始逐季回落。通胀方面 CPI 和 PPI 走势或继续分化，在猪肉产能逐渐恢复，猪肉价格大概率有所下行，CPI 中枢或下移；国内需求平稳上行，海外需求下半年或加速修复，油价或有所上行，带动 PPI 转正。在上述判断下，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，下半年经济见顶回落后债市或迎来机会。信用债方面，信用环境是基本面好转，但逆周期政策退出，融资条件弱化。政府信用扩张放缓，地方政府腾挪能力面临挑战。在信用紧缩之时，债市风险偏好下行，配债资金更多回流利率债及高等级信用债，信用利差和等级利差将普遍走扩，融资能力较弱的主体信用风险可能加速暴露。在信用债投资过程中，除了要回归基本面的行业龙头择券之外，也要在区域方面优选经济财政发达，再融资通畅的地区，规避建立在“信仰”基础上的弱国企和尾部城投。可转债方面，走势依然顺应股市走势，总体略偏谨慎。随着刺激政策逐步退出，股市估值或收缩，可转债个股的估值和转债自身的估值都会面临一定压力。因此，2021 年转债机会可能依旧在于把握行业及个券机会。中短期看经济复苏偏周期性行业盈利的改善将是大概率事件，顺周期行业依旧有机会；而中长期来看，科技消费仍是未来主路，如果估值回落则可积极布局。

在 2021 年度，本基金固定收益部分将以持有中高等级信用债为主，争取获得较高配置收益。将视市场环境灵活操作利率债，在有安全边际的情况下波段操作增厚收益。

同时配合股票部分投资策略，做好流动性管理。

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

本托管人依据《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》与《海富通富盈混合型证券投资基金托管协议》，自 2020 年 5 月 20 日起托管海富通富盈混合型证券投资基金（以下称本基金）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

毕马威华振审字第 2100157 号

海富通富盈混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了后附的海富通富盈混合型证券投资基金（以下简称“海富通富盈混合基金”）财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2020 年 5 月 20 日(基金合同

生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益 (基金净值) 变动表以及相关财务报表附注。

我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制, 公允反映了海富通富盈混合基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2020 年 5 月 20 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, 我们独立于海富通富盈混合基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

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

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息, 我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

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

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

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

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

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

基金管理人治理层负责监督海富通富盈混合基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

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

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

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

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

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

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通富盈混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-
银行存款	7.4.7.1	18,140,351.74
结算备付金	7.4.10.6	20,020,214.91
存出保证金		7,917,409.41
交易性金融资产	7.4.7.2	1,344,823,907.23
其中：股票投资		338,744,596.47
基金投资		-
债券投资		1,006,079,310.76
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		4,186,321.87
应收利息	7.4.7.5	13,486,656.09
应收股利		-
应收申购款		638,301.35
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,409,213,162.60
负债和所有者权益	附注号	本期末

2020 年 12 月 31 日		
负 债:		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		143,000,000.00
应付证券清算款		1.72
应付赎回款		33,498,579.21
应付管理人报酬		1,168,944.31
应付托管费		292,236.05
应付销售服务费		262,121.93
应付交易费用	7.4.7.7	192,739.46
应交税费		100,475.58
应付利息		-50,630.14
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	150,384.69
负债合计		178,614,852.81
所有者权益:		-
实收基金	7.4.7.9	1,167,783,074.29
未分配利润	7.4.7.10	62,815,235.50
所有者权益合计		1,230,598,309.79
负债和所有者权益总计		1,409,213,162.60

注：1、报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,167,783,074.29 份。其中海富通富盈混合 A 基金份额总额 508,304,749.87 份，份额净值 1.0553 元，海富通富盈混合 C 基金份额总额 659,478,324.42 份，份额净值 1.0527 元。

2、基金合同成立于 2020 年 5 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.2 利润表

会计主体：海富通富盈混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 5 月 20 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 20 日（基金合同生效日）至

		2020 年 12 月 31 日
一、收入		143,538,866.69
1.利息收入		39,936,786.62
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,234,618.34
债券利息收入		36,320,384.52
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,381,783.76
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		59,321,787.84
其中：股票投资收益	7.4.7.12	70,199,838.55
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-13,314,664.27
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	-1,833,595.61
股利收益	7.4.7.16	4,270,209.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	43,515,895.89
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	764,396.34
减：二、费用		24,806,001.80
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	14,495,598.73
2. 托管费	7.4.10.2. 2	3,623,899.62
3. 销售服务费		3,454,432.50
4. 交易费用	7.4.7.19	1,250,672.73
5. 利息支出		1,699,847.58
其中：卖出回购金融资产支出		1,699,847.58
6. 税金及附加		103,597.95
7. 其他费用	7.4.7.20	177,952.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		118,732,864.89
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填		118,732,864.89

列)		
----	--	--

注：财务报表的实际编制期间为 2020 年 5 月 20 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日，上年度可比期间无比较数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通富盈混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 5 月 20 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 20 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）	2,931,943,904.52	-	2,931,943,904.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	118,732,864.89	118,732,864.89
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）	-1,764,160,830.23	-55,917,629.39	-1,820,078,459.62
其中：1.基金申购款	146,077,669.68	4,683,091.80	150,760,761.48
2.基金赎回款	-1,910,238,499.91	-60,600,721.19	-1,970,839,221.10
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,167,783,074.29	62,815,235.50	1,230,598,309.79

注：基金合同成立于 2020 年 5 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：胡光涛，会计机构负责人：胡正万

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海富通富盈混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]332 号《关于准予海富通富盈混合型证券投资基金注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,931,336,195.26 元，其中海富通富盈混合 A 为人民币 1,092,228,123.51 元，海富通富盈混合 C 为人民币 1,839,108,071.75 元。经向中国证监会备案，《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 20 日正式生效，基金合同生效日的海富通富盈混合 A 基金份额总额为 1,092,446,802.70 份，其中认购资金利息折合 218,679.19 份基金份额，海富通富盈混合 C 基金份额总额为 1,839,497,101.82 份，其中认购资金利息折合 389,030.07 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》和《海富通富盈混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、股指期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产及存托凭证的比例占基金资产的比例为 0%-40%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%，投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终，扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金业绩比较基准为：中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

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

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况、自 2020 年 5 月 20 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 20 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表

内确认。

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

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

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

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

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

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

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金各类份额默认的收益分配方式是现金分红；本基金不同份额类别基金份额，其分红相互独立、互不影响；投资者不同基金交易账户设置的基金分红相互独立、互不影响；若《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配

金额后不能低于面值；同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号文《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代

扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	18,140,351.74
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	18,140,351.74

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	276,407,346.38	338,744,596.47	62,337,250.09

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	485,980,000.91	479,324,310.76	-6,655,690.15
	银行间市场	530,894,528.18	526,755,000.00	-4,139,528.18
	合计	1,016,874,529.09	1,006,079,310.76	-10,795,218.33
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,293,281,875.47	1,344,823,907.23	51,542,031.76

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-56,042,584.13	-	-	-
——股指期货	-56,042,584.13	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-56,042,584.13	-	-	-

1、于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货情况：持有卖出 IF2103 合约市值 -53,158,320.00 元，公允价值变动 -6,787,255.87 元；持有卖出 IH2103 合约市值 -10,910,400.00 元，公允价值变动 -1,238,880.00 元；公允价值变动合计 -8,026,135.87 元。

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

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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	3,168.41
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	40,378.18
应收债券利息	13,442,996.09
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	113.41
合计	13,486,656.09

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	186,404.46
银行间市场应付交易费用	6,335.00
合计	192,739.46

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	384.69

预提费用	150,000.00
合计	150,384.69

7.4.7.9 实收基金

海富通富盈混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年5月20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	1,092,446,802.70	1,092,446,802.70
本期申购	5,872,095.52	5,872,095.52
本期赎回（以“-”号填列）	-590,014,148.35	-590,014,148.35
本期末	508,304,749.87	508,304,749.87

海富通富盈混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年5月20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	1,839,497,101.82	1,839,497,101.82
本期申购	140,205,574.16	140,205,574.16
本期赎回（以“-”号填列）	-1,320,224,351.56	-1,320,224,351.56
本期末	659,478,324.42	659,478,324.42

注：1、本基金自 2020 年 4 月 24 日至 2020 年 5 月 15 日期间公开发售，共募集有效净认购资金 2,931,336,195.26 元，折合为 2,931,336,195.26 份（其中 A 类基金份额 1,092,228,123.51 份，C 类基金份额 1,839,108,071.75 份）。根据《海富通富盈混合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 607,709.26 元在本基金成立后，折算为 607,709.26 份基金份额（其中 A 类基金份额为 218,679.19 份，C 类基金份额为 389,030.07 份），划入基金份额持有人账户。

2、根据《海富通富盈混合型证券投资基金招募说明书》、《海富通富盈混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告》相关规定，本基金于 2020 年 5 月 20 日(基金合同生效日)至 2020 年 8 月 18 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回、转换、定投业务自 2020 年 8 月 19 日起开始办理。

3、此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润**海富通富盈混合 A**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	31,012,737.66	17,268,869.75	48,281,607.41
本期基金份额交易产生的变动数	-15,651,514.21	-4,538,325.34	-20,189,839.55
其中：基金申购款	143,626.45	48,756.05	192,382.50
基金赎回款	-15,795,140.66	-4,587,081.39	-20,382,222.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,361,223.45	12,730,544.41	28,091,767.86

海富通富盈混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	44,204,231.34	26,247,026.14	70,451,257.48
本期基金份额交易产生的变动数	-25,965,260.06	-9,762,529.78	-35,727,789.84
其中：基金申购款	3,761,031.65	729,677.65	4,490,709.30
基金赎回款	-29,726,291.71	-10,492,207.43	-40,218,499.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,238,971.28	16,484,496.36	34,723,467.64

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	302,482.83
定期存款利息收入	445,472.22
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	479,906.07
其他	6,757.22
合计	1,234,618.34

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	353,313,074.14
减：卖出股票成本总额	283,113,235.59
买卖股票差价收入	70,199,838.55

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年5月20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	1,660,750,621.84
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,645,011,586.63
减：应收利息总额	29,053,699.48
买卖债券差价收入	-13,314,664.27

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

单位：人民币元

项目	本期
	2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股指期货投资收益（税前）	-1,827,224.13
股指期货差价收入应缴纳增值税额	-6,371.48
合计	-1,833,595.61

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,270,209.17
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,270,209.17

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20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1.交易性金融资产	51,542,031.76
——股票投资	62,337,250.09
——债券投资	-10,795,218.33
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-8,026,135.87
——权证投资	-
——股指期货	-8,026,135.87
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	43,515,895.89

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	763,353.10
其他	471.77
基金转换费收入	571.47
合计	764,396.34

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	1,228,662.73
银行间市场交易费用	22,010.00
合计	1,250,672.73

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
审计费用	70,000.00
信息披露费	80,000.00
账户维护费	9,000.00
其他	300.00
银行汇划手续费	18,544.53
证券组合费	108.16
合计	177,952.69

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
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	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)	基金管理人的股东

Asset Management BE Holding)	
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5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	858,099,693.75	100.00%

注：基金合同成立于 2020 年 5 月 20 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 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣 金总量的 比例	期末应付佣金余 额	占期末应付 佣金总额的 比例
海通证券	621,216.76	100.00%	186,404.46	100.00%

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

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

3、基金合同成立于 2020 年 5 月 20 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20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	14,495,598.73
其中：支付销售机构的客户维护费	6,892,080.71

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 1.00% 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×1.00%/当年天数。

2、基金合同成立于 2020 年 5 月 20 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20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	3,623,899.62

注：1、支付基金托管人兴业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。

2、基金合同成立于 2020 年 5 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C	合计
兴业银行	-	3,243,714.44	3,243,714.44
海通证券	-	7,461.49	7,461.49
海富通基金	-	127,650.31	127,650.31
合计	-	3,378,826.24	3,378,826.24

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费

按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：海富通富盈混合 C 类基金日基金销售服务费=前一日 C 类份额对应的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2020 年 5 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易，基金合同成立于 2020 年 5 月 20 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 20 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 20 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 20 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 20 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20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
兴业银行	18,140,351.74	302,482.83

注：本基金通过“兴业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 20,020,214.91

元。基金合同成立于 2020 年 5 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年5月20日（基金合同生效日）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	688981	中芯国际	公开发行	462,175	12,691,325.50
海通证券	688180	君实生物	公开发行	29,617	1,643,743.50
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	688301	奕瑞科技	公开发行	2,427	290,269.20
海通证券	688550	瑞联新材	公开发行	2,539	288,735.08
海通证券	300879	大叶股份	公开发行	4,660	49,302.80

注：基金合同成立于 2020 年 5 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金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 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002602	世纪华通	2020-07-09	2021-01-11	大宗交易	15.51	7.03	390,000	5,040,750.00	2,741,700.00	2

600745	闻泰科技	2020-07-31	2021-01-29	大宗交易	135.16	96.82	25,000	3,379,000.00	2,420,500.00	-
002938	鹏鼎控股	2020-07-30	2021-02-01	大宗交易	45.80	48.82	110,000	5,038,000.00	5,370,200.00	-
002726	龙大肉食	2020-08-26	2021-02-26	大宗交易	11.03	12.38	454,892	5,017,458.76	5,631,562.96	-
000538	云南白药	2020-09-23	2021-03-23	大宗交易	97.23	110.15	31,000	3,014,130.00	3,414,650.00	-
603233	大参林	2020-09-25	2021-03-25	大宗交易	76.26	74.95	27,000	2,059,020.00	2,023,650.00	-
000661	长春高新	2020-12-23	2021-06-23	大宗交易	418.86	414.80	5,000	2,094,300.00	2,074,000.00	-
600563	法拉电子	2020-12-30	2021-06-30	大宗交易	94.70	99.41	22,000	2,083,400.00	2,187,020.00	-
603218	日月股份	2020-12-01	2021-05-27	非公开发行流通受限	20.37	27.91	294,551	6,000,003.87	8,220,918.41	-
002332	仙琚制药	2020-11-27	2021-05-27	非公开发行流通受限	13.70	12.69	437,956	5,999,997.20	5,557,661.64	-
002532	天山铝业	2020-12-23	2021-06-24	非公开发行流通受限	6.55	6.95	76,336	500,000.80	530,535.20	-
688561	奇安信	2020-07-16	2021-01-22	新股锁定	56.10	122.83	23,563	1,321,884.30	2,894,243.29	-
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	-
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	-
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	-

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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
300880	迦南智能	2020-08-25	2021-03-01	新股锁定	9.73	34.73	3,732	36,312.36	129,612.36	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
300895	铜牛信息	2020-09-17	2021-03-24	新股锁定	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
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	-
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	-

688595	芯海科技	2020-09-18	2021-03-29	新股锁定	22.82	60.59	3,190	72,795.80	193,282.10	-
300999	金龙鱼	2020-09-29	2021-04-15	新股锁定	25.70	88.29	12,114	311,329.80	1,069,545.06	-
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	-
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	-
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	-
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	-
688590	新致软件	2020-11-27	2021-06-07	新股锁定	10.73	15.79	4,171	44,754.83	65,860.09	-
688608	恒玄科技	2020-12-07	2021-06-16	新股锁定	162.07	272.00	4,179	677,290.53	1,136,688.00	-
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	-
688560	明冠新材	2020-12-16	2021-06-24	新股锁定	15.87	22.86	3,832	60,813.84	87,599.52	-
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	-
688686	奥普特	2020-12-24	2021-07-01	新股锁定	78.49	170.53	2,330	182,881.70	397,334.90	-
300894	火星机器人	2020-12-24	2021-07-01	新股锁定	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
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	-
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	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
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	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股未上	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-

				市						
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	-

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

2、[002602]世纪华通于 2020 年 7 月 9 日大宗交易买入数量 325,000 股，成本 5,040,750.00 元；于 2020 年 7 月 13 日送股，数量 65,000 股。因此总数量 390,000 股，总成本 5,040,750.00 元。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 143,000,000.00 元，于 2021 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 72.11%。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	69,747,000.00
合计	69,747,000.00

注：未评级债券为国债及政策性金融债。基金合同成立于 2020 年 5 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	146,293,000.00
合计	146,293,000.00

注：基金合同成立于 2020 年 5 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日
AAA	672,486,643.91
AAA 以下	68,603,666.85
未评级	48,949,000.00
合计	790,039,310.76

注：未评级债券为国债及政策性金融债。基金合同成立于 2020 年 5 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金

的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有人民币 143,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 3.90%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有及承担的大部分权益类金融资产和金融负债不计息，该部分的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种存在相应的利率风险，基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	18,140,351.74	-	-	-	18,140,351.74

结算备付金	20,020,214.91	-	-	-	20,020,214.91
存出保证金	7,917,409.41	-	-	-	7,917,409.41
交易性金融资产	328,901,440.00	632,204,423.47	44,973,447.29	338,744,596.47	1,344,823,907.23
应收证券清算款	-	-	-	4,186,321.87	4,186,321.87
应收利息	-	-	-	13,486,656.09	13,486,656.09
应收申购款	-	-	-	638,301.35	638,301.35
资产总计	374,979,416.06	632,204,423.47	44,973,447.29	357,055,875.78	1,409,213,162.60
负债					
卖出回购金融资产款	143,000,000.00	-	-	-	143,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	1.72	1.72
应付赎回款	-	-	-	33,498,579.21	33,498,579.21
应付管理人报酬	-	-	-	1,168,944.31	1,168,944.31
应付托管费	-	-	-	292,236.05	292,236.05
应付交易费用	-	-	-	192,739.46	192,739.46
应付销售服务费	-	-	-	262,121.93	262,121.93
应付利息	-	-	-	-50,630.14	-50,630.14
应交税费	-	-	-	100,475.58	100,475.58
其他负债	-	-	-	150,384.69	150,384.69
负债总计	143,000,000.00	-	-	35,614,852.81	178,614,852.81
利率敏感度缺口	231,979,416.06	632,204,423.47	44,973,447.29	321,441,022.97	1,230,598,309.79

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。基金合同成立于 2020 年 5 月 20 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	-4,618,379.30
	市场利率下降 25 个基点	4,670,530.59

注：基金合同成立于 2020 年 5 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
资产合计	-	4,067,275.80	4,067,275.80
以外币计价的负债			
负债合计	-	1.72	1.72
资产负债表 外汇风险敞 口净额	-	4,067,274.08	4,067,274.08

注：基金合同成立于 2020 年 5 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	203,363.70
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-203,363.70	

注：基金合同成立于 2020 年 5 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的

定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	338,744,596.47	27.53
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	338,744,596.47	27.53

注：基金合同成立于 2020 年 5 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2020年12月31日
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	14,129,083.62
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-14,129,083.62

注：基金合同成立于 2020 年 5 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 303,772,156.18 元，第二层次的余额为人民币 1,041,051,751.05 元，无属于第三层次的余额。

(a) 第二层次的公允价值计量

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

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

7.4.14.2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括应收款项、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	338,744,596.47	24.04
	其中：股票	338,744,596.47	24.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,006,079,310.76	71.39
	其中：债券	1,006,079,310.76	71.39
	资产支持证券	-	-
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	38,160,566.65	2.71
8	其他各项资产	26,228,688.72	1.86
9	合计	1,409,213,162.60	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	8,378,673.00	0.68
C	制造业	242,068,079.36	19.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,525,288.00	0.21
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,990,320.56	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	1,122,873.88	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,139,809.16	0.91
J	金融业	46,296,928.00	3.76
K	房地产业	10,839,036.14	0.88
L	租赁和商务服务业	797,220.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	2,607,662.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	149,928.30	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,252,303.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	1,509,199.27	0.12
S	综合	-	-
	合计	334,677,320.67	27.20

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	1,897,275.38	0.15
金融	1,875,089.76	0.15
医疗保健	294,910.66	0.02
合计	4,067,275.80	0.33

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	600036	招商银行	379,200	16,665,840.00	1.35
2	600519	贵州茅台	8,200	16,383,600.00	1.33
3	601318	中国平安	153,000	13,307,940.00	1.08
4	600031	三一重工	329,300	11,518,914.00	0.94
5	000333	美的集团	103,700	10,208,228.00	0.83
6	000858	五粮液	32,800	9,572,680.00	0.78
7	000568	泸州老窖	39,100	8,842,856.00	0.72
8	603218	日月股份	301,951	8,444,768.41	0.69
9	601012	隆基股份	88,036	8,116,919.20	0.66
10	600486	扬农化工	58,800	7,761,600.00	0.63
11	300760	迈瑞医疗	17,100	7,284,600.00	0.59
12	002475	立讯精密	124,118	6,965,502.16	0.57
13	002142	宁波银行	190,000	6,714,600.00	0.55
14	600887	伊利股份	147,400	6,540,138.00	0.53
15	600030	中信证券	210,000	6,174,000.00	0.50
16	000661	长春高新	13,300	5,799,953.00	0.47
17	002726	龙大肉食	454,892	5,631,562.96	0.46
18	002332	仙琚制药	442,438	5,617,541.16	0.46
19	601088	中国神华	305,100	5,494,851.00	0.45
20	002938	鹏鼎控股	110,000	5,370,200.00	0.44
21	002415	海康威视	108,100	5,243,931.00	0.43
22	601966	玲珑轮胎	143,742	5,055,406.14	0.41
23	000538	云南白药	40,300	4,471,130.00	0.36
24	002271	东方雨虹	114,200	4,430,960.00	0.36
25	600048	保利地产	271,600	4,296,712.00	0.35
26	600438	通威股份	104,900	4,032,356.00	0.33
27	002311	海大集团	59,900	3,923,450.00	0.32
28	300014	亿纬锂能	46,417	3,782,985.50	0.31
29	300316	晶盛机电	120,707	3,630,866.56	0.30
30	000581	威孚高科	155,406	3,603,865.14	0.29

31	600803	新奥股份	263,100	3,575,529.00	0.29
32	600521	华海药业	105,640	3,571,688.40	0.29
33	002557	洽洽食品	64,558	3,476,448.30	0.28
34	600741	华域汽车	120,400	3,469,928.00	0.28
35	600690	海尔智家	115,400	3,370,834.00	0.27
36	000001	平安银行	162,200	3,136,948.00	0.25
37	600563	法拉电子	30,800	3,133,460.00	0.25
38	000002	万科 A	108,900	3,125,430.00	0.25
39	688561	奇安信	23,563	2,894,243.29	0.24
40	002602	世纪华通	390,000	2,741,700.00	0.22
41	000157	中联重科	276,400	2,736,360.00	0.22
42	603259	药明康德	19,240	2,592,012.80	0.21
43	600585	海螺水泥	50,100	2,586,162.00	0.21
44	002444	巨星科技	82,200	2,557,242.00	0.21
45	600900	长江电力	131,800	2,525,288.00	0.21
46	600745	闻泰科技	25,000	2,420,500.00	0.20
47	000739	普洛药业	102,100	2,376,888.00	0.19
48	000338	潍柴动力	148,400	2,343,236.00	0.19
49	600276	恒瑞医药	20,900	2,329,514.00	0.19
50	603233	大参林	27,280	2,045,588.00	0.17
51	600383	金地集团	150,200	2,027,700.00	0.16
52	000513	丽珠集团	49,800	2,016,900.00	0.16
53	600406	国电南瑞	75,600	2,008,692.00	0.16
54	601225	陕西煤业	206,000	1,924,040.00	0.16
55	600570	恒生电子	17,700	1,856,730.00	0.15
56	002727	一心堂	55,700	1,855,367.00	0.15
57	002241	歌尔股份	45,200	1,686,864.00	0.14
58	300347	泰格医药	10,100	1,632,261.00	0.13
59	002008	大族激光	37,600	1,607,400.00	0.13
60	600176	中国巨石	80,300	1,602,788.00	0.13
61	601877	正泰电器	38,000	1,488,080.00	0.12
62	300144	宋城演艺	80,400	1,424,688.00	0.12
63	01336	新华保险	55,600	1,415,554.32	0.12
64	00700	腾讯控股	2,900	1,376,586.38	0.11
65	603882	金域医学	10,100	1,294,012.00	0.11
66	000656	金科股份	178,100	1,262,729.00	0.10
67	600522	中天科技	116,100	1,258,524.00	0.10
68	603678	火炬电子	16,900	1,221,870.00	0.10
69	000895	双汇发展	24,800	1,164,112.00	0.09
70	688608	恒玄科技	4,179	1,136,688.00	0.09
71	300146	汤臣倍健	45,800	1,106,070.00	0.09
72	002352	顺丰控股	12,500	1,102,875.00	0.09
73	300999	金龙鱼	12,114	1,069,545.06	0.09
74	300122	智飞生物	7,200	1,064,952.00	0.09

75	000651	格力电器	16,800	1,040,592.00	0.08
76	002493	荣盛石化	37,200	1,027,092.00	0.08
77	002258	利尔化学	47,200	986,480.00	0.08
78	002028	思源电气	48,000	962,880.00	0.08
79	300454	深信服	3,700	917,637.00	0.07
80	603538	美诺华	22,800	846,564.00	0.07
81	002242	九阳股份	26,000	833,040.00	0.07
82	300037	新宙邦	7,800	790,920.00	0.06
83	601899	紫金矿业	78,800	732,052.00	0.06
84	688408	中信博	4,450	714,403.00	0.06
85	002001	新和成	21,100	710,648.00	0.06
86	002430	杭氧股份	24,400	709,796.00	0.06
87	002643	万润股份	27,900	607,383.00	0.05
88	002821	凯莱英	2,000	598,280.00	0.05
89	000708	中信特钢	26,100	568,719.00	0.05
90	000786	北新建材	13,700	548,685.00	0.04
91	002532	天山铝业	76,336	530,535.20	0.04
92	03690	美团点评-W	2,100	520,689.00	0.04
93	000877	天山股份	33,814	510,591.40	0.04
94	600309	万华化学	5,600	509,824.00	0.04
95	600183	生益科技	17,900	504,064.00	0.04
96	603583	捷昌驱动	6,180	477,405.00	0.04
97	000830	鲁西化工	36,100	461,358.00	0.04
98	03908	中金公司	26,000	459,535.44	0.04
99	002127	南极电商	33,500	458,280.00	0.04
100	601636	旗滨集团	33,200	424,960.00	0.03
101	002262	恩华药业	26,600	424,802.00	0.03
102	000100	TCL 科技	59,800	423,384.00	0.03
103	002600	领益智造	34,600	414,854.00	0.03
104	688686	奥普特	2,330	397,334.90	0.03
105	603228	景旺电子	13,000	391,950.00	0.03
106	600885	宏发股份	7,100	384,962.00	0.03
107	002705	新宝股份	8,700	367,575.00	0.03
108	300577	开润股份	13,600	354,688.00	0.03
109	601888	中国中免	1,200	338,940.00	0.03
110	300003	乐普医疗	12,400	337,032.00	0.03
111	002273	水晶光电	27,600	319,884.00	0.03
112	300136	信维通信	8,900	319,332.00	0.03
113	300572	安车检测	7,300	298,424.00	0.02
114	300059	东方财富	9,600	297,600.00	0.02
115	300114	中航电测	19,800	296,010.00	0.02
116	01066	威高股份	20,000	294,910.66	0.02
117	000977	浪潮信息	10,800	290,304.00	0.02
118	300896	爱美客	473	285,389.28	0.02

119	300737	科顺股份	13,200	283,272.00	0.02
120	300244	迪安诊断	8,200	281,096.00	0.02
121	300639	凯普生物	7,300	274,334.00	0.02
122	002831	裕同科技	8,800	269,456.00	0.02
123	002080	中材科技	10,900	263,562.00	0.02
124	603129	春风动力	1,500	261,285.00	0.02
125	603987	康德莱	15,900	249,471.00	0.02
126	002318	久立特材	22,700	247,430.00	0.02
127	002541	鸿路钢构	6,600	241,098.00	0.02
128	002555	三七互娱	7,500	234,225.00	0.02
129	600989	宝丰能源	20,000	234,000.00	0.02
130	603700	宁水集团	7,500	218,775.00	0.02
131	603601	再升科技	16,000	218,400.00	0.02
132	601233	桐昆股份	10,400	214,136.00	0.02
133	603501	韦尔股份	900	207,990.00	0.02
134	600507	方大特钢	28,400	197,096.00	0.02
135	600529	山东药玻	3,900	195,585.00	0.02
136	601222	林洋能源	24,500	194,040.00	0.02
137	688595	芯海科技	3,190	193,282.10	0.02
138	600988	赤峰黄金	10,600	189,846.00	0.02
139	002624	完美世界	6,300	185,850.00	0.02
140	600496	精工钢构	40,000	179,200.00	0.01
141	002837	英维克	10,000	175,000.00	0.01
142	300880	迦南智能	3,732	129,612.36	0.01
143	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.01
144	600104	上汽集团	5,000	122,200.00	0.01
145	002832	比音勒芬	7,000	113,680.00	0.01
146	300702	天宇股份	1,200	112,200.00	0.01
147	000951	中国重汽	3,400	106,964.00	0.01
148	000961	中南建设	10,500	92,715.00	0.01
149	688560	明冠新材	3,832	87,599.52	0.01
150	688590	新致软件	4,171	65,860.09	0.01
151	300607	拓斯达	1,740	60,465.00	0.00
152	688156	路德环境	2,602	52,222.14	0.00
153	300860	锋尚文化	381	48,261.27	0.00
154	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.00
155	300525	博思软件	1,600	45,920.00	0.00
156	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00
157	300015	爱尔眼科	600	44,934.00	0.00
158	300226	上海钢联	660	43,296.00	0.00
159	000975	银泰黄金	4,400	37,884.00	0.00
160	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
161	300413	芒果超媒	500	36,250.00	0.00
162	300750	宁德时代	100	35,111.00	0.00

163	600323	瀚蓝环境	1,400	34,734.00	0.00
164	300575	中旗股份	900	34,560.00	0.00
165	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
166	002697	红旗连锁	4,800	31,728.00	0.00
167	300418	昆仑万维	1,500	29,925.00	0.00
168	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
169	300877	金春股份	569	28,933.65	0.00
170	600998	九州通	1,567	28,456.72	0.00
171	300785	值得买	300	27,264.00	0.00
172	600720	祁连山	1,900	25,802.00	0.00
173	300868	杰美特	593	25,665.04	0.00
174	002968	新大正	500	24,775.00	0.00
175	300036	超图软件	1,300	23,972.00	0.00
176	300894	火星人	628	23,217.16	0.00
177	002456	欧菲光	1,600	21,088.00	0.00
178	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
179	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
180	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
181	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
182	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
183	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
184	603369	今世缘	300	17,214.00	0.00
185	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
186	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
187	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
188	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
189	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
190	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
191	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
192	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
193	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
194	300747	锐科激光	150	13,179.00	0.00
195	003020	立方制药	374	12,858.12	0.00
196	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
197	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
198	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
199	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
200	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
201	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
202	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
203	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
204	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
205	300685	艾德生物	100	7,825.00	0.00
206	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00

207	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
208	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
209	002124	天邦股份	400	5,840.00	0.00
210	603985	恒润股份	100	3,301.00	0.00
211	600332	白云山	100	2,925.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	25,106,766.01	2.04
2	600031	三一重工	22,591,556.00	1.84
3	601398	工商银行	19,979,225.00	1.62
4	601318	中国平安	17,769,196.07	1.44
5	002602	世纪华通	16,537,017.00	1.34
6	002332	仙琚制药	15,432,295.54	1.25
7	600519	贵州茅台	12,986,660.00	1.06
8	600585	海螺水泥	12,692,310.00	1.03
9	688981	中芯国际	12,691,325.50	1.03
10	002001	新和成	12,116,308.65	0.98
11	300607	拓斯达	11,356,293.00	0.92
12	000333	美的集团	9,814,806.15	0.80
13	002555	三七互娱	9,735,000.00	0.79
14	600486	扬农化工	9,712,256.22	0.79
15	603218	日月股份	9,707,455.06	0.79
16	002938	鹏鼎控股	9,300,560.00	0.76
17	000568	泸州老窖	8,411,848.69	0.68
18	000661	长春高新	7,634,341.00	0.62
19	600803	新奥股份	7,628,929.68	0.62
20	600048	保利地产	7,486,982.06	0.61

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	688981	中芯国际	39,960,409.89	3.25
2	600031	三一重工	22,077,828.03	1.79
3	601398	工商银行	19,466,372.00	1.58
4	600036	招商银行	15,016,549.46	1.22
5	002001	新和成	12,585,152.04	1.02
6	300607	拓斯达	11,355,699.08	0.92
7	600585	海螺水泥	9,458,414.76	0.77
8	002602	世纪华通	9,038,720.07	0.73
9	002332	仙琚制药	8,578,374.00	0.70
10	002555	三七互娱	7,643,000.00	0.62
11	000568	泸州老窖	6,699,801.00	0.54
12	600486	扬农化工	6,390,421.00	0.52
13	601318	中国平安	6,188,642.12	0.50
14	300999	金龙鱼	5,657,447.10	0.46
15	600803	新奥股份	5,471,688.58	0.44
16	600406	国电南瑞	5,409,980.54	0.44
17	000338	潍柴动力	5,063,080.00	0.41
18	603218	日月股份	5,053,909.00	0.41
19	002938	鹏鼎控股	4,981,341.00	0.40
20	002271	东方雨虹	4,027,621.50	0.33

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	559,520,581.97
卖出股票的收入（成交）总额	353,313,074.14

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	29,618,000.00	2.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	89,078,000.00	7.24
	其中：政策性金融债	89,078,000.00	7.24
4	企业债券	411,245,000.00	33.42

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	271,765,000.00	22.08
7	可转债（可交换债）	58,080,310.76	4.72
8	同业存单	146,293,000.00	11.89
9	其他	-	-
10	合计	1,006,079,310.76	81.76

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	155058	18 京能 01	600,000	60,426,000.00	4.91
2	200206	20 国开 06	600,000	59,748,000.00	4.86
3	101900773	19 外高桥 MTN002	500,000	50,565,000.00	4.11
4	101901035	19 中电投 MTN014 A	500,000	50,250,000.00	4.08
5	112962	19 深建 01	500,000	50,200,000.00	4.08

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

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2103	IF2103	-34.00	-53,158,320.00	-6,787,255.87	-

IH2103	IH2103	-10.00	-10,910,400 .00	-1,238,880.00	-
公允价值变动总额合计					-8,026,135.87
股指期货投资本期收益					-1,833,595.61
股指期货投资本期公允价值变动					-8,026,135.87

注：股指期货投资本期收益中已扣除本期股指期货差价收入应缴纳增值税额。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

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

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为全国大型银行，

综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

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

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

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

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

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110059	浦发转债	3,563,000.00	0.29
2	113014	林洋转债	3,370,342.50	0.27
3	110034	九州转债	3,134,375.20	0.25

4	132009	17 中油 EB	3,118,719.10	0.25
5	110045	海澜转债	2,907,600.00	0.24
6	127012	招路转债	2,489,238.81	0.20
7	110033	国贸转债	2,314,455.00	0.19
8	110064	建工转债	2,170,303.20	0.18
9	113017	吉视转债	2,103,007.50	0.17
10	113532	海环转债	2,067,580.80	0.17
11	132007	16 凤凰 EB	2,059,800.00	0.17
12	113505	杭电转债	1,972,000.00	0.16
13	110048	福能转债	1,712,976.00	0.14
14	128044	岭南转债	1,690,222.60	0.14
15	110068	龙净转债	1,338,740.00	0.11
16	113508	新风转债	1,132,500.00	0.09
17	127016	鲁泰转债	1,124,966.88	0.09
18	110041	蒙电转债	1,090,900.00	0.09
19	128037	岩土转债	1,059,960.00	0.09
20	113024	核建转债	1,004,751.00	0.08
21	113012	骆驼转债	991,890.00	0.08
22	128064	司尔转债	969,790.40	0.08
23	128087	孚日转债	952,122.50	0.08
24	113519	长久转债	941,876.10	0.08
25	113030	东风转债	737,798.50	0.06
26	127013	创维转债	697,620.00	0.06
27	113525	台华转债	672,936.00	0.05
28	128081	海亮转债	631,288.05	0.05
29	113026	核能转债	517,050.00	0.04
30	113530	大丰转债	494,550.00	0.04
31	110038	济川转债	490,116.50	0.04
32	128107	交科转债	484,182.32	0.04
33	123004	铁汉转债	367,273.71	0.03
34	113564	天目转债	365,070.00	0.03
35	113534	鼎胜转债	330,480.00	0.03
36	128083	新北转债	317,910.00	0.03
37	113021	中信转债	315,630.00	0.03
38	110052	贵广转债	303,450.00	0.02
39	128071	合兴转债	223,800.00	0.02
40	132004	15 国盛 EB	201,640.00	0.02
41	110051	中天转债	119,240.00	0.01
42	110047	山鹰转债	106,830.00	0.01
43	128101	联创转债	106,410.00	0.01
44	128018	时达转债	102,380.00	0.01

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603218	日月股份	8,220,918.41	0.67	非公开定增

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通富盈混合 A	6,891	73,763.57	19,999,000.00	3.93%	488,305,749.87	96.07%
海富通富盈混合 C	7,831	84,213.81	87,231,924.33	13.23%	572,246,400.09	86.77%
合计	14,722	79,322.31	107,230,924.33	9.18%	1,060,552,149.96	90.82%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C 级比例分母为各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通富盈混合 A	68.92	0.0000%
	海富通富盈混合 C	520,032.27	0.0789%
	合计	520,101.19	0.0445%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海富通富盈混合 A	0
	海富通富盈混合 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通富盈混合 A	0
	海富通富盈混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
基金合同生效日（2020 年 5 月 20 日）基金份额总额	1,092,446,802.70	1,839,497,101.82
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	5,872,095.52	140,205,574.16
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	590,014,148.35	1,320,224,351.56
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	508,304,749.87	659,478,324.42

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 70,000.00 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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期	佣金	占当期	

	数量		股票成交总额的比例		佣金总量的比例	
海通证券	2	858,099,693.75	100.00%	621,216.76	100.00%	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

2、(1)交易单元的选择标准

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

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会核准。

<2> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	1,000,220,757.40	100.00%	20,013,700,000.00	100.00%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通富盈混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-07
2	海富通基金管理有限公司关于海富通富盈混合型证券投资基金新增销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-22
3	海富通基金管理有限公司关于海富通富	中国证券报、基金管	2020-04-24

	盈混合型证券投资基金新增销售机构的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
4	海富通基金管理有限公司关于海富通富盈混合型证券投资基金新增销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-25
5	海富通基金管理有限公司关于海富通富盈混合型证券投资基金新增销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-25
6	海富通基金管理有限公司关于海富通富盈混合型证券投资基金新增销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-28
7	海富通基金管理有限公司关于海富通富盈混合型证券投资基金 A 类份额参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司认购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-07
8	海富通基金管理有限公司关于海富通富盈混合型证券投资基金新增销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-11
9	海富通基金管理有限公司关于海富通富盈混合型证券投资基金延长募集期的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-12
10	海富通富盈混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-21
11	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-22
12	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
13	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
14	海富通基金管理有限公司关于变更直销中心交易传真号码的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证	2020-06-06

		监会基金电子披露网站	
15	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-24
16	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-08
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-11
18	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中山证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-13
19	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-25
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-25
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-11
22	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-13
23	海富通富盈混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-15
24	海富通基金管理有限公司关于海富通富盈混合型证券投资基金 A 类份额实行网上直销费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-18
25	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-22

		网站	
26	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-26
27	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-11
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-11
29	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-15
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-17
31	海富通基金管理有限公司关于进一步提请投资者及时提供或更新身份信息以免影响业务办理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-24
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-10-24
33	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海好买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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-10-28
34	海富通基金管理有限公司关于网上直销汇款交易业务开展费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-10-29
35	海富通基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-11
36	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京汇成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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-12

37	海富通基金管理有限公司 关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-18
38	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-01
39	海富通基金管理有限公司关于进一步提请投资者及时提供或更新身份信息以免影响业务办理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-01
40	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-01
41	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-03
42	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-05
43	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海长量基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-16
44	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-24
45	海富通基金管理有限公司关于旗下基金获配天山铝业（002532）非公开发行 A 股的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-25
46	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-31

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 92 只公募基金。截至 2020 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1251 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金再度被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·成长基金管理公司奖。

2020 年 3 月，由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金牛进取奖”，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖项。2020 年 7 月，由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金基金·股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏

股混合型基金三年期奖”。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准设立海富通富盈混合型证券投资基金的文件
- (二) 海富通富盈混合型证券投资基金基金合同
- (三) 海富通富盈混合型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通富盈混合型证券投资基金托管协议
- (五) 中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六) 法律法规及中国证监会规定的其他文件

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