

海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）

2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年四月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 4 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	海富通中证 100 指数（LOF）
场内简称	海富 100
基金主代码	162307
交易代码	162307
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 10 月 30 日
报告期末基金份额总额	56,343,236.25 份
投资目标	采用指数化投资方式，通过有效的投资程序约束和数量化风险管理手段，控制基金投资组合相对于业绩比较基准的偏离度，实现对业绩比较基准的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标

	的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。	
业绩比较基准	中证 100 指数×95%+活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金是股票型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C
下属分级基金的交易代码	162307	010224
报告期末下属分级基金的份额总额	56,343,031.72 份	204.53 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日)	
	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C
1.本期已实现收益	2,143,226.17	7.34
2.本期利润	-634,313.81	-3.15
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0111	-0.0159
4.期末基金资产净值	90,364,263.04	327.78
5.期末基金份额净值	1.604	1.603

注:(1) 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。

(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) 海富通中证100指数证券投资基金 (LOF) 于2020年11月09日发布公告, 自2020年11月10日起增加一种新的收费模式份额-C类基金份额。该类别仅开通场外申购赎回业务, 收取销售服务费, 不收取申购费。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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、海富通中证 100 指数 A:

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.99%	1.50%	-2.46%	1.55%	1.47%	-0.05%
过去六个月	15.31%	1.24%	12.07%	1.27%	3.24%	-0.03%
过去一年	51.18%	1.23%	35.65%	1.25%	15.53%	-0.02%
过去三年	70.24%	1.29%	30.89%	1.30%	39.35%	-0.01%
过去五年	124.60%	1.11%	69.45%	1.12%	55.15%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	113.82%	1.38%	61.34%	1.38%	52.48%	0.00%

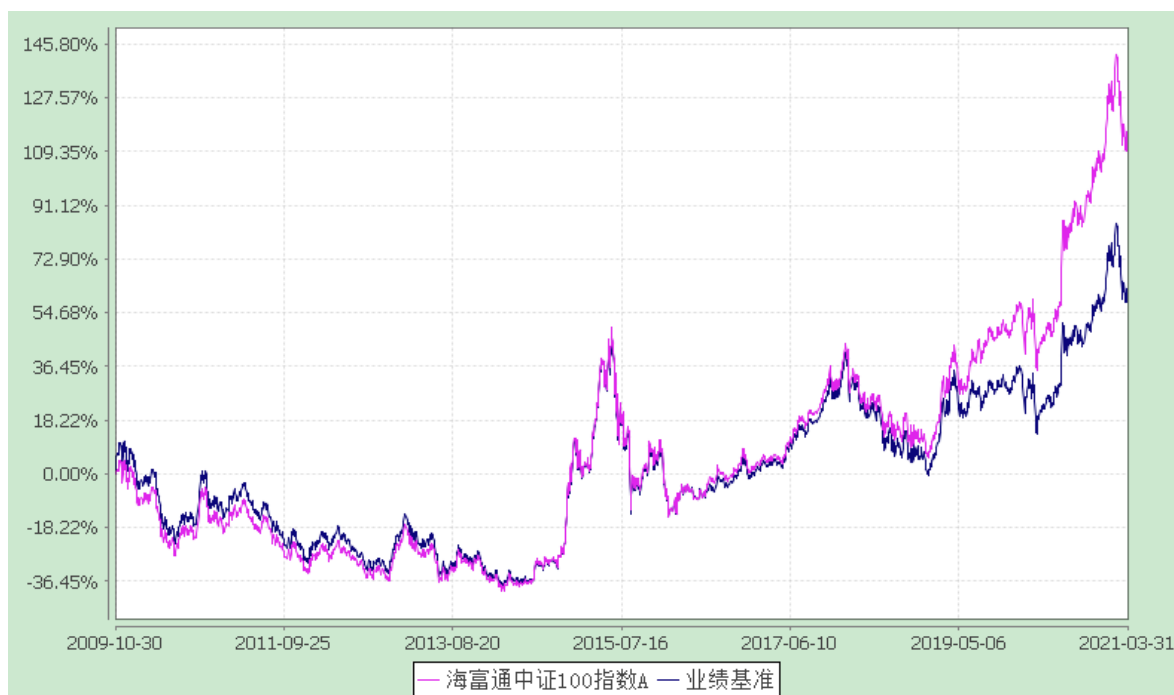
2、海富通中证 100 指数 C:

阶段	净值增长率 ①	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	-1.05%	1.51%	-2.46%	1.55%	1.41%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	4.84%	1.29%	2.56%	1.32%	2.28%	-0.03%

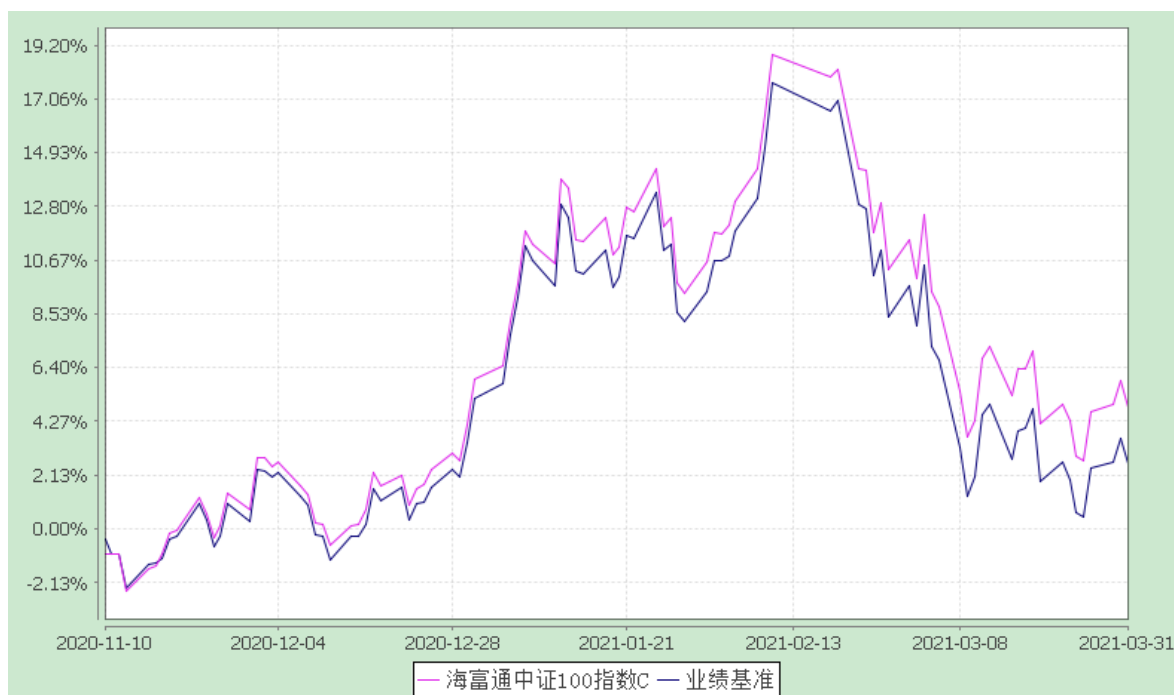
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)
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
(2009 年 10 月 30 日至 2021 年 3 月 31 日)

1. 海富通中证 100 指数 A:



2. 海富通中证 100 指数 C:



注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期满至今,本基金投资组合均达到本基金合同第十五条(二)、(七)规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
江勇	本基金的 基金经理	2018-07- 25	-	9 年	经济学硕士, 持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师, 资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2018 年 7 月起任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF、海富通上证非周期 ETF 联接、海富通中证 100 指数 (LOF) 基金经理。2018 年 7 月至 2020 年 3 月任海富通中证内地低碳指数 (现海富通中证 500 增强) 基金经理。2020 年 8 月起兼任海富通中证长三角领先 ETF、海富通中证长三角领先 ETF 联接基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2021 年 2 月起兼任海富通欣睿混合基金经理。

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为: 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 公平交易专项说明

4.3.1 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(如日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的样本,对其进行了 95%置信区间,假设溢价率为 0 的 T 分布检验,结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明,报告期内公司对旗下各投资组合公平对待,不存在利益输送的行为。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年一季度 A 股市场呈现“上行-下跌-横盘震荡”的走势,风格出现明显转换。1 季度末,上证指数收于 3441.91 点,下跌 0.90%;深证成指收于 13778.67 点,下跌 4.78%;中小板指收于 8890.60 点,下跌 6.86%;创业板指收于 2758.50 点,跌幅达 7.0%。

具体来看:

1 月份,投资者对流动性预期的变化导致市场波动加大,主要指数总体呈现“前高后低”的走势,创业板 50、创业板指、沪深 300、科创 50、上证 50、上证指数分别上涨 6.64%、5.48%、2.70%、2.08%、2.00%、0.29%,仅中证 500 跌 0.33%。分阶段看,月初至中旬,受益于中央经济工作会议“不急转弯”定调、增量资金大幅入场等,机构抱团效应显著,主要指数大幅上行,上证指数一度突破 3600 点、创业板指一度突破 3400 点;1 月下旬,由于央行 OMO 持续净回笼操

作，引发市场对资金面收紧的担忧，导致市场开始大幅回调，股债同跌。风格上看，周期占优，大盘优于中小盘。景气向上板块领涨，石油石化、银行、基础化工、有色、新能源等涨幅居前。

2 月份，A 股市场波动率加大、风格大幅调整，春节前和春节后主要指数走势出现逆转。分阶段看，春节前，以沪深 300 为表征的大市值品种持续大幅上涨，而以中证 1000 为表征的中小市值品种领跌，下跌家数显著大于上涨家数，呈现指数涨、少部分公司涨而大部分公司下跌的格局，上证指数一度突破 3700 点；而春节后，由于美国疫苗接种率提速、美国 1.9 万亿美元财政刺激有序推进等，全球通胀预期抬升、美债收益率快速上行，引致市场大跌调整、风格均衡化，高估值板块大幅下跌、而低估值板块则表现相对较优，中证 1000 开始跑赢沪深 300，呈现指数跌、少部分公司跌而大部分公司上涨的格局。风格上看，周期占优，小盘股优于大盘股。低估值板块领涨，地产、农林牧渔、钢铁、有色、石油石化等涨幅居前。

3 月份，A 股市场在利率上行和盈利上行博弈中继续调整，一方面美债长端利率继续上行、美元逐步走强，对高估值板块、新兴市场形成压制；另一方面，盈利继续向好，1-2 月数据显示经济整体仍处在良性修复的轨道上。节奏上看，A 股走势呈现“L 型”：月初至上旬，股指大跌；上旬至月末，则维持横盘震荡。风格上看，以中证 500 表征的中小市值品种表现继续优于以沪深 300 为表征的大市值品种；3 月初至上旬，金融板块相对占优，上旬至月底消费板块占优。碳中和主题是交易主线，电力及公用事业、煤炭、钢铁、建筑等涨幅居前。

2021 年一季度，在中信 30 个一级行业分类中，13 个行业录得涨幅。其中，钢铁 (15.52%)、电力及公用事业 (11.21%)、银行 (10.78%)、建筑 (7.82%)、建材 (6.46%) 涨幅排名前五，而国防军工 (-18.91%)、非银金融 (-12.55%)、通信 (-10.30%)、计算机 (-10.12%)、汽车 (-9.31%) 跌幅居前。

作为指数基金，在操作上我们严格遵守基金合同，应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度，降低跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 份额净值增长率为-0.99%，同期业绩比较基准收益率为-2.46%；C 份额净值增长率为-1.05%，同期业绩比较基准收益率为-2.46%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	84,997,239.60	93.54
	其中：股票	84,997,239.60	93.54
2	固定收益投资	127,486.00	0.14
	其中：债券	127,486.00	0.14
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,701,297.88	6.27
7	其他各项资产	37,831.66	0.04
8	合计	90,863,855.14	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-

C	制造业	311,058.02	0.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,241.36	0.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,875.76	0.07
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	112,615.11	0.12
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	506,790.25	0.56

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	1,461,363.44	1.62
B	采矿业	2,657,732.89	2.94
C	制造业	37,146,489.19	41.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,572,777.12	1.74
E	建筑业	1,599,072.06	1.77
F	批发和零售业	239,850.72	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	1,773,256.22	1.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	907,512.20	1.00

J	金融业	30,099,862.01	33.31
K	房地产业	2,887,894.90	3.20
L	租赁和商务服务业	2,672,349.60	2.96
M	科学研究和技术服务业	1,211,328.00	1.34
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	121,131.00	0.13
Q	卫生和社会工作	139,830.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	84,490,449.35	93.50

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	3,948	7,931,532.00	8.78
2	601318	中国平安	77,456	6,095,787.20	6.75
3	600036	招商银行	86,813	4,436,144.30	4.91
4	000333	美的集团	33,307	2,738,834.61	3.03
5	601166	兴业银行	112,588	2,712,244.92	3.00
6	600276	恒瑞医药	27,007	2,487,074.63	2.75
7	601888	中国中免	6,919	2,117,767.52	2.34
8	000651	格力电器	31,680	1,986,336.00	2.20
9	600887	伊利股份	46,900	1,877,407.00	2.08
10	000002	万科A	52,400	1,572,000.00	1.74

5.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产
----	------	------	-------	---------	-------

					净值比例 (%)
1	688057	金达莱	3,321	112,615.11	0.12
2	688659	元琛科技	3,445	46,335.25	0.05
3	688070	纵横股份	1,445	44,404.85	0.05
4	688079	美迪凯	3,245	39,653.90	0.04
5	688109	品茗股份	491	38,003.40	0.04

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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）	127,486.00	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	127,486.00	0.14

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	113042	上银转债	850	85,986.00	0.10
2	123107	温氏转债	415	41,500.00	0.05

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的兴业银行 (601166)，作为债务融资工具主承销商，因在债务融资工具存续期间未能对京粮集团资产无偿划转重大事项进行有效监测，及时督导京粮集团进行存续期重大事项披露，也未及时召开持有人会议，于 2020 年 5 月 15 日被中国银行间市场交易商协会责令整改。因同业投资用途不

合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权等违规行为,于 2020 年 8 月 31 日被中国银保监会福建监管局没收违法所得 6,361,807.97 元,并合计处以罚款 15,961,807.97 元。因为无证机构提供转接清算服务、为支付机构超范围经营提供支付服务、违规连通上下游支付机构提供转接清算服务等,且上述违规行为未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定等行为,于 2020 年 9 月 4 日被中国人民银行福州中心支行给予警告,没收违法所得 10,875,088.15 元,并处 13,824,431.23 元罚款。因在为永城煤电控股集团有限公司提供中介服务过程中,存在违反银行间债券市场相关自律管理规则的行为,于 2021 年 1 月 15 日被中国银行间市场交易商协会通报批评,责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

对上述证券的投资决策程序的说明:本基金系指数型基金,对上述证券的投资均系被动按照指数成分股进行复制。

其余九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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,860.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	591.30
5	应收申购款	25,379.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,831.66

5.11.4 报告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。

5.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限 情况说明
1	688057	金达莱	112,615.11	0.12	新股锁定 流通受限
2	688659	元琛科技	46,335.25	0.05	新股锁定 流通受限
3	688070	纵横股份	44,404.85	0.05	新股锁定 流通受限
4	688079	美迪凯	39,653.90	0.04	新股锁定 流通受限

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通中证100指数A	海富通中证100指数C
本报告期初基金份额总额	58,924,471.18	198.16
报告期基金总申购份额	5,724,997.83	6.37
减：报告期基金总赎回份额	8,306,437.29	-
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	56,343,031.72	204.53

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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 95 只公募基金。截至 2021 年 3 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1306 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”。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）的文件
- (二)海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同
- (三)海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）招募说明书
- (四)海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）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

9.2 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。

9.3 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
二〇二一年四月二十二日

